

XXIII CONVEGNO
A.M.A.S.E.S.

Associazione per la Matematica
Applicata alle Scienze Economiche e Sociali
8, 9, 10 e 11 settembre 1999

Università degli Studi della Calabria - Rende

CONFERENZE PLENARIE

Phelim Boyle, Waterloo University, Canada:

On barrier options

Piera Mazzoleni, Università Cattolica del Sacro Cuore, Milano:

Ottimizzazione parametrica per le applicazioni

Yosi Rinott, San Diego University, California:

**Limit theorems and expansions
under various dependence structures**

Ivar Ekeland, Université Paris IX, Dauphine:

**Reconstructing the economy from the equilibrium manifold:
can you feel the invisible hand?**

Aula Magna - Università degli Studi della Calabria

Registrazioni

Cerimonia inaugurale

Conferenza di Phelim Boyle: On Barrier Options.

Colazione di lavoro

Aula Consolidata 1

Massimo Angrisani, Università degli Studi di Roma La Sapienza:

Un modello di gestione di un fondo pensione I.V.S. a traiettorie individuali esatte.

Ennio Badolati, Università degli Studi del Sannio:

Una serie convolutoria per l'equazione di Dickson.

Maria Giuseppina Bruno, Università degli Studi di Roma La Sapienza:

Sull'analisi del rischio nei fondi pensione. Applicazioni.

Antonella Campana, Università degli Studi del Molise:

La distribuzione generalizzata di Poisson per la rappresentazione della sinistrosità nell'assicurazione R.C. auto.

Alessandra Carleo, Università degli Studi del Molise:

Un confronto tra due funzioni di non rovina relative a due diversi processi stocastici dei sinistri.

Marco Micocci, Università degli Studi di Roma La Sapienza:

Un modello attuariale di valutazione e gestione del rischio creditizio.

Coffee-break

Annamaria Olivieri, Università degli Studi di Trieste,

Sui fattori di rischio demografico nei portafogli di rendite vitalizie.

Franco Pelleray, Università degli Studi di Bergamo:

Portfolio diversification with non-independent prospects.

Mariafortuna Pietrolungo, Università degli Studi del Molise:

Comportamento asintotico della probabilità di rovina per particolari funzioni subesponenziali in un processo di rinnovi.

Pietro Platania, Università degli Studi di Catania:

Sui metodi di calcolo del rischio in fondi pensione soggetti a molteplici cause di eliminazione concorrenti. Applicazioni.

Alessandro Sbuelz, Università degli Studi di Trieste:

A general treatment of barrier options.

Matematica
attuariale
e teoria
del rischio

Aula Consolidata 2

Emilio Barucci, Università degli Studi di Pisa:

The dynamics of Pareto efficient allocations with stochastic differential utility.

Gian-Italo Bischi, Università degli Studi di Urbino:

Synchronization and riddling in competition models.

Andrea Di Liddo, I.R.M.A. - C.N.R. Bari:

Optimal pricing, advertising and subsidies policies for an innovation diffusion problem.

Roberto Dieci, Università degli Studi di Parma:

On triangular maps describing a Kaldor-type business cycle model.

Fausto Gozzi, Università degli Studi di Roma La Sapienza:

Dynamics income distribution with convex-concave production function.

Maria Gabriella Graziano, Università degli Studi della Calabria:

Measuring the set of blocking coalitions in infinite dimensional economies.

Coffee-break

Anna Agliari, Università Cattolica del Sacro Cuore:

The dynamics of an oligopoly with three producers.

Bruno Bassan, Università degli Studi di Roma La Sapienza:

Sul ruolo dell'informazione in alcuni problemi di teoria dei giochi e statistica matematica.

Gianfranco Gambarelli, Università degli Studi di Bergamo:

Una formulazione generalizzata di valore e di indice di potere.

Jacqueline Morgan, Università degli Studi di Napoli Federico II:

Stackelberg-Nash-Cournot equilibria for oligopolistic market with a multivalued inverse demand function.

Marco Pagnozzi, Università degli Studi di Napoli Federico II:

Bids as a vehicle of (mis)information: collusive behaviour in english auctions with common values.

Matematica
per l'economia

Teoria dei
giochi

Teatro "A. Rendano"

Piera Mazzoleni, Università Cattolica del Sacro Cuore:
Generalized monotonicity of the solution map.

Riccardo Cambini, Università degli Studi di Pisa:

Vector valued pseudoconcave functions: first and second order characterizations.

Giorgio Giorgi, Università degli Studi di Pavia:

Alla ricerca di una dimostrazione elementare del Teorema di Farkas-Minkowski.

Silvio Giove, Università degli Studi di Venezia Ca' Foscari:

Controllo ottimo sfocato.

Enrico Miglierina, Università Bocconi:

Some remarks on a special scalarization.

Alberto Peretti, Università degli Studi di Milano Bicocca:

Mappe contrattive per la determinazione dell'insieme immagine.

Coffee-break

Conferenza di **Piera Mazzoleni**:

Ottimizzazione parametrica per le applicazioni

Fabio Tardella, Università degli Studi di Roma La Sapienza:

Piecewise concavity and discrete approaches to continuous minimax problems.

Marina Resta, Università degli Studi di Genova:

On a model for stable distributions.

Pausa pranzo

Fabio Maccheroni, Università Bocconi:

Maximin under risk: a conservative compromise.

Gianpi Bosi, Università degli Studi di Trieste:

Funzionali di premio, aversione relativa al rischio costante ed esistenza di un equivalente certo

Enrico Diecidue, Università Bocconi:

On the intuition of RDEU.

Salvatore Greco, Università degli Studi di Catania:

Misurazione congiunta e incoerenze nelle preferenze.

Coffee-break

Assemblea dei Soci

Teatro "A. Rendano" - Ridotto

Giuseppe Di Biase, Università degli Studi di Pescara G. D'Annunzio:
La valorizzazione di prodotti derivati per mezzo di un modello semi-marcoviano omogeneo.

Marco Corazza, Università degli Studi di Venezia Ca' Foscari:

Merton-like theoretical frame for fractional brownian motion in finance.

Marco Corazza, Università degli Studi di Venezia Ca' Foscari:

Modelli di scheduling e reti neurali artificiali in una struttura ospedaliera: il caso day-surgery.

Samuele Riccarelli, Università degli Studi di Siena:

Leggi finanziarie interne pure.

Gianluca Fusai, Università degli Studi di Firenze:

Discretely sampled asian options- part I: The model and the numerical analysis.

Aldo Tagliani, Università degli Studi di Trento:

Discretely sampled asian options - part II: A comparison with continuous monitoring.

Coffee-break

Monica Baldini, Università degli Studi di Roma La Sapienza:
Volatilità stocastica: un confronto fra il modello Garch e il metodo numerico.

Andrea Berardi, Università di Verona:

Bond returns, consumption and preferences.

Pausa pranzo

Riccardo Cesari, Università degli Studi di Bologna:

Tre metodi di determinazione dell'asset allocation strategica di un fondo pensione chiuso.

Andrea Gamba, Università degli Studi di Venezia Ca' Foscari:

Option pricing bounds in a multi-period setting.

Stefano Herzel, Università degli Studi di Perugia:

Condizioni di non-arbitraggio sui prezzi di titoli derivati.

Ester Lari, Università degli Studi di Genova:

Sull'uguaglianza tra $ecva$ e $vacc$.

Coffee-break

Teatro "A. Rendano"

Massimo Angrisani, Università degli Studi di Roma La Sapienza:
Diffusione dei dati statistici e problemi di riservatezza: due nuove tecniche di tipo microaggregativo.

Sergio Bianchi, Università degli Studi di Cassino:
On estimating the time-changing dependence in economic and financial time series.

Andrea Ellero, Università degli Studi di Venezia Ca' Foscari:
Alcune osservazioni sulle scommesse sportive a quota fissa.

Raimondo Manca, Università degli Studi di Chieti:
Il trattamento numerico dei processi semi-markov.

Paolo Vicig, Università degli Studi di Trieste:
Una nozione di indipendenza stocastica per probabilità imprecise.

Antonella Basso, Università degli Studi di Trieste:
A Dea measure for mutual funds performance.

Coffee-break

Conferenza di Yosi Rinott:
Limit Theorems and Expansions under Various Dependence Structures

Intervento di Pasquale Siniscalco, Comit Direzione Generale, Servizio Studi:
Una valutazione teorica di un 'quanto-basket' reverse floater

Pausa pranzo

Enrico Cavalli, Università degli Studi di Bergamo:
Sperimentazione di reti neurali per la previsione dell'insolvenza aziendale.

Umberto Cherubini, Università degli Studi di Bologna:
Fuzzy value-at-risk.

Daniela Favaretto, Università degli Studi di Venezia Ca' Foscari:
Un modello generale per il marketing di prodotti stagionali.

Manlio Gaudio, Università degli Studi della Calabria:
Esperienze di ottimizzazione applicata alla logistica.

Benedetto Matarazzo, Università degli Studi di Catania:
L'approccio dei rough sets all'analisi del rating finanziario.

Lorenzo Peccati, Università Bocconi:
VAR- as a risk measure for multiperiod inventory models.

Coffee-break

Maria B. Chiarolla, Università degli Studi di Roma La Sapienza:
A two-country-economy equilibrium model.

Paolo Fegatelli, Università degli Studi di Bergamo:
Modeling bank capital regulation in a multiperiod prospective: beyond the limits of a mean-variance portfolio approach.

Paolo Fegatelli, Università degli Studi di Bergamo:
Perverse effects of capital regulation in a banking-sector model with informational asymmetries.

Probabilità e
Statistica

Ricerca
operativa

Matematica per
l'economia

Matematica
finanziaria

Teatro "A. Rendano" - Ridotto

Marco Li Calzi, Università degli Studi di Venezia Ca' Foscari:
Toward a target-based theory of finance.

Umberto Magnani, Università degli Studi di Pavia:
Non-linear leverage and the value of the firm.

Maria Elvira Mancino, Università degli Studi di Firenze:
A Taylor formula to price and hedge european contingent claims.

Carlo Mari, Università degli Studi della Calabria:
Making the CIR model consistent with arbitrary initial term structures: a perturbative approach.

Loretta Mastroeni, Università degli Studi dell'Aquila:
Option pricing with vanishing stochastic volatility.

Costanza Torricelli, Università degli Studi di Modena:
Pricing options on a vague asset.

Coffee-break

Pausa pranzo

Pierpaolo Montana, Università degli Studi di Roma La Sapienza:
Una caratterizzazione delle strategie di portafoglio ottimali in mercati incompleti.

Roberto Monte, Università degli Studi di Firenze:
Diffusion process for stock prices under bounded rationality.

Enrico Moretto, Università degli Studi di Parma:
Approcci alternativi di determinazione e controllo del rapporto di cambio nelle operazioni di fusione.

Lozza Sergio Ortobelli, Università degli Studi di Bergamo:
Multi-parameter analysis.

Flavio Pressacco, Università degli Studi di Udine:
Opzioni alternate a doppia barriera in ambito discreto.

Andrea Roncoroni, Università Paris IX, Dauphine:
Infinite dimensional Heath-Jarrow-Morton model for the term structure of instantaneous forward rates: construction, pricing and calibration.

Coffee-break

Andrea Consiglio, Università degli Studi della Calabria:
La valutazione di opzioni implicite nei mutui bancari.

Massimo Costabile, Università degli Studi della Calabria:
Pricing barrier options with exponential stopping times.

Vincenzo Vespri, Università degli Studi di Firenze:
Mortgage backed securities: un progetto di ricerca.



9:00

10:00

10:20

10:40

11:00

11:20

11:40

12:00

12:20

Hotel Executive

Conferenza di Ivar Ekeland:
Reconstructing the Economy from the Equilibrium Manifold:
Can You Feel the Invisible Hand?

Coffee-break

Sala A

Fabio Lamantia, Università degli Studi di Catania:
La costruzione di funzioni di utilità non additive per il
supporto alle decisioni multicriteriali.

Magali E. Zuanon, Università Cattolica del Sacro Cuore:
Utilità additiva nei semigruppi naturalmente ordinati.

Magali E. Zuanon, Università Cattolica del Sacro Cuore:
Considerazioni sulle misure coerenti di rischio.

Maria Letizia Guerra, Università degli Studi di Urbino:
Explaining option prices via stochastic volatility models:
an empirical comparison.

Alberto Roveda, Università degli Studi di Verona:
Tests on multiscale forecasting models.

Maria R. Simonelli, Istituto Universitario Navale di Napoli:
Fuzzy financial certainty equivalents.

Claudio Tebaldi, Università degli Studi di Verona:
A multifractal model for volatility fluctuations in financial
time series.

Teorie delle
decisioni

Matematica
finanziaria

Hotel Executive

Coffee-break

Sala B

Anna Marchi, Università degli Studi di Pisa:
Sull'uso dei teoremi di separazione nei teoremi di alter-
nativa.

Ugo Merlone, Università degli Studi di Torino:
Horizontal shareholding interlocks with relaxed hypo-
theses.

Giulia Rotundo, Università degli Studi di Roma La Sapienza:
Trasformazione di disequazioni variazionali in disequa-
zioni variazionali partizionabili mediante reti neurali.

Giulia Rotundo, Università degli Studi di Roma La Sapienza:
Reti neurali e longevity risk.

Ciro Tarantino, Università degli Studi di Napoli Federico II:
Sul teorema limite per economie con infiniti beni.

Anna Torriero, Università Cattolica del Sacro Cuore:
Spectrum location using trace inequalities.

Vincenzo Valori, Università degli Studi di Firenze:
Adaptive expectations with endogenous learning step:
some preliminary results.

Matematica
per l'economia