

Barbara Rogo, nata il 7 luglio 1970

Titoli di studio

Maturità scientifica, Laurea in Matematica

Posizione accademica

Ricercatore confermato

Nell'a.a. 2006-07 (fino all'a.a. 2011-12) ha in affidamento l'insegnamento di Laboratorio di calcolo finanziario e attuariale

Nell'a.a. 2012-13 ha in affidamento gli insegnamenti di Teoria del portafoglio e Valutazione e controllo delle imprese di assicurazione

Nell'a.a. 2013-14 ha in affidamento gli insegnamenti di Economia e finanza dell'impresa di assicurazione e di Laboratorio di calcolo attuariale

È docente di riferimento per il Corso di Laurea di Statistica, Economia, Finanza e Assicurazione

È tutor per gli studenti del Corso di Laurea di Statistica, Economia, Finanza e Assicurazione

Altre esperienze

Dal 2011, Gruppo di ricerca Catene di Markov, nell'ambito dei progetti di ricerca di Ateneo.

Maggio 2007, docente al corso su Principi di asset e risk management in riferimento a QIS3, organizzato da ANIA/IRSA.

Gennaio 2001 - Dicembre 2006, Tutor e docente del Master in finanza per la banca e per l'assicurazione, nato da una collaborazione della Facoltà di Scienze Statistiche dell'Università di Roma La Sapienza con Capitalia.

2002, Gruppo di ricerca Imprese di assicurazioni e fondi pensione. Modelli per la valutazione, la gestione e il controllo, nell'ambito del progetto PRIN (Programmi di ricerca di rilevante interesse nazionale) finanziato dal MIUR.

Settembre – Dicembre 2000, docente per le parti applicative, allo svolgimento del ciclo di corsi su Software e modelli per la Finanza, presso la Banca di Roma.

Settembre 1999 – Marzo 2000, docente, per le parti applicative, al progetto di formazione Fare Finanza, patrocinato dall'Istituto degli Studi Bancari di Lucca.

Aprile 1999, docente al Corso su I mutui della Cassa depositi e prestiti per gli Enti locali. Scegliere e gestire l'indebitamento, presso la Cassa depositi e prestiti.

Pubblicazioni

I principi per la valutazione e il controllo del rischio dei fondi d'investimenti nella Direttiva UCITS IV, aprile 2013, submitted.

La misurazione del rischio di performance di un investimento in polizze di ramo III secondo la normativa Consob, Rapporto tecnico n. 9 2012, Dipartimento di Scienze Statistiche, maggio 2012.

La misurazione ai fini IAS dell'efficacia di una copertura di tipo cash-flow hedge in un modello stocastico di mercato. Un caso di studio, manoscritto, giugno 2011.

Appunti di calcolo finanziario, materiale didattico, giugno 2010.

Il controllo di un investimento in obbligazioni a indicizzazione reale nei fondi pensione negoziali, Assicurazioni, n. 1, 2007.

Un'analisi empirica del mercato dei titoli italiani indicizzati all'inflazione europea: un modello bivariato per la valutazione, Gruppo di ricerca su Assicurazioni e Fondi Pensione. Modelli di la valutazione, per la gestione e per il controllo, Working paper n. 8, settembre 2005.

La valutazione di polizze unit e index linked, Gruppo di ricerca su Assicurazioni e Fondi Pensione. Modelli di Valutazione e Asset-Liability Management, Working paper n. 5, marzo 2004.

La misurazione della struttura per scadenza dei tassi di interesse: alcuni modelli di stima, Gruppo di ricerca su Assicurazioni e Fondi Pensione. Modelli di Valutazione e Asset-Liability Management, Working paper n. 2, dicembre 2003.

La valutazione di una polizza vita index linked con minimo garantito, Gruppo di ricerca su Modelli per la finanza matematica, Working paper, giugno 1999.