

GIUSEPPE MONTESI

giuseppe.montesi@unisi.it

ATTIVITÀ PROFESSIONALE	Partner & Amministratore Valuecube - Software Engineering - www.valuecubereseach.com Responsabile ricerca e sviluppo applicazioni analisi finanziaria. Responsabile sviluppo app nell'ambito del framework "Bloomberg AppPortal". Professore a contratto, Scuola di Economia e Management, Università di Siena. Consulenza e formazione per conto di banche, imprese, Università e scuole di formazione.
AREE DI INTERESSE	Financial Statement Analysis, Corporate Finance, Credit Risk Analysis, Investments Valuation. Bank Capital Adequacy & Planning, Bank Stress Testing. Progettazione e modellizzazione di sistemi di simulazione stocastica per l'analisi previsionale di banche e corporate. Progettazione e realizzazione di applicazioni software per l'analisi finanziaria e quantitativa in ambiente Java, C#, Matlab, Mathematica.
CURRICULUM ACCADEMICO	1994: Diploma di Specializzazione in Discipline Bancarie, 70/70 e lode, Scuola di Specializzazione in Discipline Bancarie, Università di Siena. Titolo della tesi di specializzazione: "Ottimizzazione e Diversificazione Internazionale del Portafoglio". 1993: Corso in "Stochastic Methods in Economics and Finance", tenuto dal Prof. A.G. Malliaris, Loyola University. 1992: Visiting scholar presso l'Institute of European Finance - University of North Wales (UK). 1990: Diploma di Laurea, 110/110 e lode, in Scienze Economiche e Bancarie, Università di Siena. Titolo della tesi di laurea: "Uno Schema Logico ed Interpretativo delle Dinamiche dei Mercati Internazionali dei Capitali".
WORKING PAPER	"Framework Metodologico di Integrazione dei Rischi Climatici nel Rischio di Credito." Workshop ABI (Associazione Bancaria Italiana): L'integrazione dei Fattori di Rischio Climatici e Ambientali: Strategia, Framework Risk Management, Propensione al Rischio, Stress Test e Informativa al Pubblico. (30 Marzo/1 Aprile, 2021). "Banking System in Time of Covid-19: A Reverse Analysis on Loss Absorption Capacity, Lending to the Economy and Market Valuation", con A. Dicanio. Paper presented at the interdisciplinary Academic Event: "Bank Resolution in Times of COVID-19", Single Resolution Board/Florence School of Banking and Finance, Brussels, November 27, 2020. "Stochastic Optimization System for Bank Reverse Stress Testing" con G. Papiro, M. Fazzini, A. Ronga. Paper presented at the 2019 EBA Policy Research Workshop: "The Future of Stress Tests in the Banking Sector - Approaches, Governance and Methodologies", EBA, Paris, November 27-28, 2019. "Bank Stress Testing: A Stochastic Simulation Framework to Assess Banks' Financial Fragility" con G. Papiro, Draft October 2015. Paper presented at the conference: "Stress Testing and Macro-prudential Regulation: A Trans-Atlantic Assessment", Systemic Risk Centre, LSE, London, October 29-30, 2015. "Gleaning Trading Signals from Implied Volatility Surface", Bloomberg Workshop, London October 22 2013. "Bank Stress Testing: A Stochastic Simulation Framework", con G. Papiro, Draft June 2013.
ALCUNE PUBBLICAZIONI	"Banks in Time of Covid-19: Loss Absorption Capacity, Lending and Market Valuation", con Dicanio A., Bancaria, 2, 2021. "Stochastic Optimization System for Bank Reverse Stress Testing" con G. Papiro, M. Fazzini, A. Ronga. Journal of Risk Financial Management, 13, 174. "Credit Risk Forecasting Modelling and Projections Under IFRS 9", con Papiro G., Ugolini L. and Ammendola G., Journal of Risk Management in Financial Institutions Vol. 12, 2019. "Bank Stress Testing: A Stochastic Simulation Framework to Assess Banks' Financial Fragility" con G. Papiro, Risks 2018, 6, 82. "Big Data-Driven Stochastic Business Planning and Corporate Valuation", Con R.M. Visconti e G. Papiro, Corporate Ownership and Control 15(3), April 2018. "Stress Testing: Un Modello di Simulazione Stocastica e un Confronto con l'Esercizio EBA/BCE 2014", con P. Nicastro e G. Papiro, Bancaria, Febbraio 2015. "Risk Analysis Probability of Default: A Stochastic Simulation Model", con G. Papiro, Journal of Credit Risk, September 2014. "Simulazioni e Corporate Finance Analysis", con G. Papiro, Franco Angeli, 2008. "La Misurazione del Rischio di Credito negli Enti Locali", con G. Papiro, AF-Analisi Finanziaria n.58, 2005. "Approccio RAPD e Stima Top-Down della Probabilità di Default di un Settore", con G. Papiro, AF-Analisi Finanziaria, No. 55, 2004. "Stima della Probabilità di Default e del Pricing in un'Operazione di Project Financing." con G. Papiro e G. Rescigno, Amministrazione & Finanza, No. 17, 2003. "L'Analisi del Rischio di Credito in una Prospettiva di Finanza Aziendale", con G. Papiro, Amministrazione & Finanza, No. 11, 2003.
PUBBLICAZIONI LAVOCE.INFO	"Banche Troppo Grandi per Funzionare", lavoce.info, 02-09-2015. "Quante Sorprese nello Stress Test", lavoce.info, 28-11-2014. "La Pelle d'Oca e i Mercati", lavoce.info, 28-07-2005. "Antonveneta, i Paradossi di una Battaglia", lavoce.info, 28-04-2005. "L'Ambigua Privatizzazione della Rai", lavoce.info, 02-03-2005. "L'Analisi Finanziaria si è Fermata a Parma", lavoce.info, 27-01-2004.