

Raffaele Zenti

Esperienze

CO-FONDATORE, PARTNER | VIRTUAL B SPA, ADVISEONLY SRL (FINTECH) | 2011-OGGI

- Membro del CdA, Resp. financial & data analysis (set-up e management dell'attività di roboadvisory B2B2C, financial & risk modeling, set-up dell'attività di data science).

CO-FONDATORE, PARTNER | SUMMARISK SRL (FINTECH) | 2015-OGGI

- Membro del CdA, risk modeling.

CO-FONDATORE, PARTNER | EKUOTA SRL (CORPORATE FINTECH)| 2013-OGGI

- Membro del CdA (supervisione dell'attività di financial modeling).

RESP. STRATEGIE FINANZIARIE | IDEA SIM | 2010

- Set-up e gestione delle strategie d'investimento (basate su asset allocation, total return, per HNWI).

RESP. GESTIONI QUANTITATIVE | BANCA LEONARDO | 2007-2010

Responsabile di vari portafogli (Sicav), con differenti profili di rischio, gestiti combinando strategie Value-Momentum, con un ampio spettro di asset class, tra le quali azioni, obbligazioni, divise, commodities.

GESTORE QUANTITATIVO | ALLIANZ GLOBAL INVESTORS ITALY | 2004-2007

- Responsabile di:
 - fondi di fondi total return, gestiti utilizzando strategie di dynamic asset allocation e tecniche di risk budgeting;
 - strategie di equity statistical arbitrage;
 - strategie basate su CPPI e VaR.

RISK MANAGER | ALLIANZ GLOBAL INVESTORS ITALY (GIÀ RAS ASSET MANAGEMENT) | 1997-2004

- Sviluppo e gestione del modello proprietario di rischio (basato sul Parallel Filtered Bootstrap, o Filtered Historical Simulation), che integra in modo coerente rischio di mercato, di credito e di liquidità.

BUSINESS CONSULTANT – FINANCIAL PRACTICE| ENGINEERING | 1996-1997

ANALISTA FINANZIARIO | SELLA ASSET MANAGEMENT | 1995

BUSINESS ANALYST E SVILUPPO ALGORITMI| DIANOS SPA | 1993-1995

Competenze "core"

Metodi quantitativi, risk analysis & management, analisi statistica, metodi di portfolio construction e strategie d'investimento, roboadvisory e digital wealth management, programmazione in Matlab e R.

Attività accademiche

- 1998-2007: **Professore a contratto di "Risk Management Techniques"** al Master in Finance, Collegio Carlo Alberto, Università di Torino.

- 2008- oggi: **Professore a contratto di “Quantitative Portfolio Management”** al Master in Finance, Collegio Carlo Alberto, Università di Torino.

Principali pubblicazioni:

- Zenti, "Volatility, decision models and complexity in financial markets" Artificial Intelligence and Cognitive Science, Il Mulino, 2/14
- Zenti, Raffaele, "Are lump sum investments riskier than systematic investment plans? Some empirical evidence", available at SSRN: <https://ssrn.com/abstract=2341773>
- Zenti & al, "Encyclopedia of Alternative Investments", ed. by G.N. Gregoriou, Chapman Hall UK
- Zenti & al, "Equity portfolio construction: a comparative analysis", in "Diversification and Portfolio Management of Mutual Funds", ed. by G.N. Gregoriou, Palgrave-MacMillan, Jan 07
- Zenti & al, "Evaluating Value-at-Risk estimates: a cross-section approach", in "Advances in Risk Management", ed. by G.N. Gregoriou, Palgrave-MacMillan, Jan 07
- Zenti & al, "Integrated risk management with a filtered bootstrap approach". Economic Notes, Nov 04 - Vol. 33 Issue 3
- Zenti & al, "Risk policies for active asset managers", "The Journal of Asset Management", 04, Vol. 4, n. 6
- Zenti & al, "La soluzione in-house". Risk Italia, Nov 03
- Zenti & al, "Are asset managers properly using tracking error estimates?", "The Journal of Asset Management" Vol. 3, 3, 02
- R. Zenti, "La struttura dei tassi d'interesse per scadenza: analisi e stima di alcuni modelli; implicazioni per la valutazione e la gestione di attività finanziarie", Quaderni Comitato G. Rota, Torino, 1994

Formazione

BA/MSC ECONOMIA | 1993 | UNIVERSITÀ DI TORINO

- Focus: Statistica, Teoria della Probabilità, Finanza.

CONTRATTO DI RICERCA POST-LAUREA | 1994 | UNIVERSITÀ DI TORINO

Con borsa di studio dal Comitato Giorgio Rota; tesi su metodi numerici per il pricing (con modelli "lattice") di derivati di tasso.

CORSI POST-LAUREA

- University of Waterloo, "Advanced Techniques for Monte Carlo Simulation"
- ETH - Swiss Federal Institute of Technology, Zurich, "Extreme Value Theory and Risk Management"
- FAME, Geneva, "Forecasting Techniques in Financial Markets"
- Brunel University, "Kalman Filters and Hidden Markov Chains"
- Brunel University, "Advanced Optimization Techniques"
- University of Brescia, "Forecasting techniques using latent-variables models"
- Risk, London, "Identifying, Measuring and Managing Market Risk"
- Risk, London, "Stress Testing Portfolios"
- Stanford University, "The Economics of Uncertainty – Models with Rational Beliefs"
- N.Y. University, "Credit Linked Instruments: Models, Pricing and Strategies"
- Facoltà di Ingegneria Biofisica ed Elettronica, Genova, "Clustering techniques for time series analysis"
- Facoltà di Ingegneria Biofisica ed Elettronica, Genova, "Cointegration and state-space models"
- Attilio Meucci Bootcamp (ARPM), London, "Quantitative risk and portfolio management".