

Ugo Pomante

FELLOW

Private Banking and Wealth Management

UGO.POMANTE@UNIBOCCONI.IT

Biography

SDA Fellow

Degree in Business Administration, Bocconi University, Milan, Italy, 1995

Ph.D. in Banking and finance, Siena University, Italy, 2001

Official Member of MBA Faculty

Full Professor of Financial Institutions Economics, University of Rome "Tor Vergata", Italy

Research Interests: Asset management: Markowitz optimization, Models minimizing estimation errors (Bayesian estimators, resampling, etc.), Market Risk Management: ALM Models, VaR models, Capital Allocation, ALM in Pension Funds

ARTICLES IN SCHOLARLY JOURNALS

POMANTE U., FARINA V., CUCURACHI P.

A "Plug-and-Play," Goal-Based, Dynamic Asset Allocation Model with Genetic Algorithms

The Journal of Wealth Management, 2024, vol.26, no. 4, pp.33-48

CARLUCCIO E., CUCURACHI P., POMANTE U.

Absolute or Relative: The Dark Side of Fund Rating Systems

Journal of Financial Management, Markets and Institutions, 2023, vol.11, no. 01, pp.2350001

POMANTE U., FARINA V., LUPO E., CUCURACHI P.

Asset allocation dinamica per i fondi pensione: un modello basato sugli algoritmi genetici

Bancaria, March, 2023, no. 3

CARLUCCIO E., CUCURACHI P., MASPERO D., POMANTE U., AJELLO F., STEFANI M.

Profilatura del cliente, costruzione dei portafogli e verifica di adeguatezza: sfide ancora aperte

Bancaria, 2022, no. 11, pp.63-80

CARLUCCIO E., CUCURACHI P., POMANTE U.

I piani di accumulo (PAC): una scelta razionale o emotiva?

Rivista Bancaria - Minerva Bancaria, 2020, vol.76, no. 4, pp.7-26

CUCURACHI P., POMANTE U.

Tolleranza al rischio e logiche di adeguatezza alla prova del Covid-19: il Suitability Ratio

Bancaria, October, 2020, no. 10, pp.12-31

CUCURACHI P., POMANTE U.

A modification of the modified Dietz approach

The Journal of Performance Measurement, 2013, vol.17, no. 4, pp.1-34

CARLUCCIO E., POMANTE U.

L'asset allocation strategica: una soluzione flessibile "private banker oriented"

Bancaria, 2011, vol.67, no. 10, pp.88-96

CONTRIBUTION TO CHAPTERS, BOOKS OR RESEARCH MONOGRAPHS

CARLUCCIO E., POMANTE U.

Fondi Flessibili: the beauty or the beast? in *Studi in onore di Antonio Dell'Atti*

S. Dell'Atti (Eds), A. Giuffrè Editore S.p.A., pp.21-41, 2020

POMANTE U.

Market timing with the Black-Litterman model in *Asset Pricing, Real Estate and Public Finance over the Crisis*

Palgrave Macmillan, pp.97-111, 2013

POMANTE U.

La curva dei rendimenti per scadenze in *Economia del mercato mobiliare*

Egea, pp.239-262, 2011

POMANTE U.

La teoria della selezione di portafoglio di Markowitz in *Economia del mercato mobiliare*

Egea, pp.317-368, 2011

POMANTE U., SAITA F., ZANOTTI G.

L'utilizzo degli strumenti derivati nella gestione di portafoglio in *Economia del mercato mobiliare*

P. L. Fabrizi (Eds), Egea, pp.587-628, 2011
