

UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI MILANO

Procedura di selezione per la chiamata a professore di I fascia da ricoprire ai sensi dell'art. 18, comma 1, della Legge n. 240/2010 per il settore concorsuale 13/D4 ,

(settore scientifico-disciplinare SECS-S/06

presso il Dipartimento di MATEMATICA "FEDERIGO ENRIQUES"

(avviso bando pubblicato sulla G.U. n. 56 del 25/07/2023) - Codice concorso 5383

Matteo Brachetta

CURRICULUM VITAE

(N.B. IL CURRICULUM NON DEVE ECCEDERE LE 30 PAGINE E DEVE CONTENERE GLI ELEMENTI CHE IL CANDIDATO RITIENE UTILI AI FINI DELLA VALUTAZIONE.

LE VOCI INSERITE NEL FACSIMILE SONO A TITOLO PURAMENTE ESEMPLIFICATIVO E POSSONO ESSERE SOSTITUITE, MODIFICATE O INTEGRATE)

INFORMAZIONI PERSONALI (NON INSERIRE INDIRIZZO PRIVATO E TELEFONO FISSO O CELLULARE)

COGNOME	BRACHETTA
NOME	MATTEO
DATA DI NASCITA	09/12/1990

TITOLI

TITOLO DI STUDIO

(indicare la Laurea conseguita inserendo titolo, Ateneo, data di conseguimento, ecc.)

Laurea Magistrale in Economia, 110/110 e lode, Università degli Studi di Chieti-Pescara, conseguita il 13/10/2016

TITOLO DI DOTTORE DI RICERCA O EQUIVALENTI, OVVERO, PER I SETTORI INTERESSATI, DEL DIPLOMA DI SPECIALIZZAZIONE MEDICA O EQUIVALENTE, CONSEGUITO IN ITALIA O ALL'ESTERO

(inserire titolo, ente, data di conseguimento, ecc.)

PhD in "Business, Institutions, Markets" cum laude, Università degli Studi di Chieti-Pescara, conseguito il 24/04/2020

ALTRI TITOLI CONSEGUITI

(inserire titolo, ente, data di conseguimento, ecc.)

Corso di Alta Formazione in Finanza Matematica, 30/30, Università degli Studi di Bologna

ATTIVITÀ DIDATTICA

INSEGNAMENTI E MODULI

(inserire periodo [gg/mm/aa inizio e fine], anno accademico, corso laurea, numero di ore frontali, eventuale CFU)

Insurance and Econometrics: 01/02/2023 - oggi, A.A. 2022/2023, Corso di Laurea Magistrale in Ingegneria Matematica, Politecnico di Milano, numero di ore frontali: 60, numero di CFU: 10.

Master in "Finance, Insurance & New Technologies", Cefriel Polimi, seconda edizione: 01-09/2022 - 31/05/2023, A.A. 2022/2023, numero di ore frontali: 68.

Mathematical Finance II (esercitazioni): 01/09/2022 - 31/12/2022, A.A. 2022/2023, Corso di Laurea Magistrale in Ingegneria Matematica, Politecnico di Milano, numero di ore frontali: 26.

Quantitative Finance: 30/04/2022, Core Module in Business Analytics and Quantitative Finance for the TOPWIN Corporate Master in Fintech, numero di ore frontali: 8.

Finance I (esercitazioni): 01/02/2022 - 31/05/2022, A.A. 2021/2022, Corso di Laurea Triennale in Ingegneria Matematica, Politecnico di Milano, numero di ore frontali: 20.

Advanced Mathematical Models In Finance (esercitazioni): 01/02/2022 - 31/05/2022, A.A. 2021/2022, Corso di Laurea Triennale in Ingegneria Gestionale, Politecnico di Milano, numero di ore frontali: 20.

Mathematical Finance II (esercitazioni): 01/09/2021 - 31/12/2021, A.A. 2021/2022, Corso di Laurea Magistrale in Ingegneria Matematica, Politecnico di Milano, numero di ore frontali: 26.

Advanced Mathematical Models In Finance (esercitazioni): 01/02/2021 - 31/05/2021, A.A. 2020/2021, Corso di Laurea Triennale in Ingegneria Gestionale, Politecnico di Milano, numero di ore frontali: 20.

Mathematical Finance II (esercitazioni): 01/09/2020 - 31/12/2020, A.A. 2020/2021, Corso di Laurea Magistrale in Ingegneria Matematica, Politecnico di Milano, numero di ore frontali: 26.

Mathematical modeling for investment decisions: 01/02/2019 - 31/05/2019, A.A. 2018/2019, Corso di Laurea Magistrale in Economia, Università di Chieti-Pescara, numero di ore frontali: 20.

ATTIVITÀ DI DIDATTICA INTEGRATIVA E DI SERVIZIO AGLI STUDENTI

ATTIVITÀ DI RELATORE DI ELABORATI DI LAUREA, DI TESI DI LAUREA MAGISTRALE, DI TESI DI DOTTORATO E DI TESI DI SPECIALIZZAZIONE

(inserire numero, anno accademico, ateneo, corso laurea, ecc.)

A.A. 2023/2024: n. 5 (cinque) tesisti in carico, Politecnico di Milano, Corso di Laurea Magistrale in Ingegneria Matematica.

A.A. 2022/2023: n. 1 (uno) laureato in Luglio 2023, Politecnico di Milano, Corso di Laurea Magistrale in Ingegneria Matematica.

A.A. 2018/2019: n. 1 (uno) tesista, Università di Chieti-Pescara, Corso di Laurea Magistrale in Economia.

ATTIVITÀ DI TUTORATO DEGLI STUDENTI DI CORSI DI LAUREA E DI LAUREA MAGISTRALE E DI TUTORATO DI DOTTORANDI DI RICERCA

(inserire anno accademico, corso laurea, ecc.)

--

SEMINARI

(inserire titolo del seminario, luogo, data, ecc.)

Chair at Energy Finance Italia 8 at Politecnico of Milano, 08/02/2023 - 10/02/2023

Chair at 24th International Congress on Insurance: Mathematics and Economics (IME 2021), Virtual Congress. Session "Ruin Theory and Its Applications", 08/07/2021

Discussant at "Big Data and Machine Learning in Finance Conference", Online Conference organized by Politecnico of Milan. 10-11/06/2021

Summer School "Complexity and Emergence: ideas, methods, with a special attention to economics and finance", Como (Italy), 22-27/07/2018

Verona Paris Stochastic Modeling Semester - Opening Conference, 18-21/12/2017

21st International Congress on Insurance: Mathematics and Economics (IME 2017), Vienna (Austria), 02-08/07/2017

First Edition of Qfin@work, Roma (Italy), 28/04/2017

ATTIVITÀ DI RICERCA SCIENTIFICA

PUBBLICAZIONI SCIENTIFICHE

(per ciascuna pubblicazione indicare: nomi degli autori, titolo completo, casa editrice, data e luogo di pubblicazione, codice ISBN, ISSN, DOI o altro equivalente)

1. Brachetta, M., Callegaro, G., Ceci, C. and Sgarra, C. "Optimal reinsurance via BSDEs in a partially observable model with jump clusters", 2023, accepted for publication on Finance and Stochastics
2. Barucci, E., Brachetta, M. and Marazzina, D. "Debt redemption fund and fiscal incentives", 2023, Communications in Nonlinear Science and Numerical Simulation, 119.
<https://doi.org/10.1016/j.cnsns.2023.107094>
3. Barucci, E., Brachetta, M. and Marazzina, D. "On the feasibility of a debt redemption fund", 2023, Economic Modelling, 119. <https://doi.org/10.1016/j.econmod.2022.106141>
4. Brachetta, M. and Ceci, C. "A stochastic control approach to public debt management". 2022. Math Finan Econ. <https://doi.org/10.1007/s11579-022-00323-7>
5. Brachetta, M. and Ceci, C. "Optimal reinsurance problem under fixed cost and exponential preferences". 2021, Mathematics, 9(4). <https://doi.org/10.3390/math9040295>
6. Brachetta, M. and Ceci, C. "A BSDE-based approach for the optimal reinsurance problem under partial information". 2020, Insurance: Mathematics and Economics, 95:1-16.
<https://doi.org/10.1016/j.insmatheco.2020.07.009>
7. Brachetta, M. and Schmidli, H. "Optimal Reinsurance and Investment in a Diffusion Model". 2019, Decisions in Economics and Finance. 8:1 - 21. <https://doi.org/10.1007/s10203-019-00265-8>
8. Brachetta, M. and Ceci, C. "Optimal proportional reinsurance and investment for stochastic factor models". 2019, Insurance: Mathematics and Economics, 87:15 - 33.
<https://doi.org/10.1016/j.insmatheco.2019.03.006>
9. Brachetta, M. and Ceci, C. "Optimal excess-of-loss reinsurance for stochastic factor risk models". 2019, 7(2). <https://doi.org/10.3390/risks7020048Risks>.

ORGANIZZAZIONE, DIREZIONE E COORDINAMENTO DI CENTRI O GRUPPI DI RICERCA NAZIONALI E INTERNAZIONALI O PARTECIPAZIONE AGLI STESSI

(per ciascuna voce inserire anno, ruolo, gruppo di ricerca, ecc.)

Funded INdAM - GNAMPA Project 2020 on "A class of optimization problems in actuarial and economics science" ("Una classe di problemi di ottimizzazione in ambito attuariale ed economico"), Organizer: Prof. Claudia Ceci.

Research Project “Problemi di controllo stocastico e arresto ottimo e applicazioni in ambito assicurativo ed economico”, Principal Investigator: Prof. Claudia Ceci, 2020

Funded INdAM - GNAMPA Project 2019 on “Stochastic control problems with partial information in infinite dimensions” (“Problemi di controllo ottimo stocastico con osservazione parziale in dimensione infinita”), Organizer: Alessandro Calvia.

Research Project “Problemi di controllo stocastico in informazione parziale con applicazione ai mercati finanziari e assicurativi e copertura del rischio di controparte in ambito assicurativo”, Principal Investigator: Prof. Claudia Ceci, 2019

Research Project “Problemi di controllo stocastico in informazione parziale: il problema della riassicurazione ottima e applicazioni alla gestione del debito pubblico”, Principal Investigator: Prof. Claudia Ceci, 2018

Research Project “Valutazione di derivati assicurativi sulla vita unit-linked in contesto d’informazione parziale e copertura del rischio di controparte in ambito assicurativo e di rischio di credito”, Principal Investigator: Prof. Claudia Ceci, 2017

ATTIVITÀ QUALI LA DIREZIONE O LA PARTECIPAZIONE A COMITATI EDITORIALI DI RIVISTE SCIENTIFICHE
(per ciascuna voce inserire anno, ruolo, rivista scientifica, ecc.)

Co-Guest Editor of the Special Issue “Stochastic Optimization Methods in Economics, Finance and Insurance” on Mathematics
(https://www.mdpi.com/journal/mathematics/special_issues/stochastic_optimization),
Guest Editor: Prof. Claudia Ceci.

TITOLARITÀ DI BREVETTI

(per ciascun brevetto, inserire autori, titolo, tipologia, numero brevetto, ecc.)

--

PREMI E RICONOSCIMENTI NAZIONALI E INTERNAZIONALI PER ATTIVITÀ DI RICERCA

(inserire premio, data, ente organizzatore, ecc.)

AMASES Award for the best paper presented by a young researcher in 2019

PARTECIPAZIONE IN QUALITÀ DI RELATORE A CONGRESSI E CONVEGNI DI INTERESSE INTERNAZIONALE

(inserire titolo congresso/convegno, data, ecc.)

Speaker at Quantitative Finance Workshop 2023, Gaeta (LT), Title: “Dynamic adoption of CBDC in a stochastic game”, 19/04/2023 - 23/04/2023

Invited talk at Symposium in Honour of Prof. Dr. Hanspeter Schmidli's 60th Birthday in University of Cologne (Germany). Title: “A contagion risk model with jump clusters under partial information, 13/03/2023

Speaker at International Fintech Research Conference: Finance, technology, methodologies in Milan, Italy, Politecnico of Milan. Title: “Dynamic adoption of CBDC in a stochastic game”. 27/10/2022 - 28/10/2022

Speaker at the AMASES XLVI Conference, title: "Optimal reinsurance via BSDEs in a partially observable contagion model with jump clusters". 22/09/2022 - 24/09/2022

Speaker at 25th International Congress on Insurance: Mathematics and Economics (IME 2022), Virtual Congress; title: "Optimal reinsurance via BSDEs in a partially observable contagion model with jump clusters". 13/07/2022 - 15/07/2022

Invited talk at the 3rd Spring Colloquium on Probability and Finance in Padova (Italy), title: "A Stochastic Control Approach to Public Debt Management". 28/04/2022 - 29/04/2022

Speaker at the XXIII Workshop on Quantitative Finance (QFW 2022), Rome (Italy), title "A Stochastic Control Approach to Public Debt Management". 31/03/2022 - 01/04/2022

Invited talk at "Virtual seminar in Insubria & Bicocca" (Organizers: Prof. Emanuela Rosazza Gianin and Elisa Matrogiacomio); title: "Optimal Public Debt Management", 14/07/2021

Speaker at 24th International Congress on Insurance: Mathematics and Economics (IME 2021), Virtual Congress; title: "Optimal reinsurance problem under fixed cost and exponential preferences", 07/07/2021

Invited talk at University of Chieti-Pescara (organizer: Prof. Claudia Ceci); title: "I principi di base della teoria del rischio: rischi assicurativi e calcolo dei premi", 14/04/2021

Invited talk at Politecnico of Milan (organizer: Prof. Emilio Barucci), title: "Stochastic Factor Risk Models and Optimal Reinsurance", 17/04/2020

Speaker at Quantitative Finance Workshop 2020, Napoli (Italy), title: "Optimal Reinsurance and Investment in a Diffusion Model", 29-31/01/2020

Speaker at 43rd Annual Meeting of the AMASES, Perugia (Italy), title: "Optimal Reinsurance and Investment in a Diffusion Model", 09-11/09/2019

Winner of the AMASES Award for the best paper presented by a young researcher

Speaker at 23rd International Congress on Insurance: Mathematics and Economics (IME 2019), Munich (Germany), title: "Optimal Reinsurance and Investment in a Diffusion Model", 10-13/07/2019

Poster presentation at Quantitative Finance Workshop 2019, Zurich (Switzerland), title: "Optimal excess-of-loss reinsurance for stochastic factor risk models", 23-25/01/2019

Invited talk at University of Bielefeld (organizer: Prof. Giorgio Ferrari), title: "Optimal reinsurance and investment problem for stochastic factor models", 09/11/2018

Invited talk at University of Cologne (organizer: Prof. Hanspeter Schmidli), title: "Optimal reinsurance and investment problem for stochastic factor models", 18/10/2018

Speaker at 42nd Annual Meeting of the AMASES, Napoli (Italy), title: "Optimal reinsurance and investment problem for stochastic factor models", 13-15/09/2018

Speaker at Quantitative Finance Workshop 2018, Roma (Italy), title: "Optimal reinsurance and investment problem for stochastic factor models", 24-26/01/2018

ATTIVITÀ GESTIONALI, ORGANIZZATIVE E DI SERVIZIO

INCARICHI DI GESTIONE E AD IMPEGNI ASSUNTI IN ORGANI COLLEGIALI E COMMISSIONI, PRESSO RILEVANTI ENTI PUBBLICI E PRIVATI E ORGANIZZAZIONI SCIENTIFICHE E CULTURALI, OVVERO PRESSO L'ATENE O ALTRI ATENEI

(inserire incarico/impegno, ente, data, ecc.)

Dal A.A. 2023/2024: Vice Direttore del Master in “Finance, Insurance & New Technologies”, Cefriel Polimi, 3 rd edition

Dal A.A. 2021/2022 ad oggi: Professore Referente ERASMUS per studenti out-going, Politecnico di Milano, Corso di Laurea Magistrale in Ingegneria Matematica.

Dal A.A. 2022/2023 ad oggi: partecipazione a Commissioni di Laurea, Politecnico di Milano, Corso di Laurea Magistrale in Ingegneria Matematica.

ATTIVITÀ CLINICO ASSISTENZIALI

(indicare, data, durata, ruolo, ente presso il quale si è prestata attività assistenziale, ecc.)

Data

17/08/2023

Luogo

Pavia