

PROGRAMMA ANNUALE SEZIONE Matematica per l'economia e la finanza

Periodo: 01.10.2015-30.09.2016

Componenti delle sezione e coordinatore

Prof. Marcellino Gaudenzi Dott. Nando Prati Prof.ssa Patrizia Stucchi	Prof. Antonino Zanette (Coordinatore) Dott.ssa Laura Ziani
---	---

PROGRAMMA ATTIVITA' DI RICERCA (A CURA DEL COORDINATORE)

Valutazione di opzioni finanziarie in modelli ibridi a volatilità stocastica. Valutazione di prodotti assicurativi (Variable annuities). Teoria Giochi, con particolare riguardo agli indici di potere; Metodi e modelli matematici per economia; Applicazioni dei Fuzzy Sets. Teoria del portafoglio, Teoria del rischio finanziario, Opzioni, Valutazione di progetti imprenditoriali. Misure di rischio in riassicurazione e finanza. Approcci alternativi al paradigma media-varianza nella storia della finanza quantitativa. Proprietà di simmetria in giochi parsimoniosi di maggioranza ponderata. Processi stocastici con salti.

Allego le schede individuali dei componenti la Sezione.

SCHEDA INDIVIDUALE: **Prof. Marcellino Gaudenzi**

Attività ricerca

- tematiche di ricerca: Teoria delle Opzioni, valutazione di contratti assicurativi equity linked.
- partecipazione a progetti di ricerca: ancora da definire
- progetti di ricerca presentati (a chi): ancora da definire
- seminari e partecipazione a convegni: ancora da definire
- partecipazione a comitati editoriali di riviste/collane scientifiche
- attività di referaggio attuate per riviste/collane scientifiche (indicare le riviste)
- Pubblicazioni: ancora da definire

Compiti organizzativi ed istituzionali

- Coordinatore per le lauree di Economia del progetto Matematica di Base
- ruoli ricoperti quale coordinatore CCS: Coordinatore del Consiglio Unificato delle Lauree Triennali di Economia e componente Commissione Didattica Economia Aziendale

	Numero ore
Attività didattica presso corsi coordinati dal DIES	144
Partecipazione a commissioni di esame/laurea	80
Altri compiti organizzativi e commissioni didattiche	40
Altro: Assistenza a studenti	86
Totale	350

SCHEDA INDIVIDUALE: **Dott. Nando Prati**

Attività ricerca

- tematiche di ricerca: Teoria Giochi, con particolare riguardo agli indici di potere; Metodi e modelli matematici per economia; Applicazioni dei Fuzzy Sets.
- partecipazione a progetti di ricerca: ancora da definire
- progetti di ricerca presentati (a chi): ancora da definire
- seminari e partecipazione a convegni: ancora da definire
- partecipazione a comitati editoriali di riviste/collane scientifiche
- attività di referaggio attuate per riviste/collane scientifiche (indicare le riviste)
- Pubblicazioni: ancora da definire

Compiti organizzativi ed istituzionali: n.d.

Attività didattica

	Numero ore
Attività didattica presso corsi coordinati dal DIES	90
Partecipazione a commissioni di esame/laurea	110
Altro: Assistenza a studenti 130	150
Totale	350

SCHEDA INDIVIDUALE: **Prof.ssa Patrizia Stucchi**

Attività ricerca

- tematiche di ricerca: Teoria del portafoglio, Teoria del rischio finanziario, Opzioni, Valutazione di progetti imprenditoriali.
- partecipazione a progetti di ricerca: ancora da definire
- progetti di ricerca presentati (a chi): ancora da definire
- seminari e partecipazione a convegni: ancora da definire
- partecipazione a comitati editoriali di riviste/collane scientifiche
- attività di referaggio attuate per riviste/collane scientifiche (indicare le riviste)
- Pubblicazioni: ancora da definire

Compiti organizzativi ed istituzionali

- Componente Commissione didattica Laurea Magistrale in Banca e Finanza.
- Direttore Biblioteca Economica e Giuridica BIB3 (incarico triennale con scadenza il 30 settembre 2016)

	Numero ore
Attività didattica presso corsi coordinati dal DIES	144
Partecipazione a commissioni di esame/laurea	80
Altri compiti organizzativi e commissioni didattiche	40
Altro: Assistenza a studenti	86
Totale	350

SCHEDA INDIVIDUALE: **Dott.ssa Laura Ziani**

Attività ricerca

tematiche di ricerca: Particolari classi di giochi omogenei di maggioranza ponderata e loro connessioni con le proprietà delle sequenze di Fibonacci. Misure di rischio-rendimento in riassicurazione e finanza.

- partecipazione a progetti di ricerca: ancora da definire
- progetti di ricerca presentati (a chi): ancora da definire
- seminari e partecipazione a convegni: ancora da definire
- partecipazione a comitati editoriali di riviste/collane scientifiche
- attività di referaggio attuate per riviste/collane scientifiche (indicare le riviste)
- Pubblicazioni: ancora da definire

Compiti organizzativi

- partecipazione commissioni didattiche L o LM
- progetti erasmus seguiti
- ruoli ricoperti quale coordinatore CCS, componente commissione qualità di CCS, ...
- ruoli coordinamento master
- altro: delegato del Rettore per la didattica e per l'orientamento e il tutorato per il DIES

Attività didattica

	Numero ore
Attività didattica presso corsi coordinati dal DIES	72
Attività didattica presso Uniud in corsi non coordinati dal DIES	0
Attività didattica presso dottorati coinvolgenti il DIES	0
Partecipazione a commissioni di esame/laurea	150
Altri compiti organizzativi e commissioni didattiche	40
Altro: Assistenza a studenti	130
Totale	350

SCHEDA INDIVIDUALE: **Prof. Antonino Zanette**

Attività ricerca

Tematiche di ricerca

Valutazione di opzioni finanziarie in modelli ibridi a volatilità stocastica. Valutazione di prodotti assicurativi (Variables annuities).

Partecipazione a progetti di ricerca

Membro del progetto MathRisk dell'Inria Rocquencourt Francia). Soggiorno di ricerca presso l'Inria Rocquencourt.

Compiti organizzativi e istituzionali

- Membro e Referente mobilità internazionale della Commissione didattica della laurea magistrale in Banca e Finanza.
- Coordinatore Erasmus per differenti sedi.

Attività didattica

	Numero ore
Attività didattica presso corsi coordinati dal DIES	120
Partecipazione a commissioni di esame/laurea	108
Altri compiti organizzativi e commissioni didattiche	20
Altro: Assistenza a studenti	60
Totale	350