

Jacopo GIACOMELLI

Ph.D., Risk Manager



researchgate.net/profile/Jacopo-Giacomelli

Esperienza professionale (15+ anni) nella misurazione e gestione di rischi finanziari e assicurativi, con focus sul rischio di credito. Selezione di risorse e gestione di team. Responsabilità su progetti di grandi dimensioni. Gestione della relazione con le Autorità di Vigilanza assicurative nazionale ed europea.

Attività di docenza e formazione, sia in ambito accademico (presso il dipartimento di matematica dell'università di Bologna e presso il dipartimento di statistica dell'università "La Sapienza" di Roma) che nel settore privato.

Background quantitativo (M. Sc. in Fisica Teorica, Ph. D. in Scienze Attuariali, postgraduate degree in Matematica Finanziaria, executive master in Finanza) con esperienza di ricerca e pubblicazioni su riviste scientifiche di rilevanza internazionale.

Competenze informatiche: sviluppo software per il calcolo scientifico e industriale; gestione ed utilizzo di basi dati.

ESPERIENZA PROFESSIONALE

Presente
Aprile 2019

Responsabile della funzione di Risk Management, SACE BT, Roma

Monitoraggio e gestione del profilo di rischio di SACE BT S.p.A. – compagnia assicurativa rami danni dotata di modello interno parziale, specializzata nelle linee di business Credito, Cauzioni ed Altri danni ai Beni.

- Supporto al CdA ed al management nelle decisioni strategiche, attraverso strumenti informativi (*reporting periodico ed informative su temi specifici*), quantitativi (*bilancio di solvibilità, tariffazione tecnica, modello di rating interno*) e qualitativi (*organizzazione Comitato Rischi, NBO su operazioni rilevanti, supporto nella definizione di linee guida, policy e strategie aziendali*).
- Sviluppo, manutenzione e validazione delle metodologie utilizzate per la misurazione dei rischi (modello interno parziale riconosciuto dall'Autorità di Vigilanza IVASS).
- Responsabilità sugli uffici di Misurazione (3 risorse) e Validazione (3 risorse).
- Gestione diretta della relazione tra la compagnia e le Autorità di Vigilanza, nazionale ed europea, per i temi di competenza.

Marzo 2019
Aprile 2017

Responsabile dell'ufficio di Misurazione e Controllo, SACE BT, Roma

Responsabilità delle attività di sviluppo e gestione del modello interno di SACE BT, finalizzato alla misurazione dei rischi tecnici assicurativi e di mercato.

- Gestione diretta del processo di approvazione del modello interno (concluso positivamente ad Aprile 2018) con l'Autorità di Vigilanza IVASS. Partecipazione allo sviluppo della piattaforma IT su cui è implementato il modello.
- 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).

Marzo 2017
Aprile 2009

Risk Analyst presso la funzione di Risk Management di SACE BT, SACE, Roma

Misurazione dei rischi della compagnia; supporto al processo di adeguamento per l'entrata in vigore del framework normativo **Solvency II**; supporto alle attività del gruppo SACE in tema di *modeling* e misurazione dei rischi.

- Progettazione ed utilizzo del modello interno per la misurazione dei rischi tecnici di SACE BT.
- Sviluppo di modelli per il pricing di prodotti assicurativi e per la valutazione del merito creditizio.
- Sviluppo e implementazione di un modello di forecast delle probabilità di insolvenza.
- Sviluppo dei modelli di pricing *ad hoc* per prodotti assicurativi di SACE.

Dicembre 2008 Marzo 2008	Quantitative Analyst (stageur), MPS CAPITAL SERVICES, GRUPPO MONTE PASCHI DI SIENA, Siena Sviluppo ed implementazione 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, CDO ² , ABS e cartolarizzazioni). Supporto ai trader della banca.
Settembre 2007 Giugno 2006	Tirocinante, LENS - European Laboratory of non-linear spectroscopy, Firenze Modellazione di un sistema quantistico disordinato, con tecniche analitiche e numeriche. Sviluppo di metodologie originali di analisi dati, specifiche per il problema affrontato, e implementazione del software necessario.

FORMAZIONE

Maggio 2022 Novembre 2018	Ph.D. in Scienze Attuariali	Scuola di Scienze Statistiche Università "La Sapienza" di Roma	Valutazione finale: <i>Ottime</i>
Novembre 2015 Novembre 2014	Executive Master in Finanza e Mercati EMAFIM	Luiss Business School, Roma	Media esami: <i>30/30</i>
Marzo 2008 Ottobre 2007	Corso di Alta Formazione in Finanza Matematica	Università degli Studi di Bologna	Media esami: <i>29/30</i>
Settembre 2007 Settembre 2005	M.Sc. in Fisica Teorica	Università degli Studi di Firenze	Valutazione finale: <i>110/110</i>
Settembre 2005 Settembre 2002	B.Sc. in Scienze Fisiche	Università degli Studi di Firenze	Valutazione finale: <i>109/110</i>
Luglio 2002 Settembre 1997	Diploma di Istruzione Classica	Liceo ginnasio "Dante Alighieri", Firenze	Valutazione finale: <i>100/100</i>

ALTRE ESPERIENZE FORMATIVE

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

DOCENZE

Marzo 2024	“Default Probabilities: inference and modeling”	C.A.F. IN FINANZA MATEMATICA UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI BOLOGNA	12 ore
Dicembre 2022	“Probability and pseudo-probability inference in Credit Risk”	DOTTORATO IN SCIENZE ATTUARIALI UNIVERSITÀ DEGLI STUDI <i>La Sapienza</i> DI ROMA	12 ore
Aprile 2022	“Estimating real-world default probabilities”	C.A.F. IN FINANZA MATEMATICA UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI BOLOGNA	10 ore
Aprile 2021	“Real-world probabilities of absorbing events : inference problems under information asymmetry”	C.A.F. IN FINANZA MATEMATICA UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI BOLOGNA	4 ore
Marzo 2021	“L’Enterprise Risk Management nelle Imprese di Assicurazione”	C.D.L. INTERMEDIARI, FINANZA INTERNAZIONALE E RISK MANAGEMENT UNIVERSITÀ DEGLI STUDI <i>La Sapienza</i> DI ROMA	2 ore
Giugno 2020	“Improved precision in calibrating the CreditRisk ⁺ model : a small data problem”	C.A.F. IN FINANZA MATEMATICA UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI BOLOGNA	4 ore
2020-2021	“Elementi di matematica per l’assicurazione del credito”	PROGRAMMA “MASTERING YOUR RISKS” GRUPPO SACE - FORMAZIONE INTERNA	6 ore/sessione
Febbraio 2016	“Laboratorio di rischio di credito”	C.A.F. IN FINANZA MATEMATICA UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI BOLOGNA	8 ore
Giugno 2015	“Introduction to risk management and pricing for a credit insurance company”	SACE GLOBAL SOLUTIONS PER PARTNERSHIP FUND, TBILISI, GEORGIA	20 ore
Febbraio 2015	“Calibrazione del rischio di credito con e senza un mercato”	C.A.F. IN FINANZA MATEMATICA UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI BOLOGNA	2 ore
2014	“The internal model : requirements and methodologies”	FORMAZIONE OFFERTA DA SACE 3 SESSIONI PER DHAMAN, ICIEC, EXIMBANK	4 ore/sessione

CONVEGNI

Luglio 2022	“A mixed ABM for NDC pension schemes in presence of demographic and economic uncertainty”, EURO 2022, primo autore; non relatore	
Aalto University, Helsinki (Finland)	Presentazione di una nuova tecnica di stabilizzazione di un sistema pensionistico di tipo NDC.	
Settembre 2020	“Improved precision in calibrating CreditRisk ⁺ model for Credit Insurance applications”, EMAF 2020, primo autore; relatore	
Université de Genève & Università Ca' Foscari di Venezia	Presentazione di una nuova tecnica di calibrazione del modello CreditRisk ⁺ .	

PUBBLICAZIONI

1. Giacomelli, J. **The Rating Scale Paradox: An Application to the Solvency 2 Framework**. *Standards* **2023**, 3(4), 356-372;
DOI : 10.3390/standards3040025
2. Giacomelli, J. **The Rating Scale Paradox: Semantics Instability versus Information Loss**. *Standards* **2022**, 2(3), 352-365;
DOI : 10.3390/standards2030024
3. Giacomelli, J. **Claim probability in Credit and Suretyship insurance**. Tesi di dottorato – settore SECS-S/06. Dipartimento di Scienze Statistiche, Università “La Sapienza” di Roma (2022).
Open Access : iris.uniroma1.it/handle/11573/1637888
4. Giacomelli, J. **One-Dimensional Matter Waves as a Multi-State Bit**. *AppliedMath* **2022**, 2(1), 143-158
DOI : 10.3390/appliedmath2010008
5. Giacomelli, J. **Parametric estimation of latent default frequency in credit insurance**. *Journal of The Operational Research Society* **2022**.
DOI : 10.1080/01605682.2022.2039567
6. Giacomelli, J.; Passalacqua, L. **Improved precision in calibrating CreditRisk⁺ model for Credit Insurance applications**. In : Corazza M., Gilli M., Perna C., Pizzi C., Sibillo M. (eds) *Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance - eMAF 2020*, Springer, Cham., first edition (2021).
DOI : 10.1007/978-3-030-78965-7_35.
7. Giacomelli, J.; Passalacqua, L. **Unsustainability Risk of Bid Bonds in Public Tenders**. *Mathematics* **2021**, 9(19), 2385;
DOI : 10.3390/math9192385.
8. Giacomelli, J.; Passalacqua, L. **Calibrating the CreditRisk⁺ Model at Different Time Scales and in Presence of Temporal Autocorrelation**. *Mathematics* **2021**, 9(14), 1679;
DOI : 10.3390/math9141679.
9. Giacomelli, J.; Passalacqua, L. **Calibrating the dependence structure of the CreditRisk⁺ model at different time scales**. Technical Report 3-2018, Università “La Sapienza” di Roma, Dipartimento di Statistica.
10. Giacomelli, J. **Localization properties of one-dimensional speckle potentials in a box**. *Physica A : Statistical Mechanics and its Applications* **2014**, 404, 158-170;
DOI : 10.1016/j.physa.2014.02.064.
11. Falco, G.M.; Fedorenko, A.; Giacomelli, J.; Modugno, M. **Density of states in an optical speckle potential**. *Physical Review A* **2010**, 82, 053405;
DOI : 10.1103/PhysRevA.82.053405.

COMPETENZE

Lingue	Italiano (<i>madrelingua</i>), Inglese (<i>capacità avanzata di espressione orale e scritta</i>)
Linguaggi di calcolo	MatLab, R, Mathematica, Maple
Basi dati	Oracle Database, SQL Server
Linguaggi di programmazione	C, C++, Fortran, VBA
Sistemi operativi	Windows, Android
Pacchetti	Suite Office (Word, Excel, PowerPoint, Outlook, Access), \LaTeX

... ALTRO

AFFILIAZIONI : membro della SIF - Società Italiana di Fisica
membro della FIDE - Fédération Internationale des Échecs (*Arena Candidate Master*)
PATENTI : A, B