

Prof. Rosa Cocozza, M.A., Ph.D.

🏠 Napoli (IT), 29 gennaio 1968

🏛️ Università degli Studi di Napoli Federico II

🏢 Dipartimento di Economia, Management, Istituzioni

📍 Via Cinthia Monte S. Angelo 80126 Napoli

✉️ rosa.cocozza@unina.it

🐦 @RositaCocozza

🌐 <https://www.docenti.unina.it/rosa.cocozza>

🌐 <https://www.linkedin.com/in/rosa-cocozza-73aaa04/>

Presentazione

Laureata in Economia e Commercio presso l'Università degli Studi di Napoli Federico II ed abilitata alla professione di Dottore Commercialista, Rosa Cocozza è Dottore di Ricerca in Economia Aziendale e Master in *Banking and Finance* presso la U.C.N.W. (UK).

Professore Ordinario di Economia degli Intermediari Finanziari, è dal 1994 nei ruoli di Federico II, dove dal 2014 è altresì *Presidente del Consiglio di Amministrazione del Fondo Pensione del Personale Docente, Tecnico e Amministrativo dell'Università degli Studi di Napoli Federico II e della Università degli Studi della Campania Luigi Vanvitelli*.

Già esponente del Collegio Sindacale di banche, e più volte su designazione della Banca d'Italia esponente di Comitati di Sorveglianza per Amministrazioni Straordinarie di banche e holding finanziarie, è, attualmente, su incarico del Ministro dell'Economia e delle Finanze, componente della Commissione Fondo Indennizzo Risparmiatori nonché su incarico della Conferenza dei Rettori delle Università Italiane (CRUI) Delegato nell'Assemblea del Fondo Pensione Perseo-Sirio in rappresentanza degli Atenei italiani. E', inoltre, esponente del Comitato Tecnico-Scientifico dell'Associazione Italiana Financial Industry Risk Managers (AIFIRM) nonché Vice Presidente dell'Associazione dei Docenti di Economia dei Mercati e degli Intermediari Finanziari e Finanza d'Impresa (Società Scientifica ADEIMF) ed esponente della Commissione Monografie dell'Accademia Italiana di Economia Aziendale (Società Scientifica AIDEA). Ha preso parte come delegato scientifico a B2o engagement group istituito dal G20 e finalizzato alla formulazione di raccomandazioni di policy. Vanta qualificata esperienza didattica in ogni livello della formazione accademica oltre che significativa esperienza di natura manageriale. Attualmente è titolare dei corsi di Banche e intermediari finanziari, Economia dei mercati e degli intermediari finanziari, di Gestione e Controllo dei Rischi e di Progettazione e analisi dei prodotti finanziari. Autrice di numerose pubblicazioni, vede censita la propria attività nei principali database scientifici internazionali.

Percorso formativo

Formazione Universitaria

- 1996 🏠 M.A. in Banking and Finance, University College of North Wales Bangor (UK)
Tesi: *An Analysis of the Variability of Interest Margin for Italian Banks over the period 1983-1992*
- 1995 🏠 Dottorato di Ricerca in Economia Aziendale, VII Ciclo
Tesi: *Gli effetti delle oscillazioni dei tassi sulle aziende di credito: aspetti teorici e verifica empirica*
- 1991 🏠 Abilitazione alla Professione di Dottore Commercialista, Università degli Studi di Napoli Federico II
- 1986 - 1991 🏠 Laurea *magna cum laude* in Economia e Commercio, Università degli Studi di Napoli Federico II
Tesi: *Banche d'Affari - Potenzialità e Realtà*

Lingue straniere

- 2021 🏠 Anfängerkurs Deutsch, Federico II University Language Center
- 1993 🏠 Certificate of Proficiency in English CPE, University of Cambridge (UK)
- 1991 🏠 Certificat Pratique de Langue Français premier degre, Université des Langues et Lettres de Grenoble (FR)

Carriera Accademica

Università degli Studi di Napoli Federico II

- 2011 - in corso 🏠 Professore Ordinario di Economia degli intermediari finanziari
- 2001 - 2011 🏠 Professore Associato di Economia degli intermediari finanziari
- 1994 - 2001 🏠 Ricercatore di Economia degli intermediari finanziari

Incarichi professionali

- 2021 – in corso
- Consigliere di Amministrazione di Mefop, Società per Azioni, su designazione del Ministero dell'Economia e delle Finanze in qualità di socio maggioritario.
 - Presidente del Collegio Sindacale della Banca del Catanzarese, Società Cooperativa. Gruppo Iccrea Banca.
- 2020 – in corso
- Delegato nell'Assemblea dei Delegati del Fondo Pensione Perseo Sirio, in rappresentanza delle Università in qualità di datori di lavoro, su nomina della Conferenza dei Rettori delle Università Italiane.
- 2019 – in corso
- Esponente della Commissione Tecnica istituita ai sensi della legge del 30 dicembre 2018 n.145, come novellata dalla L. 28 giugno 2019, n. 58 ed integrata dalla Legge di bilancio 2020 – L. 27/12/2019 n. 160, per il Fondo Indennizzo Risparmiatori, su nomina del Ministro dell'Economia e delle Finanze.
- 2014 – in corso
- Presidente del Consiglio di Amministrazione del Fondo Pensione del Personale Docente, Tecnico ed Amministrativo dell'Università degli Studi di Napoli Federico II e della Università degli Studi della Campania Luigi Vanvitelli, iscritto all'albo dei Fondi Pensione Preesistenti tenuto dalla Commissione di Vigilanza sui Fondi Pensione al numero 1423.
- 2020 – in corso
- Titolare della Funzione di Gestione del Rischio del medesimo Fondo Pensione
- 2020 – 2021
- Esponente della Commissione dei Saggi per la nomina del Collegio Sindacale dell'Organismo Confidi Minori, costituito ai sensi dell'art. 112 bis del TUB (incarico concluso).
 - Esponente della B20 Task Force Finance and Infrastructure su designazione dell'Università degli Studi di Napoli Federico II, Partner Scientifico di B20, Engagement Group istituito dal G20 con l'obiettivo di formulare raccomandazioni di policy indirizzate alla Presidenza del G20 (incarico concluso).
 - Esponente della B20 Special Initiative on Women Empowerment, Engagement Group istituito dal G20 (incarico concluso).
- 2019 – 2020
- Esponente del Comitato di Sorveglianza della Banca Credito Cooperativo San Biagio Platani in Amministrazione Straordinaria, Società Cooperativa, su nomina della Banca d'Italia.
- 2017 – 2020
- Esponente del Collegio Sindacale, sindaco effettivo della Banca Credito Cooperativo Campania Centro, Società Cooperativa.
 - Esponente dell'Organismo di Vigilanza D. Lgs. 231 della Banca Credito Cooperativo Campania Centro, Società Cooperativa.
- 2015 – 2017
- Esponente del Comitato di Sorveglianza di GBM Banca in Amministrazione Straordinaria, su nomina della Banca d'Italia.
 - Esponente del Comitato di Sorveglianza di GBM Holding in Amministrazione Straordinaria, su nomina della Banca d'Italia.

Comitati Scientifici

- 2020 – in corso
- Esponente del Comitato Tecnico-Scientifico dell'Associazione Italiana Financial Industry Risk Managers AIFIRM. <https://www.aifirm.it/chi-siamo/organi-sociali-docs/>
- 2021 – in corso
- Esponente del Comitato Scientifico del Corso di Alta Formazione sulla Finanza Etica Caffè, Università degli Studi di Napoli Federico II.

Insegnamenti

Università degli Studi di Napoli Federico II

- 2021 – in corso
- Banche e intermediari finanziari
- 2010 – in corso
- Economia dei mercati e degli intermediari finanziari
- 2005 – in corso
- Progettazione e analisi dei prodotti finanziari
- 2002 – in corso
- Gestione e controllo dei rischi dell'intermediazione finanziaria, corso certificato AIFIRM

Insegnamenti (continua)

- 2012 – 2015 📖 Vigilanza e controlli interni
1997 – 2001 📖 Economia delle aziende di assicurazione

Università Suor Orsola Benincasa, Napoli

- 2012 – 2016 📖 Mercati Finanziari

Università Guido Carli LUISS, Roma

- 2013 – 2015 📖 Risk Management e Credit Scoring, corso in lingua inglese

Seconda Università degli Studi di Napoli, Capua (CE)

- 1997 – 2001 📖 Economia degli intermediari finanziari

Collegi Dottorato

- 2021 – in corso 📖 Management Università degli Studi di Napoli Federico II, XXXVII ciclo (durata 3 anni)
2020 – in corso 📖 Management Università degli Studi di Napoli Federico II, XXXVI ciclo (durata 3 anni)
2016 – 2019 📖 Management Università degli Studi di Napoli Federico II, XXXII ciclo (durata 3 anni)
2013 – 2016 📖 Economia Università degli Studi di Napoli Federico II, XXIX ciclo (durata 3 anni)
2002 – 2013 📖 Matematica per l'analisi economica e la finanza Università degli Studi di Napoli Federico II, dal XVIII al XXV ciclo (durata 3 anni)
 * 2010-2013 Coordinatore
 📖 *A Two-Factor Binomial Model for Pricing Hybrid Securities: A Simplified Approach* 2013
 📖 *La valutazione comparata delle opzioni strutturate: un'applicazione al caso delle Outside barrier options e delle correlation digital options* 2012
 📖 *Basilea 2 – Effetti della sua applicazione sulla gestione del Rischio di Credito. Agenzie Esterne di Rating e Metodo Standardizzato vs Metodo Avanzato* 2010
2000 – 2002 📖 Scienze bancarie e finanziarie Università della Calabria, dal XVI al XVII ciclo (durata 3 anni)

Altre attività istituzionali

Responsabile Gare Studentesche e Tutor Squadre

- 2015 – in corso 📖 PRMIA Risk Management Challenge
 🏆 Medaglia d'oro Frankfurt Regional Round 2021
 * Menzione Speciale Global Chapter 2020
 🏆 Medaglia d'oro Hungarian Chapter 2020
 🏆 Medaglia di bronzo Global Chapter 2017
 🏆 Medaglia d'oro European Chapter 2017
 🏆 Medaglia d'argento European Chapter 2016
2013 – 2018 📖 CFA Fund Management Challenge (solo su invito)
 🏆 Medaglia d'oro 2017
 🏆 Medaglia d'argento 2018
2012 📖 RETC 2012 Rotman European Trading Competition (su invito)
2011 – 2012 📖 Bloomberg Trade Ideas
 🏆 Medaglia d'oro 2012
 🏆 Medaglia d'oro 2011

Commissioni Dipartimentali

- 2020 – in corso 📖 Coordinamento Ricerca e Terza Missione
2017 – in corso 📖 Orientamento in uscita. Placement e Relazioni con Aziende, Enti e Ordini Professionali
 📖 Progetti Di Ricerca

Altre attività istituzionali (continua)

Incarichi Istituzionali Accademici e Compiti Gestionali

- 2014 – in corso ■ Presidente del Fondo Pensione del Personale Docente, Tecnico ed Amministrativo dell'Università degli Studi di Napoli Federico II e della Università degli Studi della Campania Luigi Vanvitelli, CF 95007180631
- 2012 – in corso ■ Esponente del Gruppo di Assicurazione della Qualità per il Corso di Laurea Magistrale in Finanza
- 2012 – 2019 ■ Esponente del Gruppo di Assicurazione della Qualità per il Corso di Laurea Triennale in Economia delle Imprese Finanziarie
- 2013 – 2016 ■ Coordinatore del Corso di Laurea Magistrale in Finanza
- 2012 – 2016 ■ Responsabile del Gruppo del Riesame del Corso di Laurea Magistrale in Finanza
- Responsabile del Gruppo del Riesame del Corso di Laurea Triennale in Economia delle Imprese Finanziarie

Attività Didattica Internazionale

- 2018 ■ The Islamia University of Bahawalpur, Bahawalpur (PK)
Valutazione curriculare per *Professorship of Economics Department of Economics*
- 2007 ■ Universidad de Castilla La Mancha, Albacete (ES)
Commissario per Dottorato Europeo in *Economia Financiera y Contabilidad*
■ *Testing One-Factor Immunization Strategies in the Spanish Treasury Market*
<https://www.educacion.gob.es/teseo/mostrarRef.do?ref=418659>
- 1995 ■ International Business School of Moscow, Mosca (RU)
Docente TACIS, Programma europeo volto a favorire il passaggio all'economia di mercato ed al consolidamento della democrazia e lo stato di diritto negli Stati partner (NIS e Mongolia)
<https://eur-lex.europa.eu/legal-content/IT/TXT/PDF/?uri=CELEX:51996DC0345&qid=1582723518430&from=EN>

Premi e Riconoscimenti

- 2013 – in corso ■ Label AIFIRM per il Corso di Gestione e Controllo dei Rischi dell'Intermediazione Finanziaria
- 2012 – 2013 ■ 2 Economi Rettorali
- 2011 – 2018 ■ 9 Podi come *tutor* di squadre studentesche in gara
- 2013 ■ Procedura selettiva attribuzione premiale
Vincitrice Sezione Didattica
- 2011 ■ Procedura selettiva attribuzione premiale
Vincitrice Sezione Didattica
Vincitrice Sezione Ricerca
- 2002 ■ Vincitrice procedura selettiva Incentivazione Federico II
- 2001 ■ Vincitrice procedura selettiva Incentivazione Federico II

Affiliazioni scientifiche

- 2018 – in corso ■ CASMEF Centro Arcelli per gli Studi Monetari e Finanziari, Research Fellow
<https://www.luiss.it/ricerca/centri-e-altre-strutture/centro-arcelli-gli-studi-monetari-e-finanziari-casmeff>
- 2017 – in corso ■ AIDEA, Accademia Italiana di Economia Aziendale
<https://www.accademiaaidea.it/>
* 2019 - in corso Commissione Monografie

Affiliazioni scientifiche (continua)

- 2013 – in corso ■ AIFIRM, Associazione Italiana Financial Industry Risk Managers
* 2020-2021 Coordinatore Commissione: Model Risk Management post Covid 19
📄 Position Paper <https://www.aifirm.it/wp-content/uploads/2016/03/2021-Position-Paper-28-Model-Risk-Management.pdf>
* 2020 Commissione: La Governance Bancaria durante la crisi Covid-19
📄 Position Paper https://www.aifirm.it/wp-content/uploads/2020/07/2020-PositionPaper22-Covid2019_e_Governance_bancaria.pdf
* 2019-2020 Commissione: Rischio di tasso del banking book (IRRBB): evoluzioni normative in atto ed implicazioni gestionali
📄 Position Paper <http://www.aifirm.it/wp-content/uploads/2021/02/2020-Position-Paper-25-IRRBB.pdf>
* 2016-2017 Commissione: il ruolo RAF nella governance delle banche
📄 Position Paper <http://www.aifirm.it/wp-content/uploads/2017/04/2017-Position-Paper-9-Il-ruolo-del-RAF-nella-governance-delle-banche-sottoposto-a-CTS.pdf>
<https://www.aifirm.it/>
- 2012 – in corso ■ AIFIRM, Risk Management Magazine. Consigliere Scientifico.
<https://www.aifirm.it/newsletter/progetto-editoriale>
- 2007 – in corso ■ IPE Business School, Istituto per ricerche ed attività educative.
Coordinatore Modulo Risk Management per il Master in Finanza Avanzata.
<http://www.ipeistituto.it/master/>
- 2005 – in corso ■ ADEIMF, Associazione dei Docenti di Economia di Economia degli Intermediari e dei Mercati Finanziari e Finanza d'Impresa. Socio Fondatore.
* 2019 - in corso Vice Presidente
<http://www.adeimf.it/>
- 2002 – in corso ■ The Wolpertinger Club, Association of University Academics in the Economics of Financial Systems and Financial Institution.
<http://wolpertinger.bangor.ac.uk/>

Principali esiti dell'attività di Ricerca

Monografie

- 1 Porzio, C., Previali, D., Cocozza, R., Miani, S. & Pisani, R. (Cur.). (2011). *Economia delle imprese assicurative*. Milano, IT, McGraw-Hill Education.
- 2 Cocozza, R. (2000a). *Il prezzo del credito. Note sulla determinazione del premio per il rischio*. Napoli, IT, Liguori Editore.
- 3 Cocozza, R. (2000b). *La gestione del rischio di tasso di interesse nelle imprese di assicurazione sulla vita*. Padova, IT, CEDAM.
- 4 Cocozza, R. (1997b). *La rappresentazione dei rischi sistemici nei bilanci delle banche e il fondo per rischi bancari generali*. Napoli, IT, Cuen.

Dissertazioni

- 1 Cocozza, R. (1995a). *Gli effetti delle oscillazioni dei tassi di interesse sulle aziende di credito: aspetti teorici e verifica empirica* (PhD thesis). Dottorato di Ricerca in Economia aziendale VII ciclo. Roma, Firenze, IT.
- 2 Cocozza, R. (1994a). *An Analysis of the Variability of Interest Margin for Italian Commercial Banks over the Period 1983-1992* (MA thesis). University College of North Wales. Bangor, Gwynedd, UK.

Articoli Scientifici

- 1 Cocozza, R., Curcio, D. & Pacifico, A. (2020). Do global markets imply common fear? *Rivista Bancaria Minerva Bancaria*, 1-2, 7-45.
- 2 Cocozza, R., Curcio, D. & Quaranta, A. (2020). Profilatura del cliente, adeguatezza dei prodotti finanziari e modelli di selezione del portafoglio di investimento. *Rivista Bancaria Minerva Bancaria*, 4, 27-60.

- 3 Coccozza, R. & Masera, R. (2020). "Size and fit" of piecemeal liquidation processes. Aggravating circumstances and side effects. *Open Review of Management, Banking and Finance*, (1/12/2020), online.
<https://openreviewmbf.org/2020/12/01/size-fit-of-piecemeal-liquidation-processes-aggravating-circumstances-and-side-effects/>
- 4 Curcio, D., Borri, N., Cerrone, R. & Coccozza, R. (2019). Financial intermediaries' asset-liability dependency and low-interest-rate environment: evidence from EU life insurers. *Journal of Financial Management, Markets and Institutions*, 7, 1940003-1-25. <https://doi.org/https://doi.org/10.1142/S2282717X19400036>
- 5 Coccozza, R. (2018e). Regulatory framework adequacy: quesiti aperti per le banche di dimensione non qualificata. *Rivista Bancaria Minerva Bancaria*, (4), 109-115.
https://editriceminervabancaria.it/wp-content/uploads/2018/12/2018_RB_04_Sommario.pdf
- 6 Cerrone, R., Coccozza, R., Curcio, D. & Gianfrancesco, I. (2017). Does prudential regulation contribute to effective measurement and management of interest rate risk? Evidence from Italian banks. *Journal of Financial Stability*, 30, 126-138. <https://doi.org/https://doi.org/10.1016/j.jfs.2017.05.004>
- 7 Coccozza, R., Curcio, D. & Gianfrancesco, I. (2015b). Nonmaturity deposits and banks' exposure to interest rate risk: issues arising from the Basel regulatory framework. *Journal of Risk*, 17(5), 99-134.
<https://doi.org/https://doi.org/10.21314/JOR.2015.310>
- 8 Coccozza, R., Gallo, A. & Xella, G. (2011). Embedded Option in Pension Funds: the Case of Conditional Indexation Policy. *Insurance Markets and Companies: Analyses and Actuarial Computations*, 2(3), 15-24.
https://businessperspectives.org/images/pdf/applications/publishing/templates/article/assets/4515/IMC_2011_3_Coccozza.pdf
- 9 Coccozza, R., Gallo, A. & Xella, G. (2010a). The Fair Value of Pension Liabilities: the Case of Embedded Option in Scenario Analysis. *Investment Management and Financial Innovations*, 7(2), 149-158.
https://businessperspectives.org/images/pdf/applications/publishing/templates/article/assets/3355/imfi_en_2010_02cont_Coccozza.pdf
- 10 Coccozza, R. & Orlando, A. (2009). Managing Structured Bonds: An Analysis using RAROC and EVA. *Journal of Risk Management in Financial Institutions*, 2, 409-426.
- 11 Coccozza, R., Di Lorenzo, E., Orlando, A. & Sibillo, M. (2008c). The value at risk of the mathematical provision: Critical issues. *Journal of Risk Management in Financial Institutions*, 1, 311-319.
- 12 Coccozza, R., Di Lorenzo, E. & Sibillo, M. (2007a). The Current Value of the Mathematical Provision: A Financial Risk Prospect. *Problems and Perspectives in Management*, 5(2), 127-140. https://businessperspectives.org/images/pdf/applications/publishing/templates/article/assets/605/PPM_EN_2007_02_Coccozza.pdf
- 13 Coccozza, R. & Di Lorenzo, E. (2006). Solvency of Life Insurance Companies: Methodological Issues. *Journal of Actuarial Practice*, 13, 81-102.
<https://digitalcommons.unl.edu/cgi/viewcontent.cgi?article=1003&context=joap>
- 14 Coccozza, R., Di Lorenzo, E. & Sibillo, M. (2004b). Methodological Problems in Solvency Assessment of an Insurance Company. *Investment Management and Financial Innovations*, 1(2), 95-102.
https://businessperspectives.org/images/pdf/applications/publishing/templates/article/assets/1113/imfi_en_2004_02_Coccozza.pdf
- 15 Coccozza, R. (1995b). Oscillazioni dei tassi e performance delle banche italiane nel periodo 1983-1992. *Banca Impresa Società*, 14, 441-464.

Saggi in Volumi Collettanei

- 1 Coccozza, R. (2020d). Intermediazione creditizia e credito deteriorato: un binomio (im)possibile? (S. Dell'Atti, Cur.). In S. Dell'Atti (Cur.), *Studi in onore di Antonio Dell'Atti*, Milano, IT, Giuffrè Francis Lefebvre.
- 2 Coccozza, R., Curcio, D. & Gianfrancesco, I. (2019). NMDs and IRRBB: A Methodological Proposal for a Behavioural Model (U. Crespi & M. Formenti, Cur.). In U. Crespi & M. Formenti (Cur.), *A Guide to Behavioural Modelling for ALM*, Londra, UK, Risk Books.
- 3 Borri, N., Cerrone, R., Coccozza, R. & Curcio, D. (2018). Life Insurers' Asset-Liability Dependency and Low-Interest Rate Environment (M. Corazza, M. Durbán, A. Grané, C. Perna & M. Sibillo, Cur.). In M. Corazza, M. Durbán, A. Grané, C. Perna & M. Sibillo (Cur.), *Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance*, Cham, CH, Springer. https://doi.org/https://doi.org/10.1007/978-3-319-89824-7_34

4. Coccozza, R. (2015b). Back to the Future: Prospective Bank Risk Management in a Financial Analysis Perspective (E. Beccalli & F. Poli, Cur.). In E. Beccalli & F. Poli (Cur.), *Bank Risk, Governance and Regulation*, London, UK, Palgrave Macmillan. https://doi.org/https://doi.org/10.1057/9781137530943_4
5. Coccozza, R. & De Simone, A. (2014). Bifactorial Pricing Models: Light and Shadows in Correlation Role (M. Corazza & C. Pizzi, Cur.). In M. Corazza & C. Pizzi (Cur.), *Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance*, Cham, CH, Springer. https://doi.org/https://doi.org/10.1007/978-3-319-02499-8_9
6. Coccozza, R. & De Simone, A. (2013). An "economical" pricing model for hybrid product (C. Wehn, C. Hoppe & G. N. Gregoriou, Cur.). In C. Wehn, C. Hoppe & G. N. Gregoriou (Cur.), *Rethinking Valuation and Pricing Models. Lessons learned from the crisis and future challenges*, Oxford, UK, Whaltam, USA, Academic Press, Elsevier.
7. Coccozza, R., Gallo, A. & Xella, G. (2012). Valuation of the conditional indexation option in asset and liability management of defined benefit pension funds (C. Perna & M. Sibillo, Cur.). In C. Perna & M. Sibillo (Cur.), *Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance*, Milano, IT, Springer. https://doi.org/https://doi.org/10.1007/978-88-470-2342-0_12
8. Coccozza, R. (2011a). La gestione tecnica e patrimoniale delle imprese di assicurazione (C. Porzio, D. Previati, R. Coccozza, S. Miani & R. Pisani, Cur.). In C. Porzio, D. Previati, R. Coccozza, S. Miani & R. Pisani (Cur.), *Economia delle imprese assicurative*, Milano, IT, McGraw-Hill Education.
9. Coccozza, R. & De Simone, A. (2011a). The Pricing of Equity-Linked Contingent Claims Under a Lognormal Short Rate Dynamics (C. Prachalias, Cur.). In C. Prachalias (Cur.), *Proceedings of the 8th International Conference on Applied Financial Economics, Samos Island, Greece, 30 June-2 July 2011*, Atene, GR, National; Kapodistrian University.
10. Coccozza, R., De Simone, A., Di Lorenzo, E. & Sibillo, M. (2011a). Participating Policies: Risk and Value Drivers in a Financial Management Perspective (G. D'Amico, G. Di Biase, J. Janssen & R. Manca, Cur.). In G. D'Amico, G. Di Biase, J. Janssen & R. Manca (Cur.), *PROCEEDINGS ASMDA 2011*, Pisa, IT, Edizioni ETS.
11. Coccozza, R. & Di Lorenzo, E. (2011). Principi di matematica attuariale (C. Porzio, D. Previati, R. Coccozza, S. Miani & R. Pisani, Cur.). In C. Porzio, D. Previati, R. Coccozza, S. Miani & R. Pisani (Cur.), *Economia delle imprese assicurative*, Milano, IT, McGraw-Hill Education.
12. Coccozza, R., Di Lorenzo, E., Orlando, A. & Sibillo, M. (2010). A financial analysis of surplus dynamics for deferred life schemes (M. Corazza & C. Pizzi, Cur.). In M. Corazza & C. Pizzi (Cur.), *Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance*, Milano, IT, Springer. https://doi.org/https://doi.org/10.1007/978-88-470-1481-7_9
13. Coccozza, R. (2009a). Rischio e valore di un'emissione strutturata: un'analisi metodologica (M. Comana & M. Brogi, Cur.). In M. Comana & M. Brogi (Cur.), *Saggi in onore del prof. Tancredi Bianchi: Banca, sistemi e modelli - Banca, credito e rischi - Banca, mercati e risparmio*, Roma, IT, Bancaria Editrice.
14. Coccozza, R. (2009b). Usage of Stock Index Options: Evidence from the Italian Market (G. N. Gregoriou, Cur.). In G. N. Gregoriou (Cur.), *Stock Market Volatility*, London, UK, Chapman; Hall/CRC, Taylor; Francis Group.
15. Coccozza, R. (2009c). VaR Adjusted Performance for Structured Portfolios (G. N. Gregoriou, Cur.). In G. N. Gregoriou (Cur.), *The VaR Modeling Handbook: Practical Applications in Alternative Investing, Banking, Insurance, and Portfolio Management*, New York, USA, McGraw Hill.
16. Coccozza, R., D'Amato, V., Di Lorenzo, E., Russolillo, M. & Sibillo, M. (2009). Risk-sensitive insurance management vs the financial crisis (S. Kozmenko & T. Vasylyeva, Cur.). In S. Kozmenko & T. Vasylyeva (Cur.), *World financial crisis: causes, consequences, ways of overcoming*, Sumy, UC, Business Perspectives.
17. Coccozza, R., Di Lorenzo, E., Orlando, A. & Sibillo, M. (2009). Interest Rate Movements In The Life Insurance Fair Valuation Context (J. Morrey & A. Guyton, Cur.). In J. Morrey & A. Guyton (Cur.), *Liquidity, Interest Rates and Banking*, Hauppauge (NY), USA, Nova Science Publishers.
18. Coccozza, R., Di Lorenzo, E., Orlando, A. & Sibillo, M. (2008b). A Liability Adequacy Test for Mathematical Provision (C. Perna & M. Sibillo, Cur.). In C. Perna & M. Sibillo (Cur.), *Mathematical and Statistical Methods in Insurance and Finance*, Milano, IT, Springer. https://doi.org/https://doi.org/10.1007/978-88-470-0704-8_10
19. Coccozza, R. (2006). Identificazione e misurazione dei rischi nei portafogli vita: spunti critici di riflessione (L. Munari, Cur.). In L. Munari (Cur.), *Attualità e prospettive negli studi di economia dei mercati e degli intermediari finanziari*, Parma, IT, Monte Università Parma Editore S.r.l.

- 20 Cocozza, R., Di Lorenzo, E. & Sibillo, M. (2004c). Risk Profiles of Life Insurance Business: Quantitative Analysis in a Managerial Perspective (C. Perna & M. Sibillo, Cur.). In C. Perna & M. Sibillo (Cur.), *Metodi Matematici e Statistici per l'analisi dei dati assicurativi e finanziari*, Salerno, IT, CUSL.
- 21 Cocozza, R. & Di Lorenzo, E. (2003a). Risk profiles of life insurance business: a combined approach, In *Quaderni del Dipartimento di Matematica applicata alle scienze economiche, statistiche e attuariali B. de Finetti*, Trieste, IT, Università di Trieste.

Presentazioni a Convegni

- 1 Cocozza, R. (2021a). *CHAIRMAN per la sessione NPL action plan, Bad bank e cartolarizzazioni postpandemia e per la sessione La governance nelle LSI e negli intermediari finanziari non bancari: nuovi requisiti fit and proper e di architettura*. Convegno "ABI Supervision, Risks e Profitability" forthcoming. Roma, IT.
- 2 Cocozza, R. (2021b). *Emergenza e previdenza: impatto e governo dei rischi*. Convegno "ADEIMF2021 Il sistema finanziario e la crisi pandemica: impatti e prospettive di ricerca futura", On-Line Conference, IT.
- 3 Cocozza, R. (2020a). *CHAIRMAN per la sessione Gli impatti della pandemia COVID19 sul Sistema Finanziario*. Convegno "ADEIMF2020 Intermediazione finanziaria, finanza d'impresa e Covid-19. Quali riflessioni per la ricerca, la didattica e la terza missione?" On-Line Conference, IT.
- 4 Cocozza, R. (2020b). *CHAIRMAN per la sessione Nuove Prospettive: il CRO nei Fondi Pensione e negli altri Investitori istituzionali*. Convegno "ABI Supervision, Risks e Profitability". Roma, IT.
- 5 Cocozza, R., Curcio, D. & Gianfrancesco, I. (2020). *New rules to measure interest rate risk and a prolonged scenario of low market rates: evidence from Italian banks*. 33rd EBES Conference. Madrid, ES.
- 6 Cocozza, R. (2019a). *CHAIRMAN per la Conversazione Tematica*. Convegno "La Previdenza Complementare tra sfide ed opportunità". Napoli, IT.
- 7 Cocozza, R. (2019b). *Economia del territorio e ruolo delle banche*. Convegno Turismo e Agri-Food tra core e non-core business. Ruolo della Banca nei processi d'innovazione dei modelli di business. Salerno, IT.
- 8 Cocozza, R. (2019c). *I Fondi Pensione in Italia. Considerazioni di sintesi*. Convegno "I Fondi Pensione in Italia: caratteristiche, opportunità e profili di criticità" per il Mese dell'Educazione Finanziaria EDUFIN2018. Fondo Pensione Università, Università degli Studi della Campania Luigi Vanvitelli, MEF Comitato per l'Educazione Finanziaria. Capua (CE), IT.
- 9 Cocozza, R. (2019d). *Il nuovo framework sulla proporzionalità tra CRR2 ed EBA. Riflessioni in tema di appropriatezza*. Convegno ABI Supervision, Risks e Profitability 2019. Roma, IT.
- 10 Cocozza, R. (2019e). *Il Risk Management. Tradizione, Innovazione e Governance*. XV Convention AIFIRM: il ruolo dei Comitati rischi e del risk management. Milano, IT.
- 11 Cocozza, R. (2019f). *Matlab quale strumento di didattica. L'esperienza degli studenti di Finanza*. Convegno Unina Matlab - Non solo una licenza. Napoli, IT.
- 12 Cocozza, R. (2019g). *NPL: lascia o raddoppia?* Convegno La problematica dei crediti deteriorati. Rischi e opportunità. Napoli, IT.
- 13 Cocozza, R. (2019h). *Regulatory framework adequacy e competitività*. II Convention AIFIRM sezione Lazio. La dimensione per competere oggi nel business bancario: coniugare i vincoli tecnologici e di Vigilanza con la redditività. Roma, IT.
- 14 Cocozza, R. (2018a). *CHAIRMAN per la sessione "Proporzionalità ed efficienza"*. Napoli, IT.
- 15 Cocozza, R. (2018b). *Efficienza e stabilità nella prospettiva europea: il caso del credito cooperativo*. Convegno Le regole europee sulle banche: novità in corso e problemi aperti. Napoli, IT.
- 16 Cocozza, R. (2018c). *Il Fondo Pensione delle Università*. Presentazione per l'Università della Campania. Fondo Pensione Università, Università degli Studi della Campania Luigi Vanvitelli. Caserta, IT.
- 17 Cocozza, R. (2018d). *La componente fiscale del rendimento nella previdenza complementare*. Convegno "Previdenza Complementare" per la Settimana Mondiale dell'Investitore WIW2018 e per il Mese dell'Educazione Finanziaria EDUFIN2018. Fondo Pensione Università, Università degli Studi di Napoli Federico II, IOSCO, CONSOB, MEF Comitato per l'Educazione Finanziaria. Napoli, IT.

- 18 Curcio, D., Borri, N., Cerrone, R. & Coccozza, R. (2018). *Life insurers' asset-liability dependency and low-interest-rate environment*. International Conference MAF 2018. The 8th International Conference on Mathematical, Statistical Methods for Actuarial Sciences e Finance. Madrid, ES.
- 19 Coccozza, R. (2017a). *Il bilancio dei fondi pensione: modalità di redazione e contenuto informativo per gli stakeholder*. Convegno Pension Fund Italian, Spanish Legislation. Tax, accounting e commercial aspect. Capua (CE), IT.
- 20 Coccozza, R. (2017b). *Le linee guida della BCE sui crediti deteriorati: una lettura tecnica*. Seminario La gestione dei crediti deteriorati delle banche (NPL) alla luce delle nuove linee guida della BCE. Napoli, IT.
- 21 Coccozza, R. (2017c). *Risk and Value: two sides of the same coin*. Presentazione del Volume "Risk e Control Governance". Napoli, IT.
- 22 Coccozza, R. & Bianchi, M. T. (2017). *Il bilancio dei fondi pensione*. Convegno I Fondi Pensione: problemi e prospettive. Napoli, IT.
- 23 Coccozza, R. & Curcio, D. (2017). *Conoscere per Scegliere*. Seminario per la Settimana Mondiale dell'Investitore WIW 2017, IOSCO, CONSOB, e Dipartimento di Economia, Management e Istituzioni dell'Università degli Studi di Napoli Federico II. Napoli, IT.
- 24 Coccozza, R., Curcio, D. & Casano, F. (2016). *Do global markets imply common fear? 26th Annual RESER Conference – What's ahead in service research? New perspectives for Business e Society*. Napoli, IT.
- 25 Adamo, R. & Coccozza, R. (2015). *Microcredito e cooperazione di credito: una possibile roadmap verso la strutturazione dei processi gestionali*. XXXVI Conferenza scientifica annuale AISRe. L'Europa e le sue regioni - Disuguaglianze, capitale umano, politiche per la competitività. Arcavacata di Rende (CZ), IT.
- 26 Coccozza, R. (2015a). *Are interest rates relevant to stock prices? On stage the performance of financial institutions*. The Wolpertinger Conference 2015. Granada, ES.
- 27 Coccozza, R. (2015c). *Invited Opening Speech alla Sessione Plenaria di apertura del XXXVII Convegno Nazionale AIDEA. Chairman Prof. Elvio Borgonovi*. XXXVII Convegno Nazionale Accademia Italiana di Economia aziendale. Piacenza, IT.
- 28 Coccozza, R., Curcio, D. & Gianfrancesco, I. (2015a). *Measuring banks' interest rate risk: issues arising from regulatory and internal methodologies*. XXIV International Conference on Money, Banking e Finance. Roma, IT.
- 29 Coccozza, R. (2014a). *Back to the future: Prospective bank risk management in a financial analysis perspective*. The Wolpertinger Conference 2014. Milano, IT.
- 30 Coccozza, R. (2014b). *The Banking Union in a Risk Management Perspective*. Convegno Perspectives e challenges of the Banking Union. Londra, UK.
- 31 Coccozza, R. (2014c). *Gestione e Governo dei Rischi: 2014 annus mirabilis?* Convegno Governance, Controlli Interni e Gestione dei Rischi. Inaugurazione Anno Accademico IPE. Napoli, IT.
- 32 Coccozza, R. (2013). *Il processo di liberalizzazione delle finanze internazionali e la vigilanza bancaria*. Convegno Credito e Mezzogiorno. Napoli, IT.
- 33 Coccozza, R., Curcio, D. & Gianfrancesco, I. (2012a). *Non-maturity deposits and banks' exposure to the interest rate risk: issues arising from the Basel regulatory framework*. XXI International Conference on Money, Banking e Finance. Roma, IT.
- 34 Coccozza, R., Curcio, D. & Gianfrancesco, I. (2012b). *What Matters most in the Measuring Banks' Exposure to the Interest Rate Risk in the Banking Book?* International Risk Management Conference 2012. Global Standards for Risk Measurement, Management e Regulation. Roma, IT.
- 35 Coccozza, R. (2011b). *Rischio di modello o modello del rischio? Misunderstanding in tema di risk governance*. Convegno Le crisi finanziarie. Napoli, IT.
- 36 Coccozza, R., Curcio, D. & Gianfrancesco, I. (2011). *Asset Liability Dependency: Evidence from European Commercial Banks*. The 1st International Conference on Banking e Finance Perspectives. Famagusta, CYP.
- 37 Coccozza, R. & De Simone, A. (2011b). *The pricing of equity-linked contingent claims under a lognormal short rate dynamics*. The 8th International Conference on Applied Financial Economics. Samos, GR.
- 38 Coccozza, R., De Simone, A., Di Lorenzo, E. & Sibillo, M. (2011b). *Participating Policies: risk and value drivers in a financial management perspective*. The 14th Conference of the ASMDA International Society. Roma, IT.

- 39 Coccozza, R., De Simone, A. & Gallo, A. (2011). *An Insight into Bank's pricing: The case of covered warrants*. The International Finance e Banking Society Conference IFABS2011. Roma, IT.
- 40 Coccozza, R. (2010). *Qualche riflessione sull'indagine su la diffusione dell'ICT nei pagamenti elettronici e nelle attività in rete alla luce dei fattori critici del cambiamento*. Convegno Banca d'Italia su La diffusione dell'ICT nei pagamenti elettronici e nella attività di rete. Napoli, IT.
- 41 Coccozza, R., Gallo, A. & Xella, G. (2010b). *Valuation of embedded option in Asset and Liability Management*. International Conference MAF 2010 Mathematical, Statistical Methods for Actuarial Sciences e Finance. Ravello (SA), IT.
- 42 Coccozza, R., Gallo, A. & Xella, G. (2009). *Conditional Indexation for Pension Funds*. The 13th International Congress on Insurance: Mathematics e Economics. Istanbul, TR.
- 43 Coccozza, R., Di Lorenzo, E., Orlando, A. & Sibillo, M. (2008a). *A financial analysis of surplus dynamic for deferred life schemes*. International Conference MAF 2008 Mathematical, Statistical Methods for Actuarial Sciences e Finance. Venezia, IT.
- 44 Coccozza, R. & Fiordelisi, F. (2008). *Le fonti della ricerca*. Seminario per la Scuola Estiva ADEIMF 2008. Castel del Rio (BO), IT.
- 45 Coccozza, R. & Di Lorenzo, E. (2007). *A dynamic solvency approach for life insurance*. The 1st International IAA Life Colloquium. Stockholm, SE.
- 46 Coccozza, R., Di Lorenzo, E., Orlando, A. & Sibillo, M. (2007). *Profitability analysis via risk-adjusted performance indicators in life insurance*. The 11th International Congress on Insurance Mathematics e Economics. Piraeus, GR.
- 47 Coccozza, R., Di Lorenzo, E. & Sibillo, M. (2007b). *Risk-adjusted Performance Indicators in Life Insurance*. The XVI AFIR Colloquium. Stockholm, SE.
- 48 Coccozza, R. & Orlando, A. (2007). *Decision Making in Structured Finance: a case in Risk-Adjusted Performance Computation*. The 4th International Conference on Computational Management Science. Ginevra, CH.
- 49 Coccozza, R., Di Lorenzo, E., Orlando, A. & Sibillo, M. (2006a). *A liability adequacy test for mathematical provision*. Convegno MAF 2006 Metodi Matematici e Statistici per le Assicurazioni e la Finanza. Salerno, IT.
- 50 Coccozza, R., Di Lorenzo, E., Orlando, A. & Sibillo, M. (2006b). *The VaR of the mathematical provision: critical issues*. The 28th International Congress of Actuaries. Parigi, FR.
- 51 Coccozza, R. (2005). *Identificazione e misurazione dei rischi nei portafogli vita: spunti critici di riflessione*. Convegno nazionale di Economia degli Intermediari Finanziari 2005. Parma, IT.
- 52 Coccozza, R., De Feo, D., Di Lorenzo, E. & Sibillo, M. (2005). *On the financial risk factor in fair valuation of the mathematical provision*. The 36th ASTIN Colloquium. Zurigo, CH.
- 53 Coccozza, R., Di Lorenzo, E., Orlando, A. & Sibillo, M. (2004). *Risk profiles of life insurance business: quantitative analysis in a managerial perspective*. Convegno MAF 2004 Metodi matematici e statistici per l'analisi dei dati assicurativi e finanziari. Salerno, IT.
- 54 Coccozza, R., Di Lorenzo, E. & Sibillo, M. (2004a). *Life insurance risk indicators: a balance-sheet approach*. The International Congress on Insurance Mathematics e Economics. Roma, IT.
- 55 Coccozza, R. & Di Lorenzo, E. (2003b). *Risk profiles of life insurance business: a combined approach*. The 6th Spanish-Italian Meeting on Financial Mathematics. Trieste, IT.
- 56 Coccozza, R., Di Lorenzo, E. & Sibillo, M. (2003). *Methodological problems in solvency assessment of an insurance company*. The 13th International Meeting e the 68th Annual American Meeting of the Psychometric Society IMPS 2003. Cagliari, IT.
- 57 Coccozza, R. (1997a). *CreditMetrics: un nuovo strumento per la valutazione del rischio di credito*. Seminario per la Riunione Interuniversitaria Nazionale dei docenti di Tecnica Bancaria. Università Cattolica del Sacro Cuore di Milano. Milano, IT.
- 58 Coccozza, R. (1996a). *Componente speculativa ed efficienza dei prezzi del mercato future*. Seminario per la Riunione Interuniversitaria Nazionale dei docenti di Tecnica Bancaria. Università Cattolica del Sacro Cuore di Milano. Milano, IT.
- 59 Coccozza, R. (1996b). *I rischi sistemici nell'attività di intermediazione e la loro rappresentazione nei bilanci bancari*. Seminario per la Riunione Interuniversitaria Nazionale dei docenti di Tecnica Bancaria. Università Cattolica del Sacro Cuore di Milano. Milano, IT.

- 60 Coccozza, R. (1994b). *L'impatto delle variazioni dei tassi sul margine di interesse delle banche italiane*. Seminario per la Riunione Interuniversitaria Nazionale dei docenti di Tecnica Bancaria. Università Cattolica del Sacro Cuore di Milano. Milano, IT.

Comitati Scientifici Convegni

- 1 Briganti, R., Coccozza, R. & Curcio, D. (2021). *Finanza e Previdenza tra Etica e Cultura*. Napoli, IT, Fondo Pensione Università, Università degli Studi della Campania Luigi Vanvitelli e MEF Comitato per l'Educazione Finanziaria. Convegno per la Settimana Mondiale dell'Investitore WIW2021 e per il Mese dell'Educazione Finanziaria EDUFIN2021.
- 2 Coccozza, R., Curcio, D. & Di Lorenzo, E. (2020). *Il Risk Management dei Fondi Pensione*. Napoli, IT, Università degli Studi di Napoli Federico II, AIFIRM.
- 3 Buccico, C., Coccozza, R. & Meles, A. (2019). *I Fondi Pensione in Italia: caratteristiche, opportunità e profili di criticità*. Capua (CE), IT, Fondo Pensione Università, Università degli Studi della Campania Luigi Vanvitelli e MEF Comitato per l'Educazione Finanziaria. Incontro per il Mese dell'Educazione Finanziaria EDUFIN2019.
- 4 Coccozza, R. & Curcio, D. (2019). *La Previdenza Complementare tra sfide ed opportunità*. Napoli, IT, Fondo Pensione Università, Università degli Studi di Napoli Federico II, IOSCO, CONSOB, MEF Comitato per l'Educazione Finanziaria. Incontro per la Settimana Mondiale dell'Investitore WIW2019 e per il Mese dell'Educazione Finanziaria EDUFIN2019.
- 5 Porzio, C., Coccozza, R., Drago, D., Isaia, E., Monferrà, S., Sampagnaro, G. & Santorsola, G. G. (2019). *Convegno Invernale di Economia degli Intermediari Finanziari 2019*. Napoli, IT, ADEIMF.
- 6 Coccozza, R., Blandini, A. & Rispoli, M. (2018). *La declinazione del principio di proporzionalità in ambito bancario: problemi e prospettive*, IT, Università degli Studi di Napoli Federico II e AIFIRM.
- 7 Coccozza, R. & Curcio, D. (2018). *Previdenza Complementare*. Napoli, IT, Fondo Pensione Università, Università degli Studi di Napoli Federico II, IOSCO, CONSOB, MEF Comitato per l'Educazione Finanziaria. Incontro per la Settimana Mondiale dell'Investitore WIW2018 e per il Mese dell'Educazione Finanziaria EDUFIN2018.
- 8 Coccozza, R. & Blandini, A. (2017). *I Fondi Pensione: problemi e prospettive*. Napoli, IT, Università degli Studi di Napoli Federico II.
- 9 Porzio, C., Coccozza, R., Monferrà, S., Morvillo, A. & Sampagnaro, G. (2012). *Convegno Nazionale di Economia degli Intermediari Finanziari 2012*. Capri (NA), IT, ADEIMF.
- 10 Coccozza, R. & Porzio, C. (2008). *Convegno Nazionale di Economia degli Intermediari Finanziari 2008*. Capri (NA), IT, ADEIMF.

