

CURRICULUM ATTIVITÀ DIDATTICA E SCIENTIFICA

di Luca Riccetti

luca.riccetti@uniroma1.it

ATTUALE POSIZIONE ACCADEMICA

- Ricercatore a tempo determinato nel settore scientifico disciplinare SECS-P/11

ATTUALI INCARICHI DIDATTICI

- Corso di Economia degli Intermediari Finanziari
- Seminari di Econometria Applicata

AREE DI RICERCA PREVALENTI

- Analisi delle relazioni tra sistema economico reale e sistema bancario per la comprensione delle crisi economico-finanziarie.
- Analisi del rischio sistemico e delle impostazioni regolamentari.
- Gestione di portafogli finanziari con tecniche quantitative.

FORMAZIONE

- 2000-2004 Università Commerciale L.Bocconi, **Laurea** in Economia delle Istituzioni e dei Mercati Finanziari.
- 2006-2007 Università Politecnica delle Marche, **Master** in Economia Politica.
- 2006-2009 Università Politecnica delle Marche, **Dottorato** di ricerca in Economia Politica.

PRECEDENTI POSIZIONI ACCADEMICHE

- 2010 Borsa di studio post-dottorato presso l'Università Politecnica delle Marche, Dipartimento di Scienze Economiche e Sociali.
- 2010-2013 Assegno di ricerca nel settore s.d. SECS-P/01 presso l'Università Politecnica delle Marche, Dipartimento di Scienze Economiche e Sociali.



ESPERIENZA DIDATTICA (ultimi 5 anni)

- 2011-2012 - supporto alla didattica per il corso di Economia Politica II (sede di S.Benedetto del Tronto), Università Politecnica delle Marche.
- 2012-2013 - supporto alla didattica per i corsi di Economia Politica II (sedi di Ancona e di S.Benedetto del Tronto), Università Politecnica delle Marche.
 - ciclo di seminari di Econometria Applicata (48 ore, 6 cfu) per il dottorato di Management, Banking and Commodity Science, e per la laurea specialistica in Intermediari, Finanza Internazionale e Risk Management (IFIR), Sapienza Università di Roma.
- 2013-2014 - titolare del corso di **Economia degli Intermediari Finanziari** (72 ore, 9 cfu), sede di Latina, Sapienza Università di Roma;
 - ciclo di seminari di **Econometria Applicata** (40 ore) per il dottorato di Management, Banking and Commodity Science e per la laurea specialistica in Intermediari, Finanza Internazionale e Risk Management (IFIR), Sapienza Università di Roma;
 - corso di **Statistica per la Finanza** (24 ore) del Master in Banking and Finance, Sapienza Università di Roma;
- 2014-2015 - titolare del corso di **Economia degli Intermediari Finanziari** (72 ore, 9 cfu), sede di Latina, Sapienza Università di Roma;
 - ciclo di seminari di **Econometria Applicata** (40 ore) per il dottorato di Management, Banking and Commodity Science e per la laurea specialistica in Intermediari, Finanza Internazionale e Risk Management (IFIR), Sapienza Università di Roma;
 - corso di **Statistica per la Finanza** (24 ore) del Master in Banking and Finance, Sapienza Università di Roma;
- 2015-2016 - titolare del corso di **Economia degli Intermediari Finanziari** (72 ore, 9 cfu), sede di Latina, Sapienza Università di Roma;
 - ciclo di seminari di **Econometria Applicata** (32 ore) per il dottorato di Management, Banking and Commodity Science e per la laurea specialistica in Intermediari, Finanza Internazionale e Risk Management (IFIR), Sapienza Università di Roma;
 - corso di **Statistica per la Finanza** (24 ore) del Master in Banking and Finance, Sapienza Università di Roma;



PUBBLICAZIONI

Articoli su rivista

1. Riccetti L. (2012), "Using tracking error volatility to check active management and fee level of investment funds", **Global Business & Economics Review**, Vol. 14, N°3, pp. 139-158 (DOI:10.1504/GBER.2012.047801).
2. Palomba G., Riccetti L. (2012), "Portfolio frontiers with restrictions to tracking error volatility and value at risk", **Journal of Banking & Finance**, Vol. 36, pp. 2604-2615 (DOI: 10.1016/j.jbankfin.2012.05.014).
3. Riccetti L. (2012), "From Moments, Co-Moments and Mean-Variance weights to Copula Portfolio Allocation", **International Review of Applied Financial Issues and Economics**, Vol. 4, N°2.
4. Riccetti L. (2013), "A Copula-GARCH Model for Macro Asset Allocation of a Portfolio with Commodities: an Out-of-Sample Analysis", **Empirical Economics**, Vol. 44, N°3, pp. 1315-1336 (DOI: 10.1007/s00181-012-0577-1).
5. Riccetti L., Russo A., Gallegati M. (2013), "Leveraged Network-Based Financial Accelerator", **Journal of Economic Dynamics and Control**, Vol. 37, N°8, pp. 1626-1640 (DOI: 10.1016/j.jedc.2013.02.008).
6. Riccetti L., Russo A., Gallegati M. (2013), "Unemployment Benefits and Financial Factors in an Agent Based Macroeconomic Model", **Economics: The Open-Access, Open-Assessment E-Journal**, Vol. 7, 2013-42 (DOI: 10.5018/economics-ejournal.ja.2013-42).
7. Bargigli L., Gallegati M., Riccetti L., Russo A. (2014), "Network Analysis and Calibration of the "Leveraged Network-Based Financial Accelerator"", **Journal of Economic Behavior & Organization**, Vol. 99, pp.109-125 (DOI: 10.1016/j.jebo.2013.12.018).
8. Riccetti L., Russo A., Gallegati M. (2015), "An Agent-Based Decentralized Matching Macroeconomic Model", **Journal of Economic Interaction and Coordination**, Vol. 10, N°2, pp. 305-332, DOI: 10.1007/s11403-014-0130-8.
9. Riccetti L., Russo A., Gallegati M. (2016), "Financialisation and Crisis in an Agent-Based Macroeconomic Model", **Economic Modelling**, Vol. 52, Part A, January 2016, pp.162–172 (DOI:10.1016/j.econmod.2014.11.028).
10. Russo A., Riccetti L., Gallegati M. (forthcoming), "Increasing Inequality, Consumer Credit and Financial Fragility in an Agent Based Macroeconomic Model", **Journal of Evolutionary Economics**, disponibile on-line dal 12 Giugno 2015 (DOI:10.1007/s00191-015-0410-z).
11. Riccetti L., Russo A., Gallegati M. (forthcoming), "Stock Market Dynamics, Leveraged Network-Based Financial Accelerator and Monetary Policy", **International Review of Economics & Finance**, disponibile on-line dal 4 febbraio 2016 (DOI:10.1016/j.iref.2016.01.012).



Proceedings / Capitoli di libro

1. Russo A., Riccetti L., Gallegati M. (2014), "Growing Inequality, Financial Fragility, and Macroeconomic Dynamics: An Agent Based Model", *Advances in Social Simulation, Advances in Intelligent Systems and Computing*, Vol. 229, pp. 167-176 (DOI: 10.1007/978-3-642-39829-2_15)
2. Tutino F., Colasimone C., Brugnoli G.C., Riccetti L. (2014), "Intermediation model, bank size and lending to customers: is there a significant relationship? Evidence from Italy between 2008 and 2011", In Ted Lindblom, Stefan Sjögren, Magnus Willeson, *Governance, Regulation and Bank Stability*, Palgrave Macmillan.

Monografie

1. Riccetti L. (2010), "The Use of Copulas in Asset Allocation: When and How a Copula Model can be Useful?", ed. LAP Lambert (ISBN 978-3-8433-5251-2).

Curatele

1. Dornbusch R., Fischer S. e Startz R. (decima edizione italiana), a cura di Canullo G., Pettenati P., Gambini A., Riccetti L., "Macroeconomia", ed. McGraw-Hill.

Working paper

1. Palomba G., Riccetti L. (2013), "Asset Management with TEV and VAR Constraints: The Constrained Efficient Frontiers", Quaderno di Ricerca n°392 del Dipartimento di Scienze Economiche e Sociali dell'Università Politecnica delle Marche (ISSN: 2279-9575), Ottobre 2013.
2. Riccetti L., Russo A., Gallegati M. (2013), "Financial regulation in an agent-based macroeconomic model", working paper SSRN: <http://dx.doi.org/10.2139/ssrn.2345904>, Ottobre 2013. Paper accettato per la pubblicazione su "Macroeconomic Dynamics".
3. Riccetti L. (2014) "How risk managers should fix TEV and VaR constraints in asset management". Working paper SSRN: <http://dx.doi.org/10.2139/ssrn.2542545>, Dicembre 2014.



ATTIVITÀ DI RICERCA (ultimi 10 anni)

- 2010 Progetto "Cause ed effetti reali della crisi", Università Politecnica delle Marche.
- 2010-2013 Progetto "Comprendere e prevedere i rischi sistemici e l'instabilità finanziaria a livello globale", Università Politecnica delle Marche, nell'ambito del progetto europeo FOC-II ("Forecasting Financial Crises").
- 2014 Responsabile del progetto (finanziato con 4000€ dalla Sapienza Università di Roma) "Modelli ad agenti che rappresentino le interazioni tra economia reale e finanza".
- 2016 Partecipazione al progetto (finanziato con 4000€ dalla Sapienza Università di Roma, responsabile prof. Tutino) "Banche europee tra Basilea 3 e Unione Bancaria: impatti gestionali e strategie".

ALTRE ATTIVITÀ e RICONOSCIMENTI ACCADEMICI

- 2010-2015 **Referee:**
 - "Economic Notes".
 - "Economics Bulletin".
 - "Empirical Economics".
 - "International Journal of Computational Economics and Econometrics".
 - "International Review of Applied Financial Issues and Economics".
 - "Journal of Economic Behavior & Organization".
 - "Journal of Economic Interaction and Coordination".
 - "The Adriatic-Balkan Area from Transition to Integration", Edizioni Scientifiche Italiane.
 - "The Journal of Artificial Societies and Social Simulation".
 - "The Journal of Financial Management, Markets and Institutions".
- 2011-2015 **Relatore** presso conferenze
 - 3° Rimini Finance Workshop (RCEA, Rimini, Maggio 2011),
 - Replha (Università Cattolica del Sacro Cuore, Milano, Ottobre 2011),
 - Wehia 2012 (Università Paris 2 Pantheon-Assas, Parigi, Giugno 2012),
 - CEF 2012 (Praga, Giugno 2012),
 - XXI International Conference on Money, Banking and Finance (Luiss, Roma, Dicembre 2012),
 - IWcee14 - International Workshop on Computational



- Economics and Econometrics (CNR, Roma, Giugno 2014),
- 2nd International Workshop on “Financial Markets and Nonlinear Dynamics” (Parigi, Giugno 2015),
- Wehia 2015 (SKEMA Business School, Sophia Antipolis - Nizza, Maggio 2015),
- Wolpertinger Conference 2014, (Università Cattolica del Sacro Cuore, Milano, Settembre 2014),
- Convegno Estivo ADEIMF 2014, (Università Cattolica del Sacro Cuore, Milano, Settembre 2014),
- 2nd macro, banking and finance workshop (Università degli Studi di Roma “Tor Vergata”, Settembre 2014).
- 2013-2016 Socio ADEMIF.

ALTRE QUALIFICHE NON ACCADEMICHE (ultimi 10 anni)

- 2006 Gestore di fondi di fondi, nell’ufficio di asset management quantitativa di UBI Pramerica.
- 2006 Stage nell’ufficio di corporate finance di ING.
- 2006 Stage presso RiskArt, società di vendita-supperto del software RiskArt per il back-office/contabilità su strumenti finanziari derivati.