

Elenco alfabetico degli interventi

<b>Abundo M.</b>	pag. 13
SOME CONDITIONAL CROSSING RESULTS OF BROWNIAN MOTION OVER A PIECEWISE-LINEAR BOUNDARY	
<b>Agliari A. - Puu T.</b>	" 17
UN DUOPOLIO DI COURNOT CON FUNZIONE DOMANDA LIMITATA: BACINI D'ATTRAZIONE E DINAMICHE COMPLESSE	
<b>Allevi E. - Gnudi A. - Konnov I. V.</b>	" 20
DECOMPOSABLE GENERALIZED VECTOR VARIATIONAL INEQUALITIES	
<b>Angilella S. - Greco S. - Matarazzo B.</b>	" 23
LE BASI ASSIOMATICHE DELLA RAPPRESENTAZIONE DI PREFERENZE NON TRANSITIVE MEDIANTE L'INTEGRALE DI CHOQUET	
<b>Antoci A. - Borghesi S. - Galeotti M.</b>	" 26
ECONOMIC GROWTH IN AN ECONOMY IN WHICH THERE ARE SUBSTITUTES FOR ENVIRONMENTAL GOODS	
<b>Attalienti A.</b>	" 28
DEGENERATE EVOLUTION PROBLEMS AND MARKOV PROCESSES IN MATHEMATICAL FINANCE	
<b>Baione F. - Levantesi S. - Menziotti M.</b>	" 30
ALCUNE CONSIDERAZIONI SULL'EFFICIENZA DEI SISTEMI BONUS - MALUS	
<b>Baldini M. - Mari C.</b>	" 34
SINGLE FACTOR MODELS OF THE TERM STRUCTURE WITH GENERALIZED CIR VOLATILITY STRUCTURE: AN APPLICATION TO ITALIAN BOND MARKET	
<b>Barracchini C. - La Civita S.</b>	" 37
FRACTAL MARKET HYPOTHESIS AND RESCALED RANGE ANALYSIS OF HISTORICAL FINANCIAL SERIES: IS IT AN ALTERNATIVE HYPOTHESIS? AN APPLICATION TO THE ITALIAN FINANCIAL MARKET	
<b>Barracchini C. - Porfirio D.</b>	" 38
VALUE-AT-RISK: PARAMETRIC SIMULATION AND EXTREME VALUES APPROACHES IN NON-DERIVATIVE FINANCIAL ASSETS. EMPIRICAL ASPECTS	
<b>Barucci E. - Monte R. - Tessitore E.</b>	" 39
EXECUTIVE STOCK OPTION EVALUATION AND CORPORATE POLICY	
<b>Basso A. - Nardon M. - Pianca P.</b>	" 40
EARLY EXERCISE BOUNDARY OF AMERICAN OPTIONS	
<b>Battaui A.</b>	" 44
PRICING AND HEDGING ASSET DERIVATIVES WITH DISCRETE STOCHASTIC DIVIDENDS	
<b>Beccacece F.</b>	" 47
UN'ANALISI DEL MERCATO DELLA CARTOLARIZZAZIONE	
<b>Bellini F. - Figà-Talamanca G.</b>	" 50
TESTING TAIL DEPENDENCE WITH EVT APPLICATIONS	
<b>Benati S.</b>	" 54
COHERENT RISK MEASURES AND LINEAR PROGRAMMING	
<b>Bertazzi L. - Speranza M. G.</b>	" 55
A WORST-CASE ANALYSIS OF ROUNDING PROCEDURES FOR THE ECONOMIC LOT SIZE PROBLEM WITH TIME DISCRETIZATION	
<b>Biffis E. - Olivieri A.</b>	" 59
DEMOGRAPHIC RISKS IN PENSION SCHEMES WITH COMBINED BENEFITS	
<b>Bischi G. I. - Kopel M.</b>	" 63
A DUOPOLY MODEL FOR COMMERCIAL FISHING WITH ADAPTIVE EXPECTATIONS	
<b>Bordoni S. - Facchinetti G.</b>	pag. 67
INSURANCE FRAUD EVALUATION. - A FUZZY EXPERT SYSTEM	
<b>Bosi G.</b>	" 70
FUNZIONI DI UTILITÀ SUBLINEARI E CONTINUE PER PREORDINI COMPLETI	
<b>Cambini R. - Carosi L.</b>	" 74
A NOTE ON PSEUDO-AFFINE QUADRATIC FRACTIONAL FUNCTIONS	
<b>Cambini R. - Sodini C.</b>	" 77
A FINITE ALGORITHM FOR A CLASS OF NONLINEAR MULTIPLICATIVE PROGRAMS	
<b>Campana A.</b>	" 80
SULLE COPERTURE RIASSICURATIVE "EXCESS OF LOSS"	
<b>Caprari E.</b>	" 82
PROBLEMI NON DIFFERENZIABILI NELLE QUESTIONI DI IDENTIFICAZIONE: UN MODELLO	
<b>Carbone A. - Conti G. - Pastore M.</b>	" 85
SOME REMARKS ON THE SOLVABILITY OF MULTIVALUED COMPLEMENTARITY PROBLEMS IN NON CONVEX CASE	
<b>Cardona E. - Volpe di Prignano E.</b>	" 89
LA RISCHIOSITÀ E LA RIASSICURAZIONE NEI CONTRATTI VITA CON GARANZIA "DREAD DISEASE"	
<b>Caristi G. - Ferrara M.</b>	" 93
MINIMAX THEOREMS: SOME REMARKS AND NEW RESULTS ABOUT "QUANTITATIVE CONVEXITY PROPERTIES" AND LAGRANGE-TYPE THEOREM	
<b>Carreras F.</b>	" 96
POWER AND INERTIA MEASURES IN COLLECTIVE DECISION-MAKING MECHANISMS	
<b>Castaldo A. - Marinacci M.</b>	" 100
RANDOM CORRESPONDENCES AS BUNDLES OF RANDOM VARIABLES	
<b>Ceccarossi G. - Falbo P.</b>	" 102
STIMA DELLA VOLATILITÀ IMPLICITA E VALUTAZIONE DEI REVERSE CONVERTIBLE SUL MERCATO PRIMARIO	
<b>Cerqueti R. - Rotundo G.</b>	" 106
UN MODELLO MICROECONOMICO PER SERIE TEMPORALI FINANZIARIE CON MEMORIA A LUNGO TERMINE	
<b>Cherubini U. - Luciano E.</b>	" 110
PRICING VULNERABLE CREDIT DERIVATIVES WITH COPULAS	
<b>Cigola M. - Peccati L.</b>	" 114
MULTIATTRIBUTE UTILITY AND INTERTEMPORAL CHOICES: THE ROLE OF THE CERTAINTY EQUIVALENTS MANIFOLD	
<b>Ciraolo S. - Berardi A. - Trova M.</b>	" 115
ESTIMATING DEFAULT PROBABILITIES FOR EMERGING MARKETS BONDS	
<b>Coletti G. - Paneni T.</b>	" 119
UN MODELLO DI DECISIONE QUALITATIVA	
<b>Colucci D. - Gori F. - Valori V.</b>	" 123
THE EFFECTS OF POPULATION DIVERSITY ON MARKETS AND STABILITY	
<b>Consiglio A. - Cocco F. - Stavros A. Z.</b>	" 126
SCENARIO OPTIMIZATION ASSET AND LIABILITY MODELING FOR PERSONAL INVESTMENT PORTFOLIOS	
<b>Corazza M. - Vianello A.</b>	" 129
ALCUNE VARIANTI DEL CRITERIO DI REVISIONE DEL PORTAFOGLIO ALLA SMITH	
<b>Costabile M.</b>	" 133
A COMBINATORIAL APPROACH FOR PRICING PARISIAN OPTIONS	
<b>Costanzo M. - R. - Greco S. - Matarazzo B.</b>	" 136
CHOQUET AND SIPOS INTEGRAL FOR AGGREGATION OF INTERACTIVE CRITERIA IN SORTING PROBLEM	
<b>Cozzi G. - Privileggi F.</b>	" 139
FRACTAL SOCIETIES	
<b>Crespi G. - P. - La Torre D. - Rocca M.</b>	" 143
SECOND-ORDER OPTIMALITY CONDITIONS WITH MOLLIFIED DERIVATIVES	

<b>Dal Forno A.</b>	pag. 147
DETERMINATEZZA LOCALE ED EQUILIBRI SUNSPOT IN PIU' DIMENSIONI: IL CASO DEGLI SHOCK ADDITIVI	
<b>Dall'Aglio M. - Scarsini M.</b>	" 149
ZONONDS LINEAR DEPENDENCE AND SIZE-BIASED DISTRIBUTIONS ON THE SIMPLEX	
<b>D'Amico M. - Fusai G. - Gorla M. N. - Tagliani A.</b>	" 152
VALUATION OF EXOTIC OPTIONS USING MOMENTS	
<b>De Cesare L. - Di Liddo A. - Ragni S.</b>	" 157
EQUILIBRI DI TIPO FEEDBACK E OPEN-LOOP PER UN GIOCO DIFFERENZIALE DESCRIVENTE UN PROBLEMA DI DIFFUSIONE DI INNOVAZIONI	
<b>De Cesare L. - Di Liddo A. - Ragni S.</b>	" 160
UN APPROCCIO NUMERICO ALLA RISOLUZIONE DI PROBLEMI DI DIFFUSIONE DI INNOVAZIONI	
<b>De Donno M.</b>	" 163
SOME APPLICATIONS OF CYLINDRICAL STOCHASTIC INTEGRATION TO MATHEMATICAL FINANCE	
<b>De Sanctis A. - Di Spalatro D.</b>	" 165
ANALISI INTRINSECA DELLA DISUGUAGLIANZA DI CRAMER-RAO	
<b>De Simone A. - Graziano M. G.</b>	" 169
THE TWO WELFARE THEOREMS IN ECONOMIES WITH PUBLIC GOODS	
<b>De Simone A. - Graziano M. G.</b>	" 171
CONE CONDITIONS IN MARKETS WITH SYNDICATES	
<b>Di Biase G. - Manca R.</b>	" 175
SOME RESULTS ABOUT THE CARDINALITY OF THE SET OF THE ATOMS	
<b>Doninelli N. - Falbo P.</b>	" 179
"REVERSE ENGINEERING" OF MUTUAL FUNDS MARKET TIMING	
<b>Dubra J. - Maccheroni F. - Ok E. A.</b>	" 181
EXPECTED UTILITY THEORY WITHOUT THE COMPLETENESS AXIOM	
<b>Facchinetti G. - Pacchiarotti N. - Giove S.</b>	" 182
OPTIMIZATION OF RANKING FUNCTIONS ON REAL INTERVALS	
<b>Fornoni E. - Gambarelli G.</b>	" 185
UN GIOCO COOPERATIVO SULLA RIDUZIONE DEL DEBITO ESTERO PER PAESI IN VIA DI SVILUPPO	
<b>Foroni I. - Gardini L.</b>	" 189
HETEROGENEOUS MODELS WITH LEARNING AND HOMOCLINIC BIFURCATIONS	
<b>Foschini G.</b>	" 193
LA MISURA DELLA LIQUIDITA' DI UNA COMPAGNIA DI ASSICURAZIONE: IL MODELLO DI COGGER E EMERY	
<b>Funari S. - Giove S.</b>	" 197
FRACTIONAL PROGRAMMING WITH INTERVAL COEFFICIENTS	
<b>Galvani V.</b>	" 200
ON THE EXISTENCE OF A MINIMUM-COST PORTFOLIO INSURANCE	
<b>Gamba A. - Trigeorgis L.</b>	" 204
A LOG-TRANSFORMED BINOMIAL LATTICE EXTENSION FOR MULTI-DIMENSIONAL OPTION PROBLEMS	
<b>Gaudenzi M. - Lepellere M. A.</b>	" 208
PRICING DISCRETE BARRIER OPTIONS BY THE BINOMIAL METHOD	
<b>Gaudenzi M. - Piccinini L. C.</b>	" 210
BARRIER OPTIONS: AN APPROACH BY FINITE STATE SYSTEMS OF BLACK-SCHOLES EQUATIONS	
<b>Ghirardato P. - Maccheroni F. - Marinacci M. - Siniscalchi M.</b>	" 214
SUBJECTIVE FOUNDATIONS FOR OBJECTIVE RANDOMIZATION: A NEW SPIN ON ROULETTE WHEELS	
<b>Ghiselli Ricci R.</b>	" 219
OPERATORI DI AGGREGAZIONE NON IDEMPOTENTI	
<b>Giacomello B. - Pisanelli D.</b>	" 221
RUOLO DEL GAPV E AFFIDABILITA' DELLA LEVA FINANZIARIA	
<b>Giacomello B. - Pisanelli D.</b>	" 225
LIMITI ED INCOERENZE DELLA VALUTAZIONE BASATA SUL WACC	

<b>Giacometti R. - Ortobelli Lozza S.</b>	pag. 229
A COMPARISON AMONG DISPERSION MEASURES AND MODELS FOR THE ASSET ALLOCATION PROBLEM	
<b>Gigante P. - Picech L. - Sigalotti L.</b>	" 233
GRANDI SINISTRI NELLA TARIFFAZIONE RCA	
<b>Giordano C. - Palumbo B.</b>	" 237
SOME INEQUALITIES FOR THE GAMMA FUNCTION	
<b>Giorgi G.</b>	" 239
VINCOLI ESPRESSI DA UGUAGLIANZE E PUNTI DI SELLA	
<b>Giorgi G. - Crespi G.P.</b>	" 242
SENSITIVITY ANALYSIS FOR VARIATIONAL INEQUALITIES	
<b>Giove S. - Greco S. - Matarazzo B. - Slowinski R.</b>	" 246
VARIABLE CONSISTENCY MONOTONIC DECISION TREES	
<b>Giuli M. - Monte R.</b>	" 249
DIFFUSION PROCESSES IN A FINANCIAL MARKETS UNDER HETEROGENEOUS TRADING AND LEARNING	
<b>Gozzi F.</b>	" 250
ON THE SUPERREPLICATION APPROACH FOR EUROPEAN MULTIASSET DERIVATIVES	
<b>Grassi R.</b>	" 252
UNA NOTA SU ALCUNE DISUGUAGLIANZE RILEVANTI NELLA CONNESSIONE DI UN GRAFO	
<b>Grasso F. - Iannizzotto A.</b>	" 254
MORE ON THE "EXCESS VOLATILITY" REINSURANCE TREATY	
<b>Greco S. - Matarazzo B. - Slowinski R.</b>	" 256
AXIOMATIC BASIS OF NONCOMPENSATORY PREFERENCES	
<b>Guerraggio A.</b>	" 258
OPTIMALITY CONDITIONS FOR C11 CONSTRAINED MULTIOBJECTIVE PROBLEMS	
<b>Lamantia F. - Bischì G. I.</b>	" 261
A RENT SEEKING GAME WITH ACCUMULATED KNOWLEDGE	
<b>La Torre D.</b>	" 265
AN INVERSE PROBLEM FOR STOCHASTIC GROWTH MODELS WITH ITERATED FUNCTION SYSTEMS	
<b>Longo M.</b>	" 269
INNOVATION ADOPTION AND PRICING IN A MONOPOLISTIC MARKET	
<b>Luciano E. - Marena M.</b>	" 273
VALUE AT RISK BOUNDS FOR PORTFOLIOS OF NON-NORMAL RETURNS	
<b>Mammama C. - Michetti E.</b>	" 277
BACKWARD AND FORWARD LOOKING EXPECTATION IN A CHAOTIC MARKET	
<b>Mancini C.</b>	" 281
ESTIMATION OF THE PARAMETERS OF JUMP OF A GENERAL POISSON-DIFFUSION MODEL	
<b>Mari C. - Renò R.</b>	" 285
UN MODELLO PER IL RISCHIO DI CREDITO	
<b>Marques Pereira R. A. - Bortot S.</b>	" 289
CHOQUET MEASURES IN MULTIAGENT DECISIONS	
<b>Mattalia C.</b>	" 293
INFORMATION TECHNOLOGIES AND FINANCIAL MARKETS	
<b>Maturo A.</b>	" 295
M-MISURE E M-PROBABILITA' CONDIZIONATE STRATIFICATE E GEOMETRICHE	
<b>Maturo A. - Ferri B.</b>	" 299
UN MODELLO DI VALUTAZIONE DELLA QUALITA' DEI PROGETTI IN ARCHITETTURA	
<b>Menicucci D.</b>	" 303
OPTIMAL TWO-OBJECT AUCTIONS WITH SYNERGIES	
<b>Mercurio D. - Torricelli C.</b>	" 307
ESTIMATION AND ARBITRAGE OPPORTUNITIES FOR EXCHANGE RATE BASKETS	
<b>Merlone U.</b>	" 311
TAEG, ANNO COMMERCIALE E ANNO CIVILE: ALCUNE APPROSSIMAZIONI	

<b>Micocci M.</b>	pag. 313		
DALLA RIPARTIZIONE ALLA CAPITALIZZAZIONE: QUESITI TEORICI ED ESEMPI NUMERICI			
<b>Migliarina E. - Molho E. - Zaffaroni A.</b>	" 317		
STABILITY IN VECTOR OPTIMIZATION			
<b>Mignanego P. - Mulinacci S.</b>	" 319		
INTERMEDIATE SOLUTIONS OF STACKELBERG GAMES. REPUTATION OF THE LEADER AND CREDIBILITY OF THE FOLLOWER			
<b>Minenna M.</b>	" 322		
VOLATILITÀ IMPLICITA, COVERED WARRANTS E SCELTA DEGLI INVESTITORI			
<b>Moriggia V.</b>	" 326		
ANALISI LOGICA DEI DATI NEL RISCHIO DI CREDITO			
<b>Mulinacci S.</b>	" 329		
AMERICAN PATH-DEPENDENT OPTIONS: ANALYSIS AND APPROXIMATIONS			
<b>Musti S. - Chiarella C.</b>	" 333		
NUMERICAL INVESTIGATIONS OF THE HEATH-JARROW-MORTON MODEL WITH FORWARD RATE DEPENDENT VOLATILITY			
<b>Muzzioli S. - Torricelli C.</b>	" 337		
DERMAN AND KANI IMPLIED TREES IN ILLIQUID MARKETS: A CHOQUET PRICING APPROACH			
<b>Orlando A. - Trudda A.</b>	" 340		
L'ANALISI DEI PARAMETRI QUALE STRUMENTO DI SCELTA TRA I PROCESSI DEL I E DEL II ORDINE			
<b>Paris F. M.</b>	" 344		
A COMPOUND-OPTION MODEL FOR THE VALUATION OF THE MANAGER'S INCENTIVE FEE AND ITS IMPACT ON THE MANAGER'S ADVERSE INCENTIVE			
<b>Pelessoni R. - Vicig P.</b>	" 346		
MISURE DI RISCHIO COERENTI E PREVISIONI SUPERIORI			
<b>Pellizzari P.</b>	" 350		
STATICALLY HEDGING AND PRICING MULTIVARIATE DERIVATIVES			
<b>Perla F.</b>	" 354		
PARALLEL MONTE CARLO METHODS FOR OPTION VALUATION			
<b>Politano M. - Ventre V.</b>	" 357		
LA VALUTAZIONE DEL RISCHIO FINANZIARIO E DEMOGRAFICO PER I FONDI PENSIONE A CONTRIBUTO DEFINITO			
<b>Prati N.</b>	" 361		
GIOCHI COOPERATIVI SENZA IMPEGNO TOTALE: UNA INTRODUZIONE			
<b>Prati N.</b>	" 362		
OSSERVAZIONI SU UNA SIMULAZIONE DI UN MERCATO AZIONARIO			
<b>Pressacco F. - Gaudenzi M.</b>	" 363		
BINOMIAL METHODS FOR PRICING AMERICAN OPTIONS			
<b>Raucci R.</b>	" 364		
NUOVI CONCETTI DI INSIEME LIMITATO SUPERIORMENTE IN $R^n$			
<b>Raucci R.</b>	" 366		
NUOVE NOZIONI DI MONOTONIA, ISOTONIA E INDECOMPONIBILITÀ CON APPLICAZIONI			
<b>Recchioni M. C.</b>	" 367		
A PATH FOLLOWING METHOD FOR GOAL PROGRAMMING PROBLEMS			
<b>Resti A. - Sironi A.</b>	" 369		
IL LEGAME TRA PROBABILITÀ DI DEFAULT E TASSO DI RECUPERO ATTESO: UN POSSIBILE INQUADRAMENTO TEORICO BASATO SUL MODELLO DI MERTON			
<b>Scagnellato C. - Vargiolu T.</b>	" 373		
SHORTFALL RISK MINIMIZATION IN MULTINOMIAL MODELS			
<b>Scarani C.</b>	" 377		
UN PROBLEMA DI REGOLARIZZAZIONE APPLICATO AD UN MODELLO MACROECONOMICO DEI CONSUMI			
<b>Simonelli M. R.</b>	" 379		
EXPECTATION-VARIANCE-SUBJECTIVE INFORMATION IN THE PROBLEM OF THE PORTFOLIO SELECTION			
			pag. 383
<b>Terazzan O. - Berardi A. - Tebaldi C.</b>			
MODERN APPROACHES TO VALUE AT RISK: FILTERED HISTORICAL SIMULATION			
<b>Vannucci E.</b>	" 387		
COPULE ARCHIMEDEE E OPZIONI CON PIÙ SOTTOSTANTI			
<b>Venturi B.</b>	" 390		
CHAOTIC SOLUTIONS IN ENDOGENOUS GROWTH MODELS			
<b>Verico P.</b>	" 393		
SISTEMI BONUS-MALUS A CONTRATTO BIENNALE			
<b>Villanacci A. - Zenginobuz Ü.</b>	" 397		
EXISTENCE AND REGULARITY OF EQUILIBRIA IN A GENERAL EQUILIBRIUM MODEL WITH PRIVATE PROVISION OF A PUBLIC GOOD			
<b>Villanacci A. - Zenginobuz Ü.</b>	" 398		
PRIVATE PROVISION OF A PUBLIC GOOD IN A GENERAL EQUILIBRIUM MODEL			
<b>Villeneuve S. - Zanette A.</b>	" 400		
COMPARISON OF FINITE DIFFERENCE METHODS FOR PRICING AMERICAN OPTIONS ON TWO STOCKS			
<b>Zaffaroni A.</b>	" 403		
MONOTONICITY ALONG RAYS IN THE FRAMEWORK OF ABSTRACT CONVEXITY AND APPLICATIONS TO UTILITY THEORY			
<b>Zuanon M. E.</b>	" 406		
RAPPRESENTABILITÀ DI UN PREORDINE TOTALE MEDIANTE L'INTEGRALE DI CHOQUET			