

## **CURRICULUM VITAE DEL PROF. FULVIO GISMONDI**

Università degli Studi Guglielmo Marconi  
Via Plinio, 44  
00193 Roma  
T. +39 06.5377251  
C. +39.348.5850022  
e-mail [f.gismondi@unimarconi.it](mailto:f.gismondi@unimarconi.it)

PARAMETRICA Associazione Professionale  
Via Flavio Domiziano, 10  
00153 Roma  
T. +39 06.5717141  
C. +39.348.5850022  
e-mail [fulvio.gismondi@parametrica.net](mailto:fulvio.gismondi@parametrica.net)

### **BIOGRAFIA**

---

Nato a Roma l'11 settembre 1960, si laurea con lode in Scienze Statistiche Attuariali e consegue il Dottorato di Ricerca in Scienze Attuariali presso l'Università degli Studi di Roma "La Sapienza".

### **ATTIVITÀ SCIENTIFICA**

Intraprende l'attività scientifica nel 1988, dapprima come Ricercatore Universitario e, successivamente, come Professore Associato e, poi come Professore Ordinario, Settore Scientifico SECS-S/06 – Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie presso l'Università degli Studi di Roma "La Sapienza". Nel 2007 si trasferisce presso l'Università degli Studi "Guglielmo Marconi", partecipando in modo attivo allo sviluppo e alla crescita dimensionale dell'Ateneo. Nel corso degli anni è stato membro del Consiglio di Amministrazione dell'Università, ha ricoperto il ruolo di Preside della Facoltà di Economia e di Presidente del Corso di Laurea in Scienze Economiche; attualmente è titolare della Cattedra di Matematica Finanziaria, della Cattedra di Matematica Generale, è Presidente del Nucleo di Valutazione dell'Ateneo ed è Pro-Rettore della Marconi International University (Miami, Florida).

Da oltre 30 anni svolge l'attività didattica presso prestigiosi Atenei nazionali e internazionali. Ha presentato relazioni e comunicazioni scientifiche in oltre 55 convegni internazionali ed è membro di numerose società scientifiche internazionali. Ha partecipato a numerosi progetti di Ricerca del MIUR in qualità di Responsabile o Componente. E' autore di oltre 70 tra volumi e pubblicazioni soggette a processo di revisione tra pari e pubblicate su riviste scientifiche internazionali, classificate, principalmente, nell'ambito della Teoria del Rischio e dei Processi Stocastici, della Matematica Finanziaria e della Matematica Attuariale.

### **ATTIVITÀ PROFESSIONALE**

Libero professionista, a partire dal 1990 avvia l'attività professionale divenendo consulente, in materia finanziaria e attuariale, dei principali intermediari finanziari nazionali ed internazionali. Dapprima Partner di Coopers & Lybrand, diviene nel 1999 Partner e Amministratore Delegato in Italia di PwC – PriceWaterhouseCoopers. Nel 2007, fonda il gruppo di consulenza PARAMETRICA, operatore di rilievo nel mercato italiano della consulenza finanziaria e attuariale. E' stato, nel corso degli anni, Amministratore di Imprese di Assicurazioni, di Casse di Previdenza, di Società Immobiliari, Consigliere Economico presso il Ministero dello Sviluppo Economico, Consulente di Cassa Depositi e Prestiti, Consulente di Commissioni Parlamentari, Consulente dello Stato del Vaticano, dello IOR, della Repubblica di San Marino, Attuario Incaricato di 47 Imprese di Assicurazione (principali gruppi assicurativi italiani e internazionali) e Attuario revisore di oltre 60 Imprese di Assicurazione. E' Presidente di una squadra di calcio (Lega Nazionale Dilettanti).

## ATTIVITÀ SCIENTIFICA

### **Ha conseguito i seguenti titoli di studio e titoli post lauream:**

- Laurea con lode in Scienze Statistiche Attuariali
- Dottorato di Ricerca in Scienze Attuariali
- Ricercatore universitario confermato, Settore SECS-S/06 – Metodi Matematici dell’Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie
- Professore associato confermato, Settore SECS-S/06 – Metodi Matematici dell’Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie
- Professore ordinario confermato, Settore SECS-S/06 – Metodi Matematici dell’Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie
- Membro dell’Istituto Italiano degli Attuari
- Membro della Società Italiana di Statistica
- Membro dell’Associazione Matematica Applicata alle Scienze Economiche e Sociali
- Membro dell’Actuarial Approach for Financial Risks (AFIR)
- Membro degli Actuarial Studies in Non-Life insurance (ASTIN)

### **Ha presentato Comunicazioni scientifiche o Relazioni ai seguenti Convegni Internazionali:**

- [57] *“Applied Stochastic Models and Data Analysis International Conference”*, (ASMDA 2018), Chania, Crete, 2018
- [56] *“International Workshop on Applied Probability”*, (IWAP 2018), Budapest, 2018
- [55] *“42° Convegno Amases”*, (AMASES 2018), Napoli, 2018
- [54] *“International Actuarial Association Conference– Life Section”*, (IAALS 2017), Barcelona, 2017
- [53] *“International Conference on Stochastic Processes and Algebraic Structures”*, (SPAS 2017), Stockholm, 2017
- [52] *“Applied Stochastic Models and Data Analysis International Conference”*, (ASMDA 2017), London, 2017
- [51] *“European Actuarial Journal Conference”*, (EAJ 2016), Lyon, 2016
- [50] *“St. John’s Colloquium, International Pension and Employee Benefits Lawyers Association”*, (IPEBLA 2016), St. John, 2016
- [49] *“International Workshop on Applied Probability”*, (IWAP 2016), Toronto, 2016
- [48] *“Stochastic Modeling Techniques & Data Analysis International Conference”*, (SMTDA 2016), Malta, 2016
- [47] *“Applied Stochastic Models and Data Analysis International Conference”*, (ASMDA 2015), Pireo, 2015
- [46] *Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance”*, Salerno, 2014
- [45] *“Applied Stochastic Models and Data Analysis International Conference”*, (ASMDA 2013), Barcelona, 2013
- [44] *“international Cramer Symposium in Insurance Mathematics”*, (ICSIM 2013), Stockholm, 2013
- [43] *“International Conference Probability Theory and its applications”*, Moskow, 2012
- [42] *“Applied Stochastic Models and a Data Analysis International Conference”*, (ASMDA 2011), Rome, 2011
- [41] *“International Symposium on Stochastic models in reliability engineering, life science and*

- operations management*", Beer Sheva, 2010
- [40] *"International Workshop on Applied Probability"*, (IWAP 2010), Madrid, 2010
- [39] *"Stochastic Modelling Techniques and Data Analysis International Conference"*, (SMTDA 2010), Chania, Crete, 2010
- [38] *"International Finance Symposium 2009"*, Istanbul, 2009
- [37] *"Presente e futuro dei sistemi previdenziali: mutamenti demografici e sostenibilità"*, Roma, 2008
- [36] *"International Finance Symposium 2007"*, Istanbul, 2007
- [35] *"Le prestazioni nella sanità, nella previdenza complementare e il ruolo delle garanzie assicurative"*, Castellanza, 2005
- [34] *"Enasarco: ieri, oggi e domani"*, Roma, 2004
- [33] *"R.C. Auto e attuario incaricato"*, Milano 2004
- [32] *"Attuario incaricato e R.C. Auto"*, Milano, 2004
- [31] *"Assicurazioni, pensioni e finanza: il contributo professionale degli Attuari"*, Verona, 2004
- [30] *"Attuario incaricato e R.C. Auto"*, Roma, 2004
- [29] *"La gestione delle imprese di assicurazione"*, Bologna, 2004
- [28] *"27° Convegno AMASES"*, (AMASES 2003), Cagliari, 2003
- [27] *"Scienza e diritto nel prisma del diritto comparato"*, Pisa, 2003
- [26] *"Profili applicativi della riforma R.C. Auto: riflessioni giuridiche, attuariali ed economiche"*, Milano, 2003
- [25] *"La previdenza complementare nel settore del terziario e del turismo"*, Milano, 2003
- [24] *"Gli impegni finanziari e garanzie: rischi e opportunità"*, Milano, 2003
- [23] *"Considerazioni attuariali sull'equilibrio economico-finanziario dell'INAIL"*, Roma, 2002
- [22] *"Situazione INAIL e linee per un progetto di risanamento: l'equilibrio finanziario ed attuariale"*, Roma, 2002
- [21] *"Il tempo nella finanza e nelle assicurazioni"*, Benevento, 2002
- [20] *"L'assicurazione tra rischio e finanza: tendenze ed evoluzioni"*, Castellanza, 2002
- [19] *"La disciplina dell'R.C. Auto"*, Milano, 2001
- [18] *"Le riserve sinistri: valutazione attuariale e riflessi di bilancio"*, Benevento, 2001
- [17] *"Le novità del bilancio assicurativo alla luce dell'Euro"*, Milano, 2000
- [16] *"Processi di riorganizzazione e ristrutturazione in campo assicurativo"*, Parigi, 2000
- [15] *"Pricing e Reserving nelle compagnie danni"*, Milano, 2000
- [14] *"Il Bilancio di esercizio e la valutazione dello stato di salute delle imprese di assicurazione"*, Bruxelles, 1999
- [13] *"Conti annuali e consolidati delle imprese di assicurazione"*, Bruxelles, 1998
- [12] *"Rischio d'impresa in campo assicurativo"*, Roma, 1998
- [11] *"Teoria del rischio in campo assicurativo"*, Campobasso, 1997
- [10] *"La previdenza complementare"*, Roma, 1997
- [9] *"Il bilancio delle imprese di assicurazione"*, Roma, 1996
- [8] *"I Fondi Pensione"*, Roma, 1996
- [7] *"Strategie di ritenzione ottimale del rapporto riassicurativo"*, Roma, 1995
- [6] *"Lettura ed analisi del bilancio di esercizio delle imprese di assicurazione"*, Roma, 1995
- [5] *"La valutazione del rischio nella gestione delle imprese finanziarie e assicurative"*, Campobasso, 1994
- [4] *"Il rischio nelle attività delle imprese finanziarie e assicurative"*, Campobasso, 1993
- [3] *"16° Convegno AMASES"*, (AMASES 1992), Treviso, 1992
- [2] *"15° Convegno AMASES"*, (AMASES 1991), Grado, 1991
- [1] *"14° Convegno AMASES"*, (AMASES 1990), Pescara, 1990

**Ha partecipato ai seguenti Progetti di Ricerca o a Comitati scientifici in qualità di Responsabile o Componente:**

- *“Aspetti finanziari e strutturali di fondi pensione: rischi di default e di contagio, dinamica delle relazioni tra contributi e benefici”*, MIUR
- *“Analisi dei rischi ed ottimalità delle garanzie nei prodotti assicurativi vita con protezione”*, MIUR
- *“Modello econometrico INAIL per le previsioni di medio e lungo periodo”*, INAIL
- *“Metodi di stima della struttura per scadenza dei tassi di interesse per la valutazione di operazioni assicurative: un confronto internazionale”*, MIUR
- *“Decisioni e criteri di valutazione del lavoratore nell’ambito dei regimi obbligatori della previdenza”*, MIUR
- *“La liberalizzazione delle assicurazioni: nuovi prodotti e stabilità”*, MIUR
- *“Assicurazioni pubbliche e private. Teoria ed applicazioni”*, MIUR
- *“Aspetti attuariali e sociali della previdenza italiana, con particolare riferimento alla valutazione dei progetti di riforma”*, MIUR
- *“Modelli per la ritenzione ottimale del rischio negli schemi della riassicurazione”*, MIUR
- *“Costruzione di tavole di eliminazione selezionate per settori di attività professionale”*, CNR
- *“Gli effetti della liberalizzazione delle tariffe assicurative a seguito dell’entrata in vigore della III Direttiva CEE”*, MIUR
- *“Modelli matematici per le strategie riassicurative”*, MIUR
- *“Metodi attuariali analitici e numerici per l’innovazione sulle assicurazioni di persone”*, MIUR
- *“Statistiche per l’assicurazione R.C. Auto”*, MIUR

**Ha partecipato, in qualità di Componente, ai seguenti Collegi e Commissioni:**

- Collegio del Dottorato di Ricerca in *Matematica per le applicazioni economico-finanziarie*, Dipartimento di Matematica per le decisioni economiche finanziarie e assicurative, Università degli Studi di Roma La Sapienza
- Collegio del Dottorato di Ricerca in *Scienze Attuariali*, Dipartimento di Scienze attuariali e finanziarie, Università degli Studi di Roma La Sapienza
- Collegio del Dottorato di Ricerca in *Geopolitica economica e finanziaria*, Dipartimento di Scienze Economiche e Aziendali, Università degli Studi Guglielmo Marconi
- Collegio del Dottorato di Ricerca in *Analisi dei sistemi finanziari e dei processi di gestione del rischio*, Dipartimento di Scienze Economiche e Aziendali, Università degli Studi Guglielmo Marconi
- Commissione giudicatrice del Premio internazionale INA, Accademia dei Lincei per le Scienze Assicurative

**Altri Incarichi Universitari ricoperti**

- Membro del Consiglio di Amministrazione dell’Università degli Studi Guglielmo Marconi
- Preside della Facoltà di Economia dell’Università degli Studi Guglielmo Marconi
- Presidente del Corso di Laurea in Scienze Economiche (L33) dell’Università degli Studi Guglielmo Marconi
- Presidente del Nucleo di Valutazione dell’Università degli Studi Guglielmo Marconi
- Pro-Rettore della Marconi International University, Miami, Florida

## ATTIVITÀ DIDATTICA

---

L'attività didattica svolta si è sviluppata nell'ambito della Matematica Finanziaria, Matematica Attuariale, Matematica Generale e della Teoria del Rischio.

### Risultano effettuati i seguenti insegnamenti:

2007-ad oggi	<i>Matematica finanziaria</i> , Facoltà di Economia, Università degli Studi Guglielmo Marconi
2007-ad oggi	<i>Matematica generale</i> , Facoltà di Economia, Università degli Studi Guglielmo Marconi
2004-2010	<i>Modelli matematici per le assicurazioni danni I e II</i> , Master ARMA, Università degli Studi di Roma La Sapienza
2001-2009	<i>Tecnica delle assicurazioni I</i> , Master MAPA, Università degli Studi C. Cattaneo LIUC
2001-2007	<i>Modelli matematici per le assicurazioni</i> , Facoltà di Economia, Università degli Studi di Roma La Sapienza
2003-2007	<i>Teoria del rischio per le assicurazioni e la finanza</i> , Facoltà di Economia, Università degli Studi di Roma La Sapienza
2001-2005	<i>Tecnica attuariale delle assicurazioni sociali</i> , Facoltà di Economia, Università degli Studi del Sannio
2004-2005	<i>Tecnica attuariale delle assicurazioni danni</i> , Facoltà di Economia, Università degli Studi del Sannio
2001-2003	<i>Modelli matematici per la gestione delle assicurazioni contro i danni</i> , Master MGF, Università degli Studi di Roma La Sapienza
2000-2001	<i>Teoria del rischio</i> , Master MAPA, Università degli Studi C. Cattaneo LIUC
1998-2001	<i>Tecnica attuariale delle assicurazioni sociali</i> , Facoltà di Economia, Università degli Studi di Roma La Sapienza
1995-1998	<i>Matematica Attuariale</i> , Facoltà di Scienze Statistiche, Demografiche ed Attuariali, Università degli Studi di Roma La Sapienza
1994-1995	<i>Tecnica attuariale delle assicurazioni contro i danni</i> , Facoltà di Scienze Statistiche, Demografiche ed Attuariali, Università degli Studi di Roma La Sapienza
1992-1994	<i>Istituzioni di Analisi Matematica</i> , Corso di esercitazioni, Facoltà di Scienze Statistiche, Demografiche ed Attuariali, Università degli Studi di Roma La Sapienza
1988-1994	<i>Tecnica attuariale delle assicurazioni contro i danni</i> , Corso di esercitazioni, Facoltà di Scienze Statistiche, Demografiche ed Attuariali, Università degli Studi di Roma La Sapienza

## ATTIVITÀ PROFESSIONALE

---

A partire dal 1990 l'attività professionale si è sviluppata in materia finanziaria e attuariale, supportando su tali tematiche i principali intermediari finanziari nazionali ed internazionali. Partner di Coopers & Lybrand nel 1997, diviene nel 1999 Partner e Amministratore Delegato in Italia di PwC - PriceWaterhouseCoopers. Nel 2007, fonda il gruppo di consulenza PARAMETRICA, operatore di rilievo nel mercato italiano della consulenza finanziaria e attuariale. E' stato, nel corso degli anni, Amministratore di Imprese di Assicurazioni, di Casse di Previdenza, di Società

Immobiliari, Consigliere Economico presso il Ministero dello Sviluppo Economico, Consulente di Cassa Depositi e Prestiti, Consulente di Commissioni Parlamentari, Consulente dello Stato del Vaticano, dello IOR, dello Stato di San Marino, Attuario Incaricato di 47 Imprese di Assicurazione (principali gruppi assicurativi italiani e internazionali) e Attuario revisore di oltre 60 Imprese di Assicurazione.

**Ha ricoperto i seguenti Incarichi:**

2017-ad oggi Consulente Cassa Depositi e Prestiti S.p.A.  
 2007-ad oggi Presidente, Socio Fondatore di PARAMETRICA S.r.l.  
 2003-ad oggi Presidente, Socio Fondatore di Gismondi e Associati, divenuta PARAMETRICA Associazione Professionale  
 2008-2010 Consigliere Economico presso il Ministero Sviluppo Economico  
 2005-2014 Attuario incaricato delle seguenti Imprese di Assicurazioni

- |  |   |
|--|---|
| 1. Assicurazioni Generali S.p.A.             | 25. Genertel S.p.A.                                 |
| 2. ABC Assicura S.p.A.                       | 26. Genialloyd S.p.A.                               |
| 3. Alleanza Assicurazioni S.p.A.             | 27. GenertelLife S.p.A.                             |
| 4. Allianz Subalpina S.p.A.                  | 28. Il Duomo Assicurazioni S.p.A.                   |
| 5. Assicuratrice Italiana Danni S.p.A.       | 29. Ina Assitalia S.p.A.                            |
| 6. Augusta Assicurazioni S.p.A.              | 30. Incontra Assicurazioni S.p.A.                   |
| 7. AviPop Assicurazioni S.p.A.               | 31. L'Assicuratrice Italiana Danni S.p.A.           |
| 8. Aviva Italia S.p.A.                       | 32. Lombarda Vita S.p.A.                            |
| 9. Azzurra assicurazioni S.p.A.              | 33. Milano Assicurazioni S.p.A.                     |
| 10. BCC Assicurazioni S.p.A.                 | 34. Novara Assicura S.p.A.                          |
| 11. BCC Vita S.p.A.                          | 35. Popolare Vita S.p.A.                            |
| 12. Berica Vita S.p.A.                       | 36. Risparmio Assicurazioni S.p.A.                  |
| 13. Bernese Assicurazioni S.p.A.             | 37. Risparmio & Previdenza S.p.A.                   |
| 14. Bim Vita S.p.A.                          | 38. Riunione Adriatica di Sicurtà S.p.A.            |
| 15. BPU Assicurazioni S.p.A.                 | 39. Sasa Assicurazioni S.p.A.                       |
| 16. Compagnia Italiana Rischi Aziende S.p.A. | 40. Siat Assicurazioni S.p.A.                       |
| 17. Capitalia Assicurazioni S.p.A.           | 41. SIS Assicurazioni S.p.A.                        |
| 18. Commercial Union Italia S.p.A.           | 42. Skandia Vita S.p.A.                             |
| 19. CreditRas Assicurazioni S.p.A.           | 43. Società Cattolica di Assicurazione Coop. a r.l. |
| 20. Dialogo Assicurazioni S.p.A.             | 44. Systema Assicurazioni S.p.A.                    |
| 21. Duomo Assicurazioni S.p.A.               | 45. Toro Assicurazioni S.p.A.                       |
| 22. Fata Assicurazioni S.p.A.                | 46. TUA Assicurazioni S.p.A.                        |
| 23. Fata Vita S.p.A.                         | 47. UniOne Assicurazioni S.p.A.                     |
| 24. Fondiaria-SAI S.p.A.                     |   |

2004-2006 Consulente dello Stato di San Marino  
 2004-2006 Consigliere di Amministrazione di Impera S.r.l.  
 2003-2008 Consigliere di Amministrazione di Director S.r.l.  
 2003-2007 Consigliere di Amministrazione di Sumbios S.r.l.  
 2002-2007 Consigliere di Amministrazione di Skandia Vita S.p.A.  
 2002-2006 Consigliere di Amministrazione e Vicepresidente del Fondo Mario Negri  
 2002-2004 Amministratore Delegato di Immobiliare Negri S.p.A.  
 2002-2003 Revisore dei conti della Società Italiana di Statistica  
 2001-2006 Consigliere di Amministrazione di Chiara Vita S.p.A.  
 2001-2002 Consigliere di Amministrazione di Fulcron S.p.A.

2001-2002 Consigliere di Amministrazione di Borgon S.p.A.  
2001-2002 Consigliere di Amministrazione di Imark S.r.l.  
2000-2014 Consulente Stato del Vaticano e IOR  
2000-2005 Attuario revisore delle seguenti Imprese di Assicurazioni

1. A.R.A.G. S.p.A.
2. Ala Assicurazioni S.p.A.
3. Alleanza Toro S.p.A.
4. Arca Assicurazioni S.p.A.
5. Arca Vita S.p.A.
6. Assicurazioni Generali S.p.A.
7. Assitalia S.p.A.
8. AXA Assicurazioni S.p.A.
9. AXA Carlink Assicurazioni S.p.A.
10. AXA Interlife S.p.A.
11. AXA Soluzioni Vita S.p.A.
12. Azuritalia Assicurazioni S.p.A.
13. Azuritalia Vita S.p.A.
14. Bancassurance Popolari S.p.A.
15. Bentos Assicurazioni S.p.A.
16. Bipiemme Vita S.p.A.
17. Cardif Assicurazioni S.p.A.
18. Chiara Assicurazioni S.p.A.
19. Chiara Vita S.p.A.
20. Claris Vita S.p.A.
21. Credem Assicurazioni S.p.A.
22. Elba Assicurazioni S.p.A.
23. Euler Hermes Siac S.p.A.
24. Europe Assistance Italia S.p.A.
25. Europe Assistance Warrenty S.p.A.
26. Eurosun Assicurazioni Vita S.p.A.
27. Eurovita Assicurazioni S.p.A.
28. Fata Assicurazioni Danni S.p.A.
29. Fata Vita S.p.A.
30. Fideuram Assicurazioni S.p.A.
31. Fideuram Vita S.p.A.
32. Filo Diretto Assicurazioni S.p.A.
33. Gan Italia S.p.A.
34. Gan Italia Vita S.p.A.
35. Generali Vita S.p.A.
36. Global Assistance S.p.A.
37. Ima Italia Assistance S.p.A.
38. Ina Assitalia S.p.A.
39. Ina Vita S.p.A.
40. Intesavita S.p.A.
41. La Sicurtà S.p.A.
42. La Viscontea S.p.A.
43. National Suisse Assicurazioni S.p.A.
44. Nazionale Suisse Vita S.p.A.
45. Padana Assicurazioni S.p.A.
46. Poste Assicura S.p.A.
47. Poste Vita S.p.A.
48. Prumerica Life S.p.A.
49. Risparmio Assicurazioni S.p.A.
50. Sara Assicurazioni S.p.A.
51. Sara Vita S.p.A.
52. Sasa Assicurazioni S.p.A.
53. Sicurtà 1879 Assicurazioni S.p.A.
54. Sofid Vita S.p.A.
55. Swiss Re S.p.A.
56. UMS Generali Marine S.p.A.
57. Unionvita S.p.A.
58. Zurich International Italia S.p.A.
59. Zurich Investment Life S.p.A.
60. Zurich Life Insurance Italia S.p.A.
61. Zurigo Assicurazioni S.p.A.

2000-2003 Socio Fondatore di Pirola Gismondi & Associati  
2000-2003 Amministratore Delegato di PwC - PriceWaterhouseCoopers  
1999-2003 Partner di PwC - PriceWaterhouseCoopers LLP  
1997-1998 Partner di Coopers & Lybrand  
1993-2001 Consigliere di Amministrazione di Assicurazioni di Roma Vita S.p.A.  
1993-2000 Consigliere di Amministrazione e Vicepresidente di Assicurazioni di Roma SMA

## VOLUMI E PUBBLICAZIONI

---

Ha pubblicato volumi e comunicazioni scientifiche che possono essere classificati principalmente nell'ambito della Teoria del Rischio e dei Processi Stocastici, della Matematica Finanziaria e della Matematica Attuariale. L'attività di ricerca ha riguardato processi di valutazione, modelli e soluzioni operative

### VOLUMI

- [7] *Matematica Finanziaria*, G. Giappichelli Editore, Torino, 2017 (con J. Janssen, R. Manca, E. Volpe di Prignano)
- [6] *Algebra per Econometria II Edizione*, Edizioni Nuova Cultura, Roma, 2010 (con S. Gronchi)
- [5] *Algebra per Econometria*, Edizioni Nuova Cultura, Roma, 2009 (con S. Gronchi)
- [4] *La gestione finanziaria dei fondi pensione*, Il Sole24Ore, Milano, 2004 (con M. Micocci)
- [3] *Il nuovo bilancio delle imprese di assicurazione* Il Sole24Ore, Milano, 1999 (con T. Di Gregorio, G. Curti)
- [2] *Rischio d'impresa in campo assicurativo. Problemi e strategie di valutazione* Il Mulino, Bologna, 1997 (con T. Di Gregorio)
- [1] *I nuovi fondi pensione: analisi gestionale e confronti internazionali*, Il Mulino, Bologna, 1996

### PUBBLICAZIONI

- [63] *A new approach to the modeling of financial volumes*, in *Stochastic Processes and Application*, Springer, January 2019 (with G. D'Amico, F. Petroni)
- [62] *Stock market daily volatility and information measures of predictability*, in *Physica a: Statistical Mechanics and its Applications*, DOI:10.1016/j.physa.2018.11.049, November 2018 (with G. D'Amico, F. Petroni, F. Praticco)
- [61] *The calculation of Pure Premium for Health Insurance by Non-Homogeneous Semi-Markov Reward Processes*, 42° Convegno Amases, Napoli, 13-15 September 2018 (with G. D'Amico, J. Jansen R. Manca, D. Silvestrov, E. Volpe di Prignano)
- [60] *Insurance contracts for Hedging wind power uncertainty*, *International Workshop on Applied Probability*, Budapest, 18-21 June 2018 (with G. D'Amico, F. Petroni)
- [59] *A Non-Homogeneous Semi-Markov Model for the Calculation of the claim reserving of a Health Fund*, *Stochastic Modeling Techniques & Data Analysis International Conference*, Chania, Crete, 12-15 June 2018 (with G. D'Amico, M. Guillen, J. Jansen, R. Manca, E. Volpe di Prignano) ISBN:978-618-5180-27-0
- [58] *Optimal provision of a dispatchable energy source for wind energy management: dependence on the wind energy model*, *Stochastic Modeling Techniques & Data Analysis International Conference*, Chania, Crete, 12-15 June 2018 (with G. D'Amico, F. Petroni) ISBN:978-618-5180-27-0
- [57] *Reducing wind power uncertainty using insurance contracts*, *Stochastic Modeling Techniques & Data Analysis International Conference*, Chania, Crete, 12-15 June 2018 (with G. D'Amico, F. Petroni) ISBN:978-618-5180-27-0
- [56] *The Study of basic risk processes by discrete-time non-homogeneous Markov processes*, in *Theory of Probability and Mathematical Statistics*, Volume 96, 2017 (with G. D'Amico, J. Janssen, R. Manca, F. Petroni, E. Volpe di Prignano)
- [55] *A non-homogeneous semi-Markov approach for the calculation of the balance sheet of a*

- health fund”, *International Actuarial Association Conference – Life Section*, Barcelona, 23-24 October 2017 (with G. D’Amico, M. Guillen, J. Janssen, R. Manca, E. Volpe di Prignano)
- [54] “Long Term saving in an ageing world”, *International Actuarial Association Conference – Life Section*, Barcelona, 23-24 October 2017 (with G. D’Amico, M. Guillen, J. Janssen, R. Manca, E. Volpe di Prignano)
- [53] “The calculation of pure premium for non-life insurance by generalized non-homogeneous Markov reward processes”, *International conference on Stochastic Processes and Algebraic Structures*, Stockholm, 4-6 October 2017 (with G. D’Amico, M. Guillen, J. Janssen, R. Manca, E. Volpe di Prignano)
- [52] “Hitting times for claim number in car insurance setting”, *Applied Stochastic Models and Data Analysis International Conference*, London, 6-9 June 2017 (with G. D’Amico, J. Janssen, R. Manca, F. Petroni, D. Silvestrov)
- [51] “Discrete time non-homogeneous compound renewal processes: a motor car insurance application”, *European Actuarial Journal Conference*, Lyon 5-8 September 2016 (with G. D’Amico, J. Janssen, R. Manca)
- [50] “Non-homogeneous discrete time alternating renewal processes for health insurance evolution and evaluation”, *St. John’s Colloquium, International Pension and Employee Benefits Lawyers Association*, St. John, 26-29 June 2016 (with G. D’Amico, J. Janssen, F. Petroni, R. Manca E. Volpe di Prignano)
- [49] “Basic risk processes in a non-homogeneous Markov chains setting”, *International Workshop on Applied Probability*, Toronto 20-23 June 2016 (with G. D’Amico, J. Janssen, R. Manca)
- [48] “Study of human migration into EU area: a semi-Markov approach”, *Stochastic Modeling Techniques & Data Analysis International Conference*, Malta 1-4 June 2016 (with G. D’Amico, J. Janssen, R. Manca, D. Strangio)
- [47] “Homogeneous discrete time alternating compound renewal process: a disability insurance application” in *Mathematical Problems in Engineering*, ISSN: 1024-123X, June 2015 (with G. D’Amico, J. Janssen, R. Manca)
- [46] “Stochastic cash flows modeled by homogeneous and non-homogeneous discrete time backward semi-Markov reward processes”, in *Statistic and Operations Research Transaction*, p. 107-138, ISSN: 1696-2281, July-December 2014 (with J. Janssen, R. Manca, E. Volpe di Prignano)
- [45] “Discrete time non-homogeneous compound renewal processes: a motor car insurance application”, *Applied Stochastic Models and Data Analysis International Conference*, Pireo, 30 June – 4 July 2015 (with G. D’Amico, J. Janssen, R. Manca)
- [44] “Discrete time alternating compound renewal process; a disability insurance application”, *Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance*, Salerno, 22-24 Aprile 2014 (with G. D’Amico, J. Janssen, R. Manca)
- [43] “Non homogeneous time convolutions, renewal processes and age dependent mean number of motorcar accidents”, in *Annals of Actuarial Science*, ISSN: 1748-4995, doi: 10.1017/S1748499514000220, August 2014 (with J. Janssen, R. Manca)
- [42] “Discrete time homogeneous Markov processes for the study of basic risk processes” in *Methodology and Computing in Applied Probability*, ISSN: 1387-5841, doi: 10.1007/S11009-014-9416-5, July 2014 (with G. D’Amico, J. Janssen, R. Manca)
- [41] “Disability insurance claims study by a homogeneous discrete time alternating renewal processes” in *Modern Problem in Insurance Mathematics*, Springer, ISBN: 978-3-319-06652-3, 2014 (with G. D’Amico, J. Janssen, R. Manca)
- [40] “The input evaluation of generalized Bernoulli processes for salary lines construction by means of continuous time generalized non-homogeneous semi-Markov processes”, *Communications in Statistics Theory and Method*, vol. 42, p. 2889-2901, ISSN: 0361-0926,

- 2013 (with G. D'Amico, G. Di Biase, R. Manca)
- [39] "Discrete time non-homogeneous compound renewal processes for G/G risk model solution", *International Cramer Symposium on Insurance Mathematics*, Stockholm, 2013 (with J. Janssen, R. Manca)
- [38] "IBNyR claims study by an alternating renewal process approach", *International Cramer Symposium on Insurance Mathematics*, Stockholm, 2013 (with J. Janssen, F. Petroni, R. Manca)
- [37] "Discrete time homogeneous semi-Markov Monte Carlo reward risk process", *International Cramer Symposium on Insurance Mathematics*, Stockholm, 2013 (with J. Janssen, R. Manca, D. Silvestrov)
- [36] "Homogeneous and non-homogeneous risk theory renewal models", *International Conference Probability Theory and its Applications*, Moskow, 2012 (with G. D'Amico, J. Janssen, R. Manca)
- [35] "Homogeneous and non-homogeneous G/G discrete time risk models: an algorithmic approach", *Applied Stochastic Models and Data Analysis (ASMDA 2011)*, Rome, 2011 (with J. Janssen, R. Manca, G. Ventura)
- [34] "The construction of claim reserve distribution by means of a Semi-Markov Backward Simulation Model", *Annals of Actuarial Science*, vol. 6, p. 23-64, ISSN: 1748-4995, doi: .10.1017/S1748499511000315, 2011 (with J. Janssen, R. Manca)
- [33] "Il sistema contributivo: questo sconosciuto", in M. Marè (Curatore), "La previdenza complementare: quale futuro?", Il Mulino, Bologna 2011 (con S. Gronchi)
- [32] "Salary lines forecasting by means of generalized binomial processes", *International Journal of Management Science and Engineering Management*, vol. 5, p. 310-321, ISSN: 1750-9653, DOI: 10.1080/17509653.2010.10671122, 2010 (with R. Manca, A.V. Swishchuk)
- [31] "A Monte Carlo semi-Markov backward model for a distributional claim reserve construction", *International Workshop on Applied Probability (IWAP 2010)*, Universidad Carlos III De Madrid, Madrid, 2010 (with J. Janssen, R. Manca)
- [30] "The claim reserve as a company insurance reliability measure", *International Symposium on Stochastic Models in reliability Engineering, Life Sciences and Operations Management (SMRLO)*, Beer Sheva, Israel, 2010 (with J. Janssen, R. Manca)
- [29] "Application of parallel grammatical evolution to the generation of automatic trading systems", *International Finance Symposium 2009*, Istanbul, 2009 (with R. Gismondi, W. Janko, P. Kreuzinger)
- [28] "Backward e forward looking negli schemi payg-ndc", *Working Paper Mefop n. 29/2009*, Roma, 2009 (with S. Gronchi)
- [27] "The construction of salary lines", *Far East Journal of Applied Mathematics*, Volume 34, p. 233-260, ISSN: 0972-0960, 2009
- [26] "Backward-looking and forward-looking notional-defined-contribution pension schemes", *Journal of Public Finance and Public Choice*, Vol. XXVI, N. 2-3, p. 93-108, ISSN: 1120-7019, 2008 (with S. Gronchi)
- [25] "Sostenibilità di lungo periodo del sistema pensionistico pubblico: coefficienti di trasformazione e tasso di sostituzione", *Quaderno anno I numero II/08*, Università di Roma Guglielmo Marconi, Roma, 2008
- [24] "SPES: a computational framework for pricing of financial structured product", *International Finance Symposium 2007*, Istanbul, 2007 (with R. Gismondi, W. Janko)
- [23] "Quali pensioni per il domani?" *Rivista AREL – Europa Lavoro Economia*, 2007 (con S. Gronchi)
- [22] "Quanto è necessario il secondo pilastro?", *La previdenza complementare in Italia*, Il Mulino, 2006 (con S. Gronchi)

- [21] *“Un esperimento di capitalizzazione virtuale su due pilastri: la riforma del Fondo Enasarco”*, *Economia e lavoro*, ECONOMIA & LAVORO, Anno XXXIX, vol. 2, ISSN: 0012-978X, 2005 (con S. Gronchi)
- [20] *“Appraisal value e modellizzazione stocastica: un percorso obbligato?”*, *Atti del VI Congresso Nazionale di Scienza e Tecnica delle Assicurazioni*, Bologna 18-20 gennaio 2004, Istituto Italiano degli Attuari, 2004
- [19] *“Le garanzie nei fondi pensione: un modello di valutazione”* *Diritto ed Economia dell’Assicurazione*, Giuffrè Editore, Anno XLVI Fasc.1, p. 3-37, ISSN: 1125-9302, Milano, 2004 (con M. Micocci)
- [18] *“La valutazione ex-ante del danno: equità attuariale e decisione razionale”*, *Atti del XVI Colloquio Biennale Associazione Italiana di Diritto Comparato “Scienza e diritto nel prisma del Diritto Comparato”*, Ed. Giappichelli, 2004
- [17] *“International accounting standard IAS 19 and the actuarial valuation of termination indemnity funds (TFR Funds) in the Italian firms”*, *Giornale Istituto Italiano degli Attuari*, Volume LXVI, ISSN: 0390-5780, Roma, 2003 (con V. Lovecchio, M. Micocci)
- [16] *Valori medi e simulazione per la proiezione degli oneri di un fondo pensioni a prestazione predeterminata”* *Giornale Istituto Italiano degli Attuari*, Volume LXI, ISSN: 0390-5780, Roma, 1999 (con P. De Angelis)
- [15] *“Regime fiscale dei fondi pensione in Italia: evoluzione ed analisi del quadro normativo”* *Rivista di Politica Economica*, ISSN: 0035-6468, Roma, 1998 (con T. Di Gregorio)
- [14] *“Analisi di convenienza all’adesione ad uno schema di previdenza complementare”*, *Atti Convegno Aspetti scientifici e didattici nella teoria del rischio*, Università del Molise, Benevento, 1997 (con T. Di Gregorio)
- [13] *“Alcune considerazioni sull’evoluzione della tecnica attuariale dei fondi pensione”*, *Atti Convegno I Fondi Pensione*, Università Luiss, Roma, 1996
- [12] *“Sulla determinazione del premio di indifferenza nel rapporto riassicurativo: una applicazione alle forme assicurative in caso di morte”*, *Nota n. 4*, Dipartimento di Scienze Attuariali e Finanziarie, Roma, 1996 (con P. De Angelis)
- [11] *“A non-parametric statistical model for the control of italian insurance companies”*, *Rivista di matematica per le scienze economiche e sociali*, Anno 17°, Fascicolo 1, 1994 (con P. De Angelis, R. Ottaviani)
- [10] *“Il problema della ritenzione ottima del rischio con vincolo di offerta: una soluzione operativa nella logica del linguaggio Pasca”*, *Atti Giornata di Studio su La valutazione del rischio nella gestione delle imprese finanziarie ed assicurative*, Università del Molise, Benevento, 1994 (con P. De Angelis)
- [9] *“Sul problema della ritenzione ottima del rischio con vincolo di offerta”*, *Atti Giornata di Studio su La valutazione del rischio nella gestione delle imprese finanziarie ed assicurative*, Università del Molise, Benevento, 1994 (con P. De Angelis)
- [8] *“Il problema della ritenzione ottimale dei rischi nel rapporto riassicurativo: un quadro di sintesi tra teoria del rischio e teoria delle decisioni in condizioni di incertezza”*, *Atti Giornata di Studio su Il rischio nelle attività delle imprese finanziarie ed assicurative*, Università del Molise, Campobasso, 1993 (con P. De Angelis)
- [7] *“L’approccio bayesiano nella valutazione della solvibilità delle imprese assicuratrici: una applicazione al mercato assicurativo italiano di regole di classificazione fondate su modelli statistici parametrici e non parametrici”*, *Giornale dell’Istituto Italiano degli Attuari*, n. 1-2, ISSN: 0390-5780, 1992 (con P. De Angelis, R. Ottaviani)
- [6] *“La riforma della previdenza pubblica e lo sviluppo di quella integrativa”*, *Grifo Banca*, Anno 2, n. 5, 1992 (con P. De Angelis)
- [5] *“Modelli per la valutazione delle imprese assicuratrici: una applicazione al mercato assicurativo italiano di modelli parametrici e non parametrici”*, *Atti del 16° Convegno*

AMASES, Treviso, 1992 (con P. De Angelis, R. Ottaviani)

- [4] *“Sulla selezione degli indicatori di bilancio in campo assicurativo”, Atti del 15° Convegno AMASES, Grado, 1991*
- [3] *“Sul rischio finanziario nella teoria attuariale dei fondi pensione”, Nota 16, Dipartimento di Scienze Attuariali e Matematica per le Decisioni Economiche e Finanziarie, Roma, 1990*
- [2] *“Sulla costruzione di un modello non parametrico per la valutazione del rischio d’impresa in campo assicurativo”, Nota 14, Dipartimento di Scienze Attuariali e Matematica per le Decisioni Economiche e Finanziarie, Roma, 1990*
- [1] *“Ipotesi per la costruzione di un modello per la valutazione del rischio di impresa in campo assicurativo: un approccio non parametrico”, Atti del 14° Convegno AMASES, Pescara, 1990*