

## ALLEGATO B

UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI MILANO

selezione pubblica per n. 1 posto/i di Ricercatore a tempo determinato in tenure track (RTT) per il settore concorsuale 13/D4\_\_\_\_\_ ,

settore scientifico-disciplinare\_SECS/06\_\_\_\_\_

presso il Dipartimento di \_\_\_\_\_Dipartimento di Economia, Management e Metodi Quantitativi\_\_\_\_\_,

(avviso bando pubblicato sulla G.U. n. \_\_16\_\_ del \_23/02/2024\_) Codice concorso: 5498

## [Corrado De Vecchi] 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         | DE VECCHI  |
| NOME            | CORRADO    |
| DATA DI NASCITA | ██████████ |

### TITOLI

#### TITOLO DI STUDIO

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

Laurea Magistrale in Scienze Statistiche e Attuariali, Università degli studi di Trieste, conseguita il 22/11/2017. Voto finale: 110/110 e lode. Titolo tesi di laurea: ``Il rischio operativo nel settore bancario: modelli ed analisi empiriche``. Supervisor tesi: Prof. Nicola Torelli e Prof. Roberta Pappadà.

#### 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.)

Doctor in Economics, presso la Vrije Universiteit Brussel, dal 01/10/2018 al 08/06/2022.  
Titolo della tesi di dottorato: ``Essays on Optimal Portfolio Choice and Model Risk Assessment``.  
Supervisor : Prof. Carole Bernard e Prof. Steven Vanduffel.

Il titolo Doctor in Economics da me ottenuto è dichiarato equipollente al titolo di Dottore di Ricerca italiano dall'Università degli Studi di Udine.

**CONTRATTI DI RICERCA, ASSEGNI DI RICERCA O EQUIVALENTI**

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

Dal 01/10/2022 ad oggi ho lavorato come ricercatore Post-Doc presso il Dipartimento di Matematica della Technical University of Munich, Monaco di Baviera, Germania.  
L'attività di ricerca si svolge principalmente presso la Cattedra di Matematica Finanziaria.

**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.)*

Durante la mia attività lavorativa presso la Technical University of Munich (iniziata il 01/10/2022) sono stato Teaching Assistant per i seguenti insegnamenti:

- Actuarial Risk Theory, dal 20/10/2022 al 01/02/2023: 9 ore di lezioni frontali (esercitazioni), formulazione e correzione degli esami.
- Insurance Mathematics 1, dal 20/10/2023 al 15/03/2024: 42 ore di lezioni frontali (esercitazioni), formulazione e correzione degli esami.

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

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

Nel Luglio 2020 ho completato la summer school in Functional Analysis and Mathematical Statistics offerta dalla Scuola Matematica Interuniversitaria, Perugia.

**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.)*

**TITOLARITÀ DI BREVETTI**

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

#### **ATTIVITÀ DI RELATORE A CONGRESSI E CONVEGNI NAZIONALI E INTERNAZIONALI**

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

- AMASES XLVII conference, Settembre 2023, Milano, Italia. Organizzata dall'Università Milano-Bicocca.
- 26th Insurance: Mathematics and Economics conference, Luglio 2023, Edimburgo, UK. Organizzata dalla Heriot-Watt University.}
- XXIV Quantitative Finance Workshop, Aprile 2023, Gaeta, Italia. Organizzata dalla Università degli studi di Cassino e del Lazio Meridionale.
- 11th Conference in Actuarial Science and Finance on Samos. Maggio 2022, Samos, Grecia. Organizzata da KU Leuven, Copenhagen University and New York University.
- 10th MAF conference. Aprile 2022, Salerno, Italia. Organizzata dall'Università di Salerno.
- Modeling Uncertainty in Social, Economic, and Environmental Sciences. Marzo 2022, Lione, Francia. Organizzata dalla EM Lyon Business School.
- AMASES XLV conference. Settembre 2021, online. Organizzata dall'Università di Reggio Calabria
- 24th Insurance: Mathematics and Economics conference. Luglio 2021, online. Organizzata da University of Illinois Urbana-Champaign, Ulm University, e University of New South Wales.
- 10th AMaMeF conference. Giugno 2021, online, Italy. Organizzata dall'Università di Padova.
- 5th Workshop on Recent Developments in Dependence Modelling with Applications in Insurance and Finance. Settembre 2019, Agistri, Grecia. Organizzata dalla Vrije Universiteit Brussel.
- 23th Insurance: Mathematics and Economics conference. Luglio 2019, Monaco di Baviera, Germania. Organizzata dalla Technical University of Munich.

#### **CONSEGUIMENTO DI PREMI E RICONOSCIMENTI NAZIONALI E INTERNAZIONALI PER ATTIVITÀ DI RICERCA**

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

Premio come secondo miglior contributo presentato alla "11th Conference in Actuarial Science and Finance on Samos", conferenza organizzata da KU Leuven, Copenhagen University and New York University. Titolo della presentazione: "Robust assessment of life insurance products".

#### **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.)

## 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)

Interessi di ricerca includono le seguenti tematiche: Valutazione del rischio di Modello, Misure di rischio, Modelli di Dipendenza stocastica, Ottimizzazione di Portafoglio e dominanza stocastica.

Articoli e Tesi di Dottorato:

- 1) C. Bernard, C. De Vecchi and S. Vanduffel (2023), The impact of correlation on (Range) Value-at-Risk, Scandinavian Actuarial Journal, 2023:6, 531-564.  
<https://doi.org/10.1080/03461238.2022.2139630>.
- 2) C. De Vecchi (2022), Essays on Optimal Portfolio Choice and Model Risk Assessment, Ph.D. Thesis, Vrije Universiteit Brussel.
- 3) C. Bernard, C. De Vecchi and S. Vanduffel (2021), When do two- and three-fund theorems hold? Quantitative Finance, 21:11, 1869-1883. <https://doi.org/10.1080/14697688.2021.1905172>.
- 4) C. Bernard, C. De Vecchi and S. Vanduffel (2024), Robust assessment of life insurance products. Submitted (Working paper)
- 5) C. De Vecchi and M. Scherer (2023), Pricing insurance contracts with an existing portfolio acting as background risk. Submitted (Working paper)
- 6) V. Bignozzi and C. De Vecchi (2023), Risk bounds under tail risk. (Working paper).

Data

14/03/2024

Luogo

Verona