

Gianluca Cassese

Università di Milano Bicocca

Dipartimento di Economia, Metodi Quantitativi e Strategie d'Impresa, DEMS

Edificio U7

via Bicocca degli Arcimboldi, 8
20126 - Milano

Telefono: (39) 02 - 6448.5815

Fax: (39) 02 - 6448.5878

Email: gianluca.cassese@unimib.it

Homepage: <http://www.statistica.unimib.it/utenti/cassese/>

Dati Personali

Data di Nascita: 11 dicembre 1963.

Stato civile: celibe, 4 figli

Istruzione

Laurea in Discipline Economiche e Sociali, Univeristà Bocconi, Milan, 1989.

Master of Science, Economics, London School of Economics and Political Science, 1992.

Dottorato di Ricerca, Economia Politica, Università degli Studi di Ancona, 1993.

Visiting Scholar, Department of Economics, Stanford University, 1996.

Occupazione

Università di Milano Bicocca, professore associato confermato SECS P/01, 2008–presente.

Università del Salento, professore associato SECS P/01, 2005–2008.

Università Bocconi, ricercatore SECS P/01, 1990–2005.

Aree di Ricerca

Finanza Matematica.

Probabilità e Processi Stocastici.

Microeconomia e Teoria delle Decisioni.

Pubblicazioni

Articoli su Riviste Internazionali

- [Conglomerability and Representations](#), *Journal of Convex Analysis*, Vol. 25, No. 3 forthcoming (2018).
- [Asset Pricing in an Imperfect World](#), *Economic Theory*, Vol. 64, No. 3 (2017), 539-570.
- [The Theorem of Halmos and Savage under Finite Additivity](#), *Journal of Mathematical Analysis and Applications*, Vol. 437, No. 2 (2016), 870-881.
- [A Version of Komlós Theorem for Additive Set Functions](#), *Sankhyā A*, Vol. 78, No. 1 (2016), 105-123.
- [Convergence in Measure under Finite Additivity](#), *Sankhyā A*, Vol. 75, No. 2 (2013), 171-193.
- [Supermartingale Decomposition with a General Index Set](#), *Stochastic Processes and Their Applications*, Vol. 120, No. 7 (2010), 1060-1073.
- [Quasi-Martingales wit a Linearly Ordered Index Set](#), *Statistics and Probability Letters*, Vol. 80, No. 5-6 (2010), 421-426.
- [Sure Wins, Separating Probabilities and the Representation of Linear Functionals](#), *Journal of Mathematical Analysis and Applications*, Vol. 354, No. 2 (2009), 558-563.
- [Finitely Additive Supermartingales](#), *Journal of Theoretical Probability*, Vol. 21, No. 3 (2008), 586-603.
- [Asset Pricing With no Exogenous Probability Measure](#), *Mathematical Finance*, Vol. 18, No. 1 (2008), 23-54.
- [Yan Theorem in \$L^\infty\$ with Applications to Asset Pricing](#), *Acta Mathematicae Applicatae Sinica (English Series)*, Vol. 23, No. 4 (2007), 551-562.
- [Decomposition of Supermartingales Indexed by a Linearly Ordered Set](#), *Statistics and Probability Letters*, Vol. 77, No. 8 (2007), 795-802.
- [Modelling the Italian MIB30 Implied Volatility Surface. Does Market Efficiency Matter?](#), *International Review of Financial Analysis*, Vol. 15, No. 5 (2006), 145-178. (with M. Guidolin).
- [A Note on Asset Bubbles in Continuous Time](#), *International Journal of Theoretical and Applied Finance*, Vol. 8, No. 4 (2005), 523-536.
- [Pricing and Informational Efficiency of the MIB30 Index Options Market. An Analysis with High Frequency Data](#), *Economic Notes*, Vol. 33, No. 2 (2004), 275-321. (with M. Guidolin).

Articoli su Riviste Nazionali

- [Arbitrage Theory with Bounded Prices](#), *International Review of Economics and Business*, Vol. 46 (1999), 233-244.
- [Incompleteness of Markets and Vagueness of Beliefs](#), *International Review of Economics and Business*, Vol. 44 (1997), 837-855.
- [Asset Evaluation under Continuous-time: Some Remarks](#), *International Review of Economics and Business*, Vol. 42 (1995), 469-483.
- [Il Mercato Italiano delle Opzioni sull'Indice di Borsa](#), *Bancaria*, No. 1 2003, 87-95.

Libri

Teoria dei Mercati Finanziari. Un'introduzione, Roma, Carocci 2017.

Contributi a Volumi

The Representation of Conglomerative Functionals, in Ferraro M. B., Giordani P., Vantaggi B., Gagolewski M., Gil M. A., Grzegorzewski P. and Hryniewicz O. (eds.), *Soft Methods for Data Science*, Berlin, Springer 2017, 103–112.

Mercati finanziari, politica monetaria e distribuzione del reddito. Un'interpretazione teorica, in G. Nardozi (ed), *Politica monetaria, profitti e finanza: contributi per l'analisi di alcuni recenti sviluppi*, Roma, LUISS Univeristy Press 2007, 87–122.

Il Mercato degli Strumenti Derivati in Italia, in Fondazione Rosselli *Settimo Rapporto sul Sistema Finanziario Italiano*, Roma, Edibank 2002, 163-180.

Lavori non ancora pubblicati

A generalization of Tanaka's formula, *Sottoposto per la pubblicazione*, 2017, ArXiv;

Non Parametric Estimation of Option Prices via Superhedging, *Sottoposto per la pubblicazione*, 2014, ArXiv 1502.03978;

Convegni internazionali

The Mathematics of Subjective Probability, Milano, 3 - 5 Settembre 2018 (comitato organizzatore e comitato scientifico);

First Italian Meeting on Probability and Mathematical Statistics, Torino, 19 - 22 Giugno 2017 (relatore);

Model Uncertainty and Robust Finance, Milano, 10 - 11 Novembre 2016 (relatore);

Soft Methods in Probability and Statistics, Roma, 12 - 14 Settembre 2016 (relatore);

Northern Finance Association, Calgary, 8 - 10 Ottobre 2002 (relatore);

Econometric Society European Meeting, Venezia, 25 - 27 Agosto 2002 (relatore);

International Conference on Mathematical Finance, Hammamet, Tunis, 15-17 Giugno 1999 (relatore);

Econometric Society European Meeting, Toulouse, 25 - 27 Agosto 1997 (relatore);

Seminari

Università di Milano, Dipartimento di Matematica (2016);

Università di Bielefeld (2015);

Università della Svizzera Italiana (2015);

Università degli studi dell'Aquila (2007);

Visiting

Visiting Professor, Institute of Finance University of Lugano, 1996 – present;
Visiting Scholar, Department of Economics Stanford University, 1996.

Attività di Referee

The Financial Review.
Computational Statistics and Data Analysis.
Acta Applicanda Mathematica.
Annals of Applied Probability.
Journal of Applied Mathematics and Computing.
Zentralblatt MATH.

Didattica

Mathematical Finance, Università Milano Bicocca, 2013–presente
Risk Management, Università Milano Bicocca, 2008–presente
Industrial Organization, Università Milano Bicocca, 2008–2012
Financial Modeling, Università della Svizzera Italiana, 2004–2012
Introduction to Financial Engineering, Università della Svizzera Italiana, 2004–2014
Monetary Economics, Università della Svizzera Italiana, 2012–presente
Monetary Economics, Università del Salento, 2006–2008
Macroeconomics, Università del Salento, 2005–2008
International Economics, Università del Salento, 2006–2008
Theory of Games and Voting, Università del Salento, 2006–2008
Financial Markets, Università della Svizzera Italiana, 1998–2006
Futures and Options, Università Bocconi, 2000–2003

Dispense

Risk Management. Appunti di Lezione, pp. 1-112, Università di Milano Bicocca.

Economia Monetaria. Appunti di Lezione, pp. 1-117, Università del Salento, 2007.

Giochi e Strategie per la Politica e le Relazioni Internazionali, pp. 1-69, Università del Salento, 2006.

An Introduction to Financial Engineering, pp. 1-68, Università della Svizzera Italiana, 2006.

Uncertainty, Choice and Equilibrium. A Bird's Eye View, pp. 1-63, Università del Salento, 2005.

Financial Modeling, pp. 1-86, Università della Svizzera Italiana, 2004.

Options and Futures. An Introduction to Binomial Models, pp. 1-63 Università Bocconi, 2000.

Last updated: October 12, 2017