

Curriculum vitae

ROBERTA MELIS

Posizione attuale

01/2020- in corso Ricercatore a tempo determinato ai sensi dell'art. 24, comma 3, lettera b della legge 240/2010 in Metodi matematici dell'economia e delle scienze attuariali e finanziarie SC 13/D4, SSD SECS-S/06, Universitas Mercatorum, Università Telematica delle Camere di Commercio Italiane, Piazza Mattei 10, 00186 Roma.

02/2010- in corso Ricercatore associato CRENoS, Centro di Ricerche Economiche Nord Sud, Università degli Studi di Cagliari e di Sassari.

Istruzione e formazione

01/2006-02/2009 Dottorato di ricerca in Matematica per l'analisi economica e la finanza, conseguito il 25 Febbraio 2009 presso l'Università degli Studi di Napoli Federico II—Dipartimento di Matematica e Statistica, Scuola di dottorato in scienze economiche e statistiche.

Titolo della tesi: "I fondi pensione Pay-as-you-go: Rischio demografico e solvibilità."

Relatore: Prof. Alessandro Trudda.

2006-2007 Frequenza in qualità di uditor dell'XI Master in Economia e Finanza MEF, Università degli Studi di Napoli Federico II— Dipartimento di Economia.

1998-2004 Laurea in Economia e commercio (110/110), Università degli Studi di Sassari.

Tesi in matematica finanziaria dal titolo: "Pricing delle opzioni con barriera" - Relatore Prof. A. Trudda.

1991-1996 Maturità classica - Liceo Classico Mameli Tortolì (60/60).

Esperienze di ricerca

Dal 08/11/2018 al 08/07/2018 postdoc presso l'Université Catholique de Louvain, Institute de Statistique, Biostatistique et Sciences Actuarielles ISBA. Progetto PDR / FNRS in collaborazione con Université Libre de Bruxelles "Risk Management and Pricing in Finance and Insurance", supervisor Prof. Pierre Devolder e Prof. Griselda Deelstra.

15/03/2017 – 14/03/2018 Assegnista di ricerca ai sensi dell'art. 22, comma 2 della legge 240/2010 nel SSD SECS-S/06 Metodi matematici dell'economia e delle scienze attuariali e finanziarie, Università degli Studi di Sassari, Dipartimento di Scienze Economiche e Aziendali.

Progetto "Opzioni ambientali e innovazione tecnologica in una regione turistica", responsabile scientifico Prof. Paolo Russo.

28/07/2016-27/10/2016 Borsista Università degli Studi di Sassari, Dipartimento di Scienze Economiche e Aziendali.

Progetto "Capitale sociale e divari economici regionali", responsabile scientifico Prof. Angelo Antoci.

15/05/2013-14/05/2016 Ricercatore a tempo determinato ai sensi dell'art. 24, comma 3, lettera b della legge 240/2010 in Metodi matematici dell'economia e delle scienze attuariali e finanziarie SC 13/D4, SSD SECS-S/06, Universitas Mercatorum, Università Telematica delle Camere di Commercio Italiane, Facoltà di Economia, via Appia Pignatelli 62, 00178 Roma.

13/01/2012-15/05/2013 Assegnista di ricerca ai sensi dell'art. 51, comma 6 della legge 449/1997 nel SSD SECS-S/06 Metodi matematici dell'economia e delle scienze attuariali e finanziarie, Università degli Studi di Sassari, Dipartimento di Scienze Economiche e Aziendali. Responsabile scientifico Prof. Angelo Antoci.

15/01/2010-14/01/2012 Titolare di borsa di ricerca per giovani ricercatori della Regione Autonoma della Sardegna (L.R. 7/2007). Università degli Studi di Sassari, Dipartimento di Economia, Impresa e Regolamentazione DEIR.

Titolo della ricerca: "Valutazione e monitoraggio della solvibilità dei fondi pensione attraverso l'analisi dei rischi demografici e finanziari, nelle politiche di Asset Liability Management. Responsabile scientifico Prof. Alessandro Trudda.

Valutazione primo anno e finale progetto da parte di referee esterni: "Ottimo".

Esperienze di ricerca all'estero

11/2018-07/2018 Postdoc presso l'Université Catholique de Louvain, Institute de Statistique, Biostatistique et Sciences Actuarielles ISBA.

07/2018 Visiting professor su invito del Prof. Pierre Devolder, Université Catholique de Louvain, Institute de Statistique, Biostatistique et Sciences Actuarielles ISBA.

10/2016 Visiting professor su invito del Prof. Pierre Devolder, Université Catholique de Louvain, Institute de Statistique, Biostatistique et Sciences Actuarielles ISBA.

02/2015-03/2015 Visiting researcher su invito del Prof. Pierre Devolder, Université Catholique de Louvain, Institute de Statistique, Biostatistique et Sciences Actuarielles ISBA.

05/2012 Visiting researcher su invito del Prof. Pierre Devolder, Catholique de Louvain, Institute de Statistique, Biostatistique et Sciences Actuarielles ISBA. Réfèrent : Prof. Pierre Devolder.

03/2011-05/2011 Visiting researcher su invito del Prof. Pierre Devolder, Université Catholique de Louvain, Institute de Statistique, Biostatistique et Sciences Actuarielles ISBA.

Attività didattica

AA 2018/19 Università degli Studi di Sassari, Dipartimento di Scienze Economiche e Aziendali DISEA. Docente a contratto (art. 23 L 240/2010). Titolare del corso di Risk Management – (6 CFU), Corso di laurea magistrale in Economia Aziendale e Scienze Economiche.

AA 2016/17, AA 2017/18 Università degli Studi di Sassari, Dipartimento di Scienze Economiche e Aziendali DISEA. Docente a contratto (art. 23 L 240/2010). Titolare del corso di Risk Management – Modulo B (3 CFU), Corso di laurea magistrale in Economia Aziendale e Scienze Economiche.

AA 2013/14, 2014/2015, 2015/2016 Universitas Mercatorum, Università Telematica delle Camere di Commercio Italiane.

R.t.d. b Titolare del corso di Metodi Matematici (8 CFU) e supplente del corso di Matematica per le Decisioni Aziendali (4CFU), Corso di laurea in Gestione d'Impresa.

AA 2012/13 Facoltà di Economia, Libera Università di Bolzano, Piazza Università 1, Bolzano. Docente a contratto (art. 23 L 240/2010) Titolare del corso di Matematica per le Applicazioni Economiche (6CFU), Corso di Laurea in Management del Turismo, dello Sport e degli Eventi, sede di Brunico.

AA 2012/13 Università degli Studi di Sassari, Dipartimento di Scienze Economiche e Aziendali. Esercitazioni di Matematica per l'Economia e Matematica Generale, corso di Laurea in Economia e Management.

AA 2011/12 Università degli Studi di Sassari, Dipartimento di Scienze Economiche e Aziendali. Esercitazioni di Matematica per l'Economia e Matematica Generale, corso di Laurea in Economia e Management e Metodi Matematici, corso di laurea in Scienze Economiche

AA 2010/11 Università degli Studi di Sassari, Facoltà di Economia. Docente a contratto per attività didattiche integrative ai corsi di Matematica Generale (Corso A e B), Matematica per l'Economia, Corso di laurea in Economia e Management e Metodi Matematici, Laurea Magistrale in Scienze Economiche.

AA 2009/10 Università degli Studi di Sassari, Facoltà di Economia. Docente a contratto per attività didattiche integrative ai corsi di Matematica Generale (Corso A e B), Corso di laurea in Economia e Management e Metodi Matematici, Laurea Magistrale in Scienze Economiche. Esercitazioni di Scelte di Portafoglio e Matematica Attuariale (LM Scienze Economiche).

AA 2008/09 Università degli Studi di Sassari, Facoltà di Economia. Docente a contratto per attività didattiche integrative al corso di Matematica Finanziaria. Esercitazioni di Matematica Attuariale.

AA 2007/08 Università degli Studi di Sassari, Facoltà di Economia. Esercitazioni di Matematica Attuariale. Ricevimento studenti, assistenza esami di Matematica Finanziaria.

AA 2005/06 Università degli Studi di Sassari, Facoltà di Economia.

Docente a contratto per il corso di recupero di matematica finanziaria.

Cultore della materia, docente a contratto per attività didattiche integrative al corso di Matematica Finanziaria.

Esercitazioni di Metodi Matematici per l'Economia.

Referee per le riviste scientifiche

Plos One, Finance Research Letters, European Journal of Finance, Journal of Pension Economics and Finance Sustainability, Decisions in Economics and Finance, Applied Economics, Economics Bulletin, Entropy, Journal of Global Economics Management and Business Research, Arabian Journal of Business and Management Review.

Conoscenze linguistiche

Ottima conoscenza della lingua inglese (lettura, scrittura, espressione orale).

Conoscenza elementare della lingua francese (lettura, scrittura, espressione orale).

Pubblicazioni

- 1) Melis R., Trudda A. (2020) Critical issues of public pension system: the Italian case. In Peris-Ortiz, M, Domínguez Fabián, I., Alvarez-Garcia, J. and Devolder, P. (Eds), *Economic Challenges of Pension Systems – A Sustainability and International Management Perspective*, Springer International, ISBN: 978-3-030-37911-7, DOI: 10.1007/978-3-030-37912-4_19.
- 2) Melis R., Trudda A. (2018) Public pension system sustainability. In Chybalski, F. and Marcinkiewicz, E. (Eds.), *Contemporary problems of intergenerational relations and pension systems: a theoretical and empirical perspective*. Proceedings of PenCon 2018 Pensions Conference, 19-20 April 2018 Lodz, Poland, Lodz: Lodz University of Technology. ISBN: 978-83-7283-900-8.
- 3) Cadoni M., Melis R., Trudda A. (2017) Pension funds rules: paradoxes in risk control, *Finance Research Letters* 22: 20-29, ISSN: 1544-6123, doi: 10.1016/j.frl.2017.05.003.
- 4) Cadoni M., Melis R., Trudda A (2015) Financial crisis: a new measure for risk of pension fund portfolios, *Plos One* 10 (6), 10.1371/journal.pone.0129471, ISSN: 1932-6203.
- 5) Devolder P., Melis R. (2015) Optimal mix between pay-as-you-go and funding for pension liabilities in a stochastic framework, *Astin Bulletin* 45 (3): 551-575, DOI: 10.1017/asb.2015.14, ISSN: 0515-036.
- 6) Melis R., Trudda A. (2014) Mixed pension systems sustainability, *Contributi di Ricerca CRENoS*, 14/13, ISBN: 978-88-84-67-905-5.
- 7) Melis R. and Trudda A. (2012) Solvency indicators for partially unfunded pension funds, *Investment Management and Financial Innovations* 9 (4): 71-77, ISSN: 1810-4967.
- 8) Melis R., Trudda A. (2012) Financial and demographic risk impact on private PAYG pension system: the Italian case. *Actual Problems of Economics*, 133, n.7, 2012: 427-439, ISSN: 1993-6788.
- 9) Melis R., Trudda A. (2012) Financial and demographic risks in PAYG pension funds, *Economics Bulletin* 32 (2): 1320-1329, ISSN: 1545-2921.
- 10) Cadoni M., Melis R., Trudda A. (2012) Financial Crisis: a new measure for risk of pension funds assets, *Contributi di Ricerca CRENoS*, 12/31, ISBN: 978-88-84-67-780-8.
- 11) Melis R. and Trudda A. (2012) Financial and Demographic Risk Impact in Pay-As-You-Go Pension Funds, in *Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance MAF 2010*, C. Perna and M. Sibillo Eds, Springer, pp 305-313, ISBN: 978-88-470-2341-3, DOI: 10.1007/978-88-470-2342-0_36.
- 12) Melis R., Trudda A. (2010) Demographic risk indicators in pay-as-you-go pension funds, *Problems and Perspectives in Management* 8 (4): 117-126, ISSN: 1727-7051.
- 13) Melis R., Trudda A. (2010) Demographic Risk in Pay-As-You-Go Pension Funds: a solvency index, in *Atti del XVI Convegno di Teoria del Rischio*, Loffredo Editore, Napoli, ISBN: 978-88-7564-419-2, 165-186.
- 14) Melis R., Trudda A. (2009) Demographic Risk in Pay-As-You-Go Pension Funds, in *New Frontiers in Insurance and Bank Risk Management*, Mc Graw-Hill Italia, isbn 978-88-386-6061-0, 85-95.

Working papers:

- 15) Melis R. and Trudda A. (2019) Introducing a funding component in a PAYG pension system: a cost-benefit analysis. Submitted to an international journal.
- 16) Deelstra, G., Devolder P. and Melis R. (2019) Optimal successive annuitisations after retirement, working paper.
- 17) Melis R. (2018) A theoretical model for tourism stakeholders' preferences, working paper.

Presentazione a convegni

- 1) "Optimal successive annuitisations after retirement", AFIR ERM Colloquium 2019, Firenze, 21-24 Maggio 2019.
- 2) "Optimal successive annuitisations after retirement", Workshop "Fair Valuation in Insurance, 21-22 Marzo 2019 (su invito), Université Libre de Bruxelles, Bruxelles.
- 3) "On the sustainability of mixed pension systems", 4th European Actuarial Journal Conference, 10-11 Settembre 2018, Leuven, Belgio.
- 4) "Public Pension system sustainability", PenCon 2018 Pensions Conference, 19-20 April 2018 Lodz, Polonia, Lodz University of Technology.
- 5) "Funded and PAYG mixed pension systems' sustainability: an analysis of the long term equilibrium", XLI Convegno A.M.A.S.E.S, Cagliari, 14-16 Settembre 2017.
- 6) "Funded and PAYG mixed systems sustainability: stochastic risk indicators analysis", MAF 2014 Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance, Vietri sul mare 22-24 Aprile 2014.
- 7) "Risk indicators for pay-as-you-go pension funds", XVII Meeting on Risk Theory, Campobasso, 7 Settembre 2010.
- 8) "Risk indicators for unfunded pension funds", XXXIV Convegno A.M.A.S.E.S (Associazione di Matematica applicata alle Scienze Economiche e Sociali), Macerata, 1-4 Settembre 2010.
- 9) "Solvency index for pay-as-you-go pension funds", X International Conference SIMAI 2010, Cagliari 21-25 Giugno 2010.
- 10) "Financial and Demographic Risks Impact in Pay-As-You-Go Pension Funds", International Conference MAF 2010 Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance, Ravello 7-9 Aprile 2010.
- 11) "Demographic Risks in Pay-As-You-Go Pension Funds: a solvency index"- XVI XVII Meeting on Risk Theory – Campobasso, 18 Settembre 2009.
- 12) "Some Remarks on Demographic Risks in Pay-As-You-Go Pension Funds"- XXXIII Convegno A.M.A.S.E.S., Parma, 1-4 Settembre 2009.
- 13) "Demographic Risk in Pay-As-You-Go Pension Funds", X Italian-Spanish Congress of Financial and Actuarial Mathematics"- Cagliari, 23-25 Giugno 2008.

Organizzazione convegni

- 1) Membro del comitato organizzatore del XLI Convegno A.M.A.S.E.S, Cagliari, 14-16 Settembre 2017.

Partecipazione a progetti di ricerca

11/2018-8/2019. Componente del progetto PDR / FNRS Université Catholique de Louvain e Université Libre de Bruxelles "Risk Management and Pricing in Finance and Insurance", titolari Prof. Pierre Devolder and Prof. Griselda Deelstra.

01/06/2013-30/11/2015 Titolare Dott. Alessandro Trudda, Università di Sassari.

"Asset allocation degli enti previdenziali: monitoraggio della sostenibilità di lungo periodo".

Progetto di ricerca Fondazione Banco di Sardegna.

06/2015-08/2015 Componente del progetto "Valutazione del Fondo Perequativo", Universitas Mercatorum e Unioncamere.

11/2014-3/2015 Componente del progetto "Valutazione del Fondo Perequativo", Universitas Mercatorum e Unioncamere.

15/01/2010-14/01/2012 Titolare Dott.ssa Roberta Melis

"Valutazione e monitoraggio della solvibilità dei fondi pensione attraverso l'analisi dei rischi demografici e finanziari, nelle politiche di Asset Liability Management".

Progetto finanziato dalla Regione Autonoma Sardegna, Borse di ricerca giovani ricercatori (L.R. 7/2007).

01/06/2010-30/11/2011 Titolare Prof. Angelo Antoci, Università di Sassari.

"Strumenti finanziari innovativi per sostenere politiche di protezione ambientale".

Progetto di ricerca Fondazione Banco di Sardegna.

01/06/2009-30/11/2010 Titolare Dott. Alessandro Trudda, Università di Sassari.

"Fondi pensione: valutazione e controllo dei rischi demografici e finanziari nelle politiche di asset-liability management".

Progetto di ricerca Fondazione Banco di Sardegna.

Associazioni scientifiche

Socio AMASES, Associazione di Matematica Applicata alle Scienze Economiche e Sociali, dal 2009.

Ricercatore associato CRENoS, Centro di Ricerche Economiche Nord Sud, Università di Cagliari e Sassari, dal 2010.

Roberto Melis

Roma, 16/01/2020