

VENERDI' 10

Orario	Attivita'	Locazione	Tipologia attivita'
8,30 - 9,30	Conferenza	Aula magna Est + Ovest	plenaria
9,30 - 11,00	Lavori scientifici	Aula magna Est	Sessione: <i>Finanza Matematica 3</i> Chair: Prof. Gardini, L.
9,30 - 11,00	Lavori scientifici	Aula magna Ovest	Sessione: <i>Probabilità e Statistica 1</i> Chair : Prof. Barucci, E.
11,00 - 11,30	Coffee break	Sala riunioni	
11,30 - 13,00	Lavori scientifici	Aula magna Est	Sessione: <i>Ottimizzazione 2</i> Chair: Prof. Pini, R.
11,30 - 13,00	Lavori scientifici	Aula magna Ovest	Sessione: <i>Decisioni Individuali, Strategiche e Collettive 2</i> Chair : Prof. Pressacco, F.

13,15 - 14,45	Colazione di lavoro	Tennis Club	
15,00 - 16,00	Lavori scientifici	Aula magna Est	Sessione: <i>Metodi Matematici dell'Economia 2</i> Chair: Prof. Weinrich, G.
15,00 - 16,00	Lavori scientifici	Aula magna Ovest	Sessione: <i>Finanza Matematica 4</i> Chair: Prof. Zambruno, G.
16,00 - 17,00	<i>Conferenza speciale</i>	Aula magna Est + Ovest	Sessione Plenaria Chair: Prof. Paris, F.
17,00 - 17,30	Coffee break	Sala riunioni	
17,30 - 19,15	Lavori scientifici	Aula magna Ovest	Sessione: <i>Finanza Matematica 5</i> Chair: Prof. De Giuli, M.E.
17,30 - 19,15	Lavori scientifici	Aula magna Ovest	Sessione: <i>Matematica Attuariale 2</i> Chair: Prof. Giroto, B.
20,00	Proposta serata in comune	Osteria di Valle	

Titolo
Prof. Barone-Adesi, Giovanni , Università della Svizzera italiana "GARCH option in incomplete markets"
Agliardi, R. "Multicompound options: some applications" Caperdoni, C., Ciurlia, P. "Pricing of perpetual American continuous-installment options" Caramellino, L., Zanette, A. "Monte Carlo methods for pricing and hedging American option in high dimension" D'Amico, G. "Statistical inference for a semi-Markovian model of interest term structure" Chiarella, C., Dieci, R., Gardini, L. "A model of asset price and wealth dynamics with heterogeneous agents"
Maccheroni, F., Marinacci, M. "A strong law of large numbers for capacities" Macci, C., Stabile, G., Torrisi, G.L. "Bounds for Lundberg parameters of non standard multivariate risk processes" Pascucci, A. "On a volatility model with dependence on the past" Pelessoni, R., Vicig, P. "Conditioning with convex imprecise previsions and risk measures" Renò, R. "Nonparametric estimation of the diffusion coefficient via Fourier analysis, with application to short rate modeling" Barucci, E., Malliavin, P., Mancino, M.E "Harmonic analysis methods for volatility computation"
Allevi, E., Gnudi, A., Konnov, I.V. "The proximal point method for nonmonotone variational inequalities" Crespi, G.P., Ginchev, I., Rocca, M. "First order optimality conditions in set-valued optimization" Diele, F., Marangi, C., Ragni, S. "Numerical methods for solving optimal control problems based on direct optimization by continuous extensions of Runge-Kutta schemes" Marchi, A. "On the closure and connectedness of the mix-semi-efficient frontier for mix-quasiconcave problems" Bianchi, M., Kassay, G., Pini, R. "Equilibria via Ekeland's principle" Calogero, A., Carcano, G., Pini, R. "Curve di minimizzatori su iperpiani"
Bischi G., Naimzada A.K., Sbragia L. "Oligopoly games with local monopolistic approximation" Colivicchi, I., Mignanego, F., Mulinacci, S. "The concept of a new insurance policy using leader-follower games" Dal Forno, A., Merlone, U. "A model of social interaction for the study of network dynamics" Rauci, R. "Generalizzazioni del teorema di Perron-Frobenius. Legami con la teoria dei giochi" Renault, J., Scarlatti, S., Scarsini, M. "A Folk theorem for minority games" Pressacco, F. "Indici di potere e allargamento dell'Unione Europea"

Agliari, A., Dieci, R., Gardini, L. "Multistability and homoclinic tangles in a Kaldor-type business cycle model"
Patri, S. "Population growth and China's entry into the world trading regime on the North"
Sbuelz, A. "The premium for switching investment technology when business conditions worsen"
Weinrich, G. "Unemployment and inventories in the business cycle"

Maggi, M.A. "Loss aversion and perceptual risk aversion"
Uboldi, A., Renò, R. "On the presence of unspanned volatility in the Euro interest rate options"
Vannucci, E. "A model for analyzing the profit of managing intermediation systems"
Zambruno, G. "La Performance Attribution di portafogli obbligazionari"

Prof **Ephraim Clark**, Middelsex University, Londra: Presentazione della *Multinational Finance Society* e di *Multinational finance Journal*

Micocci, M., Perrotta, A. "A lifestyle strategy of investment for defined contribution pension funds"
Angelini, F., Herzel, S. "Volatilità a lungo termine dei tassi di interesse e valutazione di rischio per flussi finanziari"
Bellini, F., Minguzzi, E. "Valuing Himalaya options"
Carfi, D. "New algebraic and geometric aspects of a capitalization"
Consiglio, A., Lacagnina V., Russino A. "A high-frequency data analysis of a double auction artificial financial market"
Hallulli V., Vargiolu T. "Financial models with dependence on the past: a survey "
De Giuli, M.E., Paris, F.M., Pelizzari, C. "La valutazione dei titoli indicizzati all'infazione"

Biffis, E., Millossovich, P. "A bidimensional approach to mortality risk "
Campana, A. "Sull'utilizzo di alcune misure di rischio in ambito attuariale"
Cerchiara, R.R., Esposito, G. "Alcune possibili applicazioni della teoria dei valori estremi nel settore assicurativo: la riassicurazione excess of loss"
Levantesi, S. "Assicurazioni long term care con garanzia dread disease"
Masala, G., Menzietti, M., Micocci, M. "Pricing credit derivatives with a copula-based actuarial model for credit risk"
Masala, G., Menzietti, M., Micocci, M. "A copula-based actuarial model for credit risk"
Orlando, A., Trudda, A. "Interest rate volatility: The impact on a non-homogeneous life insurance portfolio"

Tigelle e gnocco fritto