

ASSOCIAZIONE PER LA MATEMATICA APPLICATA
ALLE SCIENZE ECONOMICHE E SOCIALI

**ATTI
DEL DICIASSETTESIMO
CONVEGNO A.M.A.S.E.S.**

Ischia, 8 -11 settembre 1993

A cura dello

ISTITUTO ITALIANO PER GLI STUDI FILOSOFICI

Hanno contribuito alla pubblicazione
il Consiglio Nazionale delle Ricerche
e il Lloyd Adriatico

INDICE

Parte I - Conferenze

- Cortazar Gonzalo, Schwartz Eduardo S.
A compound option model of production and intermediate inventories. 17
- Gilboa Itzhak, Schmeidler David
Case-based decision theory: an outline. 55
- Kast Robert, Lapiéd André
Probabilità rivelata dalle date passate, dagli individui, oppure probabilità rivelata dai prezzi? 63
- Pitacco Ermanno
I modelli multistato: un linguaggio per la matematica attuariale. 85

Parte II - Articoli

- Allevi Elisabetta
Ulteriori proprietà di monotonìa generalizzata. 127
- Amenta Pietro
Il coefficiente di correlazione lineare tra matrici di dati nel contesto multivariato. 137
- Baccarin Stefano
Alcune osservazioni sui sistemi lineari di produzione. 153
- Barucci Emilio, Zezza PierLuigi
Some economic considerations on convexity in optimal control: optimal saving in a hedonistic society. 171
- Basile Achille
Ricchezza di selezioni per multifunzioni di produzione. 189
- Basso Antonella
Problemi di identificazione in alcuni modelli con dati incompleti. 201
- Battaglio Claudia, Longo Giovanni
GAPV di investimenti industriali e cambi. 215
- Bianchi Monica
Bifunzioni pseudo P-convesse e monotonìa generalizzata. 225

Bonagura Romana <i>Il modello stocastico ICRFS per la valutazione della riserva sinistri delle imprese di assicurazioni: una sua applicazione ai dati del mercato italiano-ramo RCA.</i>	241	Giorgi C Constra remarks
Brun Marco, Canestrelli Elio <i>Un modello intertemporale di decisione consumo-investimento applicato al mercato azionario italiano.</i>	271	Giorgi C Invexity
Camiz Sergio <i>The analysis of input/output matrices through associated graphs.</i>	287	Giove Si Stabilizz fuzzy ad
Campana Antonella <i>L' "adjustment coefficient" e il rapporto riassicurativo.</i>	301	Gota Ma Valutazi.
Cardin Marta, Ferretti Paola <i>Certo equivalente, avversione al rischio e avversione all'incertezza.</i>	315	Levi Lau Alcune o
Cigola Margherita, Peccati Lorenzo <i>Un problema di collant.</i>	333	Maffi Er La valuta
Consiglio Andrea <i>Il simulated annealing per la selezione di un portafoglio media-varianza a variabili intere.</i>	345	Magni C Valore d'indebit
Corazza Marco, Giove Silvio <i>Applicazione delle reti neurali alla selezione delle variabili esplicative in modelli economico-finanziari.</i>	353	Manna A Scelta de nei fondi
Corazza Marco, Nardelli Carla <i>Fenomeno della dipendenza a lungo termine nel mercato finanziario italiano.</i>	359	Marchi A An algor.
Crisma Lucio <i>Una caratterizzazione delle probabilità coerenti condizionate ad eventi finiti.</i>	383	Mari Car Modelli sensitive.
De Giuli Maria Elena, Magnani Umberto <i>Consistent optima in pure capital rationing problems.</i>	393	Matrigali Strutture coperture
Dieci Roberto <i>Sulla scelta della scorta massima in un modello (s, s-1) con domanda poissoniana e lead time esponenziale.</i>	401	Merlone Scelte dir
Fischetti Matteo, Toth Paolo, Vigo Daniela (Università di Bologna) <i>Un algoritmo branch and bound per il capacitated vehicle routing problem su grafi orientati.</i>	417	Montrucc Sulla mis
Gallizio Giovanni Paolo <i>Leva finanziaria e investimenti scalabili.</i>	445	Montrucc Proprietà obiettivo
Giacomello Bruno <i>Immunizzazione finanziaria e tasso di cambio: l'ipotesi di una relazione decrescente e convessa con il differenziale di interesse.</i>	459	Olivieri A Effetto se

ese	241	Giorgi Giorgio, Guerraggio Angelo <i>Constraint qualifications: the invex case, the set constraint case and other remarks.</i>	485
al	271	Giorgi Giorgio, Molho Elena, Schaible S. <i>Invexity of quadratic functions, local and restricted invexity.</i>	511
	287	Giove Silvio <i>Stabilizzazione dinamica in modelli macroeconomici mediante la teoria del controllo fuzzy adattativo.</i>	525
	301	Gota Maria Luisa <i>Valutazione finanziaria di progetti e loro tempo di completamento.</i>	541
	315	Levi Laura <i>Alcune osservazioni sulla dominanza temporale.</i>	547
	333	Maffi Emilio <i>La valutazione della redditività di un contratto di leasing.</i>	559
	345	Magni Carlo Alberto <i>Valore attuale netto di un'operazione finanziaria e politiche ottimali d'indebitamento.</i>	569
elli	353	Manna Angelo <i>Scelta dei generatori di numeri pseudo-casuali; riflessi sulle valutazioni attuariali nei fondi pensione.</i>	581
	359	Marchi Anna, Sodini Claudio <i>An algorithm for a non-differentiable non-linear fractional programming problem.</i>	597
	383	Mari Carlo <i>Modelli stocastici per la valutazione del contratto future su titoli interest-rate sensitive.</i>	609
	393	Matrigali Paola, Pacati Claudio <i>Strutture per scadenza dei tassi di interesse come soluzioni duali di problemi di copertura.</i>	625
ana	401	Merlone Ugo <i>Scelte dinamiche ottime di investimento.</i>	649
itmo	417	Montrucchio Luigi, Tibiletti Luisa <i>Sulla misura di avversione al rischio di de Finetti-Arrow-Pratt.</i>	655
	445	Montrucchio Luigi, Uberti Mariacristina <i>Proprietà contrattive in problemi di ottimizzazione sequenziale con funzione obiettivo uniperiodale non limitata.</i>	675
ione	459	Olivieri Annamaria <i>Effetto selezione ed andamento della riserva per rendite d'invalidità.</i>	695

Paris Francesco M. <i>Alcune puntualizzazioni per una teoria degli interest rate swaps.</i>	711	Bacine Valuta: capital
Pucci Sabrina <i>Valutazione delle prestazioni maturate da un partecipante ad un fondo pensioni nell'ipotesi di uscita anticipata per dimissioni.</i>	729	Basile Un mo
Queyranne Maurice, Spieksma Frits, Tardella Fabio <i>A general class of greedily solvable linear programs.</i>	751	Beccac Sulle fc
Redaelli Giovanna <i>Scelte finanziarie in presenza di vincoli.</i>	769	Brasoli La pers
Ritelli Daniele <i>On a production planning problem.</i>	787	Bruno Modell
Roma Antonio <i>Un modello bivariato della struttura per scadenza dei tassi di interesse.</i>	803	Cambin Flussi e
Rossi Francesco <i>Sull'uso congiunto di indicatori per un microsistema decisionale nell'analisi tecnica.</i>	823	Cantalt Una str
Sbordone Carlo <i>Medie integrali e loro valori asintotici.</i>	839	Capass A non l
Scarelli Antonio <i>Analisi multicriterio in condizioni di incertezza.</i>	847	Carota Funzion
Sobrero Monica <i>Metodi ricorsivi per lo studio delle distribuzioni composte nella teoria del rischio.</i>	865	Ceccar Matrici
Tedesco Lucia <i>Efficienza e tasso di convergenza di un sistema bonus-malus.</i>	871	Cigola Ordina
Verico Paola <i>Ancora sullo studio di collettività chiuse con il metodo simulativo.</i>	881	Coletti Charac
Zaffaroni Alberto <i>Condizioni necessarie di ottimo per funzioni direzionalmente derivabili.</i>	899	De San Sottova
Parte III - Sunti		Diale G Algorit
Antoni Carla, Pellegrini Letizia <i>Funzione gap e disequazioni variazionali. Applicazioni a problemi di equilibrio del traffico.</i>	921	Ellero Un pari
		Falbo P La valu

		Bacinello Anna Rita, Ortu Fulvio <i>Valutazione del premio di assicurazioni "equity-linked" con garanzie di minimo capitale e in presenza di rischio di tasso.</i>	923
mi	711		
		Basile Luciano, D'Apuzzo Livia <i>Un modello per la sintesi dei giudizi.</i>	927
	729		
		Beccacece Francesca <i>Sulle forme funzionali flessibili.</i>	931
	751		
		Brasolin Antonella <i>La persistenza nei risultati dei fondi comuni di investimento.</i>	933
	769		
		Bruno Maria Giuseppina <i>Modelli non markoviani e mercati finanziari.</i>	937
	787		
		Cambini Riccardo <i>Flussi di costo minimo e modelli lineari di produzione: alcuni recenti risultati.</i>	941
	803		
nalisi		Cantalupi Marco, Nardini Franco, Ricottilli Massimo <i>Una strategia di sviluppo con ricorso al credito estero.</i>	945
	823		
		Capasso Vincenzo, Di Liddo Andrea, Maddalena Lucia <i>A non linear model for the geographical spread of innovations.</i>	953
	839		
		Carota Cinzia, Salinelli Ernesto <i>Funzioni generatrici e teoria delle singolarità.</i>	957
	847		
schio.	865	Ceccarossi Guido Luigi <i>Matrici irriducibili e indice di primitività.</i>	959
		Cigola Margherita, Li Calzi Marco <i>Ordinally quasiconcave functions.</i>	961
	871		
		Coletti Giulianella, Scozzafava Romano <i>Characterization of coherent conditional probabilities.</i>	963
	881		
		De Sanctis Angela <i>Sottovarietà geodetiche di una famiglia di modelli statistici.</i>	965
	899		
		Diale Giulio, Rotta Marcello <i>Algoritmi per la ricerca delle basi di un insieme di vettori.</i>	969
		Ellero Andrea, Moretti Tomasin E. <i>Un particolare problema di programmazione frazionaria.</i>	971
ilibrio		Falbo Paolo <i>La valutazione delle imprese produttrici di risorse naturali: il caso del petrolio.</i>	973
	921		

Favaretto Daniela, Mazzega Paolo, Mezzaroba Alberto, Viscolani Bruno <i>Controllo ottimo di produzione e comunicazione per un prodotto stagionale con una funzione di domanda non differenziabile.</i>	975
Frittelli Marco <i>Sull'esistenza di una misura equivalente di martingala.</i>	979
Galeotti Marcello, Gori Franco <i>Sulla struttura geometrica degli attrattori in sistemi dinamici debolmente contraenti.</i>	981
Gardini Laura, Mammana Cristiana <i>Bounded fluctuations and basins of attraction.</i>	985
Ghezzi Luca Luigi, Peccati Lorenzo <i>Un nuovo approccio al calcolo dei valori fondamentali.</i>	989
Gilio Angelo <i>Algoritmi per la coerenza di probabilità condizionate.</i>	991
Giroto Bruno, Holzer Silvano <i>Weak compactness and Prokhorov type theorems for sets of masses on normal topological spaces.</i>	995
Grasso Fabio <i>Sulla regolamentazione di una "riserva di compensazione" per le assicurazioni del ramo credito.</i>	1001
Manca Raimondo <i>Algoritmi per la gestione di fondi pensione a mezzo di processi stocastici semimarkoviani.</i>	1005
Mignanego Fausto <i>Approssimazione di un problema non lineare di minimizzazione a bilivello.</i>	1007
Modica Salvatore, Rustichini Aldo <i>Unawareness.</i>	1009
Petris Giovanni, Regazzini Eugenio <i>Catene di Markov e scambiabilità parziale.</i>	1011
Picech Liviana <i>Considerazioni sull'utilizzo di un modello moltiplicativo in una tariffa bonus-malus.</i>	1013
Pini Rita <i>Convessità lungo curve e invessità su una varietà liscia.</i>	1019
Raucci Roberto <i>Esistenza per problemi di Stackelberg vettoriali.</i>	1017

Regoli C
RationalRossi G
Some obSimonel
Fuzzy inSquillan
EconomSquillan
On somWeinric
On the v

		Regoli Giuliana	
		<i>Rational comparisons and numerical representations.</i>	1023
<i>con</i>	975	Rossi Guido A.	
		<i>Some observations about additivity of probabilities.</i>	1025
	979	Simonelli Maria Rosaria	
		<i>Fuzzy interactive knowledge</i>	1027
<i>nte</i>	981	Squillante Massimo, Ventre Aldo G. S.	
		<i>Economic systems as general dynamical systems and invariant states.</i>	1029
	985	Squillante Massimo, Ventre Aldo G. S.	
		<i>On some nonlinear accumulation laws.</i>	1033
	989	Weinrich Gerd	
		<i>On the validity of Arrow's local risk-neutrality theorem.</i>	1037
	991		
<i>mal</i>	995		
<i>ioni</i>	1001		
<i>stici</i>	1005		
	1007		
	1009		
	1011		
<i>nus-</i>	1013		
	1019		
	1017		