

CURRICULUM VITAE DI ANNAGRAZIA QUARANTA

Nata a Lecce il 20 luglio 1966.

E-mail annagrazia.quaranta@unibo.it

TITOLI E CONCORSI

- **Maturità Scientifica** (1980-1985) presso Liceo Scientifico Statale “G. Banzi-Bazzoli” di Lecce.
- **Laurea** (1985-1990) in Scienze Economiche e Bancarie – Indirizzo Statistico-Economico- conseguita presso l’Università degli Studi di Siena il 4 luglio 1990 con voti **110 su 110 e lode**.
Tesi Sperimentale: “Analisi statistica della produttività nel settore del credito: un caso di studio riferito ad un’azienda operante nel Mezzogiorno” (Relatore Prof. A. Lemmi).
- **Dottorato di Ricerca** in “**Metodi Economici e Quantitativi per l’Analisi dei Mercati**” (durata 3 anni) conseguito presso l’Università degli Studi di Lecce in data 17 Febbraio 2006.
Titolo Tesi di Dottorato: “*Ottimizzazione Robusta del Conditional Value at Risk e Selezione di Portafoglio*” (Relatore Prof. A. Zaffaroni).
Giudizio finale: “*Le ricerche oggetto della tesi sono fortemente originali. Le metodologie appaiono in linea con gli sviluppi più avanzati e innovativi della letteratura di riferimento. I risultati sono molto interessanti ed analizzati con ottimo senso critico. Nel colloquio il candidato dimostra una ottima conoscenza delle problematiche trattate. Per il prosieguo della attività di ricerca, si suggerisce alla candidata di valorizzare le implicazioni finanziarie della metodologia e dei risultati, ad esempio prendendo in considerazione i costi di transazione, l’ipotesi di assenza di vendite allo scoperto ed esprimendo i risultati in termini di quote di portafoglio. La Commissione unanime giudica il lavoro svolto ottimo e meritevole di pubblicazione.*”
- Vincitrice di **Borsa di Studio Post-Dottorato** (Settembre 2005) per attività di ricerca sul tema “**Modellizzazione matematica di reti neurali per il calcolo e l’identificazione**” (durata 2 anni) presso il Dipartimento di Fisica dell’Università di Camerino.
- Vincitrice di **Borsa di Studio** (Luglio 2007) per attività di ricerca sul tema “**Modellizzazione matematica di processi di queueing**” (durata 2 anni) presso il Dipartimento di Fisica dell’Università di Camerino.
- **Abilitazione** (nel 1992) per la classe di concorso A064 (attuale 48A) – **Matematica Applicata**.
- **Vincitrice di cattedra** (nel 1992) per l’insegnamento di **Matematica Applicata** nelle scuole secondarie superiori in seguito al superamento del **concorso ordinario per titoli ed esami** bandito nel 1990 dal M.P.I.; **assegnata in via definitiva all’insegnamento** a partire dal 1° Settembre 1992.
Servizio prestato nelle sottoindicate scuole:

Anno Scolastico	Scuola Media Superiore	Materia d'insegnamento
Dal 1992 al 1995	I.T.C. "A. Einstein" Loreto (AN)	Matematica Applicata
1995/96	I.T.C. "L. Einaudi" Tolentino (MC)	Matematica Applicata
1996/97	I.P.C.T. "I. Panneggi" San Severino Marche (MC)	Informatica Gestionale
Dal 1997 al 2000	I.T.C. "L. Einaudi" Tolentino (MC)	Matematica Applicata
2000-2001	I.T.C. "G. Antinori" Camerino (MC)	Matematica Applicata
2001-2009	I.T.C. "L. da Vinci" Tolentino (MC)	Matematica Applicata

- **Vincitrice di un posto da ricercatore** (2008) nel settore scientifico disciplinare SECS-S06 – METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCIENZE ATTUARIALI E FINANZIARIE – presso la Facoltà di Economia dell'Università di Bologna – sede di Forlì. Presa di servizio in data 1° Ottobre 2009.

ALTRI CORSI DI PERFEZIONAMENTO E SCUOLE DI SPECIALIZZAZIONE

- Particolari studi in materia di **produttività /efficienza** presso l'Università di Siena dal 1990 al 1992;
- Particolari studi in materia di **distribuzione del reddito e misure di povertà** presso l'Università di Siena dal 1990 al 1992;
- **Scuola Estiva di Economia Computazionale** (attestazione di superamento con esito positivo) – Università di Lecce - Luglio 2004;
- **Corso Residenziale di Econometria – 2005 per i partecipanti ai programmi di Dottorato di Ricerca (CIDE) – Terzo Turno** (attestazione di superamento con esito positivo) – Università di Lecce – 5/14 Settembre 2005;
- **Robust Optimization Summer School** – IASI/CNR – Cortina d'Ampezzo – 2/6 Luglio 2007.

ALTRI ATTESTATI

- **Cultrice della materia** per l'insegnamento di **Statistica** presso la Facoltà di Scienze Politiche e per il Corso di Laurea in Scienze Bancarie dell'Università degli Studi di Macerata dal Maggio 1991 al Dicembre 1993.
- **Cultrice della materia** per l'insegnamento di **Ricerca Operativa** presso la Facoltà di Scienze Matematiche, Fisiche e Naturali dell'Università degli Studi di Camerino (decorrenza dal Gennaio 2001).

- **Docente esercitatore** (utilizzo di Stata 8) nell'ambito del **Corso Residenziale di Econometria – 2005 per i partecipanti ai programmi di Dottorato di Ricerca (CIDE) – Terzo Turno** – Università di Lecce – 5/14 Settembre 2005
- **Docente esercitatore** (utilizzo di Stata 9) nell'ambito del **Corso Residenziale di Econometria – 2006 per i partecipanti ai programmi di Dottorato di Ricerca (CIDE) – Terzo Turno** – Università di Lecce – 4/13 Settembre 2006
- **Docente esercitatore** (utilizzo di Stata 9) nell'ambito del **Corso Residenziale di Econometria – 2007 per i partecipanti ai programmi di Dottorato di Ricerca (CIDE) – Terzo Turno** – Università di Lecce – 3/12 Settembre 2007
- **Docente esercitatore** (utilizzo di Stata 9) nell'ambito del **Corso Residenziale di Econometria – 2008 per i partecipanti ai programmi di Dottorato di Ricerca (CIDE) – Terzo Turno** – Università di Lecce – 1/13 Settembre 2008

COLLABORAZIONI

- Dal Novembre 1989 al Maggio 1991 con Centro Ricerche e Consulenza S.r.l. – per l'economia, la statistica, il marketing e l'informatica - Siena – in relazione alle analisi:
 - a) Donne e lavoro: un'analisi descrittiva dei risultati di un sondaggio campionario in provincia di Siena;
 - b) Donne e lavoro nella Pubblica Amministrazione;
 - c) Indagine statistica sulla condizione della donna nel settore agricolo della provincia di Siena;
 - d) Analisi statistica della povertà in Toscana;
- Nel 1990 con l'Amministrazione Provinciale di Siena in relazione ad una indagine sulla Domanda di Lavoro e le Professioni (convenzione di cui alla Del. G.R. n. 05491 del 25/06/1990);
- Nel 1991 con il Prof. Achille Lemmi, dell'Università degli Studi di Siena, e con il Prof. Alessandro Viviani dell'Università degli Studi di Firenze, in relazione alla elaborazione dei dati ed alla stesura del lavoro “La misura della produttività nelle Aziende di Credito” di A. Lemmi e A. Viviani, presentato alla XXXII Riunione Scientifica della SIEDS (Società Italiana di Economia, Demografia e Statistica) nei giorni 19-21 Aprile 1991 a Siena; tale lavoro è pubblicato nella Rivista di Economia, Demografia e Statistica.
- Referee per la rivista scientifica *Journal of Banking and Finance* dal Febbraio 2008.
- Referee per la rivista scientifica *OR Spectrum* dal marzo 2009.

ATTIVITA' DIDATTICA UNIVERSITARIA

Anno Accademico 1990-1991

- **Esercitatore e membro in commissione d'esame in qualità di cultore della materia** del corso di **Statistica** presso la Facoltà di Scienze Politiche e per il Corso di Laurea in Scienze Bancarie dell'Università degli Studi di Macerata;

Anno Accademico 1991-1992

- **Esercitatore e membro in commissione d'esame in qualità di cultore della materia** del corso di **Statistica** presso la Facoltà di Scienze Politiche e per il Corso di Laurea in Scienze Bancarie dell'Università degli Studi di Macerata;

Anno Accademico 1992-1993

- **Esercitatore e membro in commissione d'esame in qualità di cultore della materia** del corso di **Statistica** presso la Facoltà di Scienze Politiche e per il Corso di Laurea in Scienze Bancarie dell'Università degli Studi di Macerata;

Anno Accademico 1999-2000

- **Docente**, quale figura di sistema, nell'ambito della **SSIS** (Scuola di Specializzazione Interuniversitaria all'Insegnamento Secondario) di Macerata per l'indirizzo Fisico – Informatico – Matematico (con sede di servizio presso l'Università degli Studi di Camerino).

Anno Accademico 2000-2001

- **Docente**, quale figura di sistema, nell'ambito della **SSIS** (Scuola di Specializzazione Interuniversitaria all'Insegnamento Secondario) di Macerata per l'indirizzo Fisico – Informatico – Matematico (con sede di servizio presso l'Università degli Studi di Camerino).
- **Titolare del corso di Didattica della Matematica Applicata 3 e di Laboratorio di Matematica Applicata 2** presso la Scuola Interuniversitaria di Specializzazione all'Insegnamento Secondario (SSIS) delle Marche, classi di abilitazione 47A, 48A e 49A.

Anno Accademico 2001-2002

- **Docente**, quale figura di sistema, nell'ambito della **SSIS** (Scuola di Specializzazione Interuniversitaria all'Insegnamento Secondario) di Macerata per l'indirizzo Fisico – Informatico – Matematico (con sede di servizio presso l'Università degli Studi di Camerino).
- **Titolare del corso di Didattica della Matematica Applicata 2, Didattica della Matematica nelle altre Scienze 2, Laboratorio di Didattica della Matematica Applicata e Laboratorio di Didattica della Matematica Applicata 1** presso la Scuola Interuniversitaria di Specializzazione all'Insegnamento Secondario (SSIS) delle Marche, classi di abilitazione 47A, 48A e 49A.

Anno Accademico 2003-2004

- **Titolare dei corsi di Calcolo I e Calcolo II** - Facoltà di Scienze e Tecnologie - corso di Laurea in Tecnologie per l'Innovazione - Università di Camerino (sede di Recanati);
- **Ciclo di Seminari** (40 ore) Facoltà di Scienze e Tecnologie nell'ambito dell'insegnamento di **Calcolo III** - corso di Laurea in Tecnologie per l'Innovazione - Università di Camerino (sede di Recanati);
- **Ciclo di Seminari** (20 ore) Facoltà di Scienze e Tecnologie nell'ambito dell'insegnamento di **Matematica Finanziaria** - corso di Laurea in Matematica - Università di Camerino.

Anno Accademico 2004-2005

- **Titolare dei corsi di Calcolo I e Calcolo II** Facoltà di Scienze e Tecnologie - corso di Laurea in Tecnologie per l'Innovazione - Università di Camerino (sede di Recanati);
- **Ciclo di Seminari** (40 ore) nell'ambito dell'insegnamento di **Calcolo III** - Facoltà di Scienze e Tecnologie - corso di Laurea in Tecnologie per l'Innovazione - Università di Camerino (sede di Recanati);
- **Docente esercitatore** (utilizzo di Stata 8) nell'ambito del **Corso Residenziale di Econometria – 2005 per i partecipanti ai programmi di Dottorato di Ricerca (CIDE) – Terzo Turno** – Università di Lecce – 5/14 Settembre 2005

Anno Accademico 2005-2006

- **Titolare dei corsi di Calcolo I, Calcolo II** Facoltà di Scienze e Tecnologie - corso di Laurea in Tecnologie per l'Innovazione - Università di Camerino (sede di Recanati);
- **Ciclo di Seminari** (40 ore) nell'ambito dell'insegnamento di **Calcolo III** - Facoltà di Scienze e Tecnologie - corso di Laurea in Tecnologie per l'Innovazione - Università di Camerino (sede di Recanati);
- **Titolare del corso di Statistica Economica** Facoltà di Scienze e Tecnologie - corso di Laurea di Matematica con Applicazioni Gestionali e Tecnologiche - Università di Camerino.
- **Docente esercitatore** (utilizzo di Stata 9) nell'ambito del **Corso Residenziale di Econometria – 2006 per i partecipanti ai programmi di Dottorato di Ricerca (CIDE) – Terzo Turno** – Università di Lecce – 4/13 Settembre 2006

Anno Accademico 2006-2007

- **Titolare del corso di Calcolo** (120 ore) Facoltà di Scienze e Tecnologie - corso di Laurea in Tecnologie per l'Innovazione - Università di Camerino (sede di Recanati);
- **Titolare del corso di Statistica Economica** (40 ore) Facoltà di Scienze e Tecnologie - corso di Laurea di Matematica con Applicazioni Gestionali e Tecnologiche - Università di Camerino;
- **Titolare del corso di Statistica Economica** (32 ore) nell'ambito del Master Universitario di II livello in Analisi dei Mercati e Sviluppo Locale - Università di Lecce;
- **Titolare del corso di Laboratorio di Statistica Applicata** (20) - Facoltà di Economia – Corso di laurea Magistrale - dell'Università di Macerata
- **Titolare del corso di Matematica Finanziaria ed Attuariale** (30 ore) nell'ambito dei Corsi di Abilitazione all'insegnamento secondario organizzati dall'Università di Camerino.

Anno Accademico 2007-2008

- **Titolare del corso di Calcolo 2** (40 ore) Facoltà di Scienze e Tecnologie- corso di Laurea in Tecnologie per l'Innovazione dell'Università di Camerino (sede di Recanati);
- **Titolare del corso di Econometria** (40 ore) Facoltà di Scienze e Tecnologie - corso di Laurea di Matematica con Applicazioni Gestionali e Tecnologiche - Università di Camerino;
- **Titolare del corso di Statistica VS** (40 ore) Facoltà di Economia – Corso di laurea Triennale - Università di Macerata;
- **Tutor del Corso di Matematica Finanziaria** (30 ore) Facoltà di Economia - Università di Bologna (sede di Forlì).

Anno Accademico 2008-2009

- **Titolare del corso di Calcolo 1** (40 ore) Facoltà di Scienze e Tecnologie - corso di Laurea in Tecnologie per l'Innovazione - Università di Camerino (sede di Recanati);
- **Titolare del corso di Econometria** (90 ore) Facoltà di Economia - Corso di Laurea Magistrale in Economia e Politica dei Mercati - Università di Bologna (sede di Rimini);
- **Titolare del corso di Statistica VS** (40 ore) Facoltà di Economia – Corso di Laurea Triennale - Università di Macerata;
- **Titolare del corso di Analisi del Rischio Finanziario** (50 ore) Facoltà di Economia – Corso di Laurea Magistrale - Università di Bologna (sede di Forlì);
- **Docente di Risparmio Gestito** (8 ore) nel Corso di Alta Formazione in Finanza Matematica Edizione 2008 – Università di Bologna;
- **Docente di Risparmio Gestito** (16 ore) nel Corso di Alta Formazione Universitaria Previcomp Economia e Diritto della Previdenza Complementare – Università di Bologna;
- **Docente di Risparmio Gestito** (4 ore) nel Master in Economia e Diritto della Previdenza Complementare – Università degli Studi della Tuscia (Facoltà di Economia) ed il MEFOP S.p.A.
- **Tutor del Corso di Matematica Finanziaria** (30 ore) - Facoltà di Economia - Università di Bologna (sede di Forlì).

Anno Accademico 2009-2010

- **Titolare del corso di Statistica VS** (60 ore) Facoltà di Economia – Corso di Laurea Triennale - Università di Macerata;
- **Titolare del corso di Analisi del Rischio Finanziario** (50 ore) Facoltà di Economia – Corso di Laurea Magistrale - Università di Bologna (sede di Forlì);
- **Titolare del corso di Metodi di Ottimizzazione** (25 ore) Facoltà di Economia – Corso di Laurea Magistrale - Università di Bologna (sede di Forlì);
- **Docente di Risparmio Gestito** (5 ore) nel Corso di Alta Formazione in Finanza Matematica Edizione 2009 – Università di Bologna;
- **Docente di Risparmio Gestito** (12 ore) nel Corso di Alta Formazione Previquant – MEFOP S.p.A.

Anno Accademico 2010-2011

- **Titolare del corso di Analisi del Rischio Finanziario** (50 ore) Facoltà di Economia – Corso di Laurea Magistrale - Università di Bologna (sede di Forlì);

- **Titolare del corso di Metodi di Ottimizzazione** (25 ore) Facoltà di Economia – Corso di Laurea Magistrale - Università di Bologna (sede di Forlì);
- **Titolare del corso di Econometria** (40 ore) Facoltà di Economia – Corso di Laurea Magistrale - Università di Macerata;
- **Titolare del corso di Statistica VS** (60 ore) Facoltà di Economia – Corso di Laurea Triennale - Università di Macerata.

CORRELATORE DI TESI

- *“Metodi ed Algoritmi per la gestione Ottima e l’Immunizzazione di un Portafoglio Titoli”*, - Corso di Laurea in Matematica - Facoltà di Scienze Matematiche, Fisiche e Naturali dell’Università di Camerino – Relatore Prof. R. De Leone – Settembre 2002;
- *“Expected Shortfall: una misura coerente di rischio di portafoglio”*, laurea magistrale - Corso di Laurea in Matematica - Facoltà di Scienze e Tecnologie - Università di Camerino – 14 Dicembre 2005;
- *“Lo sconto dei Fondi Immobiliari Italiani: il ruolo dell’assemblea dei partecipanti e altre variabili esplicative”*, laurea magistrale – Corso di Laurea in Consulenza per i Mercati e le Istituzioni Finanziarie – Facoltà di Economia – Università di Macerata – 15 Novembre 2007.

RELATORE DI TESI

- *“Analisi statistica delle giacenze di magazzino: il caso Poltrona Frau S.p.A”*, laurea triennale – Corso di Laurea in Matematica ed Applicazioni Economiche e Gestionali – Università di Camerino - 14 Febbraio 2007;
- *“Basilea 2: sviluppo di un modello di scoring mediante reti neurali artificiali”*, laurea magistrale – Corso di Laurea in Matematica ed Applicazioni – Università di Camerino - 4 Aprile 2007;
- *“Scoring aziendale via cluster analysis nel contesto Basilea 2”*, laurea magistrale – Corso di Laurea in Matematica ed Applicazioni – Università di Camerino - 4 Aprile 2007.
- *“Dimensionamento dell’organico bancario attraverso gli indici di produttività”*, laurea triennale – Corso di Laurea in Matematica ed Applicazioni Economiche e Gestionali – Università di Camerino - 12 Dicembre 2007.
- *“Analisi statistica delle importazioni ed esportazioni: il caso di studio delle aziende manifatturiere maceratesi”*, laurea triennale – Corso di laurea in Matematica ed Applicazioni Economiche e Gestionali – Università di Camerino – 9 Aprile 2008.
- *“Individuazione e stima della funzione di produzione delle aziende manifatturiere della provincia di Macerata”*, laurea triennale – Corso di laurea in Matematica ed Applicazioni Economiche e Gestionali – Università di Camerino – 9 Aprile 2008.

ORGANIZZAZIONE DI CORSI E CONVEGNI

- Membro del **Comitato Organizzatore** di AIRO 2005 - Polo Informatico - Università degli Studi di Camerino -6/9 Settembre 2005.

RELATORE DI SEMINARI

- “*Analisi Esplorativa delle Serie Storiche*” – Università di Macerata – 27 Aprile 1992.
- “*Dalla Teoria dell’Utilità Attesa alla Selezione di Portafoglio*” – Università di Camerino – 13 Luglio 2005.
- “*Ottimizzazione Robusta per la Selezione di Portafogli Finanziari efficienti*” – Università di Macerata – 28 Novembre 2005.
- “*Teoria dei Giochi ed Applicazioni in Economia*” - Università di Camerino – 10 Aprile 2006.
- “*Applicazioni in GAMS del problema della selezione del portafoglio finanziario con approccio di Markowitz*” – Università di Macerata – 6/7 Dicembre 2006.
- “*Applicazioni della Teoria dei Giochi*” – Progetto Lauree Scientifiche - Università di Camerino - 19 Febbraio 2007.
- “*Ottimizzazione in GAMS di nuove misure per la Selezione di Portafoglio*” – Università di Macerata – 7 Novembre 2007.
- “*Asset Allocation Strategica: l’approccio econometrico*” – Università di Macerata – 10 Dicembre 2010.

COMUNICAZIONI A CONVEGNI

- “*Measuring Poverty: a Case Study in an Italian Industrial City*” – International Meeting on: Personal Income, Distribution, Inequality and Poverty – University of Siena – October 28-30 1991;
- “*Autoregression and Artificial Neural Networks for Financial Market Forecast*” – AIRO 2004 – University of Lecce – September 7-11 2004;
- “*Robust Optimization of Conditional Value at Risk and Portfolio Selection*” - III International Summer School on Risk Measurement and Control – Roma – 20/28 Giugno 2006;
- “*Robust Optimization of a Coherent Risk Measure*” – II International Conference on Management of Risk Factors in economically relevant human activities – Roma – 31 Agosto/2 Settembre 2006;
- “*Robust Optimization of a bi-criteria model of Stochastic Programming*” – XXX Convegno AMASES – Università degli Studi di Trieste – 4/7 Settembre 2006.
- “*Robust Optimization of CVaR and VaR: a comparison*” – XXXI Convegno AMASES – Università degli Studi di Lecce – 3/6 Settembre 2007.
- “*A stochastic model for financiers*” – XXXI Convegno AMASES – Università degli Studi di Lecce – 3/6 Settembre 2007.

- “*Basel 2: firm’s scoring via Cluster Analysis and Artificial Neural Networks*” – CLADAG 2007 – 12/14 Settembre 2007 – Università degli Studi di Macerata.
- “*Banking Competition, Switching Cost and Customer Vulnerabilità*” – 2007 LABSI International Conference on Political Economy and Public Choice: Theory and Experiments – Certosa di Pontignano – Siena – 27/29 September 2007.
- “*Concorrenza bancaria, Switching Cost e Vulnerabilità del Cliente*” – XII Rapporto sul Sistema Finanziario Italiano – Bellagio 4/5 Ottobre 2007.
- “*Robust CVaR Portfolio Management*”- XXXII Convegno AMASES – Università di Trento- 1/4 Settembre 2008.
- “*Robust Portfolio Management*” - MTISD 2008 – Università di Lecce – 18/20 Settembre 2008.
- “*Basilea 2: Rating Interno, Probabilità di Default e Componente Qualitativa del Rischio*” – Settimo Workshop sul Sistema Finanziario Italiano. Presentazione del X Rapporto SFI - Le Banche Italiane e la Finanza per lo sviluppo: territori, imprese e famiglie – Bellagio – 2/3 Ottobre 2008.
- R. Cesari, A.G. Quaranta: “*Un Approccio Robusto Risk-based alla Gestione di Portafoglio.*” - XXXIV Convegno AMASES – Università di Macerata- 1/4 Settembre 2010.
- M. Biasin, A.G. Quaranta: “*Capital Structure, Managers’ Compensation and REITs’ Share Value*” - XXXIV Convegno AMASES – Università di Macerata- 1/4 Settembre 2010.
- M. Marconi, A.G. Quaranta, S. Tartufoli: “*Evaluating the Risk of Insolvenc.*” - International Conference “**Can it happen again?**” - Università di Macerata- 1/2 Ottobre 2010.

RICERCA E COLLABORAZIONI SCIENTIFICHE IN CORSO

- Costruzione di modelli di oligopolio collusivo basati su approcci numerici con modelli ispirati dalla meccanica statistica – Lavoro interdisciplinare con Dott. Marco Patriarca e Dott.ssa Els Heinsalu (Università di Tartu - Estonia) e Dott.ssa Marcella Scrimatore (Università del Salento);
- Analisi della statistica dei tempi di soggiorno di fenomeni sociali ed attività economiche con obiettivo la modellizzazione in termini di processi di diffusione anomala - Lavoro interdisciplinare con Dott. Marco Patriarca e Dott.ssa Els Heinsalu (Università di Tartu - Estonia);
- Definizione di modelli di *scoring* aziendale nel contesto Basilea 2 basati sull’utilizzo di Reti Neurali Artificiali – in collaborazione con il servizio *Asset Liability Managment* di Banca delle Marche;

- Indicatori finanziari e probabilità di *default* delle imprese clienti: un nuovo approccio allo *z-score* di Altman via *panel-data* – in collaborazione con Prof. Mauro Marconi e Dott.ssa Silvana Tartufoli (Università di Macerata);
- Ottimizzazione robusta *risk-based* alla gestione di portafoglio, con ricorso a misure coerenti di rischio –con Prof. Riccardo Cesari (Università di Bologna);
- Struttura del capitale, remunerazione dei managers e valore delle quote dei Fondi Immobiliari Italiani - con Prof. Massimo Biasin (Università di Macerata);
- Problemi di ottimizzazione dinamica: strategie di finanziatori legali ed illegali – con Dott.ssa Raffaella Barone (Università di Lecce) e Dott. Roy Cerqueti (Università di Macerata);
- Reazioni ed adattamenti della Borsa italiana a *shocks* esogeni ed endogeni: l’eco della crisi sub-prime e l’introduzione del “Book Profondo” – con Dott.ssa Maria Elena Bontempi (Università di Bologna), Prof.ssa Caterina Lucarelli e Dott.ssa Camilla Marzoli (Università Politecnica delle Marche).

PUBBLICAZIONI

- A. Lemmi, A.G. Quaranta, A. Viviani: “*La misura della produttività: questioni di metodo ed evidenze empiriche*” – NIE – **Rapporti Tecnici – Economia e Fisco** – ISBN 8871450329 – Siena - 2004;
- A.G. Quaranta: “*Analisi statistica della produttività nel settore del credito: un caso di studio riferito ad un’azienda operante nel Mezzogiorno*” – Macerata - 1991;
- A.G. Quaranta: “*Numerologia*” – Memorabilia: itinerari per studio e per diletto – Città di Tolentino – Settembre 1993;
- A.G. Quaranta – S. Rascioni: “*Valori mobiliari e borsa valori: aspetti teorici ed applicativi*” – **Innovazione Scuola** – Rivista di Informazione Didattica e Professionale dell’IRRE Marche – n. 1 – 2002.
- R. De Leone e A.G. Quaranta: “*Utilizzo di Derive nello studio di funzioni di una variabile reale*” – FAD Unicam – [http: www.unicam.it](http://www.unicam.it) - 2002;
- R. De Leone, E. Marchitto, A.G. Quaranta: “*Autoregressione e Reti Neurali Artificiali per la previsione finanziaria*” – Linotype – Tolentino - 2004;
- R. De Leone, E. Marchitto, A.G. Quaranta: “*Autoregression and Artificial Neural Networks for Financial Market Forecast*” – **Neural Networks World** – 2/2006 – pag. 109-128 - Praga;
- A.G. Quaranta, A. Zaffaroni: “*Robust Optimization of Conditional Value at Risk and Portfolio Selection*” – Quaderni del Dipartimento di Scienze Economiche e Matematico-Statistiche – Collana di Matematica - n° 17- Università degli Studi di Lecce – Dicembre 2006;

- R. Barone, A.G. Quaranta: “*Concorrenza Bancaria, Switching Cost e Vulnerabilità del Cliente*” – **Banche Italiane: Un’industria al bivio. Mercati, consumatori, governance** - a cura di G. Bracchi e D. Masciandaro – Edibank – Bancaria Editrice – Roma - 2007;
- A.G. Quaranta: “*Ottimizzazione Robusta e Selezione di Portafoglio*” – Quaderni del Dipartimento di Scienze Economiche e Matematico-Statistiche – Collana di Matematica - n°19 - Università degli Studi di Lecce – Aprile 2007;
- R. Barone, R. Cerqueti, A.G. Quaranta: “*A stochastic model for financiers*” – Quaderno del Dipartimento di Istituzioni Economiche e Finanziarie – n°42 - Università di Macerata – Maggio 2007;
- R. Barone, A.G. Quaranta: “*Banking Competition, Switching Cost and Customer Vulnerability: the case of South Italy*” – **The Icfai Journal of Behavioral Finance** – March 2008;
- A.G. Quaranta: “*Attribuzione dello scoring aziendale nel contesto Basilea 2*” – **Banche e Banchieri** – 2/2008 - pag. 125-137 – Milano;
- R. Barone, A.G. Quaranta: “*Basilea 2: Rating Interno, Probabilità di Default e Componente Qualitativa del Rischio*” – **Le Banche Italiane e la Finanza per lo sviluppo: territori, imprese e famiglie** – a cura di D. Masciandaro - settembre 2008.
- A.G. Quaranta, A. Zaffaroni: “*Robust Optimization of Conditional Value at Risk and Portfolio Selection*” – **Journal of Banking and Finance** – Vol. 32 – pp. 2045-2056 – October 2008;
- R. Barone, A.G. Quaranta: “*Modelli di Rating Interno e Propensione al Rischio del Management*” – **Banche e Banchieri** – 6/2009 – Milano;
- M. Biasin, E. Giacomini, A.G. Quaranta: “*Quotazione a Sconto, Governance e Regolamentazione dei Fondi Immobiliari Italiani*” – **Bancaria** – n. 1/2010 - Roma.
- M.E. Bontempi, C. Lucarelli, C. Mazzoli, A.G. Quaranta: “*Reaction of the Italian Stock Exchange to Exogenous and Endogenous Events*” – **Journal of Emerging Markets** – Vol. 15(1), pp. 23-37 – 2010;
- M. Biasin, E. Giacomini, A.G. Quaranta: “*Public REITs Governance and Regulatory Structure: Effects on NAV Discount. Evidence from the Italian Market*” - **Journal of European Real Estate Research** – Vol.3 ISS: 3- pp.161-181 - October 2010;
- M. Biasin, A.G. Quaranta: “*Effects of Regulatory and Market Constraints on the Capital Structure and Share Value of REITs. Evidence from the Italian Market.*” – **International Real Estate Review – Journal of the Asian Real Estate Society** – Issn: 1029-6131 – Volume 13 – number 3 – pp. 282-322- Winter 2010;

- R. Cesari, A.G. Quaranta: “Un approccio robusto *risk-based* alla gestione di portafoglio” – **Working Paper** n°27 – MEFOP – 2011;
- R. Cesari, A.G. Quaranta: “Un approccio robusto *risk-based* alla gestione di portafoglio: una verifica empirica in tempi di crisi” – **Bancaria** – n. 1/2011 – pp.18-31;
- R. Barone, R. Cerqueti, A.G. Quaranta: “Illegal Finance and usurers’ behaviour” – **European Journal of Law and Economics** – 2011 – to appear
- R. Cerqueti, A.G. Quaranta: “The Perspective of a Bank in Granting Credits: an Optimization Model” - **Optimization Letters** – 2011 – to appear

PROCEEDINGS

- N. Panunzi, A.G. Quaranta: “*Measuring Poverty : a Case Study in an Italian Industrial City*” – Atti dell’**International Meeting on: Personal Income, Distribution, Inequality and Poverty** – University of Siena – October 28-30 1991;
- A.G. Quaranta: “*Robust Optimization of Conditional Value at Risk and Portfolio Selection*” – Atti della **III International Summer School on Risk Measurement and Control** – Roma – 20/28 Giugno 2006;
- A.G. Quaranta: “*Robust Optimization of a Coherent Risk Measure*” – Atti della **II International Conference on Management of Risk Factors in economically relevant human activities** – Roma – 31Agosto/2 Settembre 2006;
- A.G. Quaranta, A. Zaffaroni: “*Robust Optimization of a bi-criteria model of Stochastic Programming*” – Atti del **XXX Convegno AMASES** – Università degli Studi di Trieste – 4/7 Settembre 2006;
- R. Cesari, A.G. Quaranta: “*Robust Optimization of CVaR and VaR: a comparison*” – Atti del **XXXI Convegno AMASES** – Università degli Studi di Lecce – 3/6 Settembre 2007;
- R. Barone, R. Cerqueti, A.G. Quaranta: “*A stochastic model for financiers*” – Atti del **XXXI Convegno AMASES** – Università degli Studi di Lecce – 3/6 Settembre 2007;
- S. Fedeli, A.G. Quaranta, E. Voltattorni: “*Basel 2: firm’s scoring via Cluster Analysis and Artificial Neural Networks*” – **Classification and Data Analysis 2007** – 12/14 Settembre 2007 – Book of Short Papers – Eum edizioni università di Macerata – settembre 2007;
- R. Barone, A.G. Quaranta: “*Banking Competition, Switching Cost and Customer Vulnerability*” – **2007 LABSI International Conference on Political Economy and Public Choice: Theory and Experiments** – Certosa di Pontignano – Siena – 27/29 September 2007;
- M. Biasin, A.G. Quaranta: “Regulatory and Market Constraints’ effects on REITs’ Capital Structure and Share Value. Debt Incentive and NAV Discount Effects” – **XV Annual**

Conference of the European Real Estate Society - ERES 2008 – Krakow – Poland- 18/21 June 2008;

- R. Cesari, A.G. Quaranta: “Robust CVaR Portfolio Management”- Atti del **XXXII Convegno AMASES** – Università di Trento- 1/4 Settembre 2008;
- R. Cesari, A.G. Quaranta: “Robust Portfolio Management” – Atti del **MTISD 2008** – Università di Lecce – 18/20 Settembre 2008;
- M.E. Bontempi, C. Lucarelli, C. Mazzoli, A.G. Quaranta: “Reaction of the Italian Stock Exchange to exogenous and endogenous shocks: the echo of the sub-prime crisis and the introduction of “Book Profondo”” – **MFA 2009**– Chicago – 4 Marzo 2009;
- M. Biasin, E. Giacomini, A.G. Quaranta: “Italian Public REITs’ Governance and Regulatory Structure: Effects on NAV Discount” – **XVI Annual Conference of the European Real Estate Society – ERES 2009** – Giugno 2009;
- R. Cesari, A.G. Quaranta: “Un Approccio Robusto *risk-based* alla Gestione di Portafoglio” – **ABI** - Roma – Giugno 2009;
- R. Cesari, A.G. Quaranta: “Un Approccio Robusto *risk-based* alla Gestione di Portafoglio” – **Conferenza Risk&Return in Italia** – Milano – 26 Novembre 2009;
- M. Biasin, A.G. Quaranta: “Capital Structure, Managers’ Compensation and REITs’ Share Value” – **Weimer School of Advanced Studies in Real Estate and Land Economics** – Maury Seldin Advanced Studies Institute - Gennaio 2010;
- M. Biasin, A.G. Quaranta: “Struttura del Capitale, Commissioni dei Gestori e Valore delle Quote dei Fondi Immobiliari Italiani” - **XVII Annual Conference of the European Real Estate Society – ERES 2010** – Milano- Giugno 2010;
- R. Cesari, A.G. Quaranta: “Un Approccio Robusto *Risk-based* alla Gestione di Portafoglio.” - Atti del **XXXIV Convegno AMASES** – Università di Macerata- 1/4 Settembre 2010;
- M. Biasin, A.G. Quaranta: “Capital Structure, Managers’ Compensation and REITs’ Share Value” - Atti del **XXXIV Convegno AMASES** – Università di Macerata- 1/4 Settembre 2010;
- M. Marconi, A.G. Quaranta, S. Tartufoli: “Evaluating the Risk of Insolvency.” - Atti dell’International Conference **Can it happen again?** - Università di Macerata- 1/2 Ottobre 2010. – to appear;

LAVORI ATTUALMENTE IN REFERAGGIO

- A.G. Quaranta, G. Ricci: “Un approccio Monte Carlo per la valutazione del fair value delle partecipazioni non quotate” – submitted – Novembre 2010;

- M. Marconi, A.G. Quaranta, S. Tartufoli: “*Assessing the Risk of Bankruptcy*” – submitted – Gennaio 2011;

LINGUE CONOSCIUTE

- Inglese (fluente).

SISTEMI OPERATIVI, EDP E PACKAGES INFORMATICI

- MS-DOS, Windows, Linux;
- Word, WinEdt, Latex;
- Excel;
- Access;
- Power Point;
- SPSS, SAS, Easy-Reg, STATA 9;
- Derive, Mathematica, Cabri Geometre;
- PSTricks, Paint, Paint Shop Pro, Illustrator.

LINGUAGGI DI PROGRAMMAZIONE

- Fortran;
- Pascal ;
- C++;
- MatLab;
- SNNS, LibSVM-2.6;
- GAMS.