

PROF. ANDREA GHENO

FORMAZIONE ACCADEMICA

Dottorato di ricerca (PhD) in Matematica per le applicazioni economico-finanziarie presso l'Università degli Studi di Roma La Sapienza

Master in Financial Engineering and Quantitative Analysis presso l'International Capital Market Association (ICMA) Centre dell'Università di Reading (Inghilterra)

Laurea in Economia conseguita con lode presso l'Università degli Studi Roma Tre

POSIZIONI ACCADEMICHE

Professore associato nel settore scientifico-disciplinare SECS-S/06 Metodi matematici dell'economia e delle scienze attuariali e finanziarie presso la Facoltà di Economia dell'Università degli Studi Roma Tre dal 2011, afferente al Dipartimento di Economia fino al 2012 e afferente al Dipartimento di Economia aziendale dal 2013

Coordinatore Erasmus del Dipartimento di Economia Aziendale dal 2013

Referente della sezione Finanza, mercati e regolazione del Dottorato di ricerca del Dipartimento di Economia aziendale dell'Università degli Studi Roma Tre, dal 2013

E' stato Ricercatore nel settore scientifico-disciplinare S04B Matematica finanziaria e scienze attuariali presso la Facoltà di Economia dell'Università degli Studi Roma Tre dal 2002 al 2010

ATTIVITÀ DIDATTICA

Titolare dei corsi di Finanza quantitativa e derivati, Financial and Actuarial Sciences e Teoria del portafoglio e dei contratti derivati presso il Dipartimento di Economia aziendale dell'Università degli Studi Roma Tre

E' stato titolare di Matematica finanziaria, Matematica finanziaria corso progredito, Real Estate Finance (Finanza immobiliare), Misurazione e controllo dei rischi, Fondamenti della valutazione finanziaria, Modelli matematici dei mercati finanziari presso Università degli Studi Roma Tre, Scuola Superiore dell'Economia e delle Finanze (Roma e Milano) e LUISS

SELEZIONE DI PUBBLICAZIONI

"Incomplete Financial Markets and Contingent Claim Pricing in a Dual Expected Utility Theory Framework" (con M. Corradini) riguarda la valutazione di contratti derivati in mercati con caratteristiche 'non ideali'. Pubblicato su *Insurance: Mathematics and Economics*

"Dynamic Portfolio Selection in a Dual Expected Utility Theory Framework" (con M. Cenci e M. Corradini) riguarda la selezione ottimale di portafogli finanziari mediante una tecnica innovativa. Pubblicato su *ASTIN Bulletin*

"Chapman-Kolmogorov Lattice Method for Derivatives Pricing" (con F. Aluigi e M. Corradini) riguarda la valutazione di contratti derivati mediante un innovativo metodo numerico estremamente efficiente. Pubblicato su *Applied Mathematics and Computation*

"Pricing and Applications of Digital Installment Options" (con P. Ciurlia) riguarda la valutazione di un particolare tipo di opzioni esotiche spesso presente all'interno di contratti finanziari strutturati. Pubblicato su *Journal of Applied Mathematics*

"A Model for Pricing Real Estate Derivatives with Stochastic Interest Rates" (con P. Ciurlia) riguarda la valutazione di contratti derivati su attività immobiliari tramite l'introduzione di un modello coerente con l'aleatorietà dei tassi di interesse. Pubblicato su *Mathematical and Computer Modelling*

"Corporate Valuations and the Merton Model" riguarda l'applicazione della teoria delle opzioni alla valutazione aziendale evidenziandone alcune criticità rilevanti. Pubblicato su *Applied Financial Economics Letters*

LINGUA STRANIERA

Certificate of Proficiency in English dell'Università di Cambridge (Inghilterra)