

SELEZIONE PUBBLICA PER TITOLI E COLLOQUIO PER IL CONFERIMENTO DI N. 8 ASSEGNI EXPERIENCED DI 36 MESI E DI N. 2 ASSEGNI EARLY STAGE DI 12 MESI PER LO SVOLGIMENTO DI ATTIVITA' DI RICERCA AI SENSI DELL'ART. 22 DELLA LEGGE N. 240/2010 PRESSO I VARI DIPARTIMENTI NELL'AMBITO DEL PROGRAMMA STARS (SUPPORTING TALENTED RESEARCHERS) 2019/2021 - Azione 1 - 2019 1^a TRANCHE - TIPO A - CUP: F56C18000670001

bandito con Decreto del Rettore Rep. n. 126/2019 del 28.02.2019, pubblicato all'Albo di Ateneo il 28.02.2019

CODICE N. 5

PROGETTO DI RICERCA

"Cause ed effetti della diffusione di portafogli sempre più overlapping sul rischio sistemico"

Struttura di ricerca: Dipartimento di Scienze aziendali, economiche e metodi quantitativi

Durata dell'assegno: 36 mesi

Area scientifica: 13 – Scienze economiche e statistiche

Settore concorsuale: 13/D4 – Metodi matematici dell'economia e delle scienze attuariali e finanziarie

Settore scientifico disciplinare: SECS-S/06 – Metodi matematici dell'economia e delle scienze attuariali e finanziarie

Responsabile scientifico: Prof.ssa GIACOMETTI Rosella

Il progetto vuole studiare il mercato degli ETF in Europa sotto diverse lenti: guardando ai singoli investitori e gestori di portafoglio proponiamo tecniche di replicazione innovative che hanno l'obiettivo di diminuire i costi di replica e minimizzare l'esposizione a rischio sistemico e contagio dovuto alla sovrapposizione di strategie di investimento simili. Dal punto di vista aggregato studiamo invece con un'ottica sia teorica sia empirica il ruolo dell'investimento passivo nell'aumentare il potenziale di rischio sistemico. Questo ci permetterà di migliorare la comprensione delle dinamiche di mercato e sviluppare indicatori adeguati per il monitoraggio del rischio sistemico.

Il progetto farà uso di tecniche tipiche della finanza quantitativa, ed altre più innovative legate all'analisi delle reti.