

# CURRICULUM VITAE

## DATI ANAGRAFICI

*Gabriella Piscopo*

Nata a Napoli, il 16-06-1983

Residente in Via San Gioacchino n.2, 80011 Acerra (NA)

Tel 081-5207971

Tel. Cell. 320-3621244

Email: [gabriella.piscopo@unifi.it](mailto:gabriella.piscopo@unifi.it)

## TITOLI

- Marzo 2010 ad oggi: **Assegnista di Ricerca** presso il Dipartimento di Matematica per le Decisioni dell'Università degli Studi di Firenze. Titolo dell'assegno "*Fondi pensione: problematiche sulla gestione finanziaria, attuariale ed analisi dei rischi*"
- 2006-2009: **Dottore di Ricerca** in *Matematica per l'Analisi Economica e la Finanza* (ciclo XXII), presso l'Università degli Studi di Napoli Federico II. Titolo della tesi di dottorato: *Variable Annuities and Embedded Options: models and tools for fair valuation and solvency appraisal*. Supervisors: Di Lorenzo Emilia e Haberman Steven.
- 2006-2009: **Europeand PhD**, presso l'Università degli Studi di Napoli Federico II
- 2009 ad oggi: **Culture della materia** per gli a.a. 2009/2010, 2010/2011, 2011/2012 e 2012/2013 nelle discipline: *Matematica finanziaria I*, *Matematica Finanziaria II*, *Finanza Matematica*
- Gennaio-Luglio 2009: diploma di **Master** in *Finanza Avanzata: metodi quantitativi e applicazioni informatiche per la finanza e la gestione del rischio* (VII edizione), presso l'I.P.E. (Istituto di Ricerche ed Attività Educative, Collegio Universitario legalmente riconosciuto ed operante sotto la vigilanza del Ministero dell'Istruzione dell'Università e della Ricerca, Ente morale eretto con D.P.R. 374/81), Riviera di Chiaia 264- 80121 Napoli. Votazione riportata: A+
- Aprile 2009: International English Language Testing System- **Academic IELTS**, rilasciato da: University of Cambridge.

- Marzo-Giugno 2008: **Visiting Researcher** presso la Cass Business School, City University of London, su chiamata del prof. Steven Haberman
- Ottobre-Dicembre 2007: **Visiting Researcher** presso la Cass Business School, City University of London, su chiamata del prof. Steven Haberman
- Novembre 2006- Luglio 2007: Uditore al **Master in Economia e Finanza** (XI edizione) presso l'Università degli studi di Napoli Federico II.
- 25 Luglio 2006: conseguimento della **Laurea Magistrale** in *Finanza*, presso l'Università degli Studi di Napoli Federico II. Tesi in Matematica Finanziaria Avanzata, relatore: Di Lorenzo Emilia. Votazione riportata: 110/110 e lode
- 19 Ottobre 2004: conseguimento della **Laurea Triennale** in Economia Aziendale, presso l'Università degli Studi di Napoli Federico II. Votazione riportata: 110/110 e lode

## ATTIVITA' DI FORMAZIONE

### *Partecipazioni a convegni, scuole di formazione, attività seminariali*

- 1) **05-09/07/2010: International Summer School on Risk Management and Control** Roma, Istituto di Finanza dell'Università della Svizzera Italiana e Università La Sapienza di Roma.
- 2) **Seminario, 20 Gennaio 2010: A Flexible Savings Plan with Targeted Contributions**, tenuto da Iqbal Owadally (Cass Business School, City University of London) presso l'Università degli Studi di Napoli Federico II.
- 3) **Seminario, 2 Ottobre 2009: Financial Risk Theory for a regulated Insurer**, tenuto da Gary Parker (Simon Fraser University) presso l'Università degli Studi di Salerno
- 4) **Seminario, 28 Settembre 2009: Stochastic Surplus Analysis**, tenuto da Gary Parker (Simon Fraser University) presso l'Università degli Studi di Napoli Federico II
- 5) **Workshop, 11-12 Marzo 2009: First Florence- Ritsumeikan Workshop on Finance and Risk Theory**, CISA, presso l'Università degli Studi di Firenze
- 6) **Seminario, 20 Maggio 2008: The UK pension system**, tenuto da Zaki Khorasane presso la Cass Business School, City University of London.
- 7) **Seminario, 5 Maggio 2008: Internal Models, Uncertainty and Embedding in the Context of Solvency II**, tenuto da Andreas Tsanakas presso la Cass Business School, City University of London.
- 8) **Seminario, 15 Marzo 2008: Environmental Liability Risk and Insurance**, tenuto da Chris Parsons presso la Cass Business School, City University of London.
- 9) **Seminario, 22 Febbraio 2008: ERM in Life Insurance: hedging the longevity risk**, tenuto da Annamaria Olivieri presso l'Università degli Studi di Napoli Federico II
- 10) **Seminario, 22 Febbraio 2008: ERM in Life Insurance: the framework**, tenuto da Ermanno Pitacco presso l'Università degli Studi di Napoli Federico II.

- 11) **Corso, Novembre-Dicembre 2008:** *Introduction to Econometrics*, tenuto da C. Monti (Master in Economics and Finance) presso l'Università degli Studi di Napoli Federico II
- 12) **Conferenza, 7-8 Dicembre 2007:** *Measuring Dependence in Finance*, tenutasi presso la Cass Business School, City University of London.
- 13) **Corso, Dicembre 2007:** *English for Academic Purposes: Oral skills* (5 weekly classes), presso il Centre for Language Studies, Cass Business School, City University of London
- 14) **Seminario, 5 Dicembre 2007:** *Stochastic survival probabilities: Actuarial Analysis of the Lee-Carter model*, tenuto da Michel Denuit (Université catholique de Louvain) presso la Cass Business School, City University of London.
- 15) **Corso, Novembre 2007:** *English for Academic Purposes: Writing skills* (5 weekly classes), presso il Centre for Language Studies, Cass Business School, City University of London
- 16) **Seminario, 2 Novembre 2007:** *Risk adjusted value allocation for non traded assets with performance ratios*, tenuto da Johannes Leitner (Vienna University of Technology) presso la Cass Business School, City University of London.
- 17) **Seminario, 14 Novembre 2007:** *Dependence modeling with Archimedean Copulas and Levy Copulas*, tenuto da Alfred Muller (Heriot-Watt University) presso la Cass Business School, City University of London.
- 18) **Seminario, 31 Ottobre 2007:** *Bayesian Inference is Robust*, tenuto da Jim Smith (University of Warwick) presso la Cass Business School, City University of London.
- 19) **A.a. 2006-2007:** uditore al Master in Economia e Finanza (XI edizione) presso l'Università degli Studi di Napoli Federico II.

#### *Partecipazione a corsi con esame finale*

- 1) **Gennaio- Luglio 2009:** Moduli Formativi seguiti e d esami sostenuti durante il Master in Finanza Avanzata presso l'I.P.E.: *Metodi quantitativi per la Finanza, Business English, Mercati finanziari e Mercati regolamentari, Mercati Finanziari: vigilanza aspetti fiscali e legali, Risk Management, Finanza Aziendale, Finanza Straordinaria, Simulazione di borsa, Project Work: Evoluzione del sistema di rating.*
- 2) **Febbraio- Marzo 2008:** Corso di *Inferenza Statistica* tenuto dal prof. La Rocca nell'ambito del Master in Concorrenza Economia della Valutazione e della Regolamentazione presso l'Università degli Studi di Napoli Federico II (superamento del relativo esame con valutazione A+)
- 3) **Marzo- Luglio 2007:** Corso di *Processi Stocastici* tenuto dal prof. Buonocore presso la Facoltà di Matematica dell'Università degli Studi di Napoli Federico II (superamento del relativo esame con votazione 30/30)
- 4) **Novembre 2006- Luglio 2007:** Corsi seguiti ed esami sostenuti in qualità di uditore del Master in Economia e Finanza (XI edizione) presso l'Università degli studi di Napoli Federico II: *Microeconomia I, Teoria dei giochi, Matematica per l'Economia, Econometria, Macroeconomia, Microeconomia II, Analisi delle Serie Storiche, Analisi e Valutazione d'impresa, Economia*

*della previdenza, Analisi dei titoli derivati, Valutazione di titoli e strategie di portafoglio.*

## **PREMI E BORSE DI STUDIO E RICERCA**

- Marzo 2010: **Assegno di ricerca**, Università degli Studi di Firenze, Dipartimento di Matematica per le decisioni.
- Luglio 2009: **Premio** per il primo classificato al Master in *Finanza Avanzata: metodi quantitativi e applicazioni informatiche per la finanza e la gestione del rischio* (VII edizione), I.P.E., finalizzato al sostegno dell'attività di ricerca svolta nel periodo Gennaio-Luglio 2009.
- 2006-2009: **Borsa di dottorato di ricerca**, Università degli Studi di Napoli Federico II.
- Marzo- Giugno 2008: **Borsa di Studio** ad incremento della borsa di Dottorato per soggiorno all'estero, Università degli Studi di Napoli Federico II.
- Settembre- Dicembre 2007: **Borsa di Studio** ad incremento della borsa di Dottorato per soggiorno all'estero, Università degli Studi di Napoli Federico II.

## **ATTIVITA' DIDATTICA**

1. Gennaio 2011: **Incarico di Docenza al Master** in Finanza Avanzata: Metodi Quantitativi ed Applicazioni Informatiche per la gestione del rischio (IX edizione), nell'ambito del modulo *Metodi Quantitativi per la Finanza*, n. ore: 8
2. Gennaio 2010: **Professore a Contratto per l'a.a. 2009/2010** per attività didattiche integrative presso l'Università degli Studi di Napoli Federico II, facoltà di Scienze Politiche, Corso di Laurea in Statistica. Insegnamento: *Analisi dei Rischi* (settore disciplinare SECS-S/06), n. ore 27 (Febbraio-Marzo 2010)
3. Gennaio 2010: **Docenza al Master** in Finanza Avanzata: Metodi Quantitativi ed Applicazioni Informatiche per la gestione del rischio (VIII edizione), nell'ambito del modulo *Metodi Quantitativi per la Finanza*, n. ore: 8
4. Gennaio 2010: **Professore a Contratto per l'a.a. 2009/2010**, corso di primo sostegno per l'a.a. 2009-2010 presso la Seconda Università degli Studi di Napoli nella disciplina: "*Elementi di base di Matematica*" (Prot. N. 2284 del 29.12.2009); n. ore:32

5. Novembre 2009: **Cultore della materia** per gli a.a. 2009/2010, 2010/2011, 2011/2012 e 2012/2013 nelle discipline: *Matematica finanziaria I, Matematica Finanziaria II, Finanza Matematica*
6. 2007- 2010: **Ciclo di Esercitazioni** al corso di Finanza Matematica, moduli I e II della cattedra prof. Emilia Di Lorenzo, Università degli Studi di Napoli Federico II
7. 2007-2010: Assistenza didattica relativa ai corsi di *Matematica Finanziaria Avanzata I, Matematica Finanziaria Avanzata II, Finanza Matematica* della prof. Emilia di Lorenzo, Università degli Studi di Napoli Federico II.

## PARTECIPAZIONE A PROGETTI DI RICERCA

1. 2010: FIRB *Longevity Risk and Pension System: tool and perspectives in an Ageing Society*. Coordinatore: dott.ssa Valeria D'Amato
2. 2009 Titolare: dott.ssa Valeria D'Amato. *Rischi demografici, sistematici e applicazioni in ambito attuariale*. Quota dei fondi per la ricerca scientifica (ex quota 60%)-Università di Salerno
3. 2009 Titolare: dott.ssa Maria Russolillo. *Strategie simulative applicate ai modelli di proiezione della mortalità*. Quota dei fondi per la ricerca scientifica (ex quota 60%) – Università di Salerno
4. 2009 Titolare: Prof.ssa Marilena Sibillo. *Indicatori di performance aggiustati al rischio per portafogli di annualità pensionistiche*. Quota dei fondi per la ricerca scientifica (ex quota 60%) – Università di Salerno
5. Progetto di Ricerca **PRIN 2008**, responsabile dell'unità di Ricerca: Prof.ssa Emilia di Lorenzo; Coordinatore Scientifico: Prof. Ermanno Pitacco.

## COMUNICAZIONI A CONVEGNI E SEMINARI

1. 10-11 Febbraio 2011: *A framework for pricing a mortality derivative: the q-forward contract*. Lavoro accettato- prossima comunicazione alla Conferenza **Interplay between Finance and Insurance- AFMATH 2011**, Bruxelles
2. 16-18 Settembre 2010: *Efficient simulation in the Lee Carter framework*. Workshop PRIN 2007 Tropea: Modelli per la Valutazione del rischio in ambito assicurativo.

3. 17-19 Giugno 2010: *Integrated Variance Reduction Techniques in the Lee Carter Model*; Comunicazione al Convegno Internazionale **IME 10** (con D'Amato V., Haberman S. e Russolillo M.)
4. 27-29 Maggio 2010: *Iterative Algorithms for detecting mortality in the family of Lee Carter Models*. Comunicazione al Convegno **WIRN 10, Italian Society for Neural Networks**, Vietri sul Mare (con D'Amato V. e Russolillo M.)
5. 7-9 Aprile 2010: *Measuring Mortality Heterogeneity in Pension Plans*. Comunicazione al Convegno **MAF 2010** (con D'Amato V. e Russolillo M.)
6. 30 Marzo 2010: *Actuarial Valuation of Variable Annuities and Guarantees*; seminario tenuto presso il Polo delle Scienze Sociali dell'Università degli Studi di Firenze.
7. 20 Gennaio 2010: *Italian Defined Contribution Pension Scheme*. Seminario tenuto presso il Dipartimento di Matematica e Statistica dell'Università degli Studi di Napoli Federico II
8. 1-4 Settembre 2009: *Financial Valuation of Guaranteed Lifelong Withdrawal Benefit Option*, comunicazione al **XXXIII convegno AMASES**, Università degli Studi di Parma
9. 30 Maggio- 3 Giugno 2009: *Smoothing the Lee Carter Model: an Empirical Analysis on the Italian Data*, comunicazione al Convegno **EURISBIS 09**, Università degli Studi di Cagliari (con D'Amato V. e Russolillo M.)
10. 28-30 Maggio 2009: *Intensive Computational Forecasting Approach to the Functional Demographic Lee Carter Model*, comunicazione al Convegno **WIRN 09**, Italian Society for Neural Networks (SIREN), Vietri sul mare (con D'Amato V. e Russolillo M.)
11. 16-20 Marzo 2009: *A pricing model for the Guaranteed Lifelong Withdrawal Benefit Option*, comunicazione al **Workshop Finance and Insurance, Marie Curie ITN Network**, Friedrich Schiller University of Jena- Institut für Angewandte Mathematik, Jena (Germany)
12. 1-4 Settembre 2008: *Surplus Analysis for Variable Annuities with a GMDB option*, comunicazione al **XXXII Convegno Amases**, Università degli Studi di Trento (con Haberman S.)

## PUBBLICAZIONI

1. D'AMATO V., PISCOPO G., RUSSOLILLO M. (2011). *The mortality of the Italian population: Smoothing techniques on the Lee Carter model*. To appear in the **Annals of Applied Statistics (Impact Factor 2.57)**.
2. HABERMAN S., PISCOPO G. (2011). *The valuation of Guaranteed Lifelong Withdrawal Benefit Options in variable annuity contracts and the impact of mortality risk*. To appear in the **North American Actuarial Journal**.
3. D'AMATO V., PISCOPO G., RUSSOLILLO M. (2011). *Measuring mortality heterogeneity in pension plans*. To appear in the **Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance, Springer**.
4. PISCOPO G. (2011). *The impact of Longevity Risk on Annuity Factors in the Italian state Defined Contribution Pension Scheme*. To appear in the **Insurance Markets and Companies: Analyses and Actuarial Computations**.
5. COLIVICCHI I., PISCOPO G., VANNUCCI E. (2011). An "equilibrium" model for defined benefit pension schemes in a stochastic scenario. To appear in the **Proceedings of ASMDA2011** (indexed in the ISI Thompson DB of Web of Science)
6. PISCOPO G., HABERMAN S. (2010). *Surplus Analysis for Variable Annuities with a GMDB Option*. **Actuarial Research Paper** No. 193, Faculty of Actuarial Science and Insurance, Cass Business School, City University of London. ISBN 978-1-905752-25-6
7. PISCOPO G. (2010). *Italian Deposits Time Series Forecasting Via Functional Data Analysis*. **Banks and Bank Systems**, Vol. 5, Issue 1. ISSN 1816-7403
8. PISCOPO G. (2010). *Withdrawal Strategy for Guaranteed Lifelong Withdrawal Strategy*. **Perspectives of Innovations, Economics & Business**, Vol. 5 (2). ISSN 1804-0519 (Print), ISSN 1804-0527 (Online)
9. PISCOPO G. (2010). *Expected value and variance of insurance surplus for a portfolio of equity-linked policies*. To appear in **Quaderni di Statistica** vol. 12. ISSN:1594-3739
10. D'AMATO V., PISCOPO G., RUSSOLILLO M. (2010). *Iterative Algorithms for detecting mortality in the family of Lee Carter Models*. To appear in **Frontiers in Artificial Intelligence and Applications**, Neural Nets WIRN10, IOS Press- *KBIES* book series.
11. D'AMATO V., PISCOPO G., RUSSOLILLO M. (2009). *Intensive Computational Forecasting Approach to the Functional Demographic Lee Carter Model*. **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
12. PISCOPO G. (2009). *Variable Annuities and Embedded Options: models and tools for fair valuation and solvency appraisal*. **Tesi di dottorato europeo** (Supervisors: Emilia Di Lorenzo e Steven Haberman). <http://www.fedoatd.unina.it/view/year/2009.html>
13. PISCOPO G. (2009). *The fair price of Guaranteed Lifelong Withdrawal Benefit Option in Variable Annuity*. **PROBLEMS & PERSPECTIVES IN MANAGEMENT**, vol. 7, Issue 4. ISSN: 1727-7051
14. HABERMAN S., PISCOPO G. (2008). *Mortality Risk and the Valuation of Annuities with Guaranteed Minimum Death Benefit Option: Application to the Italian Population*, **Actuarial Research Paper** n. 187, **Cass Business School**. ISBN 978-1-905752-16-4. (Paper inserito nelle Mortality Reading List 2006-2009 e Life Assurance Reading List 2006-2009, Faculty of Actuaries and Institute of Actuaries)

### **Abstracts**

15. D'AMATO V., PISCOPO G., RUSSOLILLO M. (2011). *A framework for pricing a mortality derivative: the q-forward contract*. To appear in the **Interplay between Finance and Insurance**- AFMATH 2011, Bruxelles (with ISBN)
16. D'AMATO V., HABERMAN S., PISCOPO G., RUSSOLILLO M. (2010). *Integrated Variance Reduction Techniques in the Lee Carter Model*; Convegno Internazionale **IME 10**, Toronto Extended Abstract available on <http://atlas-conferences.com/cgi-bin/abstract/cazx-74>
17. D'AMATO V., PISCOPO G., RUSSOLILLO M. (2009). *Smoothing the Lee Carter Model: an Empirical Analysis on the Italian Data*. (2009) In: **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

### **Working Papers**

18. D'AMATO V., HABERMAN S., PISCOPO G., RUSSOLILLO M. (2011). *Integrated Variance Reduction Techniques in the Lee Carter Model*.
19. PISCOPO G. (2011). *Guaranteed Minimum Withdrawal Benefit with Dynamic Protection*.

## **CONOSCENZE INFORMATICHE**

Concetti di base della Tecnologia dell'Informazioni; gestione dei file; Elaborazione testi; Foglio elettronico; Basi di dati; Strumenti di presentazione; Reti informatiche:

- livello di conoscenza: ottimo;

Programmi:

Sistema Operativo Windows XP; Microsoft Office 2003:

- livello di conoscenza: ottimo;

Programmi:

**E-VIEWS 7** (software statistico)

Livello di conoscenza: buono

**FINCAD** (software finanziario)

- livello di conoscenza: buono;

**GRET 1.8.7** (software statistico)

- livello di conoscenza: buono;

**MATLAB 7.1** (software matematico-statistico)

- livello di conoscenza:buono.

**R** (software statistico)

- livello di conoscenza: ottimo.

**STATA** (software statistico)

livello di conoscenza: buono.

## **CONOSCENZE LINGUISTICHE**

Lingua: Inglese

- livello di conoscenza: buono (certificazione: Academic IELTS)

Lingua: Francese

- livello di conoscenza: scolastico

Lingua: Spagnolo

- livello di conoscenza: basilare.

Firenze 1/02/2011

Gabriella Piscopo