Marco **Bonomelli, PhD**

PhD in Analytics for Economics and Business

 | marco.bonomelli@unibg.it | Marco Bonomelli

Interessi di ricerca

Portfolio analysis and optimization - Sustainable investments - Risk Management - Energy and commodity markets - Machine Learning - Blockchain

Esperienze

Università degli Studi di Bergamo

Bergamo, Italia

Ricercatore a tempo determinato - tipo A

Lug. 2023 - Oggi

- Ricercatore nel settore STAT-04/A - Metodi matematici dell'economia e delle scienze attuariali e finanziarie

Protiviti

Milano, Italia

Consulente Aziendale

Mag. 2021 - Giu. 2023

- Attività di consulenza manageriale nel settore Risk and Sustainability con un focus su attività di Risk management ed in particolare sul mercato Energy e Utilities;
- Progettazione e implementazione di modelli quantitativi per l'analisi dei mercati;
- Definizione di regole di governance nella gestione di framework di Risk Management;
- Attività di coordinamento di persone nella realizzazione di diverse attività progettuali;
- Ruolo: Senior Consultant;
- Principali progetti seguiti:
  1. Ideazione, progettazione e sviluppo di un modello, implementato su R, per la definizione e rilevazione di informazioni privilegiate ai fini REMIT;
  2. Evoluzione di un modello per la rilevazione di fattispecie di manipolazione di mercato in ambito commodity;
  3. Implementazione di Risk Appetite Framework attravesto lo studio e l'ideazione di indicatori qualitativi e quantitativi (tra gli altri: finanziari, sostenibilità e operativi);
  4. Definizione di framework di Risk Management da un punto di vista organizzativo e gestionale.

Università degli Studi di Bergamo

Bergamo, Italia

Borsa di ricerca

Set. 2020 - Apr. 2021

- Progetto di ricerca: Computational Management Science Pricing, Risk And Optimization in Management Science

Università degli Studi di Roma Tre

Roma, Italia

Visiting Student

Nov. 2019 - Dic. 2019

Università degli Studi di Bergamo

Bergamo

Cultore della materia

Set. 2018 - Oggi

- Misurazione del rischio di credito e dei rischi operativi
- Matematica Finanziaria

Attività Didattiche

Attività didattiche

Bergamo

Università degli Studi di Bergamo

Set. 2023 - Oggi

- a.a. 2024/2025 insegnamento: Matematica Finanziaria (Docente titolare) - Impegno didattico 40 ore
- a.a. 2023/2024 insegnamento: Matematica Finanziaria - Impegno didattico 24 ore

Seminari dottorali

Bergamo

Università degli Studi di Bergamo

Set. 2024 - Oggi

- a.a. 2023/2024 Corso di dottorato: Management accounting and finance - Insegnamento: Python and application - Impegno didattico 10 ore

Attività di tutorato integrativo d'aula e individuale

Bergamo

UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI BERGAMO

Set. 2018 - Oggi

- a.a. 2022/2023 insegnamento: Matematica Finanziaria
- a.a. 2021/2022 insegnamento: Matematica Finanziaria - prot. n. 0141435/VII/16 - n. 0141433/VII/16
- a.a. 2020/2021 insegnamento: Matematica Finanziaria - prot. n. 31213/VII/16
- a.a. 2019/2020 insegnamento: Credit and operational risks measurement - prot. n. 58652/VII/16
- a.a. 2019/2020 insegnamento: Misurazione del rischio di credito e dei rischi operativi - prot. n. 58726/VII/16

Pubblicazioni

Models and Methods for portfolio selection

Collana della Scuola di Alta Formazione Dottorale

AUTORE

2021

- Pubblicazione della tesi di Dottorato all'interno della collana pubblicata dall'Università degli Studi di Bergamo, relativa alle tesi di Dottorato selezionate dal Comitato Scientifico
- DOI: https://dx.doi.org/10.13122/978-88-97413-50-9

Joint tails impact in stochastic volatility portfolio selection models

Annals of Operations Research

AUTORE

Febbraio 2020

- Articolo che studia l'impatto delle code congiunte (ricchezza e volatilità) del portafoglio rispetto alle scelte ottimali
- Annals of Operations Research volume 292, pages 833–848 (2020)
- (WoS, Scopus, Classe A area 13/D4)
- DOI: https://doi.org/10.1007/s10479-020-03531-w

Progetti di ricerca

GACR 19-11965S - A network approach to optimal portfolio and index tracking selection

Repubblica Ceca

CZECH SCIENCE FOUNDATION

2019

- Gruppo di ricerca coordinato da R. Giacometti

Analisi out of sample di portafogli costruiti con vincoli di dominanza stocastica

Bergamo

UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI BERGAMO

2019

- Gruppo di ricerca coordinato da R. Giacometti - Fondi di Ateneo 2019

Creazione di un indice di stile

Bergamo

UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI BERGAMO

2018

- Gruppo di ricerca coordinato da R. Giacometti - Fondi di Ateneo 2018

Presentazioni

30th European Conference on Operational Research

Dublin, Ireland

PERFORMANCE OF AN ENHANCED INDEX TRACKING MODEL

Giu. 2019

- Presentazione di un modello di selezione di portafoglio basato sulla quantile regression, con vincoli di enhancement e di dominanza stocastica.

33rd European Conference on Operational Research

Copenhagen, Danmark

ESG ENHANCED TRACKING PORTFOLIO WITH QUANTILE REGRESSION

Giu. 2024

- Presentazione di un modello di selezione di portafoglio basato sul tracking error con vincoli di enhancement con l'inserimento di vincoli ESG.

XLVIII AMASES Conferenc

Ischia, Italia

HOW SUSTAINABILITY RATING AND NEW DISCLOSURES AFFECT PORTFOLIO PERFORMANCE

Sep. 2024

- Presentazione di un modello di portafoglio basato costruito sulle evidenze di disagreement tra rating ESG.

Formazione

Università degli Studi di Bergamo

Bergamo, Italia

DOTTORATO DI RICERCA IN MODELLI E METODI PER L'ECONOMIA E L'AZIENDA (ANALYTICS FOR ECONOMICS AND BUSINESS)

Ott. 2016 - Apr. 2020

- Tesi: Models ad Methods for portfolio selection
- Esami sostenuti: Measure Theory and Stochastic Processes, Probability, Statistical Inference, Linear Programming, Convex Analysis, Game Theory, Microeconomics and Finance, Stochastic Processes, Stochastic Optimization, Econometrics, Risk Measures and Management
- Valutazione: Eccellente

ARPM

New York, USA

ADVANCED RISK AND PORTFOLIO MANAGEMENT BOOTCAMP

Ago. 2016

- Intensive training on data science for finance, quantitative risk modeling and portfolio construction
- Vincitore di borsa di studio finanziata da Eurizon Capital

Università degli Studi di Bergamo

Bergamo, Italia

LAUREA MAGISTRALE IN MANAGEMENT, FINANZA E BUSINESS INTERNAZIONALE

Set. 2013 - Apr. 2016

- Tesi: Il modello di Ang e Longstaff: un'analisi empirica del rischio sistemico in Europa
- Relatore: Prof.ssa Giacometti Rosella
- Valutazione: 110 \110 e Lode

Università degli Studi di Bergamo

Bergamo, Italia

LAUREA TRIENNALE IN ECONOMIA AZIENDALE - DIREZIONE D'IMPRESA

Set. 2010 - Ott. 2013

- Tesi: Governare una Public Utility: tra scelte economiche e politiche.
- Relatore: Prof.ssa Bettinelli Cristina
- Valutazione: 110 \110

Competenze

Software Matlab, R, GAMS, Stata, LaTeX, Eikon-Thomson Reuters

Lingue Inglese, conoscenza professionale

Il sottoscritto Bonomelli Marco, consapevole che le dichiarazioni false comportano l'applicazione delle sanzioni penali previste dall'art. 76 del D.P.R. 445/2000, dichiara che le informazioni riportate nel seguente curriculum vitae corrispondono a verità.

Marco Bonomelli