

• **Gilberto Castellani**

nato il 23 luglio 1954

Titoli di studio

- Maturità scientifica, Laurea in fisica.

Posizioni professionali e accademiche

- professore ordinario dal 1990
- titolare degli insegnamenti di Modelli matematici per i mercati finanziari e di Teoria del rischio, nella Facoltà di Scienze Statistiche dell'Università di Roma "La Sapienza"
- membro del consiglio direttivo dell'Istituto Italiano degli Attuari.

Esperienze precedenti

- 1990-1993: titolare della cattedra di Matematica finanziaria nell'Università di Chieti
- 1990-1993: responsabile del "gruppo locale" dell'Università di Chieti, nel progetto di ricerca su "Modelli di struttura per scadenza dei tassi di interesse", finanziato dal Ministero dell'Università e della Ricerca Scientifica e Tecnologica
- 1991-1992: ha organizzato (con M. De Felice, F. Moriconi e C. Mottura) il corso su "Il controllo del rischio di tasso di interesse", presso la Scuola Normale Superiore di Pisa
- 1993-2000: titolare della cattedra di Matematica Generale, nella Facoltà di Economia dell'Università di Roma 3
- 1993-2000: responsabile del Centro di calcolo della Facoltà di Economia dell'Università di Roma 3
- 1993-2000: responsabile del "gruppo locale" dell'Università di Roma 3 nel progetto di ricerca su "Modelli per la finanza matematica", finanziato dal Ministero dell'Università e della Ricerca Scientifica e Tecnologica
- 1996: ha organizzato (con M. De Felice, F. Moriconi e C. Mottura) il corso su "Il problema dell'asset-liability management nella banca", presso la Scuola Normale Superiore di Pisa
- 1997-2000: Presidente del Corso di Laurea in Economia e Commercio dell'Università di Roma 3
- 2001-2007: Direttore del Dipartimento di Scienze Attuariali e Finanziarie dell'Università di Roma "La Sapienza".
- 2003: ha organizzato (con M. De Felice, F. Moriconi) il corso su "Strategie CPPI e polizze sulla vita", per l'Associazione Amici della Scuola Normale Superiore di Pisa, in collaborazione con l'ANIA
- 2004-2005: ha organizzato (con M. De Felice, F. Moriconi e C. Mottura) il progetto "Gestione dei fondi pensione" in collaborazione con Mefop.
- 2011: ha organizzato (con M. De Felice, F. Moriconi e Luca Passalacqua) il corso su "Global asset allocation", tenuto presso la Banca d'Italia.
- 2012: ha organizzato (con M. De Felice, F. Moriconi e Luca Passalacqua) il corso su "Controllare il rischio di tasso e il rischio di credito", tenuto presso la Banca d'Italia.

Ha svolto attività di consulenza e di formazione presso ABN Amro, AIP (poi Eurizon), Alleanza Assicurazioni, Associazione Amici della Scuola Normale Superiore di Pisa, Banca del Piemonte, Banca di Roma, Banca d'Italia, Gruppo Cattolica, Cisalpina Previdenza, Fondiaria-SAI, HSBC Bank, IBM-SEMEA, INA, INASIM, IRSA, ISVAP, PosteVita, RAS, Gruppo Reale Mutua, RomaVita (poi FinecoVita,

poi CNP Capitalia Vita, poi CNP Unicredit Vita), SAI, Gruppo Sara, Sviluppo Finanziaria, Gruppo Unipol.

Alcune pubblicazioni più recenti

- *Manuale di Finanza – I. Tassi d’interesse. Mutui e Obbligazioni*, Bologna, il Mulino, 2005 (con M. De Felice e F. Moriconi).
- *Manuale di Finanza – II. Teoria del portafoglio e del mercato azionario*, Bologna, il Mulino, 2005 (con M. De Felice e F. Moriconi).
- *Manuale di Finanza - III. Modelli stocastici e contratti derivati*, Bologna, il Mulino, 2006 (con M. De Felice e F. Moriconi).
- *L’“informativa sulle polizze index-linked. Considerazioni sul “Regolamento emittenti – Modifiche alle disposizioni in materia di prospetto relativo all’offerta pubblica o all’ammissione alla negoziazione di strumenti finanziari in un mercato regolamentato” diffuso dalla CONSOB il 28 dicembre 2007*, Working paper presentato dall’ANIA per la pubblica consultazione del documento CONSOB, febbraio 2008 (con M. De Felice, F. Moriconi e P. Zaffaroni).
- *Sviluppare il mercato delle rendite vitalizie*, Mefop, Working paper n. 22, 2009 (con M. De Felice e F. Moriconi).
- *L’“internal model” delle imprese di assicurazione. Finalità, metodi e tecnologia. Un’esperienza di organizzazione*, ANIA–IRSA, Milano, maggio 2009 (con M. De Felice e F. Moriconi).
- *L’“internal model” delle imprese di assicurazione. Considerazioni sui “consultation papers” del CEIOPS*, ANIA–IRSA, Milano, settembre 2009 (con M. De Felice e F. Moriconi).
- *Applications of distributed and parallel computing in the Solvency II framework: the DISAR system*, in M.R. Guarracino *et al.* (eds.), *Euro-Par 2010 Workshops*, Berlin, Springer-Verlag, 2011 (con L. Passalacqua).
- *Claims Reserving in Non-Life Insurance: a Fully Bayesian Model*, in S. Greco *et al.* (eds.), *IPMU 2012*, Berlin, Springer-Verlag, 2012 (con M. De Felice e F. Moriconi).