

UNIVERSITA' DEGLI STUDI DI PADOVA

Procedura selettiva 2022PO183 – allegato 22 per la chiamata di n. 1 posto di Professore di prima fascia presso il Dipartimento di Matematica "Tullio Levi-Civita" - DM per il settore concorsuale 13/D4 - METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCIENZE ATTUARIALI E FINANZIARIE (profilo: settore scientifico disciplinare SECS-S/06 - METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCIENZE ATTUARIALI E FINANZIARIE), ai sensi dell'art. 18 comma 1 legge 240/2010, bandita con Decreto Rettorale n. 94611 del 23/05/2022.

Allegato al verbale n. 3

DICHIARAZIONE LAVORI IN COLLABORAZIONE

Il prof. Martino Grasselli ha i seguenti 6 lavori in comune tra i 15 presentati dal candidato prof. Alessandro Gnoatto:

General closed form basket option pricing bounds, (with R. Caldana, G. Fusai and M. Grasselli), Quantitative Finance, 16(4) (2015) 535-554

Analytic pricing of volatility-equity option within Wishart-based stochastic volatility models, (with J. Da Fonseca and M. Grasselli), Operations Research Letters, (43) (2015) 601-607

An affine multicurrency model with stochastic volatility and stochastic interest rates, (with M. Grasselli), SIAM Journal on Financial Mathematics, 5(1) (2014) 493-531

The explicit Laplace transform for the Wishart process, (with M. Grasselli), Journal of Applied Probability 51(3) (2014) 640-656

Smiles all around: FX joint calibration in a multi-Heston model, (with A. De Col and M. Grasselli), Journal of Banking and Finance 37(10) (2013) 3799-3818

A flexible matrix Libor model with smiles, (with J. Da Fonseca and M. Grasselli), Journal of Economic Dynamics and Control 37(4) (2013) 774-793

Il contributo del candidato prof. Alessandro Gnoatto è stato paritario con i co-autori.

Padova, 18 novembre 2022.

Prof. Martino Grasselli presso l'Università degli Studi di Padova

Firmato digitalmente ai sensi del D.Lgs. n. 82/2005