

Giornata CISA – Giovani Ricercatori

Metodi innovativi per la misura e la gestione dei rischi

Firenze 29 Novembre, Aula Magna, Via delle Pandette 9, Ed. D6

Programma

Ore 10.00 – 10.45 Saluti del Magnifico Rettore dell'Università di Firenze, dei Direttori dei Dipartimenti DiSIA e DiSEI, di Rappresentanti della Regione Toscana, del Comune e della Provincia di Firenze, del Presidente e del Direttore del CISA.

Introduzione del **Prof. Achille Basile**, Presidente dell'AMASES (Associazione per la Matematica Applicata alle Scienze Economiche e Sociali).

Ore 10.45 – 13.00 Prima sessione: presiede e introduce il **Prof. Giampaolo Crenca**, Presidente del Consiglio Nazionale degli Attuari.

- **Gabriella Piscopo** (Università di Genova): *Measuring Population Mortality Dependence*
- **Anna Rogantini Picco** (Banca d'Italia): *Common Components in Marginal Expected Shortfall: an Analysis of Systemic Risk in Italy and Germany*
- **Emanuele Vannucci** (Università di Pisa): *The Sum of Dependent Risks: the Convergence of the Estimation*
- **Alessandro Fiori Maccioni** (Università di Sassari): *A Stochastic Model for New Entrants in Pension Schemes*

Ore 13.00– 14.45 Pausa pranzo

Ore 14.45 – 17.30 Seconda sessione: presiede e introduce la **Prof.ssa Carla Angela**, Università di Roma La Sapienza, già Presidente dell'Ordine Nazionale degli Attuari.

- **Luca Regis** (IMT, Lucca): *Longevity-risk Transfer with Financial Risk: is it worth for Annuity Providers?*
- **Francesca Zucchi** (École Polytechnique Fédérale de Lausanne): *Managerial Discretion, Uncertain Financing and Investment*
- **Massimiliano Kaucic** (Università di Trieste): *Solving Multiobjective Portfolio Selection Problems with Parametric Ideals and Gröbner Systems*
- **Fabio Baione** (Università di Firenze): *TBA*
- **Gian Paolo Clemente** (Università Cattolica, Milano): *Modelling Premium Risk for Solvency II: from Empirical Data to Risk Capital Evaluation*