

Curriculum vitae et studiorum di Roy Cerqueti

- Dal 01/10/2014 Professore Associato, S.S.D.: SECS-S/06, presso il Dipartimento di Economia e Diritto, Università degli Studi di Macerata.

POSIZIONE PRECEDENTE

- Dal 01/11/2007 al 30/09/2014 Ricercatore Universitario e Professore Aggregato, S.S.D.: SECS-S/06, presso l'Università degli Studi di Macerata.

ABILITAZIONE SCIENTIFICA NAZIONALE, TORNATA 2012

- Abilitato nel ruolo di Professore Associato, settore concorsuale: 13/D4 - METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCIENZE ATTUARIALI E FINANZIARIE.
- Abilitato nel ruolo di Professore Associato, settore concorsuale: 13/B4 - ECONOMIA DEGLI INTERMEDIARI FINANZIARI E FINANZA AZIENDALE.

STUDI E TITOLI SCIENTIFICI

- Dal 01/07/2006 al 01/11/2007: Titolare di assegno di ricerca, presso l'Università degli Studi di Roma La Sapienza. Titolo della ricerca: Modelli semimarkoviani per i network di comunicazione.
- Dal 01/03/2004 al 28/02/2005: Titolare di un assegno di ricerca presso l'Università degli Studi della Tuscia, Viterbo. Titolo dell'assegno: Modelli matematici per l'economia e la finanza.
- 16/03/2004: Conseguimento del titolo di dottore di ricerca. Titolo della tesi: Stochastic calculus applied to finance: optimal financing policies and time series with memory properties models..
- Dal 01/11/2000 al 30/10/2003: Dottorato di ricerca in Matematica per le Applicazioni Economico-Finanziarie, Facoltà di Economia, Università di Roma La Sapienza.
- 13/07/2000: Laurea in Matematica, presso l'Università di Roma La Sapienza. Relatore: professor Peter Laurence. Titolo della tesi: Entropia e misure di martingala in mercati incompleti.

Selezione di pubblicazioni¹

¹Sono riportati solamente gli articoli pubblicati o accettati per la pubblicazione. La lista completa dei Working Paper é disponibile nella sezione successiva.

1. **Stochastic calculus applied to finance: optimal financing policies and time series with memory properties models, 2004.**

2. R. Cerqueti, M. Ausloos, **Statistical Assessment of Regional Wealth Inequalities: the Italian Case.** *Quality and Quantity*, forthcoming.
3. T.A. Mir, M. Ausloos, R. Cerqueti **Benford's law predicted digit distribution of aggregated income taxes: the surprising conformity of Italian cities and regions.** *The European Physical Journal B*, forthcoming.
4. R. Cerqueti, R. Coppier, **Corruption, Evasion and Environmental Policy: a Game Theory Approach.** *IMA Journal of Management Mathematics*, forthcoming.
5. R. Cerqueti, M. Ventura, **Patent Valuation Under Spatial Point Processes with Delayed and Decreasing Jump Intensity.** *The B.E. Journal of Theoretical Economics*, doi:10.1515/bejte-2013-0104, (2014).
6. F. Bartolacci, N.G. Castellano, R. Cerqueti, **The impact of innovation on companies' performance: an entropy-based analysis of the STAR Market Segment of Italian Stock Exchange.** *Technology Analysis and Strategic Management*, doi:10.1080/09537325.2014.952624, (2014).
7. R. Cerqueti, F. Tramontana, M. Ventura, **On the coexistence of innovators and imitators.** *Technological Forecasting & Social Change*, doi:10.1016/j.techfore.2014.03.011, (2014).
8. R. Cerqueti, R. Coppier, **A game theoretical analysis of the impact of income inequality and ethnic diversity on fiscal corruption.** *Annals of Operations Research*, doi:10.1007/s10479-014-1567-9, (2014).
9. R. Cerqueti, G. Rotundo, **A review of aggregation techniques for agent-based models: understanding the presence of long-term memory.** *Quality and Quantity*, doi:10.1007/s11135-014-9995-9, (2014).
10. R. Cerqueti, F. Sarnari, **Symmetries of systems with spatially bounded domains.** *Journal of Advanced Research in Dynamical and Control Systems*, 6(1), 11-25, (2014).
11. R. Cerqueti, M. Ventura, **Risk and Uncertainty in the Patent Race: a Probabilistic Model.** *IMA Journal of Management Mathematics*, doi:10.1093/imaman/dpt020, (2013).

12. R. Cerqueti, **Exhaustion of Resources: a Marked Temporal Process Framework.** *Stochastic Environmental Research and Risk Assessment*, 28(4), 1023-1033, (2014).
13. R. Cerqueti, R. Coppier, **Corruptibility and Tax Evasion.** *European Journal of Law and Economics*, doi:10.1007/s10657-013-9406-z, (2013).
14. R. Cerqueti, L. Correani, G. Garofalo, **Economic Interactions and Social Tolerance: A Dynamic Perspective.** *Economics Letters*, 120(3), 458-463, (2013).
15. R. Castellano, R. Cerqueti, **Mean-variance portfolio selection in presence of unfrequently traded stocks** , *European Journal of Operational Research*, 234(2), 442-449, (2014).
16. M. Bovi, R. Cerqueti, **A Quantitative View on Policymakers' Goal, Institutions and Tax Evasion.** *Quality & Quantity*, doi:10.1007/s11135-013-9849-x, (2013).
17. R. Cerqueti, P. Falbo, G. Guastaroba, C. Pelizzari, **A Tabu Search Solution in Markov Chain Bootstrapping**, *European Journal of Operational Research*, 227(2), 367-384, (2013).
18. R. Cerqueti, F. Spizzichino, **Extension of dependence properties to semi-copulas and applications to the mean-variance model**, *Fuzzy Sets and Systems*, 220, 99-108, (2013).
19. R. Castellano, R. Cerqueti, **Roots and effects of financial misperception in a stochastic dominance framework**, *Quality & Quantity*, 43, 3371-3389, (2013).
20. R. Castellano, R. Cerqueti, **Optimal consumption/investment problem with light stocks: A mixed continuous-discrete time approach**, *Applied Mathematics and Computation*, 218(12), 6887-6898, (2012).
21. R. Cerqueti, M. Costantini, **New results on the convergence of random matrices**, *Statistics: A Journal of Theoretical and Applied Statistics*, 47(4), 663-671, (2013).
22. R. Cerqueti, R. Coppier, G. Piga, **Corruption, growth and ethnolinguistic fractionalization: a theoretical game model**, *Journal of Economics*, 106(2), 153-181, (2012).
23. R. Castellano, R. Cerqueti, R.L. D'Ecclesia, **A Disutility-Based Drift Control for Exchange Rates**, *Optimization*, 63(2), 255-269, (2014).
24. R. Cerqueti, G. Rotundo, **The Role of Diversity in Persistence Aggregation**, *International Journal of Intelligent Systems*, 27(2), 176-187, (2012).

25. R. Cerqueti, **Financing Policies via Stochastic Control: a Dynamic Programming Approach**, *Journal of Global Optimization*, 53(3), 539-561, (2012).
26. R. Cerqueti, A.G. Quaranta, **The Perspective of a Bank in Granting Credits: an Optimization Model**, *Optimization Letters*, 6(5), 867-882, (2012).
27. R. Barone, R. Cerqueti, A.G. Quaranta, **Illegal financier and usurer behavior**, *European Journal of Law and Economics*, 34(2), 265-277, (2012).
28. R. Cerqueti, M. Costantini, **Testing for rational bubbles in the presence of structural breaks: Evidence from nonstationary panels**, *Journal of Banking and Finance*, Vol. 35, 2598-2605, (2011).
29. R. Castellano, R. Cerqueti, **The optimal bid/ask spread in a Specialist System**, *Economic Modelling*, Vol. 28, 2247-2253, (2011).
30. R. Cerqueti, R. Coppier, **Corruption, tax evasion and economic growth**, *Economic Modelling*, Vol. 28, no. 1-2, 489-500, (2011).
31. S. Brianzoni, R. Cerqueti, E. Michetti, **A dynamics stochastic model of asset pricing model with heterogeneous beliefs**, *Computational Economics*, Vol. 35, no. 2, 165-188, (2010).
32. R. Cerqueti, G. Rotundo, **Options with underlying asset driven by a fractional brownian motion: crossing barriers estimates**, *New Mathematics and Natural Computation*, Vol. 6, no. 1, 109-118, (2010).
33. R. Cerqueti, M. Costantini, **Some Nonparametric Asymptotic Results for a Class of Stochastic Processes**, *Communications in Statistics: Theory and Methods*, Vol. 39, no. 14, 2552-2560, (2010).
34. R. Cerqueti, M. Costantini, **Asymptotic solutions of a generalized eigenvalue problem**, *Applied Mathematical Sciences*, Vol. 3, no. 60, 2985-2999, (2009).
35. R. Cerqueti, R. Coppier, **Tax revenues, fiscal corruption and “shame” costs**, *Economic Modelling*, Vol. 26, no. 6, 1239-1244, (2009).
36. R. Cerqueti, R. Foschi, F. Spizzichino, **A Spatial Mixed Poisson Framework for Combination of Excess of Loss and Proportional Reinsurance Contracts**, *Insurance: Mathematics and Economics*, Vol. 45, no. 1, 59-64, (2009).
37. R. Cerqueti, G. Rotundo, **Companies’ decisions for profit maximization: a structural model**, *Applied Mathematical Sciences*, Vol. 3, no. 27, 1327-1340, (2009).
38. R. Cerqueti, **Dynamic Programming via Measurable Selection**, *Pacific Journal of Optimization*, Vol. 5, no. 1, 169-181, (January 2009).

39. R. Cerqueti, M. Costantini, **On the asymptotic behaviour of random matrices in a multivariate statistical model**, *Statistics and Probability Letters*, Vol. 78, no. 14, 2039-2045, (2008).
40. R. Cerqueti, G. Rotundo, **Productivity and costs for growing firms in presence of technological renewal processes**, *International Transactions in Operational Research*, 14, 521-534, (2007).

ARTICOLI SU LIBRO INTERNAZIONALE

41. R. Cerqueti, F. Spizzichino, **Signatures of systems with non-exchangeable lifetimes: some implications in the analysis of financial risk**, *Springer Proceedings in Mathematics & Statistics*, T. Oliveira and C. Kitsos Eds., Springer-Verlag (forthcoming).
42. M. Bovi, R. Cerqueti, **Why is the Tax Evasion so Persistent?**, *PROGRESS IN ECONOMICS*, Vol. 24, A. Tavidze Ed., NEW YORK: Nova Science Publishers Inc., (forthcoming).
43. R. Castellano, R. Cerqueti, **Light Stocks and Wealth Allocation**, *24TH MINI EURO CONFERENCE ON CONTINUOUS OPTIMIZATION AND INFORMATION-BASED TECHNOLOGIES IN THE FINANCIAL SECTOR - MEC EUROPT 2010: SELECTED PAPERS*, VILNIUS: Vilnius Technika, 1-4 (2010).
44. R. Cerqueti, G. Rotundo, **Firms clustering in presence of technological renewal processes**, *NONLINEAR ECONOMIC DYNAMICS*, T. Puu and A. Panchuk Eds., NEW YORK: Nova Science Publishers Inc., 135-145 (2010).
45. R. Cerqueti, G. Rotundo, **Memory Property in Heterogeneously Populated Markets**, *PREFERENCES AND DECISIONS - Studies in Fuzziness and Soft Computing, Volume 257/2010*, S. Greco, R.A. Marques Pereira, M. Squillante, R.R. Yager and J. Kacprzyk Eds., Springer-Verlag, 53-67 (2010).
46. R. Cerqueti, M. Costantini, C. Lupi, **A Characterization of the Dickey-Fuller Distribution With Some Extensions to the Multivariate Case**, *AMERICAN STATISTICAL ASSOCIATION - Proceedings of the Joint Statistical Meeting (Business and Economic Statistics Section)*, Washington DC, USA, 1-6 August 2009, 4570-4576.
47. R. Cerqueti, G. Rotundo, **Dynamics of financial time series in an inhomogeneous framework**, *MATHEMATICAL AND STATISTICAL METHODS IN INSURANCE AND FINANCE*, C. Perna and M. Sibillo Eds., Springer-Verlag, 67-74, (2008).

48. R. Cerqueti, G. Rotundo, **Microeconomic modeling of financial time series with long term memory**, *PROCEEDINGS OF IEEE. International Conference on Computational Intelligence for Financial Engineering*, Hong Kong, China, 191-198, (2003).²

ARTICOLI SU LIBRO NAZIONALE

49. R. Cerqueti, **Il ruolo della pioggia nella finanza moderna**. Macerata, Eum (forthcoming).
50. R. Cerqueti, **L'evitabilità dell'estinzione di una risorsa naturale**. In: *Oikos: la radice comune di economia e di ecologia*, curatore: P. Rovati. Macerata, Eum, (2012)³.
51. R. Cerqueti, **Laghi poco profondi: un modello matematico di interazione tra economia e inquinamento**. In: *Economia, Ambiente e Società*, curatore: P. Rovati. Macerata, Eum, (2011).
52. R. Cerqueti, G. Rotundo, **Processi di rinnovamento nei cluster di imprese**, lavoro invitato sul volume collettivo: *CAPITALISMO DISTRETTUALE, LOCALISMI D'IMPRESA, GLOBALIZZAZIONE*, reviewer: G. Riey, curatore: G. Garofalo, Firenze University Press, (2007).

ATTIVITÀ DI ORGANIZZAZIONE

- 1-3 settembre 2005: International conference for the management of risk factors in economically relevant human activities, Viterbo, Italia (in questa conferenza é stato anche presentato un lavoro)
- 31 agosto - 2 settembre 2006: MARF 2 Conference, Roma, Italia (in questa conferenza é anche stato presentato un lavoro, e sono stato chairman di una sessione).
- 31 agosto - 2 settembre 2006: Prey-Predator-Like Systems Workshop, Roma, Italia.
- Giugno 2007: Fourth Edition of the International Summer School on Risk Measurement and Control, Roma, Italia.
- Giugno 2010: Sixth Edition of the International Summer School on Risk Measurement and Control, Roma, Italia.
- 1-4 Settembre 2010: XXXIV Convegno AMASES, Macerata, Italia.

²Questo lavoro è stato selezionato dall'Università della Tuscia insieme ad altri 7 per la valutazione dell'attività scientifica di Ateneo del 2003.

³Premio Speciale del Presidente della Repubblica conferito per i particolari meriti dell'opera: *Oikos: La radice comune di economia e di ecologia*.

- 3-5 maggio 2012: 50th EWGFM, Roma, Italia.
- Giugno 2012: Seventh Edition of the International Summer School on Risk Measurement and Control, Roma, Italia.
- Ciclo di Seminari presso l'Università degli Studi di Macerata. Relatori:
 - Anna Grazia Quaranta
 - Marco Patriarca
 - Els Heinsalu
 - Ernesto Volpe di Prignano
 - Marcel Ausloos

SEMINARI AD INVITO

- INRIA, Paris. Titolo del seminario: Volatility calibration via entropic methods.
- Università La Sapienza, Facoltà di Scienze Matematiche, Fisiche e Naturali, Dipartimento di Matematica. Titolo del seminario: Politiche ottimali di finanziamento: un problema di controllo stocastico con approccio di programmazione dinamica.
- Università del Molise, Campobasso. Titolo dei seminari:
 - 1) Panel based tests for a change in persistence: inflation and interest rate;
 - 2) Detecting bubbles in stock market: new international evidence.
- Università del Salento, Lecce. Titolo del seminario: Dynamic stochastic optimization in economics and finance.
- Università di Brescia. Titolo del seminario: Dynamic stochastic optimization models in economics and finance.
- Università di Messina. Titolo del seminario: Stochastic Optimal Control: New Results and Applications.
- Università di Brescia. Titolo del seminario: Natural Resources and Environmental Stochastic Sustainability.

Presso l'Università di Macerata, sono stati tenuti cinque seminari, con i seguenti titoli:

- Il ruolo della pioggia nella finanza moderna (seminario didattico).
- L'evitabilità dell'estinzione di una risorsa naturale (seminario didattico).

- Laghi poco profondi: un modello quantitativo di economia e inquinamento (seminario didattico).
- Matematica da Nobel (seminario didattico).
- Dynamic optimization and more (seminario scientifico).

CONVEGNI

- 02/2001: II Workshop di Finanza Matematica, Pisa, Italy
- 09/2001: XXV Convegno AMASES, Florence, Italy.
- 12/2001: Calcul de Malliavin appliqué a la finance, Paris (INRIA), France.
- 01/2002: III Workshop di Finanza Matematica, Verona, Italy.
- 09/2002: XXVI Convegno AMASES, Verona, Italy.
- 09/2002: Stochastic processes, stochastic calculus and applications, Rome, Italy.
- 03/2003: International Conference on Computational Intelligence for Financial Engineering, Hong Kong, China.
- 05/2003: Eighth Viennese Workshop on Optimal Control, Dynamic Games and Nonlinear Dynamics: Theory and Applications in Economics Vienna, Austria.
- 05/2003: Invito alla Finanza Matematica, L'Aquila, Italy.
- 09/2003: XXVII Convegno Amases Cagliari, Italy.
- 06/2004: Invito alla Finanza Matematica, University of Rome Tor Vergata, Italy.
- 06/2004: 8th International Congress on Insurance: Mathematics and Economics, Rome, Italy.
- 07/2004: Third World Congress of the Bachelier Finance Society, Chicago, USA.
- 09/2004: XXVIII Convegno Amases, Modena, Italy.
- 07/2005 Institute for Operations Research and the Management Sciences Triennial Conference, Honolulu, Hawaii, USA (SPEAKER IN AN INVITED SESSION).
- 07/2005 Computational Intelligence for Economics and Finance, Salt Lake City, Utah, USA.
- 09/2005 Stochastic Methods in Mathematical Finance, Rome, Italy.
- 09/2005 XXIX Convegno Amases, Palermo, Italy.

- 09/2005 Unit Roots and Cointegration Tests Conference, Faro, Portugal, September 2005
- 07/2006 21st European Conference on Operational Research, Reykjavik, Iceland.
- 09/2006 XXX Convegno AMASES, Trieste, Italy.
- 10/2006 Convegno Metodi Matematici e Statistici per le Assicurazioni e la Finanza, Salerno, Italy.
- 01/2007: CIDE, Rimini, Italia.
- 03/2007 20 Years of Cointegration: theory and practice in prospect and retrospect, Rotterdam, The Netherlands.
- 05/2007: XL EWGFM (Euro Working Group on Financial Modeling), Rotterdam, The Netherlands. (SPEAKER IN AN INVITED SESSION)
- 05/2007: Network, topology and dynamics, Urbino, Italia.
- 09/2007: XXXI Convegno AMASES, Lecce, Italy.
- 01/2008: Recent Development in Econometrics: a Conference in Memory of Carlo Giannini, Bergamo, Italy.
- 06/2008: 15th World congress of the International Economics Association, Istanbul, Turkey.
- 06/2008: Institute for Operations Research and the Management Sciences Triennial Conference, Sandton, Johannesburg, South Africa. (SPEAKER IN AN INVITED SESSION)
- 09/2008: XXXII Convegno AMASES, Trento, Italy.
- 02/2009: Macroeconomic and Policy Implications of Undergroud Economy and Tax Evasion, Milan, Italy.
- 06/2009: 6th International Conference on Nonlinear Economic Dynamics (NED09), Jönköping, Sweden.
- 06/2009: CORS-INFORMS International Meeting, Toronto, Canada.
- 06/2009: XVII Scientific Conference - AIESSEC, Perugia, Italia.
- 07/2009: Joint Statistical Meeting 2009, Washington DC, USA.
- 09/2009: 24th Annual Congress of the European Economic Association, Barcelona, Spain.

- 04/2010: Methods for Actuarial Sciences and Finance Conference (MAF 2010), Ravello, Italia.
- 05/2010: Second Annual Meeting on Physics of Competitions and Conflicts, Sunny Beach, Bulgaria.
- 06/2010: 24th Mini EURO Conference on Continuous Optimization and Information-Based Technologies in The Financial Sector, Izmir, Turkey. (SPEAKER IN AN INVITED SESSION AND CHAIR)
- 09/2010: XXXIV Convegno Amases, Macerata, Italia.
- 09/2010: European Law and Economic Association Conference (EALE 2010), Paris, France.
- 09/2010: Second International Workshop on Managing Financial Instability in Capitalist Economies, Reykjavik, Iceland.
- 06/2011: Insurance: Mathematics and Economics Conference, Trieste, Italy.
- 07/2011: Conference in Honor of Hashem Pesaran 65th Birthday, Cambridge, UK.
- 09/2011: XXXV Convegno Amases, Pisa, Italy.
- 02/2012: Eighteenth International Working Seminar on Production Economics, Innsbruck, Austria.
- 07/2012: Workshop Copulae in Mathematical and Quantitative Finance, Krakow, Poland.
- 07/2012: 25th European Conference on Operational Research, Vilnius, Lithuania. (SPEAKER IN AN INVITED SESSION)
- 05/2013: Eastern Economic Association Conference, New York, USA. (SPEAKER IN AN INVITED SESSION)
- 05-06/2013: 5th International Conference on Risk Analysis (ICRA5), Tomar, Portugal. (INVITED SPEAKER)
- 09/2013: Structural Change, Dynamics and Economic Growth Conference, Livorno, Italy.
- 09/2014: XXXVIII Convegno AMASES, Reggio Calabria, Italy
- 09/2014: International Meeting Dyse 2014 - Dynamics of Socio-Economic Systems, Sevilla, Spain. (INVITED SPEAKER)

SCUOLE DI SPECIALIZZAZIONE (COME STUDENTE O COME RELATORE)

- 01/2001: Partecipazione alla Cattedra Galileana Mathematical Models in Finance, Prof. Marco Avellaneda (Courant Institute of Mathematical Science, New York), Pisa, Italia.
- 06/2001: Partecipazione alla Scuola Estiva: Workshop Fondamenti e Sviluppi della Matematica per l' Economia, Pozzuoli, Italia.
- 07/2003: Partecipazione alla Scuola Estiva CIME Stochastic Methods in Finance, Bressanone, Italia.
- 05/2004: Partecipazione alla scuola estiva: Spring school in finance, Università degli Studi di Bologna, Italia.
- 06/2005: Partecipazione alla scuola estiva: International Summer School in Risk Management and Measurement, Roma, Italia, in qualità di relatore di un contributed paper. Lavoro presentato: Speculative Bubbles in International Stock Markets: A Panel Cointegration Analysis.
- 06/2006: Partecipazione alla scuola estiva: Third International Summer School in Risk Management and Measurement, Roma, Italia, in qualità di relatore di un contributed paper. Lavoro presentato: Exchange Rates Modeling: a Disutility-Based Stochastic Control Approach.
- 06/2008: Partecipazione alla scuola estiva: Fourth International Summer School in Risk Management and Measurement, Roma, Italia, in qualità di relatore di un contributed paper. Lavoro presentato: The Specialist's Role in Thin Stocks.

STAGE DI RICERCA

Dall'ottobre 2001 al marzo 2002 effettua uno stage retribuito a Parigi, presso l'Ecole Nationale des Pontes et Chaussées, presso l'Université de Marne La-Vallée e presso l'INRIA, su due progetti di ricerca coordinati dai proff. Damien Lamberton e Bernard Lapeyre. Un progetto era inerente l'implementazione di modelli dinamici associati ad equazioni di tipo Hamilton-Jacobi-Bellman con salti (PREMIA). L'altro era volto ad uno studio di metodi probabilistici applicati alla matematica finanziaria (MATHFI).

Da un punto di vista della formazione, sono stati seguiti diversi corsi del DEA di Analyse et système aléatoires, presso l'Université de Marne La-Vallée, e un corso introduttivo di C++ applicato alla finanza.

Per una descrizione dettagliata dell'attività svolta si rimanda ai seguenti siti:

<http://cermics.enpc.fr/ra/CERMICS-2001.pdf>

<http://cermics.enpc.fr/ra/CERMICS-2002.pdf>

<http://www.inria.fr/rapportsactivite/RA2002/mathfi>

ASSOCIAZIONI SCIENTIFICHE

- AMASES
- INFORMS (Institute for Operations Research and the Management Sciences)
- European Economic Association
- Econometric Society
- Western Economic Association
- EWGFM (Euro Working Group on Financial Modelling)

COMITATI SCIENTIFICI

- Membro del Comitato Scientifico della International Summer School on Risk Measurement and Control, 16-21 giugno 2014, Roma, Italia.
- Membro del Comitato Scientifico del Third Edition of the International Workshop on Managing Financial Instability in Capitalist Economies (MAFIN 2012), 19-21 settembre 2012, Genova, Italia.
- Membro eletto del Comitato di Area per la Ricerca (Area 13) (CAR) (organo composto da 5 membri e preposto alla valutazione dell'attività di ricerca dei colleghi di Ateneo afferenti all'Area 13) presso l'Università degli Studi di Macerata per i bienni 2008/2010 e 2010/2012.

PARTECIPAZIONE A PROGETTI DI RICERCA

★ Membro di unità di ricerca:

- PRIN 2003: La gestione del rischio finanziario, di credito e operativo: strumenti e modelli (coordinatore: LORENZO PECCATI) (durata: 24 mesi).
- PRIN 2004: Modelli stocastici in finanza matematica (coordinatore: WOLFGANG JOHANN RUNGGALDIER) (durata: 24 mesi).
- PRIN 2006: Metodi di ottimizzazione e controllo per la gestione del debito pubblico; modelli statici e dinamici (coordinatore: FAUSTO GOZZI) (durata: 24 mesi).
- PRIN 2006: Modelli stocastici in finanza (coordinatore: WOLFGANG JOHANN RUNGGALDIER) (durata: 24 mesi).
- PRIN 2010: Dinamiche nonlineari in modelli di cambiamento strutturale (coordinatore: NERI SALVADORI) (durata: 24 mesi).

★ Coordinatore (ex 60%):

- FAR 2012 (Univ. Macerata): Ottimizzazione dinamica e dipendenza stocastica: teoria e applicazioni economico-finanziarie
- FAR 2011 (Univ. Macerata): Analisi di problemi economico-finanziari attraverso modelli di ottimizzazione dinamica con dipendenza stocastica e copule
- FAR 2010 (Univ. Macerata): Processi stocastici a tempo discreto e applicazioni in economia e finanza
- FAR 2009 (Univ. Macerata): Modelli economici e finanziari attraverso tecniche di controllo ottimo stocastico
- FAR 2008 (Univ. Macerata): Modelli economici e finanziari attraverso ottimizzazione dinamica e analisi della cointegrazione tra serie temporali

ATTIVITÀ DI VISITING

- 2009. Università di Brescia.
- 2009. University of Vienna, Austria.
- 2010. Université du Luxembourg.
- 2011. Brunel University, UK.

ATTIVITÀ DI REFEREE

- Reviewer per *AMERICAN MATHEMATICAL SOCIETY*.
- Referee per *Insurance: Mathematics and Economics*, *Economic Modelling*, *Quantitative Finance*, *Journal of Economics*, *Journal of Economic Law and Organization*, *Optimization*, *Journal of Population Economics*, *International Review of Economics and Finance*, *Journal of Industrial and Management Optimization*, *Journal of Banking and Finance*, *Economic Inquiry*, *The Energy Journal*, *Communications in Statistics: Theory and Methods*, *IMA Journal of Management Mathematics*, *European Journal of Operational Research*, *European Physical Journal B*, *Scientific Research and Essays*, *International Journal of Computational Economics and Econometrics*, *International Journal of Information Technology and Decision Making*, *Journal of Economic Growth*, *European Journal of Finance*, *Abstract and Applied Analysis*, *OR Spectrum*, *Electronic Journal of Statistics*, *Quality and Quantity*, *Journal of Economic Dynamics and Control*, *Technology Analysis and Strategic Management*.

ATTIVITÀ DIDATTICA

★ CORSI DI FORMAZIONE SUPERIORE

- Presso l'Università degli Studi di Tor Vergata, Facoltà di Economia 2012/2013: Continuous-time Finance, nell'ambito del Doctorate in Money and Finance (CORSO IN LINGUA INGLESE).
- Presso la Presidenza del Consiglio dei Ministri 2011: Sfruttamento dell'ignoranza finanziaria da parte delle banche di investimento: case studies, nell'ambito della Scuola di Formazione Intelligence e Geoeconomia.
- Presso l'Università degli Studi di Macerata 2008/2009: Corso di Modelli Matematici per la Finanza (modulo di Equazioni Differenziali) nell'ambito del Master in Finanza Quantitativa.
- Presso l'Associazione Formazione Professionisti (A.FO.PROF.) e Università di Macerata 2008/2009: Corso di Matematica Finanziaria nell'ambito della Scuola per la preparazione all'abilitazione Dottori Commercialisti.
- Membro del Comitato Organizzatore del Master di I livello in Economia e Legislazione Antiriciclaggio, nell'A.A. 2006/2007.

★ CORSI DI FORMAZIONE UNIVERSITARIA DI BASE

→ PRESSO L'UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI MACERATA, FACOLTÀ DI ECONOMIA:

- **Titolare del corso di Analisi e Misura dei Rischi Finanziari, A.A. 2014/2015**
- **Titolare del corso di Laboratorio di Economia e Finanza per le Imprese di Assicurazione, A.A. 2014/2015.**
- **Titolare del corso di Laboratorio di Matematica Finanziaria, A.A. 2014/2015.**
- **Titolare del corso di Matematica Generale 2 (VS), A.A. 2011/2012**
- **Titolare del corso di Matematica Finanziaria (VS), A.A. 2010/2011-2013/2014**
- **Titolare del corso di Teoria Matematica del Portafoglio Finanziario, A.A. 2006/2007-oggi.**
- **Titolare del corso di Elementi di Calcolo delle Probabilità e Teoria Matematica del Portafoglio Finanziario, A.A. 2008/2009-oggi.**
- **Titolare del corso di Laboratorio di Modelli Matematici per l'Economia e la Finanza, A.A. 2008/2009-2009/2010.**
- **Titolare del corso di Laboratorio di Matematica 2, A.A. 2007/2008.**

→ PRESSO L'UNIVERSITÀ DI ROMA LA SAPIENZA, FACOLTÀ DI ECONOMIA, FACOLTÀ DI SCIENZE MATEMATICHE, FISICHE E NATURALI E FACOLTÀ DI STATISTICA:

- **Titolare dei corsi di Matematica Generale, Complementi di Matematica Generale e Introduzione alla Matematica Finanziaria, corsi di recupero, nell’A.A. 2006/07.**
- Vincitore di un contratto per attività di tutoraggio presso la cattedra di Calcolo delle Probabilità presso il corso di laurea in Matematica (titolari: proff. Isopi, Piccioni) nell’A.A. 2006/2007.
- Vincitore di un contratto per attività di tutoraggio presso la cattedra di Analisi Matematica II, Matematica III, presso il corso di laurea in Statistica (titolare: prof. Peter Laurence) nell’A.A. 2005/2006.
- Vincitore di un contratto per attività di tutoraggio presso la cattedra di Calcolo delle Probabilità presso il corso di laurea in Matematica (titolari: proff. Spizzichino, Piccioni) nell’A.A. 2005/2006.
- **Titolare del corso di Matematica Generale, corso di recupero, nell’A.A. 2004/05.**
- Vincitore di un contratto per attività di tutoraggio presso la cattedra di Analisi Matematica II, Istituzioni di Matematiche, Metodi Matematici dell’Economia e della Finanza presso il corso di laurea in Statistica (titolari: prof. Peter Laurence, Bianca Maria D’Onofrio) nell’A.A. 2004/2005
- Vincitore di un contratto per attività di tutoraggio presso la cattedra di Calcolo delle Probabilità presso il corso di laurea in Matematica (titolari: proff. Spizzichino, Bassan, Nappo) nell’A.A. 2004/2005.
- Vincitore di un contratto per attività di tutoraggio presso la cattedra di Calcolo delle Probabilità presso il corso di laurea in Matematica (titolari: proff. Spizzichino, Bassan, Nappo) nell’A.A. 2003/2004.
- Collaborazione alla cattedra di Matematica Generale (titolare del corso: prof.ssa Giulia Rotundo) negli A.A. 2001/2002, 2002/2003, 2003/2004, 2004/2005 e 2006/2007.
- Collaborazione alla cattedra di Complementi di Matematica Generale (titolare del corso: prof.ssa Giulia Rotundo) negli A.A. 2001/2002, 2002/2003 e 2006/2007.
- Collaborazione alla cattedra di Matematica Generale corso avanzato (titolare del corso: prof. Fausto Gozzi) nell’A.A. 2002/2003.
- Vincitore di un contratto per attività di tutoraggio presso la cattedra di Istituzioni di Matematiche presso il corso di laurea di biologia, con riferimento al modulo di Biostatistica (titolare del corso: prof. Camillo Cammarota) nell’A.A. 2002/2003.
- Membro della commissione nazionale per la valutazione di studenti di scuola secondaria superiore per il conferimento di borse di studio INDAM ai fini dell’immatricolazione al corso di laurea in matematica, nel settembre 2000.

→ PRESSO L’UNIVERSITÀ DELLA TUSCIA, FACOLTÀ DI ECONOMIA:

- **Titolare del corso di Matematica Finanziaria, A.A. 2004/2005 e 2005/2006.**
 - **Titolare del corso di Complementi di Matematica Finanziaria, A.A. 2004/2005 e 2005/2006.**
 - Vincitore di tre contratti per attività di tutoraggio presso le cattedre di Matematica Generale, Complementi di Matematica (titolare del corso: prof.ssa Giulia Rotundo) nell’A.A. 2005/2006.
 - Collaborazione alla cattedra di Matematica Generale (titolare del corso: prof.ssa Giulia Rotundo) negli A.A. 2002/2003, 2003/2004, 2004/2005 e 2005/2006.
 - Collaborazione alla cattedra di Complementi di Matematica Generale (titolare del corso: prof.ssa Giulia Rotundo) negli A.A. 2002/2003, 2003/2004, 2004/2005 e 2005/2006.
 - Collaborazione alla cattedra di Introduzione ai Processi Stocastici per la Finanza (titolare del corso: prof.ssa Giulia Rotundo) negli A.A. 2003/2004, 2004/2005 e 2005/2006.
- PRESSO L’UNIVERSITÀ CATTOLICA DI MILANO (SEDE DI ROMA), FACOLTÀ DI ECONOMIA:
- **Titolare del corso di Strumenti Matematici e Statistici per le Decisioni Sanitarie, A.A. 2005/2006 e 2006/07.**
- PRESSO L’UNIVERSITÀ LUISS GUIDO CARLI:
- Idoneo al conferimento di insegnamenti a contratto, art. 23, della l. 30 dicembre 2010, n. 240, presso l’Università Luiss - Guido Carli, per il S.S.D. SECS-S/06, nei seguenti Dipartimenti: Dipartimento di Impresa e Management, Dipartimento di Economia e Finanza, Dipartimento di Giurisprudenza.
 - Contratto integrativo di insegnamento presso la cattedra di Mathematics 2 (titolare del corso: prof. Fausto Gozzi) nell’ A.A. 2012/2013 (CORSO IN LINGUA INGLESE).
 - Contratto integrativo di insegnamento presso la cattedra di Mathematical Finance (titolare del corso: prof. Roberto Renò) negli A.A. 2012/13-2013/14 (CORSI IN LINGUA INGLESE).
 - Contratto integrativo di insegnamento presso la cattedra di Processi Stocastici per la Finanza (titolare del corso: prof. Roberto Renò) nell’ A.A. 2010/2011.
 - Contratto integrativo di insegnamento presso la cattedra di Matematica Generale (titolare del corso: prof. Fausto Gozzi) nell’ A.A. 2004/2005 e 2005/2006.
- PRESSO L’UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI TERAMO, FACOLTÀ DI SCIENZE POLITICHE:

- Collaborazione alla cattedra di Teoria del Portafoglio (responsabile del modulo di Teoria delle Decisioni) (titolare del corso: prof. Randa Morgan) nell' A.A. 2005/2006 e 2006/2007

→ PRESSO L'UNIVERSITÀ DI MALTA:

- Contratto integrativo di insegnamento per i corsi di Quantitative Business Methods, Strumenti e Tecniche per la Finanza, Gestione di Rischio, Statistica, Matematica Finanziaria (titolari dei corsi: proff. Rita Laura D'Ecclesia, Randa Morgan, Gianni Ricci) nell' A.A. 2004/2005.

Ai sensi degli artt. 46 e 47 del D.P.R. n. 445/2000 e consapevole delle sanzioni penali derivanti dal produrre informazioni false e mendaci, dichiara veritiere le affermazioni presenti in questo documento.

Macerata, 01/10/2014

Roy Cerqueti