

**GABRIELE STABILE**  
SAPIENZA Università di Roma  
Facoltà di Economia  
Via del Castro Laurenziano, 9 - 00161 Roma - Italy  
[gabriele.stabile@uniroma1.it](mailto:gabriele.stabile@uniroma1.it)

## FORMAZIONE

1995	Laurea in Matematica, "Sapienza" Università di Roma
1996	Diploma del Corso di Perfezionamento in "Didattica della Matematica e della Matematica Applicata", "Sapienza" Università di Roma;
1997-98	Corso di perfezionamento all'estero della durata di un anno presso il Dipartimento di Matematica della Ruhr Universität, Bochum (Germania) (concorso a 8 borse di studio bandito da "Sapienza" Università di Roma, G.U. n. 59 - Area CUN 01);
2002	Dottore di Ricerca in Matematica per le Applicazione Economiche, Finanziarie e Assicurative, "Sapienza" Università di Roma.
2002-04	Titolare dell'assegno di ricerca (SECS-S/06) "Modelli di controllo ottimo per previdenza in ambito pubblicistico e privatistico", Responsabile scientifico Prof. E. Volpe di Prignano, Facoltà di economia, "Sapienza" Università di Roma;
2005-06	Titolare dell'assegno di ricerca (SECS-S/06) "Modelli di controllo ottimo per la previdenza complementare individuale", Responsabile scientifico Prof. E. Volpe di Prignano, Facoltà di economia, "Sapienza" Università di Roma.

## POSIZIONE ATTUALE

Ricercatore confermato

S.S.D. SECS-S/06 "Metodi matematici dell'economia e delle scienze attuariali e finanziarie presso il Dipartimento di Metodi e modelli per l'economia, il territorio e la finanza (MEMOTEF) Facoltà di economia, "Sapienza" Università di Roma.

## INTERESSI DI RICERCA

Modelli di controllo stocastico per la finanza e le assicurazioni

Tecniche probabilistiche per lo studio della probabilità di rovina di una compagnia assicurativa, ramo danni

## PRINCIPALI PUBBLICAZIONI

- M.Longo, G.Stabile (2019),  
Sub-optimal investment for insurers.  
Communications in Statistics - Theory and Methods(DOI) 10.1080/03610926.2019.1599020
- T. De Angelis, G.Stabile (Accepted: 10 December 2018),  
*On Lipschitz continuous optimal stopping boundaries.*  
SIAM Journal on Control and Optimization (DOI) 10.1137/17M1113709
- T. De Angelis, G.Stabile (2018),  
*On the free boundary of an annuity purchase.*  
Finance and Stochastics (DOI) 10.1007/s00780-018-00379-8
- G.T.Spartà, G.Stabile (2018),  
*Tax compliance with uncertain income: a stochastic control model.*  
Annals of Operations Research 261 (1-2), pp 289-301, ISSN: 0254-5330
- M.B.Chiarolla, G.Ferrari, G.Stabile (2015),  
*Optimal dynamic procurement policies for a storable commodity with Lévy prices and convex holding costs.*  
European Journal of Operational Research 247 (3), pp. 847-858, ISSN: 0377-2217
- G.Stabile (2015),  
*Underperformance Fees and Manager's Portfolio Risk Taking.*  
International Journal of Financial Research 6 (1), pp. 79-89, ISSN: 1923-4023.
- M.Abundo, C.Macci, G.Stabile (2012),  
*Asymptotic results for exit probabilities of stochastic processes governed by an integral type rate function.*  
Probability and Mathematical Statistics 32 (1), pp. 25-39, ISSN: 0208-4147.
- G.Stabile, G.L.Torrisi (2010),  
*Large deviations of Poisson shot noise processes under heavy tail semi-exponential conditions.*  
Statistics & Probability Letters 80 (15-16), pp. 1220-1209, ISSN: 0167-7152.
- G.Stabile, G.L.Torrisi (2010),  
*Risk processes with non-stationary Hawkes claims arrivals.*  
Methodology and Computing in Applied Probability 12 (3), pp 415-429 ISSN: 1387-5841.

- G.Stabile (2006),  
*Optimal timing of the annuity purchase: a combined stochastic control and optimal stopping problem.*  
International Journal of Theoretical and Applied Finance 9 (2), pp.151-170, ISSN: 0219-0249
- C.Macci, G.Stabile (2006),  
*Large deviations for risk processes with reinsurance.*  
Journal of Applied Probability 43 (3), pp. 713-728, ISSN: 00219002
- C.Macci, G.Stabile, G.L.Torrisi (2005),  
*Lundberg parameters for non standard risk processes.*  
Scandinavian Actuarial Journal (6), 417-432, ISSN: 0346-1238