

ROSELLA CASTELLANO

Curriculum breve

rosella.castellano@unitelmasapienza.it

ATTUALI POSIZIONI

Professoressa Ordinaria di Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie Dipartimento di Scienze Giuridiche ed Economiche - Università degli Studi di Roma UnitelmaSapienza (dal 2017).

Presidente del Comitato Unico di Garanzia – Università degli Studi di Roma UnitelmaSapienza (dal 2023)

Componente dell'Advisory Board Global Network of Executive Master in Financial Management (GEMFM) (dal 2020)

Componente dell'Advisory Board del Dottorato di Ricerca in Scienze Economiche, Scuola di Dottorato Sapienza Università di Roma (dal 2013)

PRECEDENTI POSIZIONI

Non Accademiche

Consigliera di amministrazione indipendente della Banca Monte dei Paschi di Siena e componente dei comitati endoconsiliari “Rischio e Sostenibilità”, e “Nomine” (2020-2023).

Direttrice di Sezione (f.f.) – c/o Presidenza del Consiglio dei Ministri (2000 – 2005).

Accademiche

Direttrice del Dipartimento di Scienze Giuridiche ed Economiche - Università degli Studi di Roma UnitelmaSapienza (2021-2023).

Professoressa Associata di Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie, Dipartimento di Scienze Giuridiche ed Economiche – Università degli Studi di Roma UnitelmaSapienza (2014-2017) e Dipartimento di Economia e Diritto - Università di Macerata (2005-2014).

Visiting Professor presso Universidad de Leon, Leon – SP, 2019

Visiting Professor presso Institute Universitaire de Technologie , Valence – FR, 2011

Ricercatrice - Facoltà di Economia- Università di Macerata (1996-2000)

Visiting Scholar, Decision Sciences Department, "The Wharton School" of the University of Pennsylvania (1991 -1993), Philadelphia (USA).

CORSI DI INSEGNAMENTO (PRESENTE)

I Livello: Metodi Quantitativi per la Gestione Aziendale.

II Livello: Misura dei Rischi Finanziari; Artificial Economics, Simulation and Computational Methods; Modelli Computazionali per l'Economia e la Finanza; Finanza Sostenibile.

Post Laurea: Machine Learning e Big Data; Modelli Computazionali per l'Analisi e la Classificazione dei Big Data.

TEMI DI RICERCA RECENTI

- Machine Learning
- Network Analysis
- Modelli di ottimizzazione per la gestione aziendale, logistica e trasporti
- Misura e controllo dei rischi finanziari, ESG, transizione ecologica, ...
- Modelli quantitativi per l'analisi dei fenomeni economico-finanziari.
- Portafoglio ottimo e diversificazione.
- Modelli complessi per la valutazione delle attività finanziari e la gestione del rischio.

- Finanza comportamentale e Financial Literacy.

INCARICHI ACCADEMICI PREGRESSI (SELEZIONE)

Università di Roma UnitelmaSapienza: **Presidente** Commissione Paritetica Docenti Studenti; **Delegata del Rettore** al Job Placement, **Coordinatrice** Commissione di Valutazione e Titoli Stranieri.

Università degli Studi di Roma Tor Vergata: **Componente** del Collegio dei Docenti del Dottorato di Ricerca in Economia delle istituzioni e dei mercati monetari e finanziari (2008-2013), **Docente** di Financial Engineering presso il Dottorato di di Ricerca in Economia delle istituzioni e dei mercati monetari e finanziari (2008-2013); **Docente** di Mathematics presso il Corso di Laurea in Buisness Administration (2012-2013);

Università di Macerata: **Direttrice** della Summer School in Economia e Legislazione Antiriciclaggio; **Delegata del Rettore** al Polo Interdisciplinare di Ricerca “Secure, Clean and Efficient Energy”; **Delegata del Dipartimento di Economia e Diritto** presso la “Commissione EuroRegione Adriatico-Ionica”; **Delegata del Direttore del Dipartimento di Economia e Diritto** alla Pianificazione Strategica e Rendicontazione Sociale dell’Ateneo; **Componente** del Comitato Scientifico del Centro di Ricerca “Maffeo Pantaleoni” per gli studi bancari, finanziari e assicurativi; **Componente** del Comitato Scientifico del Laboratorio “Fausto Vicarelli”, per lo studio del rapporto tra Banca e Industria; **Componente** del Centro Interuniversitario di Ricerca per lo Sviluppo Sostenibile (CIRPS); **Docente** di Matematica Finanziaria (1996 – 2004), Laboratorio di Anals e Misura dei Rischi Finanziari (2008-2013), laboratorio di Matematica Attuariale (2000-2013).

ULTERIORI ATTIVITA' (SELEZIONE)

Comitati Scientifici

- CISA – Centro Interaccademico per le Scienze Attuariali e la Gestione dei Rischi (dal 2021).
- Energy Finance Italia (dal 2020).
- Global Network of Executive Master in Financial Management (GEMFM) (dal 2020).
- Minerva Lab, laboratorio interdisciplinare sulle disuguaglianze di genere, di Sapienza Università di Roma (dal 2018).
- International Summer School “Risk Measurement and Control” (dal 2012).

Componente Commissioni di Concorso

- Concorso per la selezione di Esperti in Mercati Finanziari e Gestione dei Rischi (2018, 2021) – Banca d’Italia
- Concorso per l’Esame di Stato Attuario Senior e Junior - Sede di Roma (2019)
- Concorsi per l’accesso ai ruoli accademici (tutte le fasce della docenza)
- Concorsi per l’ammissione a Dottorati di Ricerca.

Incarichi in qualità di Esperta (Selezione)

- Consulenza Tecnica per l’integrazione dei criteri ESG nelle strategie di impresa, dal 2021.
- Consulenza Tecnica per l’implementazione di Modelli di Machine Learning e analisi di Big Data (dal 2020)
- Consulenza Tecnica per la valutazione di strumenti di finanziamento adottati da imprese private, dal 2014.
- Consulenza Tecnica per la Financial Literacy, CGIL Firenze, 2017
- Consulenza Tecnica per la valutazione degli expected payoff delle VLT, 2012.
- Consulenza Tecnica per l’implementazione di algoritmi per la misurazione delle performance di Fondi Comuni di Investimento, 2000.

Coordinamento di Progetti (Selezione)

- *Progetto di Ricerca FAR*: Modelli quantitativi per la sostenibilità in ambito bancario 2022-2024.

- *Management Committee Sub* Progetto europeo COST Action CA15122, Reducing Old-Age Social Exclusion: Collaborations in Research and Policy (ROSEnet) dal 4 aprile 2016 al 04-aprile-2020.
- *Progetto di Ricerca FAR*: Realtà Virtuale Aumentata, Teoria dei prospetti e finanza comportamentale, 2018, 2019.
- *Progetto di Ricerca FAR*: Modelli quantitativi per l'analisi dei mercati delle materie prime 2016, 2017.
- *Progetto di Ricerca di Ateneo*: Metodi quantitativi per il conformance checking in ambito aziendale, 2014, 2015.
- *Progetti di Ricerca FAR* Dinamiche complesse per i mercati dei derivati 2010, 2012, 2013.
- *Progetto UE/FSE* Economia e Legislazione Antiriciclaggio, 2006-2008.

Responsabilità Scientifica di convegni nazionali e internazionali (Selezione).

- 67° Euro Working Group on Financial and Commodities Modeling, Roma 2023
- International Summer School on Risk Measurement and Control, iniziativa permanente in collaborazione con Sapienza Università di Roma, LUISS e pool di Università europee, dal 2004
- XVIII International Conference on Finance and Banking, 2020.
- Energy Finance Italia, Roma (dal 2020).
- 50° Euro Working Group for Commodity and Financial Modelling, Roma 2012.
- 30° Euro Working Group for Financial Modeling (2002)
- XII "Annual European Futures Research Symposium" del Chicago Board of Trade, Roma dal 13-14 settembre 1999.

PARTECIPAZIONE A CONVEGNI E SEMINARI E ATTIVITA' EDITORIALE

Partecipazione a più di 150 conferenze internazionali e seminari sia come relatrice che come speaker invitata o in sessione plenaria.

Guest Editor di riviste internazionali (Annals of Operation Research, Quality&Quantity, ecc.)

Membro dell'Advisory Board della sezione "Financial Mathematics" della rivista Mathematics

Membro dell'Advisory Board della collana del Dipartimento di Economia e Diritto dell'Università di Macerata

Attività di Referaggio e Valutazione (Selezione): The International Journal of Management Science; Journal of Banking and Finance; The European Journal of Finance; Applied Financial Economics; Journal of the Operational Research Society, Omega, Computers & Operations Research; Journal of Economic Dynamics and Control; European Journal of Operational Research; Central European Journal of Operations Research; Applied Economics; International Review of Financial Analysis; Research in International Business and Finance; South Eastern Journal of Economics; Frontiers in Finance and Economics, International Society for Intercommunication of New Ideas (ISINI) and - Lille Graduate School of Management (Group ESC); Rivista di Statistica Applicata; Rivista Italiana degli Economisti; Rivista di Politica Economica; Sustainability; Classification, Data Analysis and Knowledge Organization; Progetti di Ateneo dell'Università degli Studi di Siena; Premio «Angelo Costa»; Premio SIE per Tesi di dottorato, Società Italiana degli Economisti..

ISTRUZIONE E FORMAZIONE

Dottorato di Ricerca in Matematica per l'Analisi dei Mercati Finanziari Università degli Studi di Brescia	1994
Scuola di Perfezionamento in Economia Bancaria e dei Mercati Finanziari Int.li Università degli Studi di Roma "La Sapienza"	1991
Laurea in Scienze Politiche (Indirizzo Economico)	1990

ARTICOLI SCIENTIFICI IN RIVISTA (ULTIMI 10 ANNI)

1. Castellano R., Cini F., Ferrari A., Stima delle classi di rating ESG: un approccio di Machine Learning con indici di bilancio e misure di rischio sistematico. *BANCARIA* (in via di pubblicazione):
2. Castellano R., Cini F., Ferrari A., Value Creation and Sustainable Business Model: Are ESG ratings a matter of class? *ANNALS OF OPERATIONS RESEARCH* (in via di pubblicazione)
3. Ventre V, and Martino R, and Castellano R, and Sarnacchiaro P, The analysis of the impact of the framing effect on the choice of financial products: an analytical hierarchical process approach, *ANNALS OF OPERATIONS RESEARCH*, 2023.
4. Castellano, R., Riccioni, J., & Rinaldi, A. (2023). Do satisfaction, gender issues, and financial inclusion impact Italian female managers? *REVIEW OF MANAGERIAL SCIENCES*, 1-18.
5. Castellano R, and Corallo V. Morelli G., Structural estimation of Counterparty Credit Risk under recovery risk, *JOURNAL OF BANKING & FINANCE*, 140, 2022.
6. Castellano R, and Cerqueti R, and Clemente G, and Grassi R, An optimization model for minimizing systemic risk, *MATHEMATICS AND FINANCIAL ECONOMICS*, 15, 2021.
7. Castellano R, and Mancinelli M, and Ponsi G, and Tieri G, What if versus probabilistic scenarios: a neuroscientific analysis, *ANNALS OF OPERATIONS RESEARCH*, 299, 2021.
8. Brunelli S., and Carlino C., and Castellano R, and Giosi A.}, Going Concern Modifications and Related Disclosure in the Italian Stock Market: Do Regulatory Improvements Help Investors in Capturing Financial Distress? *THE JOURNAL OF MANAGEMENT AND GOVERNANCE*, 25, 2021.
9. Castellano R, and Cerqueti R, and Rotundo G., Exploring the financial risk of a temperature index: a fractional integrated approach, *ANNALS OF OPERATIONS RESEARCH*, 284(1), 2020.
10. Castellano R, and Ferrari A, Are Stock Price Dynamics Affected by Financial Analysts' Recommendations? Evidence from Italian Green Energy Stocks, *QUALITY & QUANTITY*, 53, 2019.
11. Castellano R, and Cerqueti R, A theory of misperception in a stochastic dominance framework and its application to structured financial products, *IMA JOURNAL OF MANAGEMENT MATHEMATICS*, 29(1), 2018.
12. Ausloos M, and Castellano R, and Cerqueti R, Regularities and Discrepancies of Credit Default Swaps: a Data Science approach through Benford's Law, *CHAOS, SOLITONS AND FRACTALS*, 90, 2016.
13. Castellano R, and Cerqueti R, and Spinesi L., Sustainable Management of Fossil Fuels: A Dynamic Stochastic Optimization Approach with Jump-Diffusion. *EUROPEAN JOURNAL OF OPERATIONAL RESEARCH*, 255(1), 2016.
14. Castellano R, and Cerqueti R, Mean-variance portfolio selection in the presence of infrequently traded stocks, *EUROPEAN JOURNAL OF OPERATIONAL RESEARCH*, 234(2), 2014.
15. Castellano R, and Cerqueti R, and D'Ecclesia RL, A Disutility-Based Drift Control for Exchange Rates, *OPTIMIZATION*, 63(2), 2014.
16. Castellano R, and Scaccia L, Can CDS indexes signal future turmoils in the stock market? A Markov switching perspective, *CENTRAL EUROPEAN JOURNAL OF OPERATIONS RESEARCH*, 22, 2014.
17. Castellano R, and Cerqueti R, Roots and Effects of Financial Misperception in a Stochastic Dominance Framework, *QUALITY & QUANTITY*, 47, 2013.
18. Castellano R, and D'Ecclesia RL, CDS Volatility: the Key Signal of Credit Quality, *ANNALS OF OPERATIONS RESEARCH*, 205, 2013.

CONTRIBUTI IN VOLUME - ULTIMI 10 ANNI

1. Castellano R, D'Ecclesia R.L., Zambruno G., In the Footsteps of Giorgio Philip Szegö: His Scientific Contributions, Life, and Legacy. Springer Nature 2023.
2. Castellano R., Cini F., Ferrari A., Machine Learning for ESG Rating Classification: an integrated replicable model with financial and systemic risk parameters, *MAF 2024 – Book of Short Papers SPRINGER* (in via di pubblicazione)

3. Castellano R, and Rinaldi A, and Tieri G, Financial literacy and education: how technology can help involving the children, in International, Technology, Education and Development INTED.2019, 2019
4. Castellano R, and Mancinelli M, and Sarnacchiaro P, A statistical investigation on the relationships among financial disclosure, sociodemographic variables, financial literacy, and risk assessment ability, in Smart Statistics for Smart Applications: Book of Short Paper SIS 2019, Eds. Arbia G Peluso S Pini A Rivellini G, Pearson Milano, 2019.
5. Castellano R, and Mancinelli M, and Sarnacchiaro P, A statistical model for the investigation of the retail investors' risk assessment ability, Eds Matilde Bini Pietro Amenta Antonello D'Ambra Ida Camminatiello, in Statistical Methods for Service Quality Evaluation, Cuzzolin Editore, NAPOLI, 2019.
6. Castellano R, and Cerqueti R, in Silvestrelli P, Sustainability and ethic view of the future generations, in Sustainable development for territories. Threats and opportunities, Eum, MACERATA - ITA, 2015.
7. Castellano R, and Cedrola E, in. Monte Carlo/Monte Carlo Markov Chain Method, Wiley Encyclopedia of Management, 2015

La sottoscritta Rosella Castellano autorizza al trattamento dei dati personali ai sensi del D.L. 196/2003.

Roma, 21 febbraio 2024