

ALL. B

Decreto Rettore Università di Roma "La Sapienza" D.R. n. 555/2023 del 09.03.2023

**Valeria D'Amato**  
**Curriculum Vitae**  
**Ai Fini della Pubblicazione**

Salerno  
24.04.2023

**Parte I – Informazioni Generali**

Nome	Valeria D'Amato
------	-----------------

**Parte II – Formazione e posizioni accademiche**

Tipo	Anno	Istituzione	Note
Laurea	2003	Università degli Studi di Salerno	Laurea in Economia, tesi in Matematica finanziaria
Dottorato	2005-2008	Università degli Studi di Napoli, Federico II	titolo di Dottore di Ricerca in Matematica per l'Analisi Economica e la Finanza (ciclo XX)
Borsista post-dottorato	2008	Università degli Studi di Salerno, Ex Cass Business School Londra (UK)	Borsa di perfezionamento all'estero post-dottorato nell'area disciplinare Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Finanziarie ed Attuariali. La sottoscritta ha fruito della predetta borsa presso la Cass Business School City University di Londra, sotto la supervisione diretta del professor Steven Haberman
Ricercatore SECS-S/06	2008-2011	Università degli Studi di Salerno	Ricercatore a tempo indeterminato NON confermato in Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze attuariali e Finanziarie presso la Facoltà di Economia
Ricercatore SECS-S/06	2011-2015	Università degli Studi di Salerno	Ricercatore a tempo indeterminato confermato in Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze attuariali e Finanziarie presso la Facoltà di Economia
Associato SECS-	Dal	Università degli Studi di	Associato in ruolo presso in

S/06	2015	Salerno	Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze attuariali e Finanziarie presso la Facoltà di Economia
------	------	---------	--

### Parte III – Principali Nomine ed Incarichi

#### III A – Nomine ed incarichi accademici

Inizio	Fine	Istituzione	Posizione
Dal 2021	oggi	“Althea” - Un’istituzione Mediterranea: La Scuola Medica Salernitana presso Università degli Studi di Salerno	Vice Direttore Centro di Ricerca Interdipartimentale
Dal 2020	oggi	Cattedra UNESCO “Piante per la salute nella Tradizione del Mediterraneo”, presso Università degli Studi di Salerno	Membro Gruppo di Ricerca
Dal 2018	oggi	Abilitazione Scientifica Nazionale-MUR	Abilitazione alle funzioni di Professore Ordinario nel settore concorsuale 13/ D4– Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze attuariali e Finanziarie (SECS-06)
2017	2019	Bayes Business School, ex Cass Business School, City University, Londra UK	Honorary Senior Visiting Fellow, Upgrade Nomina Membro dello Staff
2019	2023	“Scuola di Scienze Statistiche”, Curriculum Scienze Attuariali, Università Roma Sapienza	Membro Collegio di Dottorato
2018	2020	“Centro Linguistico di Ateneo”, Università degli Studi di Salerno	Membro Comitato Tecnico Scientifico
2017	2017	Università degli Studi di Salerno	Referente “Conoscere la Borsa”, concorso di simulazione borsistica europea
Dal 2016	2023	Università degli Studi di Salerno	Chair e Fondatore di UNISActuarial SCHOOL, scuola internazionale di Matematica Attuariale
2016	2018	Università degli Studi di Salerno	Ideatrice di App (opera dell'ingegno) per applicazioni di matematica attuariale in ambito accademico e professionale (IOS Apple ed Android Systems), sotto il patrocinio del Consiglio Nazionale degli Attuari
2016	2016	Università degli Studi di Salerno	Docente corso di Dottorato di Metodologia della ricerca quantitativa in Management & Information Technology, Università degli Studi di

2014		Abilitazione Scientifica Nazionale-MUR	Salerno Abilitata alle funzioni di Professore Associato nel settore concorsuale 13/D4-Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze attuariali e Finanziarie
2014	2014	Università di Castilla-La Mancha de Albecete (Spagna)	Componente del Board per l'attribuzione del titolo di Dottore di Ricerca in ECONOMÍA FINANCIERA Y CONTABILIDAD, FACULTAD DE CIENCIAS ECONOMICAS Y EMPRESARIALES DE ALBACETE
2013	2013	Università degli Studi di Salerno	Membro Collegio Dottorato Università degli Studi di Salerno "Analisi Economica, Giuridica e Statistica delle Politiche, dei Mercati e delle Imprese"
2010	2017	Bayes Business School, ex Cass Business School, City University, Londra UK	Honorary Visiting Fellow
2012	2017	Università degli Studi di Salerno	Docente Master e Tutor Didattico Mefirm Economics, Finance and Risk Management, Master universitario di I livello

### III B – Altre nomine

Inizio	Fine	Istituzione	Posizione
Dal 2021	2023	Actuarial Association of Europe Brussels (Belgio)	Delegato Italiano AAE Working Group on Sustainability and Climate-related Risks
2021	2024	ANAC anticorruzione	Perito Camera Arbitrale
2020	2020	Comune di Salerno, Università degli Studi di Salerno	Membro Task Force per la candidatura della Scuola Medica Salernitana nella lista del patrimonio immateriale Unesco
Dal 2020	2023	Regione Campania, Università degli Studi di Salerno	Docente IFTS - Tecnico superiore per la gestione ecosostenibile delle filiere agroalimentari tipiche e della tradizione enogastronomica (III edizione) presso Regione Campania
2019	2019	Consiglio Nazionale degli Attuari ed Ordine Nazionale degli Attuari	Membro Commissione Solvency II
2017	2018	Rivista internazionale Investment Management and Financial Innovations	Membro Comitato Editoriale
2017	2018	Rivista internazionale Problems and	Membro Comitato Editoriale

**Parte IV – Elenco completo delle Pubblicazioni**

IV A – Pubblicazioni su riviste internazionali

2023	Vine Copula modelling dependence among cyber risks: a dangerous regulatory paradox, (con M. Carannante, P. Fersini, S. Forte, G. Melisi) Applied Stochastic Models in Business and Industry, accettato per la pubblicazione ad Aprile 2023
2023	“Firms’ profitability and ESG score: a machine learning approach”, (Con R. D’Ecclesia, S. Levantesi) Applied Stochastic Models in Business and Industry, accettato per la pubblicazione a Marzo 2023
2023	“Effect of the Covid-19 frailty heterogeneity on the future evolution of mortality by stratified weighting” (con Carannante M., Haberman, S.), Journal of Demographic Economics, accettato per la pubblicazione a Dicembre 2022
2022	“The future evolution of the mortality acceleration due to the Covid-19: the Charlson Comorbidity Index in stochastic setting”, (con Carannante M., Iaccarino, G.), Frontiers in Cardiovascular Medicine - Hypertension 2022(9): 938086 <a href="https://doi.org/10.3389/fcvm.2022.938086">https://doi.org/10.3389/fcvm.2022.938086</a>
2022	“Covid-19 accelerated mortality shocks and the impact on life insurance: the Italian situation”, (con Carannante M., Haberman S.), Annals of Actuarial Science 2022: 1-20 <a href="https://doi.org/10.1017/S1748499522000094">https://doi.org/10.1017/S1748499522000094</a>
2022	“Disruption of Life Insurance Profitability in the Aftermath of the COVID-19 Pandemic”, (con M. Carannante, P. Fersini, S. Forte, G. Melisi), Risks 10(2), 40 <a href="https://doi.org/10.3390/risks10020040">https://doi.org/10.3390/risks10020040</a>
2022	“Deep learning in predicting cryptocurrency volatility”, (con S. Levantesi, G. Piscopo), Physica A: Statistical Mechanics and its Applications Volume 596, 127158 <a href="https://doi.org/10.1016/j.physa.2022.127158">https://doi.org/10.1016/j.physa.2022.127158</a>
2021	“ESG score prediction through Random Forest algorithm”, (con D’Ecclesia R. L., S. Levantesi), Computational Management Science <a href="https://doi.org/10.1007/s10287-021-00419-3">https://doi.org/10.1007/s10287-021-00419-3</a>
2021	“Fundamental ratios as predictors of ESG scores: a machine learning approach (con D’Ecclesia R. L., S. Levantesi), Decisions in Economics and Finance <a href="https://doi.org/10.1007/s10203-021-00364-5">https://doi.org/10.1007/s10203-021-00364-5</a>
2020	“De-risking long-term care insurance”, (con S. Levantesi, M. Menziatti), Soft Computing, 1-15.
2019	“Pension Schemes versus Real Estate”, (con Di Lorenzo E., Haberman S., Tizzano R., Sibillo M.), Annals of Operations Research, 1-13 -ISSN:1572-9338.
2018	“De-risking strategy: longevity spread buy-in”, (con Di Lorenzo E., Haberman S., Sagoo P., Sibillo M.), Insurance: Mathematics and Economics, Vol, 79, March 2018, 124-136
2018	“An option pricing approach for measuring Solvency Capital Requirements in Insurance Industry” (con Coppola M., Levantesi S.) Physica A: Statistical Mechanics and its Applications, Elsevier, vol. 509(C), pages 717-728.
2018	“Dread Disease and Cause-Specific Mortality: Exploring New Forms of Insured Loans”, Risks, Vol. 6. Pag.1-21 ISSN:2227-9091
2017	“The dependency premium based on a Multifactor Model for Dependent mortality data”, (con Haberman S., Piscopo G.), Communications in Statistics – Theory and Methods,

<https://doi.org/10.1080/03610926.2017.1366523>

2017	“A longevity basis risk analysis in a Joint FDM framework”, (con M. Coppola, S. Levantesi, M. Menziatti, M. Russolillo), Journal of Risk Finance, vol. 18, issue 1, 55
2016	“Multiple Mortality Modeling in Poisson Lee Carter framework”, (con Haberman S., Piscopo G., Russolillo M., L.Trapani), Communications in Statistics – Theory and Methods, vol. 45, n.6, 1723-1732
2016	“Counterparty risk evaluation in power derivatives”, (con L. De Martino), Journal of Applied Quantitative Methods, vol. 11, n. 1,45-56, ISSN 1842-4562
2014	“Decision Making in Pension Policies: Annuitisation Risk Measures”, American Journal of Mathematics and Mathematical Sciences, Vol. 3 n. 2, ISSN: 2278-0874
2014	“Basis risk in solvency capital requirements for longevity risk” (con M. Coppola), Investment Management and Financial Innovations, vol. 11, Issue 3, 53-57 ISSN:1812-9358
2014	“Detecting longevity common trends by a multiple population approach” (con Haberman S., Piscopo G., Russolillo M., L.Trapani) North American Actuarial Journal Vol. 18, n. 1, Pag. 139-149
2014	“Computational Framework for Longevity Risk Management” (con Haberman S., Piscopo G., Russolillo M.) Computational Management Science, Volume 11, Issue 1 (2014), Pag. 111-137
2014	“Further Results about Calibration of Longevity Risk for the Insurance Business” (con M. Coppola), Applied Mathematics – Special Issue on Stochastic Processes, vol.5 No.4, March 2014, <a href="https://doi.org/10.4236/am.2014.54061">https://doi.org/10.4236/am.2014.54061</a>
2013	“Profit participation annuities: a business profitability analysis within a demographic risk sensitive approach” (con E. Di Lorenzo, A. Orlando, M. Russolillo, M. Sibillo) Investment Management and Financial Innovations, vol. 10, Pag.155-165 ISSN:1812-9358.
2012	“Modelling dependent data for longevity projections” (con G. Piscopo, M. Russolillo, S. Haberman) Insurance: Mathematics and Economics - IME, vol. 51, Pag. 694-701, ISSN: 0167-6687
2012	“The Mortality Pricing of the Q-forward contracts” (with G. Piscopo, M. Russolillo) International Review of Applied Financial Issues and Economics IRAFIE, vol 4(3) , ISSN:9210 - 1737
2012	“The Stratified Sampling Bootstrap for Measuring the Uncertainty in Mortality Forecasts” (con M. Russolillo, S. Haberman) Methodology and Computing in Applied Probability, Volume 14, Issue 1, Pag. 135-148, ISSN: 1387-5841 [Peer Reviewed] <a href="https://doi.org/10.1007/s11009-011-9225-z">https://doi.org/10.1007/s11009-011-9225-z</a>
2012	“Backtesting the Solvency Capital Requirement for Longevity risk” (con M. Coppola), Journal of Risk Finance, vol. 13, issue 4, pag. 19-28, Emerald, ISSN: 1526-5943,
2011	“The mortality of the Italian population: Smoothing techniques on the Lee Carter Model” (con G. Piscopo, M. Russolillo) The Annals of Applied Statistics, Vol. 5, No. 2A, 705–724 <a href="https://doi.org/10.1214/10-AOAS394">https://doi.org/10.1214/10-AOAS394</a> ;ISSN1932-6157
2011	“The Poisson log-bilinear Lee Carter model: Applications of efficient bootstrap methods to annuity analyses” (con Di Lorenzo E., Haberman S., Russolillo M., Sibillo M.) North American Actuarial Journal Vol.15, issue 2, 315-333, ISSN 1092-0277 <a href="http://www.soa.org/library/journals/north-american-actuarial-journal/2011/no-2/naaj-2011-vol15-no2.aspx">http://www.soa.org/library/journals/north-american-actuarial-journal/2011/no-2/naaj-2011-vol15-no2.aspx</a>
2011	“Population Heterogeneity in Defined Contribution Pension Schemes” (con G. Piscopo, M. Russolillo) Insurance Markets and Companies: Analyses and Actuarial Computations,

	vol 2, issue 3 ISSN 2078-2454 Pag. 56-64
2009	"Fair value and demographic aspects of the insured loan", (con Coppola M., Sibillo M.) Banks and Bank System, vol. 1 – ISSN 1816-7403 (print), ISSN 1991-7074 (online), Pag. 19-29
2008	"Life Office Management perspectives by actuarial risk indexes", (con Coppola M., Di Lorenzo E., Sibillo M.), Investment Management and Financial Innovations, International Research Journal, Volume 5, Issue 2, 2008, pp. 73-78, ISSN 1810-4967 (Print), ISSN 1812-9358 (On-line), ISSN 1813 – 4998 (CD-ROM)),

#### IV B – Proceedings di Conferenze Internazionali (Peer Reviewed)

2021	"Socially Sustainable proposal for the Securitization of Pandemic Risk" (con E. Di Lorenzo, G.Piscopo, M.Sibillo) Presented at ASMDA2021
2016	"The impact of the discrepancies in the yield curve on actuarial forecasting", (con Diaz, A.; Di Lorenzo, E.; Navarro, E., Sibillo M.), In: Proceedings of the XVI Iberian Italian Conference on Financial and Actuarial Mathematics Marilena Sibillo Pag.49-55 ISBN:9788861970601
2014	"A New Modelling Approach in Mortgage Life Insurance" (con V. Passannante, M. Sibillo), XV Iberian-Italian Congress of Financial and Actuarial Mathematics - Abstract in Atti di Convegno
2014	"Longevity Index Methodology: a critic discussion on Spanish case. (con Pilar Requena), XV Iberian-Italian Congress of Financial and Actuarial Mathematics, Siviglia (Spagna) - Abstract in Atti di Convegno
2014	"The prediction of mortality by causes of death in Critical Illness", (con Passannante V., Sibillo M.), Mathematical Methods in Engineering and Economics – Proceedings of the 2014 International Conference on Applied Mathematics and Computational Methods in Engineering II (AMCME '14) and the 2014 International Conference on Economics and Business Administration II (EBA '14)- Edited by: H.M. Srivastava, Martin Bohner, Ivan G. Avramidi, Martin Schechter, Morris Adelman- ISBN 978 1 61804 230 9
2013	"Multiple Population Projections by Lee Carter Models" (con Haberman S., Piscopo G., Russolillo M., Trapani L.), Applied Stochastic Models and Data Analysis – ASMDA 2013, Book of Abstract – ISBN 978 618 80698 24
2013	"The SCR Adequacy according to the Longevity Shock Volatility" (con Coppola M.), Applied Stochastic Models and Data Analysis – ASMDA 2013, Book of Abstract – ISBN 978 618 80698 24
2013	"De-risking Strategy: Modeling Buy-in", (con Di Lorenzo E., Sibillo M.), ERCIM Conference London – Book of Abstract
2013	"Longevity risk hedging and basis risk", (con Coppola M., Levantesi S., Menziatti M., Russolillo M.), 17th International Congress on Insurance Mathematics and Economics – IME, Abstract in Atti di Convegno
2012	"Measuring and Hedging the basis risk by Functional Data Models" (con M. Coppola, Levantesi S., Menziatti M., Russolillo M.), MAF 2012, Venezia, Abstract in Atti di Convegno
2012	"Modelling dependent data for longevity projections" (con Haberman S., Piscopo G., Russolillo M.), Seventh International Longevity Risk and Capital Market Solutions Conference, Francoforte 2011
2012	"Profit participation annuities: a business profitability analysis within a demographic risk sensitive approach", (con Di Lorenzo E., Orlando A., Russolillo M., Sibillo M.) Seventh International Longevity Risk and Capital Market Solutions Conference, Francoforte 2011

2012	“Simulation Framework in fertility projections” (con Piscopo G., Russolillo M.), WIRN 11, Italian Society for Neural Networks, Vietri sul Mare, Salerno- Italy
2011	“Backtesting the Solvency Capital Requirement for Longevity risk” (con M. Coppola), 12nd Iberian Italian Congress of Financial and Actuarial Mathematics, Lisbona 2011, Abstract in Atti di Convegno
2011	“A framework for pricing a mortality derivative: The q-forward contract” (con G. Piscopo, M. Russolillo) Actuarial and Financial Mathematics Conference, Interplay between Finance and Insurance, ISBN 978 90 6569 087 6, pag.81-86, Bruxelles M. Vanmaele, G. Deelstra, A. De Schepper, J. Dhaene, S. Vanduffel & D. Vyncke (Eds.)
2011	“Methods for improving mortality projections” (con S. Haberman, G. Piscopo, M. Russolillo) Applied Stochastic Models and Data Analysis, ISBN 97888467-3045-9, pag.307-314
2010	“The conjoint effects of stochastic risks on insurance portfolio internal models”, (con Di Lorenzo E., Russolillo M., Sibillo M.) 3rd International Conference of the ERCIM on COMPUTING & STATISTICS (ERCIM’10), London – Dicembre 2010, Abstract in Atti di Convegno
2010	“Stratified Sampling scheme of death causes for forecasting the survival trend”, (con Russolillo M.), 3rd International Conference of the ERCIM on COMPUTING & STATISTICS (ERCIM’10), London – December 2010, Abstract in Atti di Convegno
2010	“Integrated Variance Reduction Techniques in the Lee Carter Model”, (con Piscopo G., Russolillo M.), Insurance Mathematics and Economics IME10 Toronto 2010, Abstract in Atti di Convegno
2009	“Smoothing the Lee Carter Model: an empirical analysis on the Italian data” (con Piscopo G., Russolillo M.) EURISBIS’09- European Regional Meeting of the International Society for Business and Industrial Statistics Book of Abstracts. CAGLIARI, 30 Maggio- 3 Giugno, 2009 F.Mola, C. Conversano, V. Esposito Vinzi, N. Fisher, p. 230-231. ISBN 978-88-89744-13-0
2008	“Surplus analysis in life office management: the role of longevity risk”, (con Di Lorenzo E., Russolillo M., Sibillo M.) invited talk: International Workshop on Applied Probability – IWAP 2008, Université de Technologie de Compiègne (France), Abstract in Atti di Convegno
2006	“Fair value and demographic aspects of the insured loans”, Insurance: Mathematics and Economics, abstract, (con Coppola M., Sibillo M.), vol. 39, issue 3 – 425-426, December IDS no. 109NR, ISSN 0167-6687 ISI code 3930099 IB10
2006	The fair value of the insured loan portfolio scheduled at variable interest rates, (con Coppola M., Sibillo M.) Metodi matematici e statistici per le assicurazioni e la finanza - Maf 2006 – University of Salerno, Abstract in Atti di Convegno

#### IV C – Capitoli di libro

2022	“Artificial Intelligence Algorithms in Precision Medicine: a New Approach in Clinical Decision-Making”, (con P. Campiglia, C. Bassano), In The Human Side of Service Engineering, C. Leitner, W. Ganz, C. Bassano, D. Satterfield (Eds). AHFE International <a href="http://doi.org/10.54941/ahfe1002532">http://doi.org/10.54941/ahfe1002532</a>
2022	“Innovative Parametric Weather Insurance on Satellite Data in Agribusiness”, (con M. Carannante, P. Fersini, S. Forte), In Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance, M. Corazza, C. Perna, C. Pizzi, M. Sibillo (Eds). Springer, Cham.

	pp. 127-133 <a href="https://doi.org/10.1007/978-3-030-99638-3_21">https://doi.org/10.1007/978-3-030-99638-3_21</a>
2021	“Gli effetti della pandemia da Covid-19 sulla popolazione italiana e sul pricing dei prodotti assicurativi di puro rischio”. (con M. Carannante, P. Fersini, S. Forte) In D’Ambrosio I., Palumbo P. (Eds.), <i>Diritto Economia e societ`a dopo la pandemia</i> pp. 19-29. Napoli: Edizione Scientifica. ISBN 1259761584
2018	“Life Annuity portfolios: risk-adjusted valuations and suggestions on the product attractiveness” (con Di Lorenzo E., Orlando A., Sibillo) In Skiadas, C. C., Skiadas C. <i>Population Aging, Mortality and Data Analysis</i> Pag.315-323 Cham Springer. ISBN:978-3-319-76001-5; 978-3-319-76002-5 ISSN:1877-2560.
2018	“Money Purchase Pensions: Contract proposals and risk analysis” (con Di Lorenzo E., Sibillo M., Tizzano R.) In M: Corazza, M. Durban, A. Granet, C. Perba, M. Sibillo <i>Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance</i> , Pag.285-288 Cham Springer.
2018	“What if two different interest rates datasets allow for describing the same financial product? “ (con Diaz, A.; Di Lorenzo, E.; Navarro, E., Sibillo M.) In M. Corazza, M. Durban, A. Gran`e, C. Perna, M. Sibillo <i>Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance</i> , Pag.289-294 Cham Springer. ISBN:978-3-319-89824-7
2018	“New Challenges in Pension Industry: Proposals of Personal Pension Products.” (con Di Lorenzo E., Sibillo M.) In A. Esposito, M. Faundez-Zanuy, F. C. Morabito, E. Pasero, <i>Neural Advances in Processing Nonlinear Dynamic Signals</i> , Pag.253-263 Cham Springer
2017	“Profit-Sharing and Personal Pension Products: a proposal” (con Di Lorenzo E., Sibillo M., Tizzano R.) on <i>Book Pensions: Global Issues, Perspectives and Challenges</i> , Pag.97-111 New York Nova Science Publishers, Inc.. ISBN:978 1 53612 462 0
2014	“Adaptive Neuro-Fuzzy Inference Systems vs Stochastic Models for mortality data” (con Piscopo G., Russolillo M.) <i>Recent Advances of Neural Network Models and Applications – Springer</i> , Eds. Bassis, S.; Esposito A.; Morabito F.C. Series: Smart Innovation, Systems and Technologies, Vol. 26 ISBN 978-3-319-04128-5
2014	“How Longevity Volatility influences the Insurance Solvency Capital Requirements” (con M. Coppola) on <i>Book Theoretical and Applied Issues in Statistics and Demography</i> (C H. Skiadas, Eds)
2014	“Alternative Assessments of the Longevity Trends” (con S. Haberman, G. Piscopo, M. Russolillo) <i>Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance</i> , Perna C. & Sibillo M. Eds, Springer
2014	“The solvency capital requirement management for an insurance company” (con M. Coppola) <i>Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance</i> , Perna C. & Sibillo M. Eds, Springer
2013	“Forecasting Net Migration by Functional Demographic Model, (con M. Russolillo, G. Piscopo) <a href="https://doi.org/10.1007/978-3-642-35467-0-21">https://doi.org/10.1007/978-3-642-35467-0-21</a> . pp.201-208. In <i>Neural Nets and Surroundings</i> , Series: Smart Innovation, Systems and Technologies - ISBN:9783642354663. In SMART INNOVATION, SYSTEMS AND TECHNOLOGIES - ISSN:2190-3018 vol. 19
2013	“Simulation Framework in fertility projections” (con Piscopo G., Russolillo M.), <i>Neural Nets and Surroundings</i> , Apolloni B., Bassis S., Esposito A., Morabito C.F.. Springer, pag. 209-216
2012	“Internal risk control by solvency measures” (con E. Di Lorenzo, M. Russolillo, M. Sibillo) <i>Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance</i> , ISBN 979-88-470-2341-3, pag.149-156, Perna C. & Sibillo M. Eds, Springer Verlag
2012	“Measuring mortality heterogeneity in pension annuities” (con G. Piscopo, M.

	Russolillo) Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance, ISBN 978-88-470-2341-3, pag.157-164, Perna C. & Sibillo M. Eds, Springer Verlag
2011	“Iterative Algorithms for detecting mortality trends in the family of Lee Carter Models” (con Piscopo G, Russolillo M). Frontiers in Artificial Intelligence and Applications, Vol. 226, pp. 69-76; Neural Nets WIRN10, IOS Press- KBIES book series. ISBN 978-1-60750-691-1
2010	“Risk-sensitive insurance management vs the financial crisis” (con Coccozza R., D’Amato V., Di Lorenzo E., Russolillo M., Sibillo M.) World financial crisis: causes, consequences, ways of overcoming, published by the Ukrainian Academy of Banking of the National Bank of Ukraine and Publishing Company Business Perspectives Kozmenko and Vasileva. ISBN 978- 966-2965-07-0, pag. 83-95
2010	“Lee Carter error matrix simulation: heteroschedasticity impact on actuarial valuations” (con Russolillo M.) Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance, ISBN 978-88-470-1480-0, Corazza M. & Pizzi C. Eds, Springer Verlag
2009	“Efficient Bootstrap applied to the Poisson Log-Bilinear Lee Carter Model” (con Haberman S., Russolillo M.) Applied Stochastic Models and Data Analysis – ASMDA 2009 Selected Papers, ISBN 978 -9955-28-463-5 Edited by L. Sakalauskas, C. Skiadas, E.K. Zavadskas
2009	“The interplay between financial and demographic risks in a pension annuity system” (con Di Lorenzo E., Russolillo M., Sibillo M.) Applied Stochastic Models and Data Analysis – ASMDA 2009 Selected Papers, ISBN 978 -9955-28-463-5 Edited by L. Sakalauskas, C. Skiadas, E.K. Zavadskas
2009	“Some Remarks on parametric Monte Carlo Simulation applied to the Lee Carter model” (con Russolillo M.) New Frontiers in Insurance and Bank Risk Management, Mc Graw-Hill, ISBN 978-88-386-6061-0, Editors: C. Angela, S. Carrillo Menendez, M. Micocci, E. Navarro Arribas, R. Ottaviani, F. Pressacco
2009	“Intensive Computational Forecasting Approach to the Functional Demographic Lee Carter Model” (con Piscopo G., Russolillo M.). Frontiers in Artificial Intelligence and Applications, Vol. 204, pp. 177-186; Neural Nets WIRN09, IOS Press- KBIES book series. ISBN 978-1-60750-072-8
2009	“Safety loading in annuity pension fund dynamics”, (con Coppola M., Di Lorenzo E., Sibillo M.) in NEW DIRECTIONS IN NEURAL NETWORKS, B. Apolloni, S. Bassis, M. Marinaro Eds, Series: Frontiers in artificial intelligence and applications, vol.193, IOS Press – ISSN 0922-6389 – 165-175
2008	“Risk Measurement and Fair Valuation Assessment in life insurance field”, (con Coppola M., Di Lorenzo E., Sibillo M.) in New Economic Windows by Springer Eds Faggini M.; Lux, T. (Eds.) 2008, XIV, pp.149-156., Hardcover ISBN: 978-88-470-1082-6
2007	“Remarks on insured loan valuation”, (con Coppola M., Sibillo M.), in Mathematical and Statistical Methods for Insurance and Finance, Springer, Perna C. and Sibillo M. (eds) – Springer, ISBN 987 -88- 470- 0703-1, pp.91-98

#### IV D – Monografie

2010	“Il pricing delle obbligazioni strutturate reverse floater: profili critici ed analisi del rischio di modello”, (con Rubino L.), Quaderni del Dipartimento di Scienze Economiche e Statistiche, Università di Salerno, n.50, ISBN 9788861970458
2007	“Pricing di opzioni esotiche: rassegna teorica e strumenti informatici per il prezzamento”, Quaderni del Dipartimento di Scienze Economiche e Statistiche, Università di Salerno, n.3-189, ISBN 978-88-6197-014-4, ISSN: 1971-3029

## Parte V – Attività di ricerca all'estero

2016-2019	Nomina - Membro Staff Bayes Business School, ex Cass Business School, City University, Londra UK, Faculty of Actuarial Science and Insurance, Londra – UK, Upgraded Status: Honorary Senior Visiting Fellow
2010-2016	Nomina - Membro Staff Bayes Business School, ex Cass Business School, City University, Londra UK, Faculty of Actuarial Science and Insurance, Londra – UK, Status: Honorary Visiting Fellow
11/2015	Visiting Researcher Faculty of Actuarial Science and Insurance, ex Cass Business School, City University, Londra UK, Faculty of Actuarial Science and Insurance, Londra – UK - collaborazione prof. Steven Haberman, Deputy Dean
12/2013	Visiting Researcher Faculty of Actuarial Science and Insurance, ex Cass Business School, City University, Londra UK, Faculty of Actuarial Science and Insurance, Londra – UK - collaborazione prof. Steven Haberman, Deputy Dean
04/2012	Visiting Researcher Faculty of Actuarial Science and Insurance, ex Cass Business School, City University, Londra UK, Faculty of Actuarial Science and Insurance, Londra – UK - collaborazione prof. Steven Haberman, Deputy Dean
11/2011	Visiting Researcher Faculty of Actuarial Science and Insurance, ex Cass Business School, City University, Londra UK, Faculty of Actuarial Science and Insurance, Londra – UK - collaborazione prof. Steven Haberman, Deputy Dean
07/2011	Visiting Researcher Faculty of Actuarial Science and Insurance, ex Cass Business School, City University, Londra UK, Faculty of Actuarial Science and Insurance, Londra – UK - collaborazione prof. Steven Haberman, Deputy Dean
03/2011	Visiting Researcher Faculty of Actuarial Science and Insurance, ex Cass Business School, City University, Londra UK, Faculty of Actuarial Science and Insurance, Londra – UK - collaborazione prof. Steven Haberman, Deputy Dean
12/2010	Visiting Researcher Faculty of Actuarial Science and Insurance, ex Cass Business School, City University, Londra UK, Faculty of Actuarial Science and Insurance, Londra – UK - collaborazione prof. Steven Haberman, Deputy Dean
11/2010	Visiting Researcher Faculty of Actuarial Science and Insurance, ex Cass Business School, City University, Londra UK, Faculty of Actuarial Science and Insurance, Londra – UK - collaborazione prof. Steven Haberman, Deputy Dean
09/2010	Visiting Researcher Faculty of Actuarial Science and Insurance, ex Cass Business School, City University, Londra UK, Faculty of Actuarial Science and Insurance, Londra – UK - collaborazione prof. Steven Haberman, Deputy Dean
03/2010	Visiting Researcher Faculty of Actuarial Science and Insurance, ex Cass Business School, City University, Londra UK, Faculty of Actuarial Science and Insurance, Londra – UK - collaborazione prof. Steven Haberman, Deputy Dean
09/2009	Visiting Researcher Faculty of Actuarial Science and Insurance, ex Cass Business School, City University, Londra UK, Faculty of Actuarial Science and Insurance, Londra – UK - collaborazione prof. Steven Haberman, Deputy Dean
03/2009	Visiting Researcher Faculty of Actuarial Science and Insurance, ex Cass Business School, City University, Londra UK, Faculty of Actuarial Science and Insurance, Londra – UK - collaborazione prof. Steven Haberman, Deputy Dean
03-09/2008	Visiting Researcher Faculty of Actuarial Science and Insurance, ex Cass Business School, City University, Londra UK, Faculty of Actuarial Science and Insurance, Londra – UK - collaborazione prof. Steven Haberman, Deputy Dean

## Parte VI – Progetti di Ricerca

2021	Responsabile scientifico progetto di ricerca finanziato da DMBI Consultants – Roma. Titolo: “Weather Risk Management by Satellite Data”
2021	Responsabile scientifico progetto di ricerca autorizzato da SIIA – Società Italiana Ipertensione Arteriosa e Lega contro Ipertensione Arteriosa. Titolo: “L’impatto del Covid-19 sulla mortalità italiana: il caso dell’accelerazione per comorbidità” - SIIA database – Società Italiana Ipertensione Arteriosa e Lega contro Ipertensione Arteriosa
2020	Membro progetto di ricerca EU (Euro 1.105.500,00) Titolo: “PROGEMA - PROCessi Green per l’Estrazione di principi attivi e la depurazione di MATrici di scarto e non”
2019	Membro progetto di ricerca e sviluppo Titolo: “Combattere la resistenza tumorale: piattaforma integrata multidisciplinare per un approccio tecnologico innovativo alle oncoterapie – CAMPANIA ONCOTERAPIE”, POR FESR CAMPANIA 2014-2020 – Manifestazione di interesse per la realizzazione di Technology platform nell’ambito della lotta alle patologie oncologiche – D.D. n. 355 del 05.06.2017
2017	Consulente per progetto Horizon 2020 (Euro 5 milioni) Titolo: “Circular Models leveraging investments in cultural heritage adaptive re-use”, Call su Innovative financing, business and governance models for adaptive re-use of cultural heritage” (SC5-22-2017), Tipo di azione: Research and Innovation Action Partnership: Academic, SME, Local Government
2017	Responsabile scientifico Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: “Different gradient of improvements in mortality: a demographic mix”” Università degli Studi di Salerno
2017	Membro Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: “Nuove sfide nell’industria pensionistica: proposte di prodotti pensionistici personali”. Responsabile Scientifico: prof.ssa Marilena Sibillo, Università degli Studi di Salerno
2017	Membro Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: “Retirement age and Life expectancy: How to Face Population Ageing”. Responsabile Scientifico: dott.ssa Maria Russolillo, Università degli Studi di Salerno
2017	Membro Progetto di ricerca dipartimentale Titolo: “Politiche di internazionalizzazione delle piccole e medie imprese nell’Unione Europea: un’analisi multidisciplinare”. Responsabile Scientifico: prof.ssa Cira Perna, Università degli Studi di Salerno
2016	Responsabile scientifico Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: “Pension de-risking investment strategies” Università degli Studi di Salerno
2016	Membro Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: “La complessità della gestione dei rischi in portafogli assicurativi vita”. Responsabile Scientifico: prof.ssa Marilena Sibillo, Università degli Studi di Salerno
2016	Membro Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: “Enterprise Risk Management and life insurance business”. Responsabile Scientifico: dott.ssa Maria Russolillo, Università degli Studi di Salerno
2016	Membro Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: “Giochi ad utilità non trasferibile (NTU) in partition function form: shapley value e core con esternalità”. Responsabile Scientifico: dott.ssa Giovanna Bimonte, Università degli Studi di Salerno
2016	Membro Progetto di ricerca dipartimentale Titolo: “Regole di bilancio europee e disegno delle politiche pubbliche: un’analisi multidisciplinare”. Responsabile Scientifico: prof.ssa Cira Perna, Università degli Studi di Salerno
2015	Responsabile scientifico Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: “Modeling Pricing Collateralized Longevity Derivatives” Università degli Studi di Salerno
2015	Membro Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: “Systematic risk drivers within a life annuity context”. Responsabile Scientifico: prof.ssa Marilena Sibillo, Università degli Studi di Salerno

	degli Studi di Salerno
2015	Membro Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: "Life expectancy and protection of high-risk populations". Responsabile Scientifico: dott.ssa Maria Russolillo, Università degli Studi di Salerno
2015	Membro Progetto di ricerca dipartimentale Titolo: "Regolamentazione e politiche pubbliche in presenza di vincoli di bilancio stringenti". Responsabile Scientifico: prof.ssa Cira Perna, Università degli Studi di Salerno
2014	Responsabile scientifico Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: "Modeling and Insurability of the emerging health risks related to the Ageing" Università degli Studi di Salerno
2014	Membro Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: "Strategie di de-risking per portafogli ramo vita". Responsabile Scientifico: prof.ssa Marilena Sibillo, Università degli Studi di Salerno
2014	Membro Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: "Procedure di proiezione della mortalità globale e per cause di morte specifiche". Responsabile Scientifico: dott.ssa Maria Russolillo, Università degli Studi di Salerno
2014	Membro Progetto di ricerca dipartimentale Titolo: "Regolamentazione e politiche pubbliche in presenza di vincoli di bilancio stringenti". Responsabile Scientifico: prof.ssa Cira Perna, Università degli Studi di Salerno
2013	Responsabile scientifico Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: "Trasferimento del rischio longevità al mercato dei capitali: pricing ed hedging di contratti longevity-linked" Università degli Studi di Salerno
2013	Membro Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: "Nuovi indicatori di redditività per prodotti assicurativi indicizzati". Responsabile Scientifico: prof.ssa Marilena Sibillo, Università degli Studi di Salerno
2013	Membro Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: "Simulazione ed analisi del fenomeno della sopravvivenza". Responsabile Scientifico: dott.ssa Maria Russolillo, Università degli Studi di Salerno
2013	Membro Progetto di ricerca dipartimentale Titolo: "Crisi economica e mercati finanziari". Responsabile Scientifico: prof.ssa Cira Perna, Università degli Studi di Salerno
2012	Responsabile scientifico Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: "Strumenti per il risk management delle aziende assicurative" Università degli Studi di Salerno
2012	Membro Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: "Nuove strutture di prodotti assicurativi indicizzati". Responsabile Scientifico: prof.ssa Marilena Sibillo, Università degli Studi di Salerno
2012	Membro Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: "Analisi integrata dei rischi e problemi di copertura in portafogli pensionistici". Responsabile Scientifico: dott.ssa Maria Russolillo, Università degli Studi di Salerno
2012	Membro Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: "Il Patto di Stabilità e Crescita alla luce della recente crisi". Responsabile Scientifico: dott.ssa Marisa Faggini, Università degli Studi di Salerno
2012	Membro Progetto di ricerca dipartimentale Titolo: "Analisi dell'impatto economico e profili giuridici della crisi finanziaria in Italia". Responsabile Scientifico: prof.ssa Cira Perna, Università degli Studi di Salerno
2011	Responsabile scientifico Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: "Misura dell'eterogeneità in portafogli assicurativi Ramo Vita" Università degli Studi di Salerno

2011	Membro Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: “Annualità vitalizie con partecipazioni agli utili. Analisi di redditività”. Responsabile Scientifico: prof.ssa Marilena Sibillo, Università degli Studi di Salerno
2011	Membro Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: “Annualità vitalizie con partecipazioni agli utili. Analisi di redditività”. Responsabile Scientifico: prof.ssa Marilena Sibillo, Università degli Studi di Salerno
2010	Responsabile scientifico Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: “Misure di efficienza nell’analisi stocastica della sopravvivenza” Università degli Studi di Salerno
2010	Membro Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: “Modelli interni di controllo per attività assicurative”. Responsabile Scientifico: prof.ssa Marilena Sibillo, Università degli Studi di Salerno
2010	Membro Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: “Procedure di riduzione della varianza nell’analisi attuariale”. Responsabile Scientifico: dott.ssa Maria Russolillo, Università degli Studi di Salerno
2010	Membro Progetto di ricerca dipartimentale Titolo: “Analisi delle interazioni tra imprese ed istituzioni nei processi innovativi”. Responsabile Scientifico: prof.ssa Cira Perna, Università degli Studi di Salerno
2010	Coordinatore Scientifico Progetto di Ricerca FIRB (non finanziato) Titolo: “Rischio longevità e sistemi pensionistici: strumenti e prospettive in una società che invecchia”. Valutazione Coordinatore Panel Scientifico Internazionale Miur: “The proposed research is of current interest and great relevance in actuarial and financial economics. The scientific qualification in the field of the coordinator is very good.”
2010	Membro Progetto di ricerca PRIN (cofin) 2008 Titolo: “Analisi delle interazioni tra imprese ed istituzioni nei processi innovativi”. Responsabile Scientifico: prof.ssa Cira Perna, Università degli Studi di Salerno. Coordinatore nazionale Coordinatore nazionale: prof. Ermanno Pitacco, Università degli Studi di Trieste
2009	Responsabile scientifico Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: “Rischi demografici sistematici e applicazioni in ambito attuariale” Università degli Studi di Salerno
2009	Membro Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: “Indicatori di performance aggiustati al rischio per portafogli di annualità pensionistiche”. Responsabile Scientifico: prof.ssa Marilena Sibillo, Università degli Studi di Salerno
2009	Membro Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: “Strategie simulative applicate ai modelli di proiezione della mortalità”. Responsabile Scientifico: dott.ssa Maria Russolillo, Università degli Studi di Salerno
2009	Membro Progetto di ricerca dipartimentale Titolo: “Metodi e modelli di analisi economico-statistica per la ricerca sull’economia sommersa”. Responsabile Scientifico: prof.ssa Pasquale Persico, Università degli Studi di Salerno
2008	Membro Progetto di ricerca di ateneo ex-60% Titolo: “Analisi stocastica del surplus in portafogli di rendite pensionistiche”. Responsabile Scientifico: prof.ssa Marilena Sibillo, Università degli Studi di Salerno

## Parte VII – Principali Convegni e Seminari

### VII- A Organizzazione e relazioni a convegni nazionali ed internazionali

20 Aprile	Talk, Policyholders’ subjective beliefs: approaching new drivers of insurance ESG
-----------	---

2023	reputational risk, at Sustainability and Climate-related Risks (SCRR) Working Group Meeting - European Actuarial Association, Bratislava (Slovacchia)
12 settembre 2022	Talk, Frailty Heterogeneity and Differentials in Mortality: A Focus on the Health Insurance Market, Longevity 17 Conference (da remoto)
28 luglio 2022: Talk	Talk, Artificial Intelligence Algorithms in Precision Medicine: a New Approach in Clinical Decision-Making, AHFE 2022 Conference, New York
7 giugno 2022	Talk, Stochastic modelling of the Covid-19 excess of deaths, 7th Stochastic Modeling Techniques and Data Analysis International Conference, Atene (da remoto)
20 novembre 2021	Invited Seminar, Climate Risk Management by using weather index-based insurance, Abelica Global (UK) (da remoto)
12 novembre 2021	Talk, Ricerca e Professione: la scienza nella conoscenza, spunti di riflessione, Congresso Nazionale degli Attuari, Roma (Italia)
11 novembre 2021	Talk, Prospettive didattiche delle discipline attuariali in un mondo che cambia, Congresso Nazionale degli Attuari, Roma (Italia)
1 Ottobre 2021	Talk, Mapping and translation of climate scenarios to insurance, Sustainability and Climate-Related Risks (SCRR) Working Group meeting, Zurigo (Svizzera)
13 agosto 2021	Talk, Projecting mortality in post-pandemic era, Sixteenth International Longevity Risk and Capital Markets Solutions Conference Longevity16 Copenhagen Business School Copenhagen (Danimarca)
18 giugno 2021	Talk, ESG score prediction through Random Forest algorithm, Commodity & Energy Markets Association, (CEMA 2020-2021), Universidad Carlos III, Madrid (Spagna)
2 giugno 2021	Talk, Insurance incentives to pursue social well-being, The 19th Conference of the Applied Stochastic Models and Data Analysis International Society ASMDA2021, Atene (Grecia)
17 dicembre 2021	Talk, Basis Risk in Weather Index-based Insurance, Seminario invitato presso Consiglio Nazionale Attuari (da remoto)
19 novembre 2020	Talk, Weather Risk Insurance, Seminario invitato presso Consiglio Nazionale Attuari (da remoto)
14 maggio 2020	Talk, The effect of Disruption in Insurance Industry: Cyber Risk Evaluation, ASTIN Virtual Colloquium
18 febbraio 2020	Talk, ESG score prediction through Random Forest algorithm, Madrid (Spagna)
23-24 maggio 2019	Partecipazione su invito, World Pension Forum, Brussels World Pension Council
2 giugno 2021	2 giugno 2021: Talk, Insurance incentives to pursue social well-being, The 19th Conference of the Applied Stochastic Models and Data Analysis International Society ASMDA2021, Atene (Grecia)

17 dicembre 2021	Talk, Basis Risk in Weather Index-based Insurance, Seminario invitato presso Consiglio Nazionale Attuari (da remoto)
19 novembre 2020	Talk, Weather Risk Insurance, Seminario invitato presso Consiglio Nazionale Attuari (da remoto)
14 maggio 2020	Talk, The effect of Disruption in Insurance Industry: Cyber Risk Evaluation, ASTIN Virtual Colloquium
18 febbraio 2020	Talk, ESG score prediction through Random Forest algorithm, Madrid (Spagna)
23-24 maggio 2019	Partecipazione su invito, World Pension Forum, Brussels World Pension Council
20 maggio 2019	Chair ed Organizzatore del Workshop, Fostering the interaction between academics and actuaries A joint meeting with the UNISActuarial School, Bologna
9 luglio 2018	Talk, Pension Schemes versus Real Estate, Euro 2018 Valencia (Spagna)
5 aprile 2018	Talk, "Money purchase" pensions: contract proposals and risk analysis, Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance, MAF 2018, Madrid (Spagna)
4 aprile 2018	Organizzatore di sessione, Survival Models and Longevity Projections, Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance, MAF 2018, Madrid (Spagna)
17 dicembre 2017	Talk, Modelling longevity trends and longevity risk, 10th International Conference of Ercim on CMS, Londra (UK)
26 ottobre 2017	Talk coautore Piscopo G, Managing cyber risk by new analytics (con D.Castagna, Piscopo G.), ITEMA2017, Budapest, (Ungheria)
14 giugno 2017	Talk, New challenges in pension industry: proposals of personal pension products, 27th Italian Workshop on Neural Networks, Vietri sul Mare (Italy)
15 dicembre 2013	Talk, De-risking Strategy: Modeling Buy-in, ERCIM Conference, University of London, London (UK)
19 settembre 2013	Presentazione poster, Mortality Panel Factor Series, (con Haberman S., Piscopo G., Russolillo M., Trapani L.), International Workshop Frontiers in Time Series Analysis with Applications to Economics and Finance, Universit`a degli Studi di Salerno
1 luglio 2013	Talk, Longevity risk hedging and basis risk, (con Coppola M., Levantesi S., Menzietti M., Russolillo M.), 17th International Congress on Insurance Mathematics and Economics – IME, Copenhagen (Danimarca)
28 giugno 2013	Talk, Multiple Population Projections by Lee Carter Models, (con Haberman S., Piscopo G., Russolillo M., Trapani L.), Applied Stochastic Models and Data Analysis – ASMDA 2013, Matar`o- Barcellona (Spagna)
28	Talk, The SCR Adequacy according to the Longevity Shock Volatility, (con Coppola

giugno 2013	M.), Applied Stochastic Models and Data Analysis – ASMDA 2013, Matar`o-Barcellona (Spagna)
25 giugno 2013	Talk, Empirical Scenario Forecasting for financial risk measurement in pension annuity systems, (con Di Lorenzo E., Russolillo M., Sibillo M.), XIV Iberian-Italian Congress of Financial and Actuarial Mathematics - IBIT, Madrid (Spagna)
1 febbraio 2013	Talk, Retirement Income Adequacy by a compulsory annuitisation: a flexible approach for valuation, PARTY 2013, Perspectives on Actuarial Risks in Talks of Young Researchers, Ascona (Svizzera)
8 settembre 2012	Talk, Detecting Longevity Common Trends by Multiple Population Approach, (con Haberman S., Piscopo G., Russolillo M., Trapani L.), Eight International Longevity Risk and Capital Market Solutions Conference, Waterloo, Ontario (CANADA)
30 agosto 2012	Talk, Critical illness diagnosis rates by causes in stratified sampling setting, (con Russolillo M.) Computational Statistics (COMPSTAT 2012), Limassol, Cipro
18 giugno 2012	Talk, Dependence problems for longevity projections, (con Haberman S., Piscopo G., Russolillo M.) 1st Conference of the International Society for NonParametric Statistics, Chalkidiki – Grecia
18 aprile 2012	Talk, Panel Sieve Bootstrap on Mortality Data, (con Haberman S., Piscopo G., Russolillo M.), Computational Management Science, Imperial College London
8 settembre 2011	Talk, Profit Participation Annuities: A Business Profitability Analysis within a Demographic Risk Sensitive Approach, (con Di Lorenzo E., Orlando A., Russolillo M., Sibillo M.), Seventh International Longevity Risk and Capital Market Solutions Conference, Frankfurt 2011
16 giugno 2011	Talk, Bootstrap for mortality projections on dependent data, (con Haberman S., Piscopo G., Russolillo M.), 15 IME Congress, Trieste
15 giugno 2011	Talk, Backtesting the solvency capital requirement for longevity risk, (con Coppola M.), 15th IME Congress, Trieste
11 dicembre 2010	Talk, The conjoint effects of stochastic risks on insurance portfolio internal models, (con Di Lorenzo E., Russolillo M., Sibillo M.) working paper presented at 3rd International Conference of the ERCIM on COMPUTING & STATISTICS (ERCIM'10), Senate House, University of London, UK
7 aprile 2010	Talk, Internal risk control by solvency measures, Conference Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance, (con Di Lorenzo E., Russolillo M., Sibillo M.) Maf 2010, Ravello
26 settembre 2009	Talk, The Poisson Log-Bilinear Lee Carter Model: Efficient Bootstrap in Life Annuity Actuarial Analysis, Conference: Longevity Five, Fifth International Longevity Risk and Capital Market Solutions, New York (USA), (con Di Lorenzo E., Haberman S., Russolillo M., Sibillo M.)
7 luglio 2009	Talk, Surplus analysis in life office management: the role of longevity risk, Conference: International Workshop on Applied Probability – IWAP 2008, Universit`e de Technologie de Compiègne (France), (con Di Lorenzo E., Russolillo M., Sibillo M.)
3 luglio 2009	Talk, The interplay between financial and demographic risks in a pension annuity system, Conference: XIII International Conference Applied Stochastic Models and Data Analysis ASMDA 2009, Vilnius (Lituania), (con Di Lorenzo E., Russolillo M., Sibillo M.)
2 luglio 2009	Talk, Efficient Bootstrap applied to the Poisson Log-Bilinear Lee Carter Model, Conference: XIII International Conference Applied Stochastic Models and Data

	Analysis ASMDA 2009, Vilnius (Lituania), (con Haberman S., Russolillo M.)
23 giugno 2008	Talk, Some Remarks on parametric Monte Carlo Simulation applied to the Lee Carter model, X Italian Spanish Congress of Financial and Actuarial Mathematics, Cagliari (Italia)
23 febbraio 2008	Talk, Mortality Forecasting: assessing the robustness of a bilinear mortality model, PRIN 2006, Università di Napoli Federico II (Italia)
20 aprile 2007	Talk, Life Office Management perspectives by actuarial risk indexes, Conference on Computational Management Science Geneva (Switzerland) (con Coppola M., Di Lorenzo E., Sibillo M.)
12 ottobre 2006	Talk, The fair value of the insured loan portfolio scheduled at variable interest rates, (con Coppola M., Sibillo M.), Conference Maf 2006 – Università degli Studi di Salerno (Italy)
2-3 luglio 2006	Talk, Risk Measurement and Fair Valuation Assessment in the life insurance field, (con Coppola M., Di Lorenzo E., Sibillo M.), Conference ECOPL, Economics: from tradition to complexity, Capri (Italia)

#### VII- B Seminari

11 novembre 2013	Invited Seminar, Dependence into Mortality Data: Projections by Lee Carter Models, Humboldt University, Berlin (Germany)
17 maggio 2013	Invited Seminar, Modelli matematici per proiezioni della mortalità, Università di Bologna, in Rimini (Italia)
16 maggio 2013	Invited Seminar, The Longevity Risk Assessment by Cross Country Common Trends, Università di Bologna (Italia)
23 giugno 2010	Invited Seminar, Metodi simulativi per l'analisi della sopravvivenza nelle Assicurazioni Vita, Università della Calabria, Cosenza (Italia)
10 marzo 2010	Invited Seminar, Efficient Bootstrap in life annuity actuarial analysis, Faculty of Actuarial Science and Insurance - Cass Business School City University London (UK)
9 febbraio 2010	Invited Seminar, Indicatori di solvibilità per portafogli assicurativi Ramo Vita in ipotesi stocastiche per la sopravvivenza, Università di Salerno (Italy)

#### Parte VIII – Attività Didattica

#### VIII – A Insegnamento in corsi di laurea triennali e magistrali presso Dipartimento Scienze Economiche e Statistiche, Dipartimento di Scienze Aziendali – management and Innovation Systems, Dipartimento di Farmacia, Università degli Studi di Salerno e altre Università

Anno	Istituzione	Corso
A.A. 2022-2023	Luiss Guido Carli Roma	Matematica Finanziaria
A.A.	Università degli Studi di Salerno	Matematica, Laurea a ciclo unico Chimica e

2022-2023		Tecnologia Farmaceutiche
A.A. 2022-2023	Università degli Studi di Salerno	Elementi di Matematica, Laurea a ciclo unico in Farmacia
A.A. 2022-2023	Università degli Studi di Salerno	Principi di Statistica, Laurea Gestione e valorizzazione delle risorse agrarie e delle aree protette
A.A. 2022-2023	Università degli Studi di Salerno	Matematica, Laurea Gestione e valorizzazione delle risorse agrarie e delle aree protette
A.A. 2022-2023	Università degli Studi di Salerno	Elementi di Matematica e Statistica, Laurea Farmaceutica e Nutraceutica Animale
A.A. 2022-2023	Università degli Studi di Salerno	Matematica, Laurea Tecniche Erboristiche
A.A. 2021-2022	Università degli Studi di Salerno	Matematica, Laurea a ciclo unico Chimica e Tecnologia Farmaceutiche
A.A. 2021-2022	Università degli Studi di Salerno	Elementi di Matematica, Laurea a ciclo unico in Farmacia
A.A. 2021-2022	Università degli Studi di Salerno	Statistica, Laurea Gestione e valorizzazione delle risorse agrarie e delle aree protette
A.A. 2021-2022	Università degli Studi di Salerno	Matematica, Laurea Tecniche Erboristiche
A.A. 2020-2021	Università degli Studi di Salerno	Matematica, Laurea a ciclo unico Chimica e Tecnologia Farmaceutiche
A.A. 2020-2021	Università degli Studi di Salerno	Elementi di Matematica, Laurea a ciclo unico in Farmacia
A.A. 2020-2021	Università degli Studi di Salerno	Statistica Applicata, Laurea a ciclo unico Chimica e Tecnologia Farmaceutiche
A.A. 2020-2021	Università degli Studi di Salerno	Matematica, Laurea Tecniche Erboristiche
A.A. 2019-2020	Università degli Studi di Salerno	Matematica per l'Economia, Laurea Triennale Economia e Commercio
A.A. 2019-2020	Università degli Studi di Salerno	Laboratorio di Applicazioni Finanziarie, Laurea Triennale Economia Aziendale
A.A.	Università degli Studi di Salerno	Finanza Stocastica, Laurea Magistrale Scienze

2019-2020		Statistiche per la Finanza
A.A. 2019-2020	Università degli Studi di Salerno	Matematica, Laurea Tecniche Erboristiche
A.A. 2018-2019	Università degli Studi di Salerno	Matematica per l'Economia, Laurea Triennale Economia e Commercio
A.A. 2018-2019	Università degli Studi di Salerno	Laboratorio di Applicazioni Finanziarie
A.A. 2017-2018	Università degli Studi di Salerno	Matematica per l'Economia, Laurea Triennale Economia e Commercio
A.A. 2017-2018	Università degli Studi di Salerno	Laboratorio di Applicazioni Finanziarie, Laurea Triennale Economia Aziendale
A.A. 2017-2018	Università degli Studi di Salerno	Finanza Matematica, Laurea Magistrale in Scienze Statistiche per la Finanza
A.A. 2017-2018	Università degli Studi di Salerno	Finanza Stocastica, Laurea Magistrale in Scienze Statistiche
A.A. 2016-2017	Università degli Studi di Salerno	Matematica per l'Economia, Laurea Triennale Economia e Commercio
A.A. 2016-2017	Università degli Studi di Salerno	Laboratorio di Applicazioni Finanziarie, Laurea Triennale Economia Aziendale
A.A. 2016-2017	Università degli Studi di Salerno	Finanza Matematica, Laurea Magistrale in Scienze Statistiche per la Finanza
A.A. 2016-2017	Università degli Studi di Salerno	Finanza Stocastica, Laurea Magistrale in Scienze Statistiche per la Finanza
A.A. 2015-2016	Università degli Studi di Salerno	Matematica per l'Economia, Laurea Triennale Economia e Commercio
A.A. 2015-2016	Università degli Studi di Salerno	Laboratorio di Applicazioni Finanziarie, Laurea Triennale Economia Aziendale
A.A. 2015-2016	Università degli Studi di Salerno	Finanza Matematica, Laurea Magistrale in Scienze Statistiche per la Finanza
A.A. 2015-2016	Università degli Studi di Salerno	Finanza Stocastica, Laurea Magistrale in Scienze Statistiche per la Finanza
A.A.	Università degli Studi di Salerno	Finanza Stocastica, Laurea Magistrale in

2014-2015		Scienze Statistiche per la Finanza
A.A. 2014-2015	Università degli Studi di Salerno	Modelli Matematici per l'Economia e la Finanza, Laurea Magistrale in Scienze Statistiche per la Finanza
A.A. 2013-2014	Università degli Studi di Salerno	Analisi Statistica per le Ricerche di Mercato, Laurea magistrale Consulenza e Management
A.A. 2013-2014	Università degli Studi di Salerno	Modelli Matematici per l'Economia e la Finanza, Laurea Magistrale in Scienze Statistiche per la Finanza
A.A. 2012-2013	Università degli Studi di Salerno	Matematica per l'Economia e Matematica Finanziaria, Laurea triennale in Economia Aziendale
A.A. 2012-2013	Università degli Studi di Salerno	Modelli Matematici per l'Economia e la Finanza, Laurea Magistrale in Scienze Statistiche per la Finanza
A.A. 2011-2012	Università degli Studi di Salerno	Matematica per l'Economia, Laurea triennale in Economia e Commercio
A.A. 2011-2012	Università degli Studi di Salerno	Modelli Matematici per l'Economia e la Finanza, Laurea Magistrale in Scienze Statistiche per la Finanza
A.A. 2010-2011	Università degli Studi di Salerno	Matematica per l'Economia e Matematica Finanziaria, Laurea triennale in Scienze Gestionali
A.A. 2009-2010	Università degli Studi di Salerno	Matematica per l'Economia e Matematica Finanziaria, Laurea triennale in Scienze Gestionali
A.A. 2008-2009	Università degli Studi di Salerno	Matematica per l'Impresa, Laurea Specialistica in Economia Aziendale

### VIII – B Altri incarichi di docenza

Anno	Istituzione	Corso
AA. 2022-2023	Università degli Studi di Salerno	Applicazioni matematiche in ambito farmaceutico presso Scuola di specializzazione in Farmacia ospedaliera
AA.AA. 2016-2017; 2017-2018; 2018-2019	Università degli Studi di Salerno	Portafogli assicurativi e finanziari, MEFIRM – Economics, Finance and Risk Management, Master universitario di I livello
AA.AA. 2016-	Università degli Studi di Salerno	Pricing di strumenti finanziari, MEFIRM – Economics, Finance and Risk Management,

2017; 2017- 2018; 2018- 2019		Master universitario di I livello
A.A. 2012- 2013	Università degli Studi di Salerno	Portafogli assicurativi e finanziari, MEFIRM – Economics, Finance and Risk Management, Master universitario di I livello
A.A. 2012- 2013	Università degli Studi di Salerno	Pricing di strumenti finanziari, MEFIRM – Economics, Finance and Risk Management, Master universitario di I livello

### Parte IX – Board Editoriali e Referee per riviste internazionali

Membro del Comitato Scientifico: Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance, MAF 2018, Madrid (Spagna)
Editore Special Issue: "New Perspectives in Actuarial Risk Management" <a href="http://www.mdpi.com/journal/risks/special%20issues/New%20Perspectives%20in%20Actuarial%20Risk%20Management">http://www.mdpi.com/journal/risks/special issues/New Perspectives in Actuarial Risk Management</a>
Membro Board Editoriale : per Journal of Finance and Economics
Referee: per Risks
Referee: per Journal of Forecasting 2016 – Reviewer Certificate
Referee: per Royal Statistical Society 2016
Referee: per Population Studies 2014
Referee: per IME Insurance: Mathematics and Economics 2010, 2011, 2012, 2013
Referee: per Lifetime Data Analysis 2013
Referee: per Statistical Modelling 2012
Referee: per Journal of Probability and Statistics 2010
Referee: per Methodology and Computing in Applied Probability 2009
Referee: per WIRN Italian Workshop on Neural Networks 2009, 2010, 2011, 2012, 2013
Referee: per Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance 2009, 2012, 2014
Referee: per Rivista Politica Economica 2014

### Parte X – Attività Organizzative

Co-Fondatore Scuola Internazionale di Matematica Attuariale UNISActuarial School, presso Università degli Studi di Salerno dal 2014
Coordinatore: Job Speed Dating 2017, Dipartimento di Scienze Economiche e Statistiche, Università degli Studi di Salerno – Italia
Organizzatore: Workshop tematico Dall'Università al mondo del lavoro, in collaborazione con Banca Monte Pruno, 20 Novembre 2017, Dipartimento di Scienze Economiche e Statistiche, Università degli Studi di Salerno – Italia
Organizzatore: Workshop tematico Conoscere la Borsa. Regole e Meccanismi spiegati

dagli operatori, 20 Novembre 2017, Dipartimento di Scienze Economiche e Statistiche, Università degli Studi di Salerno – Italia
Coordinatore: Monthly Meetings, Incontri di Placement presso il Dipartimento di Scienze Economiche e Statistiche, Università degli Studi di Salerno – Italia
Componente: del Comitato Organizzativo One - Day Conference, Volatilità e rischio in Finanza, 21 Dicembre 2011, Università degli Studi di Salerno – Italia
Componente: del Comitato Organizzativo MAF Conferences Università degli Studi di Salerno e Università Ca' Foscari di Venezia, anni: 2004, 2006, 2008, 2010, 2012, 2014
Componente: del Comitato Placement della Facoltà di Economia, Università degli Studi di Salerno, anni: 2010, 2011, 2012, 2013

## Parte XI – Attività Istituzionali

Dal 2017 al 2019	Presidente: Commissione Orientamento in Entrata ed in Itinere, Dipartimento di Scienze Economiche e Statistiche, Università degli Studi di Salerno
Dal 2017 al 2019	Presidente: Commissione Placement, Dipartimento di Scienze Economiche e Statistiche, Università degli Studi di Salerno
Dal 2016 al 2017	Componente: Gruppo Assicurazione Qualità Università degli Studi di Salerno, anni: 2016, 2017
Dal 2010 al 2012	Componente: Commissione Orientamento, Facoltà di Economia, Università degli Studi di Salerno
Dal 2011 al 2013	Componente: Commissione Piani di Studio, Facoltà di Economia, Università degli Studi di Salerno
2010	Componente: Commissione Test d'accesso, Lauree Triennali Facoltà di Economia, Università degli Studi di Salerno
<u>Dal 2011 al 2012</u>	Componente: Commissione Test d'accesso, Lauree Magistrali Facoltà di Economia, Università degli Studi di Salerno

## Parte XII – Consulenze Professionali

### XII – A Principali attività di consulenza svolte in ambito bancario

• verifica della coerenza tra gli “obiettivi legittimi” degli strumenti finanziari derivati negoziati e la natura delle operazioni di indebitamento sottostanti;
• analisi dei rapporti di conto corrente in merito a usura, anatocismo, commissioni di massimo scoperto, interessi ultralegali;
• analisi dei rapporti di mutuo in merito a usura, indeterminatezza delle condizioni economiche; rapporti di leasing in merito alla usura sulla indeterminatezza delle condizioni applicate, sulla errata indicizzazione dei canoni;
• supporto al processo di adeguamento della Funzione di Risk Management nelle BCC

## **XII – B Principali attività scientifiche correlate ad attività professionali in ambito assicurativo riguardanti la Funzione Attuariale e la Funzione di Risk management**

• costruzione di modelli stocastici per la valutazione dei rischi finanziari e dei rischi demografici sia nel campo previdenziale che assicurativo e relativa valutazione dei requisiti di capitale;
• docenza a corsi di formazione inerenti le tecniche di Risk Management assicurativo, Solvency 2 e Tecnica attuariale Vita;
• valutazione della profittabilità dei principali prodotti vita del mercato italiano in ottica Solvency 2;
• supporto al processo di adeguamento della Funzione di Risk Management nelle BCC
• attività di supporto al controllo interno sia nel campo previdenziale che assicurativo;
• docenza a corsi di formazione inerenti le tecniche A.L.M., Risk Management, Solvency e Tecnica attuariale Vita e Danni;
• costruzione di profit test sui prodotti vita;
• costruzione di modelli di Embedded Value per le assicurazioni vita;
• supporto tecnico all'attività di Risk Manager nelle assicurazioni vita;
• costruzione di modelli simulativi per la valutazione dei rischi tecnici assicurativi delle compagnie di assicurazione vita;
• costruzione di profit test sui prodotti dei rami danni;
• supporto tecnico all'attività di Risk Manager nelle assicurazioni danni;
• costruzione di modelli simulativi per la valutazione dei rischi tecnici assicurativi delle compagnie di assicurazione danni;
• studio di fattibilità/business plan di Fondi Pensione Negoziali;
• costruzione di modelli interni nella assicurazioni contro i danni.

## **Parte XIII– Associazioni Scientifiche**

Socio AMASES, Italian Applied Mathematics Society
Iscritta a The Geneva Association, International Association for the Study of Insurance Economics
Iscritta a Life and Longevity Markets Association, UK
Iscritta a The Actuarial Profession -Institute and Faculty of Actuaries, UK

## **Parte XIV– Competenze ICT**

Software: FINCAD, MIDFIN, MATLAB, R, STATA
--

## **Parte XV– n. 10 Pubblicazioni selezionate ai fini della valutazione**

2023	“Firms’ profitability and ESG score: a machine learning approach”, (D’Amato V., R. D’Ecclesia, S. Levantesi) Applied Stochastic Models in Business and Industry, accettato per la pubblicazione a Marzo 2023
2023	“Effect of the Covid-19 frailty heterogeneity on the future evolution of mortality by stratified weighting” (Carannante M., D’Amato V., Haberman, S.), Journal of

	Demographic Economics, accettato per la pubblicazione a Dicembre 2022
2022	“Deep learning in predicting cryptocurrency volatility”, (D’Amato V., S. Levantesi, G. Piscopo), Physica A: Statistical Mechanics and its Applications Volume 596, 127158 <a href="https://doi.org/10.1016/j.physa.2022.127158">https://doi.org/10.1016/j.physa.2022.127158</a>
2021	“ESG score prediction through Random Forest algorithm”, (D’Amato V., D’Ecclesia R. L., S. Levantesi), Computational Management Science <a href="https://doi.org/10.1007/s10287-021-00419-3">https://doi.org/10.1007/s10287-021-00419-3</a>
2021	“Fundamental ratios as predictors of ESG scores: a machine learning approach (D’Amato V., D’Ecclesia R. L., S. Levantesi), Decisions in Economics and Finance <a href="https://doi.org/10.1007/s10203-021-00364-5">https://doi.org/10.1007/s10203-021-00364-5</a>
2019	“Pension Schemes versus Real Estate”, (D’Amato V., Di Lorenzo E., Haberman S., Tizzano R., Sibillo M.), Annals of Operations Research, 1-13 -ISSN:1572-9338.
2018	“De-risking strategy: longevity spread buy-in”, (D’Amato V., Di Lorenzo E., Haberman S., Sagoo P., Sibillo M.), Insurance: Mathematics and Economics, Vol, 79, March 2018, 124-136
2018	“An option pricing approach for measuring Solvency Capital Requirements in Insurance Industry” (Coppola M., D’Amato V., Levantesi S.) Physica A: Statistical Mechanics and its Applications, Elsevier, vol. 509(C), pages 717-728.
2014	“Detecting longevity common trends by a multiple population approach” (D’Amato V., Haberman S., Piscopo G., Russolillo M., L.Trapani) North American Actuarial Journal Vol. 18, n. 1, Pag. 139-149
2014	“Computational Framework for Longevity Risk Management” (D’Amato V., Haberman S., Piscopo G., Russolillo M.) Computational Management Science, Volume 11, Issue 1 (2014), Pag. 111-137

Autorizzo il trattamento dei miei dati personali ai sensi del Decreto Legislativo 30 giugno 2003, n. 196 e del GDPR (Regolamento UE 2016/679)

Salerno, 24/04/2023

In fede,