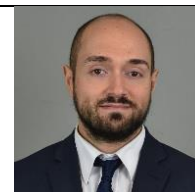


CURRICULUM VITAE DI JACOPO GIACOMELLI

(Ultimo aggiornamento - Dicembre 2021)

DATI PERSONALI

Nome e Cognome **Jacopo Giacomelli**
Cittadinanza Italiana



ESPERIENZA PROFESSIONALE

Da 04/2019 **Responsabile - Risk Management Sace BT**, presso Sace-Simest, Gruppo Cassa Depositi e Prestiti – Roma

Attività svolte e principali responsabilità Responsabilità sul monitoraggio del profilo di rischio di Sace BT S.p.A. (compagnia di assicurazione specializzata nei rami Credito, Cauzioni e Altri danni ai Beni). Sviluppo, manutenzione e validazione delle metodologie utilizzate per la misurazione dei rischi (modello interno parziale riconosciuto dall’Autorità di Vigilanza IVASS). Supporto al management della compagnia e al CdA nelle decisioni strategiche e di contenimento del rischio, attraverso strumenti informativi (reportistica periodica sugli esiti della misurazione), quantitativi (tariffazione tecnica, modello di rating interno) e qualitativi (partecipazione ai comitati impegni, supporto nella definizione di linee guida, policy e strategie aziendali). Predisposizione delle comunicazioni circa il profilo di rischio e la solidità patrimoniale della compagnia ai soggetti e nelle modalità previsti dalla normativa vigente. Gestione diretta dei rapporti tra la compagnia e le Autorità di Vigilanza, nazionale ed europea, per i temi di competenza. Responsabilità su due unità aziendali (“Misurazione e Controllo” e “Validazione”), per un totale di sei risorse gestite.

Da 04/2017 **Responsabile - Unità Misurazione e Controllo**, presso Risk Management di Sace BT,
A 04/2019 presso Sace S.p.A., Gruppo Cassa Depositi e Prestiti – Roma

Attività svolte e principali responsabilità Responsabilità delle attività di sviluppo e gestione del modello interno di Sace BT S.p.A., finalizzato alla misurazione dei rischi tecnici assicurativi e di mercato. Partecipazione allo sviluppo della piattaforma IT su cui è implementato il modello.
Gestione del processo di approvazione del modello interno (conclusosi con esito positivo 04/2018), relativamente alle metodologie di calcolo e alla condivisione delle stesse con l’Autorità di Vigilanza (IVASS).
Responsabilità su metodologie, software e calcolo delle riserve tecniche in logica Solvency 2.
Sviluppo degli strumenti IT necessari al calcolo e alla successiva ispezione delle stesse da parte della funzione Attuariale interna e dei revisori legali esterni.
Supporto a Sace BT per la tariffazione tecnica delle polizze credito e la valutazione automatica delle controparti (sistema di grade automatico).
Selezione e gestione di risorse.

Da 04/2009 **Risk Analyst**, servizio Risk Management di Sace BT, presso Sace S.p.A., Gruppo Cassa
A 04/2017 Depositi e Prestiti – Roma

Attività svolte e principali responsabilità Responsabilità di gestione, calibrazione e upgrade del modello interno per la misurazione dei rischi tecnici di Sace BT S.p.A.. Sviluppo e implementazione di modelli per il pricing di prodotti assicurativi del ramo credito. Sviluppo e implementazione di un modello di forecast delle probabilità di insolvenza.
Supporto a progettazione e implementazione di upgrade al modello interno di Sace S.p.A.. Partecipazione alla progettazione e allo sviluppo dei modelli di pricing (per Sace S.p.A. e Sace BT) e di valutazione del merito creditizio (per Sace BT). Svolgimento di corsi sulle tematiche legate ai modelli interni per le assicurazioni del Credito.

- Da** 03/2008 **Quantitative Analyst (stageur)** presso MPS Capital Services (quantitative staff) – Siena
A 12/2008
Attività svolte e principali responsabilità Sviluppo ed implementazione in linguaggio C++ di modelli per il pricing di prodotti derivati del mercato del Credito (path-dependent, opzioni americane, prodotti ibridi su rischio di credito e di tasso di interesse) e per prodotti strutturati (CDO, CDO², ABS e cartolarizzazioni). Collaborazione diretta con i trader della banca.
- Da** 09/2006 **Tirocinante** presso LENS (European Laboratory for Non-linear Spectroscopy) - Firenze
A 06/2007
Attività svolte e principali responsabilità Modellazione di un sistema quantistico disordinato, sia con tecniche analitiche che numeriche. Sviluppo di metodologie originali di analisi dati, specifiche per il problema affrontato, e implementazione in linguaggio C del software necessario all'analisi.

DOCENZE E SEMINARI

2022/03 C.A.F. in Finanza Matematica	Università degli Studi di Bologna; 8 ore; lingua italiana	<i>“Estimating real-world default probabilities”</i> Corso su problemi di inferenza e di calibrazione, con focus sul rischio di credito.
2021/03 C.d.L. IFIR Intermediari, finanza internazionale e risk management	Università “La Sapienza” di Roma; 2 ore; lingua italiana	<i>“L’Enterprise Risk Management nelle Imprese di Assicurazione”</i> Seminario su tematiche relative all’enterprise risk management e al ruolo del gruppo SACE nel contesto attuale.
2021/03 C.A.F. in Finanza Matematica	Università degli Studi di Bologna; 4 ore; lingua italiana	<i>“Real-world probabilities of absorbing events: inference problems under information asymmetry”</i> Corso su problemi di inferenza a informazione incompleta, con applicazioni a finanza, assicurazioni e biostatistica.
2020/09 eMAF 2020 già MAF 2020, Université de Genève (evento online causa pandemia)	Université de Genève/Università Ca’ Foscari Venezia; lingua inglese	<i>“Improved precision in calibrating CreditRisk+ model for Credit Insurance applications”</i> Presentazione ad un convegno internazionale di alcuni risultati di ricerca su tematiche relative al rischio di credito.
2020/06 C.A.F. in Finanza Matematica	Università degli Studi di Bologna; 4 ore; lingua italiana	<i>“Improved precision in calibrating the CreditRisk+ model: a “small data” problem”</i> Corso su tematiche relative alla calibrazione della struttura di dipendenza di un modello classico della letteratura sul rischio di credito.
2020/05 MYR Master interno del Polo Italiano dell’Export su tematiche di gestione del rischio	Gruppo Sace-Simest; 6 ore; lingua italiana	<i>“Elementi di matematica per l’assicurazione del credito”</i> Corso introduttivo su tematiche di matematica finanziaria e attuariale, finalizzato a fornire i prerequisiti per la comprensione del trattamento quantitativo del rischio di credito da un punto di vista assicurativo.
2016/02 C.A.F. in Finanza Matematica	Università degli Studi di Bologna; 8 ore; lingua italiana	<i>“Laboratorio di rischio di credito”</i> Formazione alla modellazione del rischio di credito attraverso richiami di teoria alternati allo svolgimento in classe di case study in Matlab.
2015/06 Training a Partnership Fund	Partnership Fund (Tbilisi); 20 ore; lingua inglese	<i>“Introduction to risk management and pricing for a credit insurance company”</i> Introduzione al Credit Risk Management assicurativo, formazione sull’utilizzo di un modello interno per il Credit Risk Management che ho sviluppato sulle specifiche del cliente.

2015/02 C.A.F. in Finanza Matematica	Università degli Studi di Bologna; 2 ore; lingua italiana	<i>“Calibrazione del rischio di credito con e senza un mercato”</i> Introduzione alle diverse modalità di calibrazione di un modello di misurazione del rischio di credito a seconda del set informativo disponibile sulle controparti a rischio.
2014 3 sessioni: Dhaman; Iciec; EximBank	SACE (Roma); 4 ore; lingua inglese	<i>“The internal model: requirements and methodologies”</i> Introduzione al Credit Risk Management assicurativo; requisiti per i modelli interni sotto la normativa Solvency 2.

ISTRUZIONE

Da 11/2018 A	Università La Sapienza, Roma	<i>PhD candidate</i> in Scienze Attuariali, presso la Scuola di Scienze Statistiche dell’università La Sapienza di Roma.
Da 11/2014 A 11/2015	LUISS Business School, Roma	Executive Master in Finanza e Mercati EMAFIM. Votazione (media degli esami sostenuti): 30/30 .
Da 10/2007 A 03/2008	Università degli Studi di Bologna	Corso di Alta Formazione in Finanza Matematica. Votazione (media degli esami sostenuti): 29/30 .
Da 09/2005 A 09/2007	Università degli Studi di Firenze	Laurea di secondo livello in “Scienze fisiche e astrofisiche” – specializzazione in “Fisica teorica”. Votazione: 110/110 .
Da 09/2002 A 09/2005	Università degli Studi di Firenze	Laurea di primo livello in “Scienze fisiche e astrofisiche”. Votazione: 109/110 .
Da 09/1997 A 07/2002	Liceo ginnasio “Dante”, Firenze	Diploma di istruzione classica. Votazione: 100/100 .

ISTRUZIONE (CORSI BREVI E SEMINARI)

18-21/06/2013	Bolsa de Barcelona	Financial Engineering Summer School 2013
10-15/09/2012	Cambridge, Eurocentres	Full immersion di lingua inglese
19-22/06/2012	Bolsa de Madrid	Financial Engineering Summer School 2012
21-22/06/2011	London (Infoline)	Managing Catastrophe Risk
28-29/10/2010	Lausanne, Ecole Polytechnique Fédérale de Lausanne (EPFL)	Swissquote conference on Interest Rate and Credit Risk
10/05/2010	Milano, SDA Bocconi	Le variabili qualitative nel credit risk management
22-25/09/2009	Milano, SDA Bocconi	Rischio operativo nelle banche e nelle assicurazioni
01-03/07/2009	Milano, SDA Bocconi	Controllo dei rischi e Capital Management nelle assicurazioni
15-16/05/2008	Bologna, facoltà di matematica	Spring School in Finance 2008

COMPETENZE INFORMATICHE

Conoscenza approfondita dei seguenti linguaggi e prodotti: **C, C++, Fortran, SQL Server, ORACLE, VBA, MATLAB, R, Octave, Latex, Pacchetto Office** (Access, Excel, Word, PowerPoint). Conoscenza di base dei seguenti linguaggi e prodotti: **Bloomberg, Mathematica, Maple**

COMPETENZE LINGUISTICHE

Italiano: madrelingua.

Inglese: capacità avanzate di espressione scritta e buone capacità di espressione orale. Sostenuti gli esami IELTS (03/2009, score 7.5/9) e TOEFL (09/2009, score 102/120). Full immersion linguistica presso il centro di formazione “Eurocentres” di Cambridge (Settembre 2012) e “Regent” di Londra (Agosto 2017 – valutazione C1). Docenze erogate in lingua inglese sia presso la sede Sace di Roma (2014) che *on site* presso clienti esteri (2015).

PUBBLICAZIONI SCIENTIFICHE

1. **Physical Review A** 82 (2010), 053405 “*Density of states in an optical speckle potential*”; GM Falco, AA Fedorenko, J Giacomelli, M Modugno
2. **Physica A** 404 (2014), 158-170 “*Localization properties of one-dimensional speckle potentials in a box*”; J Giacomelli
3. arXiv:1406.6375 (working paper) “*One-dimensional matter waves as a multi-state bit*”; J Giacomelli
4. Technical Report 3-2018, Università di Roma La Sapienza, Dipartimento di Statistica, “*Calibrating the dependence structure of the CreditRisk+ model at different time scales*”; J Giacomelli, L Passalacqua
5. “*Improved precision in calibrating CreditRisk+ model for Credit Insurance applications*” in *Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance eMAF 2020*, Springer, (1st edition, 2021); J Giacomelli, L Passalacqua
6. **Mathematics** 9(14) (2021), 1679 “*Calibrating the CreditRisk+ model at different time scales and in presence of temporal autocorrelation*”; J Giacomelli, L Passalacqua
7. **Mathematics** 9(19) (2021), 2385 “*Unsustainability Risk of Bid Bonds in Public Tenders*”; J Giacomelli, L Passalacqua

VARIE

Socio SIF (Società Italiana di Fisica)
Patente di guida A e B