

ASSOCIAZIONE PER LA MATEMATICA APPLICATA
ALLE SCIENZE ECONOMICHE E SOCIALI

ATTI DEL TREDICESIMO CONVEGNO A.M.A.S.E.S.

Verona, 13-15 Settembre 1989

Volume pubblicato col contributo
del Consiglio Nazionale delle Ricerche

PITAGORA EDITRICE BOLOGNA

INDICE

Parte I - ELENCO PARTECIPANTI.....	XIII
------------------------------------	------

Parte II - RELAZIONI INVITATE

G.Ottaviani

ASPETTI ECONOMICI E TECNICI DELLA PREVIDENZA INTEGRATIVA	3
---	---

S.C.Port

PROBABILISTIC METHODS IN HARMONIC ANALYSIS	39
--	----

S.Schaible

MULTI - RATIO FRACTIONAL PROGRAMMING - ANALYSIS AND APPLICATIONS	47
---	----

A.D.Wilkie

A STOCHASTIC INVESTMENT MODEL FOR ACTUARIAL USE	87
---	----

Parte III - COMUNICAZIONI

E.Allevi

UNA SPECIALE CLASSE DI SISTEMI DINAMICI	121
---	-----

E.Alvoni

SQUARE ROOT ALGORITHMS FOR TIME SERIES DECOMPOSITION USING STATE - SPACE MODELS WITH SINGULAR TRANSITION MATRIX	137
---	-----

B.Barigelli - A.Pierfederici

SULL'IMPLEMENTAZIONE DI UN ALGORITMO PER PROBLEMI DI PROGRAMMAZIONE LINEARE CON UN VINCOLO QUADRATICO	147
---	-----

<i>F.Beccacece</i> UNA DEFINIZIONE DI INVESTIMENTO TRAMITE LA "DURATION"	173
<i>R.Benassi</i> CARATTERISTICHE DI ALCUNI CONTRATTI DI ASSICURAZIONE DESUNTE DALL'ANDAMENTO DELLA RISERVA MATEMATICA	191
<i>G.Bosi</i> SULLA STIMA RICORSIVA DEI MINIMI QUADRATI IN PROCESSI DI OSSERVAZIONE MARKOVIANI	219
<i>F.A.Brunacci</i> SUL K-BOTTLENECK TSP IN FORMA DECISIONALE	239
<i>R.Camillo</i> SULLA MISURAZIONE DEI RENDIMENTI NETTI DI INVESTIMENTI POINTINPUT-POINTOUTPUT	241
<i>E.Canestrelli - S.Giove</i> OPTIMIZING A QUADRATIC FUNCTION WITH FUZZY LINEAR COEFFICIENTS	249
<i>E.Canestrelli - C.Nardelli</i> SULLA GESTIONE DINAMICA DI UN PORTAFOGLIO	263
<i>M.Cardin</i> RAPPRESENTAZIONE DI PARTICOLARI ORDINAMENTI CON FUNZIONI DI SCONTO	287
<i>G.Carpaneto - M.Dell' Amico - P.Toth</i> RICERCA DI PERCORSI HAMILTONIANI OTTIMI IN GRAFI ORIENTATI DI GRANDI DIMENSIONI	299
<i>M.Cenci</i> SUL PREMIO DI RISCHIO N-DIMENSIONALE	309
<i>M.Cenci - A.M.Cerquetti</i> SU ALCUNE PROPRIETA' DI FUNZIONI CHE INTERESSANO SISTEMI PREVIDENZIALI	325

<i>M.Cenci - F.M.Mason</i> MISURE DI AVVERSIONE AL RISCHIO E CONCAVITA' DELLA FUNZIONE DI UTILITA'	343
<i>M.Cigola</i> CONCAVITA' IN MEDIANA	357
<i>P.V.Dolci</i> UNA PROCEDURA PER LA DETERMINAZIONE AUTOMATICA DEL TIPO DI VARIABILE IN MODELLI DI DINAMICA DEI SISTEMI	371
<i>M.Fedrizzi</i> A FUZZY APPROACH TO MAJORITIES IN GROUP DECISION MAKING	383
<i>L.Ferrari - L.Peccati</i> UN MODELLO DI FUNZIONAMENTO DI UN SERVIZIO SPECIALISTICO IN UN SISTEMA SANITARIO	411
<i>P.Frigau</i> UNA PROCEDURA PER IL CALCOLO DEGLI EQUILIBRI DI GIOCHI A SOMMA NULLA	433
<i>M.Gallegati - L.Stefanini</i> STIMA ECONOMETRICA IN DISEQUILIBRIO DI UN MODELLO IS - LM	449
<i>S.Gambelli</i> REALIZZAZIONE DI PROBABILITA' QUALITATIVE DEBOLMENTE ADDITIVE	475
<i>L.Gardini</i> DINAMICHE COMPLESSE IN UNA CLASSE DI MODELLI "IS - LM" ALLE DIFFERENZE NONLINEARI, BIDIMENSIONALI	487
<i>G.Giorgi - S.Mititelu</i> INVEXITY IN NONSMOOTH PROGRAMMING	509
<i>F.Grasso</i> SULL'APPLICAZIONE DI ALCUNE TECNICHE DI APPROSSIMAZIONE AL PROBLEMA DELLA VALUTAZIONE DI UN CONTRATTO "OPTION ON STOCK FUTURES"	521

<i>A. Guerraggio</i> FUNZIONI SUPEROMOGENEE E SUPERADDITIVE E CONCAVITA' GENERALIZZATA.....	537
<i>L. Levi</i> CRITERI DI DOMINANZA E TRANSITIVITA'	559
<i>M. Li Calzi</i> ON THE CONSTRUCTION OF PREFERENCES OVER TEMPORAL PROSPECTS	569
<i>P. Manca</i> SULLE LEGGI FINANZIARIE SCOMPONIBILI, SCOMPONIBILI - UNIFORMI, COMPLETE	589
<i>S. Margarita</i> UN MODELLO DI RETE NEURALE ARTIFICIALE PER IL CAMPIONAMENTO DA POPOLAZIONI FINITE	601
<i>M. Moscarelli</i> SULLA SCELTA FRA OPERAZIONI A GARANZIA DI FLUSSI FINANZIARI	627
<i>M. Ottaviani</i> ALCUNI RISULTATI SU PROBLEMI DI OTTIMO SOTTO VINCOLI LINEARI	649
<i>G. Pacelli</i> OTTIMO DI UNA FUNZIONE FRAZIONARIA LINEARE SU UNA SFERA DI UNO SPAZIO AFFINE	661
<i>G. Patrizi - C. Spera</i> G.O.AL. : A GENERAL OPTIMIZATION ALGORITHM (DESCRIPTION AND EXPERIMENTAL RESULTS)	677
<i>E. Pessa - B. Rizzi</i> DINAMICHE ECONOMICHE E MODELLI DI EVOLUZIONE DI POPOLAZIONI	703
<i>R. Pini</i> SEMICONVESSITA' E SEMICONVESSITA' GENERALIZZATA	727

<i>F.A.Rossi - E.Erlacher</i> ARBITRAGGI SU ALCUNE VALUTE EUROPEE DALL'ANALISI DELLE QUOTAZIONI UFFICIALI	737
<i>F.A.Rossi - I.Gavioli</i> IL MULTIPLE PROBABILISTIC TRAVELING SALESMAN PROBLEM E UN ALGORITMO RISOLUTIVO	763
<i>G.A.Rossi</i> UTILITA' ATTESA : UNA VISIONE MODERNA	773
<i>G.Rossini</i> UTILITY UNDER UNCERTAINTY : A NOTE	785
<i>N.Salvadori</i> SU UN SISTEMA DI DISEQUAZIONI ALLE DIFFERENZE	809
<i>D.Sciutti</i> ON THE ACCUMULATION UNDER COMPOUND INTEREST	821
<i>L.Sigalotti</i> MODELLI PER L'ANALISI DELLA MORTALITA' IN PRESENZA DI USCITE AUTOSELEZIONATE	829
<i>G.Stoppa</i> UNA ESTENSIONE AL TEOREMA DI REVANKAR, HARTLEY E PAGANO	843
<i>P.Stucchi</i> ASSICURAZIONE DI PORTAFOGLIO SU INDICI AZIONARI. CONSIDERAZIONI TEORICHE ED APPLICAZIONI PRATICHE AL CASO ITALIANO	849
<i>C.Sutti</i> UN ALGORITMO PARALLELO PER L'ANALISI INPUT - OUTPUT	875
<i>M.Uberti</i> SU UN PROBLEMA DI FRANCHIGIA OTTIMA IN UN CONTRATTO DI ASSICURAZIONE DANNI	899
<i>L.Vannucci</i> POLITICA OTTIMA DEI DIVIDENDI PER UN PROCESSO DI RISCHIO A INCREMENTI MARKOFFIANI	915

<i>L.Vianelli Bellavista</i>	
NUMERI SPECIALI E CONVOLUZIONE DI DISTRIBUZIONI DISCRETE TRONCATE	927
<i>E.Volpe Di Prignano</i>	
INDAGINE SUI RISCHI CATASTROFICI E SULLE LORO PECULIARITA' ASSICURATIVE	947
<i>G.M.Zambruno</i>	
DETERMINAZIONE EFFICIENTE DEI MARGINI PER CONTRATTI "FINANCIAL FUTURES"	963
<i>M.Zecchin</i>	
VALUTAZIONI NUMERICHE IN FONDI PENSIONE SECONDO LA TECNICA ATTUARIALE STATUNITENSE	969
 Parte IV - SUNTI	
<i>M.Bianchi</i>	
SOLUZIONI QUASI PERIODICHE DI UNA DISEQUAZIONE QUASI VARIAZIONALE	991
<i>E.Castagnoli</i>	
QUALCHE RIFLESSIONE SULL'UTILITA' ATTESA	993
<i>G.Coletti - A.Gilio - R.Scozzafava</i>	
EVENTI CONDIZIONATI CON INFORMAZIONI VAGHE : UN MODELLO PER SISTEMI ESPERTI	995
<i>G.Coletti - A.Gilio - R.Scozzafava</i>	
ORDINAMENTI DI EVENTI CONDIZIONATI RAPPRESENTABILI CON PROBABILITA' CONDIZIONATE	999
<i>M.Di Bacco - G.Regoli</i>	
GIUSTIFICAZIONE DECISIONISTICA DELLA FORMULA DI BAYES	1001
<i>B.Dumas - E.Luciano</i>	
AN EXACT SOLUTION TO A DYNAMIC PORTFOLIO CHOICE PROBLEM UNDER TRANSACTION COSTS.....	1003

<i>M.Galeotti - F. Gori</i>	
GLOBAL DYNAMICS IN MODELS OF FLUCTUATING GROWTH	1005
<i>F.Gori - F.Rinaldi</i>	
INTERAZIONI TRA LIVELLO DEI PREZZI E RACCOLTA NETTA DEI FONDI	1011
<i>B.Matarazzo</i>	
PCCA AND DOMINANCE IN MCDM	1015
<i>F.Molinari</i>	
SULLA SCELTA TRA VARIABILI ALEATORIE	1017
<i>C.Peri</i>	
UNA FORMULA DI GEOMETRIA INTEGRALE PER CORPI CONVEXI ED APPLICAZIONI A PROBLEMI DI PROBABILITA' GEOMETRICHE	1019
<i>G.Urgeletti Tinarelli</i>	
ESAME E CONFRONTO DI TALUNI METODI PER LA SCELTA DI POLITICHE DI JOINT - ORDERING	1021
<i>S.Vassallo</i>	
ALCUNI PROBLEMI DI PROBABILITA' GEOMETRICHE CON APPLICAZIONI ALLA STEREOLOGIA	1023