ASSOCIAZIONE PER LA MATEMATICA APPLICATA
ALLE SCIENZE ECONOMICHE E SOCIALI

Sotto gli auspici dell'Istituto Italiano per gli studi Filosofici

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

Pugnochiuso, 25-28 settembre 1995

Ha contribuito alla pubblicazione del Volume
il Consiglio Nazionale delle Ricerche

Cacucci Editore - Bari -1995

INDICE

Parte I - Conferenze

Asset Returns Under Recursive Utility pag. 11
L.G.Epstein - University of Toronto

Dynamic Programming and Variational Inequalities in Finance 37
U.Haussmann - University of British Columbia

Dini derivatives in optimization-generalized monotonicity 49
G.Giorgi - Università di Pavia S.Komlòsi - Janus Pannonius University Pécs

Parte II - Articoli

Symmetry-Breaking:a Theory of Pattern Formation and Economic Applications 65
E.Agliardi - Università di Cassino

Sulle perturbazioni Maturity dependent:una estensione del teorema di Redington 69
P.Amato - Università di Bari

Sopra un problema di adeguamento 86
E.Badolati e M.Pietroluongo - Università del Molise

A note on investments and increasing returns to scale 95
E Barucci - Università di Firenze

Neural Networks for Contingent Claim Pricing via the Galerkin Method 108
E.Barucci - Università di Firenze U.Cherubini - Ufficio Studi-Banca Commerciale Italiana Milano L.Landi - Università di Firenze

Allocazione di risorse con vincoli gerarchici 113
A.Basso - Università di Venezia

Solving the multy-knapsack problem combining lagrangean theory tabu search techniques 129
C.Benati - Università di Trento A.Sorato - Università di Venezia

On generalized concavity of social Welfare Functions 145
M.Bianchi e P.Mazzoleni - Università Cattolica Milano

FMH:Una verifica sul mercato italiano 158
S.Bianchi - Università di Roma "La Sapienza"

A cobweb model with learning effects 162
G.I.Bischi - Università di Urbino A.Naimzada - Università "L.Bocconi" Milano

Indifferenze non transitive e teoria dell'utilità:Alcuni risultati 178
G.Bosi e R.Isler - Università di Trieste

Funzioni concave generalizzatz vettoriali:Composizione,crescenza e monotonia 185
R.Cambini - Università di Pisa

Sulla valutazione del "massimo danno probabile" 201
A.Campana - Università di Roma "La Sapienza"

Attitudine verso l'incertezza nei modelli con capacità 208
M.Cardin - Università di Udine P.Ferretti - Università di Venezia

Linearity in Financial Models 222
E.Castagnoli e G.Gurioli - Università "L.Bocconi" Milano

A Generalized Measure of Competition 233
R.Cesari - Università di Lecce

Una versione frazionaria delle leggi finanziarie in regime dell'interesse composto 244
M.Corazza e C.Nardelli - Università di Venezia

Un modello trinomiale per la valutazione di opzioni Lookback 258
M.Costabile - Università di Roma "La Sapienza"

Una legge dei grandi numeri per un modello CIR modificato 273
L.De Cesare - Università di Foggia D.Posa - Università di Lecce

On a Theorem by Gale-Hadley-Lancaster and Its Economic and Financial Applications 281
M.E.De Giuli - Università di Pavia

A General Equilibrium Model with Bid-Ask Spread Asset Prices 291
A.De Waegenaere - University,and G.R.E.Q.A.M.,Marseille
R.Kast - G.R.E.Q.A.M.,C.N.R.S.,Marseille
A.Lapied - G.R.E.Q.A.M.,Université d'Aix-Marseille III

Prior models of consistency for the reconstruction of individual preference structures 299
M.Fedrizzi,M.Fedrizzi,R.A.Marques Pereira - Università di Trento

A New Index for Condition and Collinearity 310
F.Fineschi,R.Giannetti,M.Mencarelli - Università di Siena

Criteri di tariffazione nella copertura assicurativa dei depositi bancari 323
G.Foschini - Università di Roma "La Sapienza"

Linear Operators and Coherent Probabilities 333
L.Garlappi and G.Gurioli - Università di Trieste and Università "L.Bocconi" Milano

Un modello per le emissioni ottimali di titoli sensibili alle variazioni dei tassi di interesse 351
R.Giacometti - Università degli studi di Bergamo e Brescia

Applicazione di un modello multinomiale ai movimenti della struttura a termine nel mercato Italiano:valutazioni empiriche 367
A.Gnudi - Università di Milano

Bond and Eurolira Futures Options with Futures-Style Margining 378
M.G.Iovino - Università di Perugia

La riassicurazione Excess of Loss e il coefficiente di insolvenza 390
E.Lari - Università di Genova

Un uso delle catene di Markov per la rappresentazione dell'intensità concorrenziale in un settore economico 400
C.A.Magni - Università di Modena

Problema si Stackelberg con risposte pesate 416
L.Mallozzi e J.Morgan - Università di Napoli

Period-adding and period-doubling phenomena 426
C.Mammana - Università di Ancona L.Gardini - Università di Brescia

Sulla connessione della frontiera efficiente di un problema bicriteria 439
A.Marchi - Università di Pisa

Prezzi e rischiosità di titoli a tasso variabile in un modello univariato di Heath,Jarrow e Morton 450
C.Mari - Università di Pescara

Dinamica stocastica e dimensione di correlazione 464
C.Nardelli - Università di Venezia

Sulle basi tecniche per assicurazioni 'long term care' in ambito multistato 484
A.Olivieri - Università di Brescia

Approssimazione polinomiale della struttura dei prezzi di titoli obbligazionari 500
C.Pacati - Università di Perugia

Investimenti in automazione flessibile:un semplice modello di valutazione 508
L.Peccati e A.Tagliani - Università "L.Bocconi" Milano

Sopra un'applicazione della formula di Bartholomew 519
M.Pietroluongo - Università del Molise

Valutazione di titoli obbligazionari con piano di ammortamento indicizzato 532
G.Redaelli - Università Cattolica Milano

Su alcune generalizzazioni del modello di crescita economica di Goodwin 545
D.Ritelli - Università di Bologna

Approssimazioni generalizzate del primo ordine 561
M.Rocca - Università di Pavia

Procedure di voto e decisioni multicriteriali 576
A.Scarelli - Università di Viterbo

Forecasting currency returns using currency positions as an asset class in global asset allocation 589
M.R.Simonelli - Università di Napoli W.T.Ziemba -University British Columbia, Vancouver

Separability of financial laws and functional equations 593
M.Squillante - Università di Napoli A.G.S.Ventre - Università di Trento

Alcune considerazioni su un problema di localizzazione di autovalori 598
S.Stefani - Università di Brescia A.Torriero - Università Cattolica Milano

Trasformata inversa di Laplace e problema dei momenti 612
A.Tagliani - Università di Milano

The information in the term structure of interest rates 628
C.Torricelli - Università di Modena

Limitazioni di probabilità non migliorabili 645
E.Volpe di Prignano e M.Clavelli - Università di Roma "La Sapienza"

Parte III - Sunti

Monotonia generalizzata per archi 667
E.Allevi - Università Cattolica Milano

Interest-rate risk and the valutation of Sinkinh-fund Bonds with multiple instalments 670
A.R.Bacinello - Università di Cassino F.Ortu - Università di Trieste

Medie integrali e disuguaglianze inverse 672
L.Basile,L.D'Apuzzo e M.Squillante - Università di Napoli

Dominanza temporale in ambito aleatorio 676
F.Beccacece - Università "L.Bocconi" Milano

A regime switching model for exchange rates as solution to a stochastic control problem 678
R.Castellano - Università di Macerata R.L.D'Ecclesia - Università di Urbino

An inflation minimization problem 681
M.B.Chiarolla - Università di Bari U.G.Haussmann - University of British Columbia,Vancouver

Learning from data by coherent probabilistic reasoning 682
G.Colletti - Università di Perugia R.Scozzafava - Universita di Roma "La Sapienza"

Un modello simulativo per il controllo del rischio di insolvibilità nell'impresa di assicurazione contro i danni 686
R.Daris - Università di Trieste

Un modello multidimensionale per la valutazione di opzioni finanziarie 691
P.L.De Angelis - Università di Napoli

Indici di potere in casi complessi 695
E.Denti - Università di Bologna N.Prati - Università di Udine

Su alcuni modelli matematici per la diffusione di innovazioni tecnologiche 697
A.Di Liddo - Ist.Ric.Mat.Appli.del CNR Bari L.Maddalena - Università di Foggia

Su un problema di ottimizzazione di politiche finanziarie 700
R.Dieci - Università di Parma

Problemi equivalenti in programmazione frazionaria generalizzata 702
A.Ellero e E.Moretti Tomasin - Università di Venezia

Asset Pricing in Financial Markets with Frictions 704
M.Frittelli - Università di Milano

Politica monetaria e struttura dei tassi di interesse 707
G.Fusai - Università di Brescia

Sistemi elettorali 709
G.Gambarelli - Università di Bergamo

Scelte in condizioni di certezza:Dalla teoria positiva alla teoria normativa 712
G.Giusti - Università di Bologna F.Nardini - Università di Catania
F.Zagonari - Università di Bologna

Sulla riserva matematica nelle assicurazioni malattia con "premio di esperienza" 715
F.Grasso - Università di Firenze

Funzione incremento,derivata generalizzata e convessità generalizzata 717
S.Greco - Università di Catania

La subscindibilità di leggi finanziarie 718
S.Greco - Università di Catania

Rough Sets approach to stock selection:an application to the Italian market 719
S.Lo Cascio - Erasmus University of Rotterdam B.Matarazzo,S.Greco
Università di Catania

Semicontinuità sequenziali per problemi di ottimizzazione vettoriali parametrici 720
P.Loridan - CERMSEM Université de Paris 1 J.Morgan,R.Raucci - Università
di Napoli

Revisione di accordi interaziendali di fornitura 722
F.Luciano - Università di Torino L.Peccati - Università "L.Bocconi" Milano

Comparison of L-R fuzzy numbers:some numerical experiments 723
B.Matarazzo - Università di Catania G.Munda - Universitat Autonoma de Barcelona

Two-level optimization in imitative stock-markets 727
F.Mignanego,P.Modesti - Università di Genova

On a Notion of Quasiconcave Set with Applications to Vector Optimization 730
E.Molho - Università di Pavia

A monotonic variable-metric algorithm for linearly constrained nonlinear programming 733
G.Pacelli,M.C.Recchioni - Università di Ancona

Una applicazione dell'approccio multistato nei fondi pensione 736
R.Pelessoni,M.Zecchin - Università di Trieste

Caratterizzazione delle soluzioni nell'ottimizzazione intertemporale stocastica 738
F.Privileggi - Università di Trieste

Sulla distribuzione esatta delle probabilità,in riferimento al risultato di esercizio di un fondo pensione 741
S.Pucci - Dottorato di Ricerca in Scienze Attuariali,Universita di Roma
"La Sapienza"

Problemi gerarchici di punti di Nash:esistenza e approssimazione nel caso di unicità al livello inferiore 745
R.Raucci - Università di Napoli

Further on the "principle of consistency" of Insolera-Cantelli for absolutely continuous financial laws 749
G.Rossi,L.Tibiletti - Università di Torino

A control financial model about portfolio theory 751
S.G.Sigini - Università di Roma "La Sapienza"