

L'incontro è libero e gratuito
Per informazioni e adesioni:
Dipartimento di Scienze
delle Decisioni
Tel. 02 5836.5553/5632
www.unibocconi.it/convegnocifarelli

Dipartimento di Scienze
delle Decisioni

Giornate di studio di probabilità, statistica e matematica

Convegno in onore
del prof. Donato M. Cifarelli

6-7 giugno 2008

Bocconi



Università Commerciale
Luigi Bocconi

Via Sarfatti, 25
20136 Milano

Aula N01
Piazza Sraffa 13
Nuovo Edificio

Il Dipartimento di Scienze delle Decisioni dell'Università Bocconi nasce nel novembre 2007 con la missione di raccogliere, proseguire e ampliare in nuove direzioni l'attività didattica e scientifica svolta finora dall'Istituto di Metodi Quantitativi, diretto per più di vent'anni dal prof. Donato M. Cifarelli.

Nel lungo periodo della sua direzione, l'IMQ ha acquisito visibilità e prestigio internazionali nei campi della probabilità, statistica e matematica applicata all'economia e alla finanza. In particolare, alcuni contributi del prof. Cifarelli sono risultati lavori d'importanza fondamentale per lo sviluppo dell'inferenza non parametrica bayesiana.

Per celebrare l'opera e l'attività del prof. Cifarelli, il Dipartimento di Scienze delle Decisioni organizza nei giorni 6 e 7 giugno 2008, due giornate di studio su temi di probabilità, statistica e matematica.

6 giugno 2008

- 10.15 **Registrazione dei partecipanti**
- 10.30 **Saluto introduttivo**
Lorenzo Peccati Prorettore per la ricerca e la gestione risorse umane, Università Bocconi
- 11.00 **Probabilità e statistica alla Bocconi fra il 1960 e il 1980**
Eugenio Regazzini Università di Pavia
- 12.00 **I parametri possono essere utili ma devono essere scelti bene - un esempio**
Ludovico Piccinato Università La Sapienza
- 13.00 **Cocktail**
- 14.00 **Comonotonia multivariata**
Marco Scarsini LUISS
- 14.40 **Intervalli di confidenza per il parametro di Hurst basati su tecniche di subsampling**
Pier Luigi Conti Università La Sapienza
- 15.20 **"Bayesian Model Averaging" coerente**
Giovanni Parmigiani Johns Hopkins University
- 16.00 **Coffee break**
- 16.30 **Scambiabilità parziale e processi stocastici rinforzati**
Pietro Muliere Università Bocconi
- 17.10 **Una equazione funzionale nello spazio delle distribuzioni su $[0,1]$**
Piercesare Secchi Politecnico di Milano
- 17.50 **Urne di Pölya, sviluppi di Hoeffding e processi di Dirichlet**
Giovanni Peccati Université Paris VI
- 20.30 **Cena**

7 giugno 2008

- 9.00 **Le derivate di Dini in un problema di ottimo vettoriale**
Angelo Guerraggio
Università dell'Insubria
- 9.40 **New insights on mean variance portfolio selection from early de Finetti's suggestions**
Flavio Pressacco
Università degli Studi di Udine
- 10.20 **Coffee break**
- 10.50 **Problemi di ostacolo per l'operatore di Laplace frazionario e connessioni con opzioni americane**
Sandro Salsa
Politecnico di Milano
- 11.30 **Internalità "grassa"**
Erio Castagnoli
Università Bocconi