

UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI MILANO
selezione pubblica per n.1 posto di Ricercatore a tempo determinato in tenure track (RTT)
per il settore concorsuale 13/D4,
settore scientifico-disciplinare SECS-S/06
presso il Dipartimento di Economia, Management E Metodi Quantitativi,
(avviso bando pubblicato sulla G.U. n. 16 del 23/02/2024) Codice concorso 5498

Amir Khorrami Chokami

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	KHORRAMI CHOKAMI
NOME	AMIR
DATA DI NASCITA	[REDACTED]

TITOLI

TITOLO DI STUDIO

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

Laurea magistrale in Ingegneria Matematica (LM-44), conseguita presso il Politecnico di Torino, in data 24/03/2014. Voto: 110/110 *cum laude*. Supervisor: Mauro Gasparini (Politecnico di Torino) and Simone Padoan (Università Bocconi). Titolo della tesi: "Extreme Value Analysis of Severe Rainfalls in the Piemonte and Valle d'Aosta Regions".

Laurea triennale in Matematica per l'Ingegneria (L-35), conseguita presso il Politecnico di Torino, in data 31/03/2011. Voto: 110/110. Supervisore: Claudio Canuto (Politecnico di Torino). Titolo della tesi: "Gevrey regularity of periodic solutions of elliptic equations".

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.)

Dottorato in "Statistics", Dipartimento di Scienze delle Decisioni, Università Bocconi, conseguito il 22/01/2019. Titolo della tesi: "New Advances on Records". Relatori: Michael Falk (Università di Würzburg) e Simone Padoan (Università Bocconi). Argomento: Teoria dei Valori Estremi, Teoria dei Record.

CONTRATTI DI RICERCA, ASSEGNI DI RICERCA O EQUIVALENTI

(per ciascun contratto stipulato, inserire università/ente, data di inizio e fine, ecc.)

Assegnista di ricerca "post dottorale" categoria B - Fascia 1 presso il Dipartimento di Scienze Matematiche "G. L. Lagrange", Politecnico di Torino (01/06/2019 - 30/09/2019).

ATTIVITÀ DIDATTICA A LIVELLO UNIVERSITARIO IN ITALIA O ALL'ESTERO

(inserire periodo [gg/mm/aa inizio e fine], anno accademico, ateneo, corso laurea, numero ore, ecc.)

Università di Torino

- Titolare del corso *Extreme Value Theory* (Ph.D. in Modeling and Data Science) - A.A. 2022/23, 2023/24, 8 ore;
- Titolare del corso *Numerical and Statistical Methods for Finance (Modulo: Simulazione) - Metodi computazionali per la statistica* (Laurea Magistrale in Quantitative Finance and Insurance, Laurea Magistrale in Stochastics and Data Science) - A.A. 2019/20, 2020/21, 2021/22, 2022/23, 2023/24, 48 ore;
- Titolare del corso *Statistics* (Laurea Triennale in Economia) - A.A. 2022/23, 2023/24, 16 ore.

Collegio Carlo Alberto, Torino

- Titolare del corso *Coding in R* (Master in Finance, Insurance and Risk Management) - A.A. 2022/23, 2023/24, 14 ore.

Politecnico di Torino

- Attribuzione incarico didattico di 8 ore del corso *Statistical Learning* (Corso complessivo di 18 ore, Ph.D. in Pure and Applied Mathematics). Modulo: *Extreme Value Theory* - A.A. 2022/23;
- Esercitatore del corso *Data Spaces/Modelli Statistici - Modulo: Machine Learning* (Laurea Magistrale in Ingegneria Matematica) - A.A. 2019/20, 20 ore;
- Attribuzione incarico didattico di 10 ore del corso *Data Spaces/Modelli Statistici*. Argomento del modulo: *Time Series* (Laurea Magistrale in Ingegneria Matematica) - A.A. 2018/19.

Università Bocconi, Milano

- Esercitatore del corso *Applied Statistics* (Laurea Triennale in Economics and Social Sciences) - A.A. 2018/19;
- Esercitatore del corso *Statistica* (Laurea Triennale in Economia e Management per Arte, Cultura e Comunicazione) - A.A. 2015/16.

Uni-Astiss Polo Universitario, Asti

- Attribuzione incarico didattico del corso *Statistica* (Biostat Summer School) - A.A. 2014.

SUPERVISIONE DI TESI DI LAUREA

Laurea Magistrale in Quantitative Finance and Insurance (Università di Torino)

- Lorenzo Calvetti (Correlatore: Dr. Giovanni Rabitti), (TBA) [2023+];
- Domenica Melone (Correlatrice: P. Marie Kratz), *An empirical study of the tail dependence between mortality and financial market risks* [2023+];
- Luca Isaia (Correlatore: Dr. Giovanni Rabitti), *Assessing Variable Importance via*

Shapley Values for Extreme Operational Losses: A Study on Banking Dataset [2023];

- Arianna Vallarino (Correlatore: Dr. Giovanni Rabitti), *Quantile Regression and Global Sensitivity Measures for Insurance Ratemaking [2022];*
- Enrico Manzone (Correlatore: P. Stefano Favaro), *Empirical Bayes method and its application to sports [2021];*
- Ismaele Caramello (Primo Supervisore: P. Luca Regis), *A data driven score model to predict default probabilities [2021].*

Laurea Magistrale in Ingegneria Matematica (Politecnico di Torino)

- Giovanni Porta (Primo Supervisore: P. Patrizia Semeraro), (TBA) [2023+];
- Maria Cannistrà (Primo Supervisore: P. Gianluca Mastrantonio), (TBA) [2023+].

DOCUMENTATA ATTIVITÀ DI FORMAZIONE O DI RICERCA PRESSO QUALIFICATI ISTITUTI ITALIANI O STRANIERI;

(*inserire anno accademico, ente, corso, periodo, ecc.*)

Visiting Researcher, ESSEC Business School, Cergy-Pontoise e Paris - La Défense, Parigi, Francia (dicembre 2021 - marzo, luglio 2022).

Visiting Scholar, Università di Würzburg, Würzburg, Germania (ottobre 2016 - gennaio 2017, 4 mesi).

DOCUMENTATA ATTIVITÀ IN CAMPO CLINICO

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

REALIZZAZIONE DI ATTIVITÀ PROGETTUALE

(*indicare, data, progetto, ecc.*)

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

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

Responsabilità progetti di ricerca

- 2023 - 2025, Coordinatore per il progetto di ricerca *Bayesian methods for Functional Data*, Dipartimento ESOMAS, Università di Torino. Gruppo di ricerca: Matteo Ruggiero, Pierpaolo De Blasi, Stefano Favaro, Silvia Montagna, Luigi Bollani, Martina Amongero;
- 2021 - 2023, Coordinatore per il progetto di ricerca *Bayesian methods for complex problems*, Dipartimento ESOMAS, Università di Torino. Gruppo di ricerca: Matteo Ruggiero, Pierpaolo De Blasi, Stefano Favaro, Silvia Montagna, Luigi Bollani, Cecilia Balocchi, Marta Catalano, Giovanni Rebaudo, Matteo Giordano;
- 2020 - 2022, PI del progetto di ricerca *Analytics and modelling of cyber-crimes*, Dipartimento ESOMAS, Università di Torino.

Partecipazione a progetti di ricerca

- 2024+, Partecipante al progetto internazionale Aging Risks and their Long-term impact on the Economy and Society (ARLES). PI: Marie Kratz.
- 2023 - 2025, Progetto di Rilevante Interesse Nazionale (PRIN 2022) Discrete random structures for Bayesian learning and prediction. PI: Antonio Lijoi.
- 2023 - 2024, Partecipante al progetto di ricerca Assessing extremal dependence using concomitants finanziato dal Labex Modèles Mathématiques et Économiques de la Dynamique, de l'Incertitude et des Interaction consortium (MME-DII-24-1-000000030). PI: Marie Kratz.
- 2021 - 2022, Partecipante al progetto di ricerca Extremal dependence using concomitants finanziato dal Labex Modèles Mathématiques et Économiques de la Dynamique, de l'Incertitude et des Interaction consortium (MME-DII ANR-11-LABX-0023- 01). PI: Marie Kratz.
- 2017 - 2020, Progetto di Rilevante Interesse Nazionale (PRIN 2015) Modern Bayesian nonparametric methods. PI: Igor Prünster.

TITOLARITÀ DI BREVETTI

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

ORGANIZZAZIONE DI EVENTI SCIENTIFICI

- Organizzatore dell'*European Young Statisticians Meeting (EYSM 2025)*, Collegio Carlo Alberto, Torino;
- Organizzatore della sessione (TBA) alla 17-esima edizione della conferenza CMStatistics 2024, Londra, Regno Unito;
- Organizzatore della sessione *Extremes and Risk* alla 16-esima edizione della conferenza CMStatistics 2023, Berlino, Germania;
- Organizzatore della conferenza EVA2023, Università Bocconi, Milano;
- Organizzatore del workshop su *Chemical Reaction Networks (2019)*, Politecnico di Torino.

ATTIVITÀ DI RELATORE A CONGRESSI E CONVEGNI NAZIONALI E INTERNAZIONALI

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

Seminari

- 2024: (in programma, 29 marzo 2024), ISFA Université Lyon 1, Lione, Francia.
- 2023: ISFA Université Lyon 1, Lione, Francia.
- 2018: Politecnico di Torino.

Relazioni Invitate

- 2023: 16th International Conference of the ERCIM WG on Computational and Methodological Statistics (CMStatistics 2023), HTW Berlin, University of Applied Sciences, Berlino, Germania.
- 2023: 13th Conference on Extreme Value Analysis (EVA2023), Università Bocconi, Milano.
- 2023: Meeting on Statistical Methods and Applications: "From Sharing Knowledge To Cooperation", con la partecipazione dell'Ambasciata d'Italia a Dakar (Senegal), Politecnico di Torino.
- 2021: 14th International Conference of the ERCIM WG on Computational and Methodological Statistics (CMStatistics 2021), Senate House, University of London, Londra, Regno Unito.
- 2020: 13th International Conference of the ERCIM WG on Computational and Methodological Statistics (CMStatistics 2020), Senate House, University of London, Londra, Regno Unito.
- 2018: 49th Meeting of the Italian Statistical Society, Università di Palermo.

- 2017: 10th International Conference of the ERCIM WG on Computational and Methodological Statistics (CMStatistics 2017), Senate House, University of London, Londra, Regno Unito.

Relazioni spontanee

- 2023: XLVII Annual Meeting of the Italian Association for Mathematics Applied to Social and Economic Sciences (AMASES 2023), Università di Milano Bicocca, Milano.
- 2023: 14-th Scientific Meeting Classification and Data Analysis Group (CLADAG 2023), Università di Salerno.
- 2023: 16th German Probability and Statistics Days (GPSD 2023), Università di Duisburg Essen, Essen, Germania.
- 2022: 15th International Conference of the ERCIM WG on Computational and Methodological Statistics (CMStatistics 2022), King's College London, Londra, Regno Unito.
- 2022: 51st Meeting of the Italian Statistical Society (SIS2022), Università della Campania Luigi Vanvitelli, Caserta.
- 2022: 14th International Conference on Ordered Statistical Data (OSD2022), Vietri sul Mare.
- 2017: 10th Conference on Extreme Value Analysis (EVA 2017), Delft, Paesi Bassi.

Poster

- 2017: Risk Quantification and Extreme Values in Applications, Losanna, Svizzera.

CONSEGUIMENTO DI PREMI E RICONOSCIMENTI NAZIONALI E INTERNAZIONALI PER ATTIVITÀ DI RICERCA (inserire premio, data, ente organizzatore, ecc.)

ALTRI PREMI E RICONOSCIMENTI

Premi Accademici

2019 - oggi: Fondi annuali per l'eccellenza nell'insegnamento, Dipartimento ESOMAS, Università di Torino, in ogni anno accademico in cui sono stati stanziati;

2018 - 2019: *Borsa di ricerca Invernizzi basata sul merito*, Università Bocconi;

2014 - 2018: *Borsa di dottorato basata sul merito*, Università Bocconi.

Competizioni

2018: *Migliore previsione oggettiva*, Stats Under the Stars IV;

2015: *Miglior progetto*, Stats Under the Stars I.

POSSESSO DEL DIPLOMA DI SPECIALIZZAZIONE EUROPEA RICONOSCIUTO DA BOARD INTERNAZIONALI (relativamente a quei settori concorsuali nei quali è prevista) (indicare diploma, data di conseguimento, ecc.)

TITOLI DI CUI ALL'ARTICOLO 24 COMMA 3 LETTERA A) E B) DELLA LEGGE 30 DICEMBRE 2010, N. 240
(indicare se contratto di tipologia A o B, Ateneo, data di decorrenza e fine contratto, ecc.)

Ricercatore a Tempo Determinato - A (Legge n. 240/10, SSD: SECS-S/01) Dipartimento ESOMAS,
Università di Torino (01/10/2019 - oggi).

ATTIVITÀ EDITORIALE / DI REVISIONE PER LE SEGUENTI RIVISTE INTERNAZIONALI

Attività Editoriale

2022 - oggi: *Guest Editor* della *Special Issue: Mathematical Analysis and Its Applications from Decision Theory to Extreme Values, Symmetry*.

Attività di Revisore (in ordine alfabetico)

- Extremes
- Hydrological Sciences Journal
- Journal of Statistical Planning and Inference
- RevStat
- Statistical Journal
- Stochastic Models

AFFILIAZIONI A SOCIETÀ SCIENTIFICHE

- (in programma) European Mathematical Society (EMS)
- Associazione per la Matematica applicata alle Scienze Economiche e Sociali (AMASES)
- Società Italiana di Statistica (SIS)
- Complex Data Modeling Research Network (MIDAS)

PRODUZIONE 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)

Pubblicazioni su riviste

- 1) Khorrami Chokami, A., and Rabitti, G. (2024). An exact game-theoretic variable importance index for generalized additive models. *Journal of Computational and Graphical Statistics*. Taylor and Francis. DOI: 10.1080/10618600.2024.2327577 (testo accettato per la pubblicazione: <https://doi.org/10.1080/10618600.2024.2327577>)
- 2) Vallarino, A., Rabitti, G., and Khorrami Chokami, A. (2023). Construction of rating systems using global sensitivity analysis: a numerical investigation. *ASTIN Bulletin - The Journal of the International Actuarial Association*. Cambridge University Press. DOI: 10.1017/asb.2023.34
- 3) Leonetti, P., and Khorrami Chokami, A. (2022). The maximum domain of attraction of multivariate extreme value distributions is small. *Electronic Communications in Probability*. Institute of Mathematical Statistics. DOI: 10.1214/22-ECP501. ISSN: 1083-589X.

- 4) Khorrami Chokami, A., Gasparini, M., and Merletti, R. (2021). Identification of periodic bursts in surface EMG: applications to the erector spinae muscles of sitting violin players. *Biomedical Signal Processing and Control*. Elsevier. DOI: 10.1016/j.bspc.2020.102369. Online ISSN: 1746-8108.
- 5) Falk, M., Khorrami Chokami, A., and Padoan, S. (2020). Records For Time-Dependent Stationary Gaussian Sequences. *Journal of Applied Probability*. Applied Probability Trust. DOI: 10.1017/jpr.2019.77. Online ISSN: 1475-6072.
- 6) Falk, M., Khorrami Chokami, A., and Padoan, S. (2018). On Multivariate Records from Random Vectors with Independent Components. *Journal of Applied Probability*. Applied Probability Trust. DOI: 10.1017/jpr.2018.4. Online ISSN: 1475-6072.
- 7) Falk, M., Khorrami Chokami, A., and Padoan, S. (2018). Some Results on Joint Record Events. *Statistics and Probability Letters*. Elsevier. DOI: 10.1016/j.spl.2017.11.011. Online ISSN: 1879-2103.

Contributi in atti di convegno

- 8) Khorrami Chokami, A. (2023). Complete Records over independent FGM sequences. *Book of Short Papers - CLADAG 2023*. Pearson, Italy. ISBN: 978-88-9193-563-2.
- 9) Khorrami Chokami, A., and Padoan, S. (2022). On multivariate records over sequences of random vectors with Marshall-Olkin dependence of components. *Proceedings of the LI Meeting of the Italian Statistical Society*. Pearson. ISBN: 9788891932310.

Monografie

- 10) Khorrami Chokami, A. (2019). New advances on records. PhD thesis. Bocconi University, Milan.

Articoli inviati a riviste / in fase di peer review

- Khorrami Chokami, A. and Merletti, R. (2023+). Right-Left sEMG Burst Synchronization of the Lumbar Erector Spinae Muscles of Sitting Violin Players. (Minor revision su *Scientific Reports*).
- Coyle, P., Rabitti, G., Cohen, R. and Khorrami Chokami, A. (2023+). Taxonomies of cyber risk loss: industrial practices and a universal proposal with quantitative evidence. (In revisione).
- Khorrami Chokami, K., Khorrami Chokami, A., Cammarata, G., Piras, G., Albertelli, M., Gatto F., Vera, L., Ferone, D., Boschetti, M. (2023+). Current perspectives in obesity management: unraveling the impact of different therapy approach in real life obesity care. (In revisione).
- Khorrami Chokami, A. and Kratz, M. (2023+). On the relation between extremal dependence and concomitants. (Inviato).

REFERENZE

- **Prof. Marie Kratz**
Professore Ordinario, ESSEC Business School, Cergy-Pontoise e Paris-La Défense (Parigi);
Direttrice del CREAR - Center of Research in Econo-finance and Actuarial Science on Risk;
kratz@essec.edu
- **Prof. Michel Dacorogna**
CEO del DEAR-Consulting;
Partner Prima Re Solutions;

Docente presso l'Università di Zurigo, l'Università Cattolica (Milano), l'Università Ca'Foscari (Venezia), il Collegio Carlo Alberto (Torino), l'ESSEC Business School (Parigi);
michel@dacorogna.ch

- **Prof. Roberto Merletti**

Professore Ordinario, Dipartimento di Elettronica e Telecomunicazioni, Politecnico di Torino (in pensione dal nov 2015);

Ex-Direttore del Laboratorio per l'Ingegneria del Sistema Neuromuscolare (LISiN), Politecnico di Torino;

roberto@robertomerletti.it

Data

24/03/2024

Luogo

Torino