

# Alessandro Calvia | Curriculum vitae

+39 0521 90 2245 • [alessandro.calvia@unipr.it](mailto:alessandro.calvia@unipr.it)  
[sites.google.com/view/alessandrocalvia](https://sites.google.com/view/alessandrocalvia) • [alessandro-calvia](https://www.linkedin.com/company/alessandro-calvia)  
🔄 Aggiornato al 16 aprile 2023

## Posizioni accademiche

<b>Università di Parma</b> <i>Ricercatore a t.d. (lett. b), Dipartimento di Scienze Economiche e Aziendali</i> (ex art. 24, c. 3, lett. b, legge 240/2010. S.S.D. SECS-S/06)	<b>Parma</b> 01 Apr 2023 – oggi
<b>LUISS Guido Carli</b> <i>Ricercatore a t.d. (lett. a), Dipartimento di Economia e Finanza</i> (ex art. 24, c. 3, lett. a, legge 240/2010. S.S.D. SECS-S/06)	<b>Roma</b> 15 Ott 2019 – 31 Mar 2023
<b>Università di Milano-Bicocca</b> <i>Assegnista di Ricerca, Dipartimento di Statistica e Metodi Quantitativi</i> Responsabile: Prof.ssa Emanuela Rosazza Gianin (ex art. 22, legge 240/2010. S.S.D. SECS-S/06)	<b>Milano</b> 01 Gen 2018 – 14 Ott 2019

## Istruzione e formazione

<b>Università di Milano-Bicocca</b> <i>Dottorato di Ricerca in Matematica Pura e Applicata</i> Tesi: <i>Optimal control of pure jump Markov processes with noise-free partial observation</i> Relatore: Prof. Marco Fuhrman, Tutor: Prof. Gianmario Tessitore	<b>Milano</b> Dic 2014 – Feb 2018
<b>Politecnico di Milano</b> <i>Laurea Magistrale in Ingegneria Matematica</i> Curriculum di studi in: Finanza quantitativa. Tesi: <i>Filtering of pure jump Markov processes with noise-free observation.</i> Relatore: Prof. Marco Fuhrman, Controrelatore: Dott.ssa Fulvia Confortola	<b>Milano</b> Ott 2011 – Lug 2014
<b>Politecnico di Milano</b> <i>Laurea Triennale in Ingegneria Matematica</i> Prova finale (reading course): <i>Dominanza stocastica e separazione tramite fondi comuni.</i> Relatore: Prof. Emilio Barucci	<b>Milano</b> Set 2008 – Set 2011
<b>SAE Institute</b> <i>Audio Engineering Diploma</i>	<b>Milano</b> Set 2006 – Ott 2007
<b>Liceo S. Quasimodo</b> <i>Diploma di Maturità classica</i>	<b>Magenta (MI)</b> Set 2002 – Giu 2007

## Interessi di ricerca

- Filtraggio stocastico, problemi di controllo ottimo con osservazione completa e parziale e applicazioni all'economia e alla finanza.
- Equazioni di Hamilton-Jacobi-Bellman, Equazioni Differenziali Stocastiche Retrograde e loro applicazioni.
- Processi stocastici a traiettorie discontinue, misure aleatorie e loro applicazioni.
- Misure di rischio,  $g$ -expectations e robustezza.

## Pubblicazioni & lavori accettati

- A. Calvia, G. Cappa, F. Gozzi, E. Priola, *HJB equations and stochastic control on half-spaces of Hilbert spaces*, J. Optim. Theory Appl., in corso di stampa (versione preprint arXiv:2209.14411).

- A. Calvia, F. Gozzi, F. Lippi, G. Zanco, *A simple planning problem for COVID-19 lockdown: a dynamic programming approach*, *Econ. Theory* (2023), <https://doi.org/10.1007/s00199-023-01493-1>.
- E. Bandini, A. Calvia, K. Colaneri, *Stochastic filtering of a pure jump process with predictable jumps and path-dependent local characteristics*, *Stoch. Proc. Appl.*, 151 (2022), pp. 396–435, <https://doi.org/10.1016/j.spa.2022.06.007>.
- A. Calvia, G. Ferrari, *Nonlinear Filtering of Partially Observed Systems arising in Singular Stochastic Optimal Control*, *Appl. Math. Optim.*, 85:12 (2022), <https://doi.org/10.1007/s00245-022-09822-x>.
- A. Calvia, S. Federico, F. Gozzi, *State constrained control problems in Banach lattices and applications*, *SIAM J. Control Optim.*, 59 (2021), pp. 4481–4510, <https://doi.org/10.1137/20M1376959>.
- A. Calvia, E. Rosazza Gianin, *Risk measures and progressive enlargement of filtration: a BSDE approach*, *SIAM J. Financial Math.*, 11 (2020), pp. 815–848, <https://doi.org/10.1137/19M1259134>.
- A. Calvia, *Stochastic filtering and optimal control of pure jump Markov processes with noise-free partial observation*, *ESAIM: COCV*, 26 (2020), 25, <https://doi.org/10.1051/cocv/2019020>.
- A. Calvia, *Optimal control of continuous-time Markov chains with noise-free observation*, *SIAM J. Control Optim.*, 56 (2018), pp. 2000–2035, <https://doi.org/10.1137/17M1139989>.

---

### Attività di ricerca in corso

---

- *Stochastic filtering and optimal control under partial observation of pure jump processes with jump-diffusion observation and path-dependent local characteristics*, in collaborazione con: Dott.ssa Elena Bandini, Dott.ssa Katia Colaneri.
- *Stochastic filtering and singular control*, in collaborazione con: Prof. Giorgio Ferrari.
- *Deterministic/stochastic optimal control on networks: modeling spatial heterogeneity in the AK model on graphs*, in collaborazione con: Prof. Fausto Gozzi, Dott.ssa Marta Leocata, Prof. Anastasios Xepapadeas, Prof. Athanasios N. Yannacopoulos.
- *Optimal control of Piecewise Deterministic Markov Processes of McKean-Vlasov type*, in collaborazione con: Dott.ssa. Elena Bandini.
- *Optimal regulation of carbon emissions marker under partial information*, in collaborazione con: Prof. René Aïd and Prof.ssa Sara Biagini.

---

### Seminari & Comunicazioni scientifiche

---

- 06 Mar 2023:** Seminario su invito: *Stochastic filtering in a non-Markovian framework with predictable jump times*, UMI-PRISMA Webinar.
- 01 Mar 2023:** Seminario su invito: *Dynamic programming in non-convex settings: an application to the optimal control of an SIRD model*, One-day Workshop in Mathematical Economics and Mathematical Finance, Universität Bielefeld, Bielefeld, Germania.
- 07 Set 2022:** Seminario su invito: *Economic growth problems in time-space*, Two-day workshop on deterministic and stochastic controls, Politecnico di Milano.
- 12 Lug 2022:** Seminario su invito: *Economic Growth Models in Time-Space on Networks*, 15th Viennese Conference on Optimal Control and Dynamic Games, TU Wien, Vienna, Austria.
- 27 Giu 2022:** Seminario su invito: *Risk measures and progressive enlargement of filtrations: a BSDE approach*, 9th International Colloquium on BSDEs and Mean Field Systems, Université Savoie Mont Blanc, Annecy, Francia.
- 13 Giu 2022:** Seminario su invito: *On a class of partially observed systems arising in singular optimal control*, Third Italian Meeting on Probability and Mathematical Statistics, Università di Bologna.
- 27 Mag 2022:** Seminario su invito: *Economic Growth Models in Time-Space on Networks*, Workshop "Taming Uncertainty and Complexity in Economics and Finance", LUISS Guido Carli.
- 13 Mag 2022:** Seminario su invito: *On a class of partially observed systems arising in singular optimal control*, Séminaire Bachelier, Institut Henri Poincaré, Parigi, Francia.

**29 Apr 2022:** Seminario su invito: *On a class of partially observed systems arising in singular optimal control*, 3rd Spring Colloquium on Probability and Finance, Università di Padova.

**06 Apr 2022:** Seminario su invito: *On a class of partially observed systems arising in singular optimal control*, Università di Bologna.

**01 Apr 2022:** Seminario: *On a class of partially observed systems arising in singular optimal control*, Quantitative Finance Workshop 2022, Università di Roma Tor Vergata.

**03 Mar 2022:** Seminario su invito: *On a class of partially observed systems arising in singular optimal control*, Workshop on Mathematical Economics and Financial Mathematics, Universität Bielefeld, Bielefeld, Germania.

**16 Set 2021:** Seminario su invito: *On a class of partially observed systems arising in singular optimal control*, AMASES XLV, Università di Reggio Calabria.

**25 Giu 2021:** Seminario: *On a class of partially observed systems arising in singular optimal control*, 10th General AMaMeF Conference, Università di Padova.

**10 Giu 2021:** Seminario su invito: *Economic growth problems in time-space*, Università degli Studi dell'Insubria.

**12 Apr 2021:** Seminario: *Economic growth problems in time-space*, DEF Internal Seminars, LUISS Guido Carli.

**13 Dic 2019:** Discussant per il seminario *Mean field models for systems of economic agents with spatial interaction*, tenuto dal Dott. Giovanni Zanco, Workshop on "Space and Growth: Theoretical and Empirical Models", Università di Pisa.

**09 Set 2019:** Seminario: *Risk measures and progressive enlargement of filtrations: a BSDE approach*, Vienna Congress on Mathematical Finance, Vienna, Austria.

**19 Giu 2019:** Seminario: *Risk measures and progressive enlargement of filtrations: a BSDE approach*, Second Italian Meeting on Probability and Mathematical Statistics, Vietri sul Mare.

**13 Giu 2019:** Seminario: *Risk measures and progressive enlargement of filtrations: a BSDE approach*, 9th General AMaMeF Conference, Parigi, Francia.

**19 Mar 2019:** Seminario su invito: *Risk measures and progressive enlargement of filtrations: a BSDE approach*, Politecnico di Milano.

**06 Feb 2019:** Seminario su invito: *Optimal control problems with partial observation: an application to the noise-free model*, Politecnico di Milano.

**24 Gen 2019:** Seminario: *Risk measures and progressive enlargement of filtrations: a BSDE approach*, Quantitative Finance Workshop 2019, ETH Zürich, Zurigo, Svizzera.

**11 Set 2018:** Seminario: *Optimal control of pure jump Markov processes with noise-free partial observation*, BSDEs, Information and McKean-Vlasov equations, University of Leeds, Leeds, Regno Unito.

**06 Lug 2018:** Seminario su invito: *Stochastic filtering and optimal control of pure jump Markov processes with noise-free partial observation*, 14th Viennese Conference on Optimal Control and Dynamic Games, TU Wien, Vienna, Austria.

**05 Mar 2018:** Seminario su invito: *Optimal control of pure jump Markov processes with noise-free partial observation*, Università di Pisa.

**20 Dic 2017:** Poster: *Filtering and optimal control of time-homogeneous pure jump Markov processes with noise-free partial observation*, Conferenza d'apertura di "Verona Paris Stochastic Modeling Semester", Università di Verona.

**14 Set 2017:** Seminario su invito: *Filtering and optimal control of time-homogeneous pure jump Markov processes with noise-free partial observation*, Stochastic control, BSDEs and new developments, Roscoff, Francia.

**05 Set 2017:** Seminario su invito: *Filtering and optimal control of time-homogeneous pure jump Markov processes with noise-free partial observation*, Workshop nell'ambito del progetto PRIN 2015 'Deterministic and stochastic evolution equations', Università di Parma.

**07 Lug 2017:** Seminario: *Filtering and control of time-homogeneous pure jump Markov processes with noise-free observation*, International Workshop on BSDEs, SPDEs and their Applications, The University of

Edinburgh, Edimburgo, Regno Unito.

**22 Giu 2017:** Seminario: *Filtering and control of time-homogeneous pure jump Markov processes with noise-free observation*, First Italian Meeting on Probability and Mathematical Statistics, Università di Torino & Politecnico di Torino.

**13 Giu 2017:** Poster: *Filtering of time-homogeneous pure jump Markov processes with noise-free observation and applications.*, 10th International Workshop on Bayesian Inference in Stochastic Processes, Università Bocconi.

**30 Giu 2016:** Seminario: *Filtering and Control of Time-Homogeneous Pure Jump Markov Processes with Noise-Free Observation*, 3rd Barcelona Summer School on Stochastic Analysis: A 2016 EMS Summer School, Centre de Recerca Matemàtica, Universitat Autònoma de Barcelona, Bellaterra, Spagna.

**17 Nov 2015:** Seminario: *Stochastic filtering and Marked Point Processes: an introduction and an application to the noise-free model*, Università di Milano-Bicocca, Milano.

**29 Set 2015:** Seminario: *Filtering of time-homogeneous pure jump Markov processes with noise-free observation*, RTG 1845 Berlin-Potsdam Summer School, Levico Terme.

## Scuole, conferenze e corsi

---

**01 Mar 2023:** *One-day Workshop in Mathematical Economics and Mathematical Finance*, Universität Bielefeld, Bielefeld, Germania.

**06 – 07 Set 2022:** *Two-day workshop on deterministic and stochastic control*, Politecnico di Milano.

**12 – 15 Lug 2022:** *15th Viennese Conference on Optimal Control and Dynamic Games*, TU Wien, Vienna, Austria.

**27 Giu – 01 Lug 2022:** *9th International Colloquium on BSDEs and Mean Field Systems*, Université Savoie Mont Blanc, Annecy, Francia.

**13 – 16 Giu 2022:** *Third Italian Meeting on Probability and Mathematical Statistics*, Università di Bologna.

**26 – 28 Mag 2022:** *Taming Uncertainty and Complexity in Economics and Finance*, LUISS Guido Carli.

**28 – 29 Apr 2022:** *3rd Spring Colloquium on Probability and Finance*, Università di Padova, Italy.

**31 Mar – 01 Apr 2022:** *Quantitative Finance Workshop 2022*, Università di Roma Tor Vergata.

**03 Mar 2022:** *Workshop on Mathematical Economics and Financial Mathematics*, Universität Bielefeld, Bielefeld, Germania.

**13 – 18 Set 2021:** *AMASES XLV*, Università di Reggio Calabria.

**22 – 25 Giu 2021:** *10th General AMaMeF Conference*, Università di Padova.

**13 – 14 Dic 2019:** *Workshop on "Space and Growth: Theoretical and Empirical Models"*, Università di Pisa.

**09 – 11 Set 2019:** *Vienna Congress on Mathematical Finance*, Vienna, Austria.

**17 – 20 Giu 2019:** *Second Italian Meeting on Probability and Mathematical Statistics*, Vietri sul Mare.

**11 – 14 Giu 2019:** *9th General AMaMeF Conference*, Parigi, Francia.

**23 – 25 Gen 2019:** *Quantitative Finance Workshop 2019*, ETH Zürich, Zurigo, Svizzera.

**10 – 12 Set 2018:** *BSDEs, Information and McKean-Vlasov equations*, University of Leeds, Leeds, Regno Unito.

**23 – 27 Lug 2018:** *RISM6 – Developments in Stochastic Partial Differential Equations*, RISM – Riemann International School of Mathematics, Varese.

**03 – 06 Lug 2018:** *14th Viennese Conference on Optimal Control and Dynamic Games*, TU Wien, Vienna, Austria.

**15 – 16 Mar 2018:** *Workshop Model Uncertainty & Robust Finance*, Università di Milano.

**18 – 21 Dic 2017:** Conferenza d'apertura di *Verona Paris Stochastic Modeling Semester*, Università di Verona.

**11 – 15 Set 2017:** Conferenza *Stochastic control, BSDEs and new developments*, Roscoff, Francia.

- 04 – 06 Set 2017:** Workshop nell'ambito del progetto PRIN 2015 *Deterministic and stochastic evolution equations*, Università di Parma.
- 03 – 07 Lug 2017:** *International Workshop on BSDEs, SPDEs and their Applications*, The University of Edimburgh, Edimburgo, Regno Unito.
- 19 – 22 Giu 2017:** *First Italian Meeting on Probability and Mathematical Statistics*, Università di Torino & Politecnico di Torino.
- 13 – 15 Giu 2017:** *10th International Workshop on Bayesian Inference in Stochastic Processes*, Università Bocconi.
- 27 Giu – 01 Lug 2016:** *3rd Barcelona Summer School on Stochastic Analysis*, A 2016 EMS Summer School, Centre de Recerca Matemàtica, Universitat Autònoma de Barcelona, Bellaterra, Spagna.
- 20 – 23 Giu 2016:** *Convegno Scientifico GNAMPA 2016*, Montecatini Terme.
- 30 Mag – 03 Giu 2016:** *Stochastic Partial Differential Equations & Applications - X*, FBK - CIRM Conference, Levico Terme.
- 09 – 11 Dic 2015:** *Corso Martingale Optimal Transport*, Università di Pisa.
- 28 Set – 02 Ott 2015:** *Stochastic Analysis with applications in biology, finance and physics*, RTG 1845 Berlin-Potsdam Summer School, Levico Terme.
- 22 Mag 2015:** *Workshop Optimal Stopping and Applications*, Università di Torino.
- 13 – 14 Apr 2015:** Conferenza *Control Theory and Related Topics*, Politecnico di Milano.
- 02 – 06 Feb 2015:** *Winter School Recent Breakthroughs in Singular Stochastic PDEs*, Università di Milano-Bicocca.

---

## Visite scientifiche

---

- 13 – 17 Mar 2023:** Université Paris Dauphine-PSL, Francia. Collab. scientifica con il Prof. René Aïd.
- 27 Feb – 10 Mar 2023:** Universität Bielefeld, Germania. Collab. scientifica con il Prof. Giorgio Ferrari.
- 16 – 20 Mag 2022:** Universität Bielefeld, Germania. Collab. scientifica con il Prof. Giorgio Ferrari.
- 09 – 13 Mag 2022:** Université Paris Dauphine-PSL, Francia. Collab. scientifica con il Prof. René Aïd.
- 21 Mar – 08 Apr 2022:** Università di Bologna. Collab. scientifica con la Dott.ssa Elena Bandini.
- 17 – 19 Gen 2022:** Università di Milano-Bicocca. Collab. scientifica con la Prof.ssa Federica Masiero.
- 12 – 14 Set 2018:** University of Leeds, Leeds, Regno Unito. Collab. scientifica con la Dott.ssa Katia Colaneri.

---

## Progetti di ricerca e finanziamenti

---

- 2022:** Vincitore del finanziamento *Erasmus+ Staff Mobility for Teaching* per l'A. A. 2021/2022. Il progetto finanziato prevede una visita scientifica di una settimana presso la *Université Paris Dauphine-PSL* e l'insegnamento di un corso di dottorato (15 ore), intitolato *Stochastic filtering and applications to optimal control problems in finance and economics*. La mobilità è stata svolta dal 9 al 13 maggio 2022.
- 2020-2023:** Partecipante al progetto MIUR-PRIN 2017 *The Time-Space Evolution of Economic Activities: Mathematical Models and Empirical Applications*. Coordinatore scientifico: Prof. Fausto Gozzi, Responsabile scientifico: Prof. Fausto Gozzi.
- 2020:** Vincitore del finanziamento *Erasmus+ Staff Mobility for Teaching* per l'A. A. 2019/2020. Il progetto finanziato prevede una visita scientifica di una settimana presso il *Center for Mathematical Economics*, Universität Bielefeld, e l'insegnamento di un corso di dottorato (15 ore), intitolato *Stochastic filtering and applications to finance and economics*. La mobilità è stata rinviata all'A. A. 2020/2021, causa pandemia Covid-19, ed è stata svolta (in modalità virtuale) dal 14 al 18 giugno 2021.
- 2019:** Coordinatore del progetto INdAM-GNAMPA *Problemi di controllo ottimo stocastico con osservazione parziale in dimensione infinita*. Tramite questo progetto è stata finanziata la visita scientifica del Prof. Giorgio Ferrari, 22-29 febbraio 2020 presso la LUISS Guido Carli, per collaborare sul tema *Stochastic filtering and singular control*.

**2018:** Partecipante al progetto INdAM-GNAMPA *Controllo ottimo stocastico con osservazione parziale: metodo di randomizzazione ed equazioni di Hamilton-Jacobi-Bellman sullo spazio di Wasserstein*, Coordinatore: Dott.ssa Elena Bandini.

**2017-2020:** Partecipante al progetto MIUR-PRIN 2015 *Deterministic and stochastic evolution equations*. Coordinatore scientifico: Prof.ssa Alessandra Lunardi, Responsabile scientifico: Prof. Gianmario Tessitore.

**2017:** Partecipante al progetto INdAM-GNAMPA *Sistemi stocastici singolari: buona posizione e problemi di controllo*, Coordinatore: Prof. Enrico Priola.

**2016:** Partecipante al progetto INdAM-GNAMPA *Problemi di controllo ottimo con osservazione parziale: applicazioni dei processi di punto marcato*, Coordinatore: Dott.ssa Fulvia Confortola.

**2015:** Partecipante al progetto INdAM-GNAMPA *Applicazioni innovative dei processi di punto marcato*, Coordinatore: Dott.ssa Fulvia Confortola.

---

## Attività di organizzazione e altri progetti

---

**13 – 16 Giu 2022:** Organizzatore (con la Dott.ssa Katia Colaneri) della Sessione *Stochastic models for energy, management, and environmental issues*, Third Italian Meeting on Probability and Mathematical Statistics, Università di Bologna. Relatori invitati: Prof.ssa Sara Biagini, Dott.ssa Athena Picarelli, Prof. Salvatore Federico.

**7 – 8 Set 2020:** Organizzatore (con: Prof. Fausto Gozzi, Prof. Francesco Lippi, Dott. Giovanni Zanco) del Workshop online [Mean Field Games in Economics](#), LUISS Guido Carli ed Einaudi Institute for Economics and Finance (EIEF), Roma.

**17 – 20 Giu 2019:** Organizzatore (con la Dott.ssa Elena Bandini) della Sessione *Methods for Stochastic Filtering and Optimal Control of Processes with Jumps*, Second Italian Meeting on Probability and Mathematical Statistics, Vietri sul Mare (SA). Relatori invitati: Dott.ssa Katia Colaneri, Prof.ssa Fulvia Confortola, Prof. Giorgio Ferrari.

**Feb 2016 – Giu 2016 & Feb 2017 – Giu 2017:** Tutor per il progetto *Piano Lauree Scientifiche. Laboratorio denominato 'Il gioco e il caso'*, finanziato dal Dip. di Matematica e Applicazioni, Università di Milano-Bicocca, sotto la supervisione scientifica della Prof.ssa Maria Gabriella Kuhn. Il progetto si è articolato in una serie di incontri con studenti di alcuni istituti lombardi di scuola secondaria superiore, mirati a introdurre ai concetti di modello matematico e di calcolo delle probabilità, per una migliore comprensione dei rischi connessi al gioco d'azzardo.

**Nov 2015 – Giu 2016 & Nov 2016 – Mag 2017:** Organizzazione del ciclo di seminari *Insalate di Matematica*, promosso dal Dip. di Matematica e Applicazioni, Università di Milano-Bicocca. Il ciclo si è articolato in una serie di seminari informali tenuti da dottorandi e giovani ricercatori in matematica.

---

## Attività di referaggio

---

Referee per le riviste *SIAM Journal on Control and Optimization*, *Mathematical Finance*, *Journal of Economic Dynamics and Control*, *Journal of Optimization Theory and Applications*, *Journal of Mathematical Economics*, *International Journal of Economic Theory*, *Journal of Mathematical Analysis and Applications*, *Mathematics and Financial Economics*, *Statistics and Probability Letters*, *The Journal of Risk*, *Asia-Pacific Financial Markets*, *Bulletin of the Malaysian Mathematical Sciences Society*.

Reviewer per AMS Mathematical Reviews (MathSciNet).

---

## Attività didattica

---

..... **A.A. 2022/2023** .....

**Titolare di *Metodi Quantitativi per l'Impresa* (8 CFU, S.S.D. SECS-S/06)**

*Laurea magistrale in Amministrazione, Finanza e Controllo*

LUISS Guido Carli

**Titolare di *Quantitative Models for Data Science* (8 CFU, S.S.D. SECS-S/06)**

*Laurea in Management and Computer Science*

LUISS Guido Carli

## A.A. 2021/2022

- Titolare di *Stoch. filtering and appl. to opt. control prob. in fin. and econ.***  
Corso di Dottorato (15 ore) Univ. Paris Dauphine-PSL
- Titolare di *Metodi Quantitativi per l'Impresa* (8 CFU, S.S.D. SECS-S/06)**  
Laurea magistrale in Amministrazione, Finanza e Controllo LUISS Guido Carli
- Titolare di *Quantitative Models for Data Science* (8 CFU, S.S.D. SECS-S/06)**  
Laurea in Management and Computer Science LUISS Guido Carli

## A.A. 2020/2021

- Titolare di *Stochastic filtering and applications to finance and economics***  
Corso di Dottorato (15 ore), Center for Mathematical Economics (IMW) Universität Bielefeld
- Titolare di *Metodi Quantitativi per l'Impresa* (8 CFU, S.S.D. SECS-S/06)**  
Laurea magistrale in Amministrazione, Finanza e Controllo LUISS Guido Carli
- Titolare di *Quantitative Models for Data Science* (8 CFU, S.S.D. SECS-S/06)**  
Laurea in Management and Computer Science LUISS Guido Carli
- Titolare (con il Dott. Giovanni Zanco) di *Mathematics Pre-Program Course***  
Lauree in Economics and Business e Management and Computer Science LUISS Guido Carli

## A.A. 2019/2020

- Titolare di *Quantitative Models for Data Science* (8 CFU, S.S.D. SECS-S/06)**  
Laurea in Management and Computer Science LUISS Guido Carli
- Titolare di *Metodi Quantitativi per l'Impresa* (8 CFU, S.S.D. SECS-S/06)**  
Laurea magistrale in Amministrazione, Finanza e Controllo LUISS Guido Carli

## A.A. 2018/2019

- Esercitazioni di *Matematica per la Finanza* (S.S.D. SECS-S/06)**  
Laurea in Econ. delle Banche, delle Assic. e degli Inter. Finanziari Università di Milano-Bicocca  
Docente: Prof.ssa Emanuela Rosazza Gianin
- Esercitazioni di *Matematica Generale I* (S.S.D. SECS-S/06)**  
Laurea in Econ. e Amm. delle Imprese Università di Milano-Bicocca  
Docente: Prof.ssa Federica Masiero
- Esercitazioni di *Probabilità* (S.S.D. MAT/06)**  
Laurea in Ing. Matematica Politecnico di Milano  
Docente: Prof. Matteo Gregoratti

## A.A. 2017/2018

- Esercitazioni di *Matematica Generale I* (S.S.D. SECS-S/06)**  
Laurea in Econ. e Amm. delle Imprese Università di Milano-Bicocca  
Docente: Prof.ssa Federica Masiero
- Esercitazioni di *Probabilità* (S.S.D. MAT/06)**  
Laurea in Ing. Matematica Politecnico di Milano  
Docente: Prof. Matteo Gregoratti

## A.A. 2016/2017

- Esercitazioni di *Matematica Generale I* (S.S.D. SECS-S/06)**  
Laurea in Econ. e Amm. delle Imprese Università di Milano-Bicocca  
Docente: Prof.ssa Federica Masiero
- Esercitazioni di *Teoria della Misura* (S.S.D. MAT/05)**  
Laurea in Matematica Università di Milano-Bicocca  
Docente: Prof. Gianmario Tessitore

**Esercitazioni di *Calcolo delle Probabilità* (S.S.D. MAT/06)***Laurea in Matematica*

Docente: Prof. Francesco Caravenna

*Università di Milano-Bicocca***Tutorato di *Probabilità****Laurea in Ing. Matematica*

Docente: Prof. Matteo Gregoratti

*Politecnico di Milano***A.A. 2015/2016****Esercitazioni di *Matematica Generale I* (S.S.D. SECS-S/06)***Laurea in Econ. e Amm. delle Imprese*

Docente: Prof.ssa Federica Masiero

*Università di Milano-Bicocca***Esercitazioni di *Teoria della Misura* (S.S.D. MAT/05)***Laurea in Matematica*

Docente: Prof. Gianmario Tessitore

*Università di Milano-Bicocca***Esercitazioni di *Calcolo delle Probabilità* (S.S.D. MAT/06)***Laurea in Matematica*

Docente: Prof. Francesco Caravenna

*Università di Milano-Bicocca***Tutorato di *Probabilità* (S.S.D. MAT/06)***Laurea in Ing. Matematica*

Docente: Prof. Marco Fuhrman

*Politecnico di Milano***A.A. 2014/2015****Tutorato di *Probabilità* (S.S.D. MAT/06)***Laurea in Ing. Matematica*

Docente: Prof. Marco Fuhrman

*Politecnico di Milano***Tutorato di *Statistica* (S.S.D. MAT/06, SECS-S/01)***Laurea in Ing. Meccanica*

Docente: Dott. Fabio Zucca

*Politecnico di Milano***Tutorato di *Analisi Matematica I* (S.S.D. MAT/05)***Laurea in Ing. Informatica*

Docente: Prof.ssa Liliana Curcio

*Politecnico di Milano***A.A. 2013/2014****Tutorato di *Statistica* (S.S.D. MAT/06, SECS-S/01)***Laurea in Ing. Energetica*

Docenti: Prof. Matteo Gregoratti e Dott.ssa Francesca Ieva

*Politecnico di Milano***Tutorato di *Statistica* (S.S.D. MAT/06, SECS-S/01)***Laurea in Ing. Energetica*

Docenti: Prof. Elio Piazza e Prof.ssa Laura Sangalli

*Politecnico di Milano***Supervisione di tesi di laurea**

- G. Bersani, *Dal CAPM ai modelli multifattoriali: analisi empirica dell'Arbitrage Pricing Theory sul mercato italiano nell'era Covid-19*. Laurea Magistrale in Amministrazione, Finanza e Controllo, LUISS Guido Carli, A.A. 2021/2022.
- M. Clarioni, *Value at Risk ed Expected Shortfall: uno studio quantitativo nel mercato delle materie prime*. Laurea Magistrale in Amministrazione, Finanza e Controllo, LUISS Guido Carli, A.A. 2021/2022.
- A. Loche, *Modelli strutturali per il rischio di credito. Un'applicazione dei modelli di Merton e KMV all'indice Euronext 100*. Laurea Magistrale in Amministrazione, Finanza e Controllo, LUISS Guido Carli, A.A. 2021/2022.
- I. Greco, *Il modello a cinque fattori di E. Fama e K. French: Analisi dell'impatto pre e post COVID-19 sui settori industriali*. Laurea Magistrale in Amministrazione, Finanza e Controllo, LUISS Guido Carli, A.A. 2020/2021.



- A. Maione, *I derivati atmosferici: analisi empirica sui dati della stazione meteorologica di Roma/Fiumicino*. Laurea Magistrale in Amministrazione, Finanza e Controllo, LUISS Guido Carli, A.A. 2020/2021.
- E. Mascarucci, *Modelli per la valutazione dei derivati energetici: uno studio sul mercato elettrico italiano*. Laurea Magistrale in Amministrazione, Finanza e Controllo, LUISS Guido Carli, A.A. 2020/2021.
- A. Mastrantonio, *Metodi quantitativi per l'Enterprise Financial Risk Management e la gestione del rischio di tasso d'interesse*. Laurea Magistrale in Amministrazione, Finanza e Controllo, LUISS Guido Carli, A.A. 2020/2021.
- A. Ruvolo, *Il rischio di credito, modelli e applicazioni. Analisi sulla probabilità di default delle imprese*. Laurea Magistrale in Amministrazione, Finanza e Controllo, LUISS Guido Carli, A.A. 2020/2021.

---

## Incarichi ufficiali

**09 Mar 2023:** Membro della commissione di valutazione per il programma di Structured Partnership con la School of Economics dell'Università di Utrecht, rivolto agli studenti della Laurea Triennale in *Economics and Business*, LUISS Guido Carli.

**09 Mar 2022:** Membro della commissione di valutazione per il programma di Structured Partnership con la School of Economics dell'Università di Utrecht, rivolto agli studenti della Laurea Triennale in *Economics and Business*, LUISS Guido Carli.

**14 Feb 2022:** Membro della commissione di ammissione (in qualità di rappresentante del Dipartimento di Economia e Finanza, LUISS Guido Carli) al programma *Next Generation UE e qualità della spesa: istituzioni, società e imprese*, Scuola per le Politiche Pubbliche – undicesimo corso 2022, Italiadecide.

**24 Feb 2021:** Membro della commissione di valutazione per il programma di Structured Partnership con la School of Economics dell'Università di Utrecht, rivolto agli studenti della Laurea Triennale in *Economics and Business*, LUISS Guido Carli.

**15 Feb 2021:** Membro della commissione di ammissione (in qualità di rappresentante del Dipartimento di Economia e Finanza, LUISS Guido Carli) al programma *La dimensione urbana delle politiche territoriali: istituzioni, ambiente e contesto socio-economico. I casi di Brescia, Reggio Calabria e Roma*, Scuola per le Politiche Pubbliche – decimo corso 2021, Italiadecide.

**9 Lug 2020 – oggi:** Membro del Gruppo di Riesame del Corso di Laurea Magistrale in *Amministrazione, Finanza e Controllo*, LUISS Guido Carli.

**16 Giu 2020 – oggi:** Referente per l'attività *Project works* dei programmi di Laurea Triennale del Dipartimento di Economia e Finanza, LUISS Guido Carli.

**12 Feb 2020:** Membro della commissione di ammissione (in qualità di rappresentante del Dipartimento di Economia e Finanza, LUISS Guido Carli) al programma *Transizione ambientale ed economia territoriale: politiche pubbliche e strategie di impresa*, Scuola per le Politiche Pubbliche – nono corso 2020, Italiadecide.

**15 Ott 2019 – oggi:** Referente per l'attività *Project works* dei programmi di Laurea Magistrale del Dipartimento di Economia e Finanza, LUISS Guido Carli.

---

## Lingue

**Italiano:** Madrelingua

**Inglese:** Ottimo

*Livello C1, TOEFL iBT 105/120*

**Francese:** Base

*Livello A2*

---

## Competenze informatiche

**Sistemi Operativi:** Microsoft Windows, Apple Mac OS, Unix/Linux

**Linguaggi:** C, C++, L<sup>A</sup>T<sub>E</sub>X

**Software:** Microsoft Office, MATLAB, R, Mathematica, WinBUGS, JAGS

## Ulteriori informazioni

### Organizzazioni

<b>Society for Industrial and Applied Mathematics</b> <i>Membro SIAM</i>	<i>Gen 2023 – oggi</i>
<b>Società Italiana di Matematica Applicata e Industriale</b> <i>Membro SIMAI</i>	<i>Gen 2023 – oggi</i>
<b>European Mathematical Society</b> <i>Membro EMS</i>	<i>Mar 2020 – oggi</i>
<b>Unione Matematica Italiana</b> <i>Membro UMI</i>	<i>Mar 2020 – oggi</i>
<b>Assoc. per la Matematica Appl. alle Scienze Econ. e Sociali</b> <i>Membro AMASES</i>	<i>Feb 2019 – oggi</i>
<b>Ist. Naz. di Alta Matematica F. Severi</b> <i>Membro INdAM-GNAMPA</i>	<i>Gen 2015 – oggi</i>

### Incarichi

<b>Dip. di Matematica e Applicazioni, Università di Milano-Bicocca</b> <i>Rappresentante dei Dottorandi</i>	<b>Milano</b> <i>Feb 2016 – Dic 2017</i>
<b>Corpo Bandistico Legnanese</b> <i>Consigliere</i>	<b>Legnano (MI)</b> <i>Feb 2016 – Feb 2021</i>

### Attività artistica

<b>Orchestra Accademica</b> <i>Tastiere</i>	<b>Crosio della Valle (VA)</b> <i>Ott 2017 – oggi</i>
<b>Scuola di Musica N. Paganini</b> <i>Coro dei Ragazzi: Tenore. Pianista accompagnatore</i>	<b>Canegrate (MI)</b> <i>Feb 2013 – Giu 2017</i>
<b>Corpo Bandistico Legnanese</b> <i>Corno francese e Flicorno contralto</i>	<b>Legnano (MI)</b> <i>Mar 2010 – oggi</i>

*Autorizzo il trattamento dei miei dati personali ai sensi del D. Lgs. 30 giugno 2003, n. 196 "Codice in materia di protezione dei dati personali" e la pubblicazione degli stessi secondo le norme vigenti in materia di trasparenza degli atti amministrativi.*