

MARIA GIUSEPPINA BRUNO
Professore Associato
Università di Roma “Sapienza”, Facoltà di Economia,
Dipartimento di Metodi e modelli per l’economia, il territorio e la finanza (MEMOTEF)
e-mail: giuseppina.bruno@uniroma1.it

CURRICULUM DELL’ATTIVITA’ DIDATTICA E SCIENTIFICA

(aggiornato al mese di giugno 2018)

Titoli accademici

Dal 29 dicembre 2003

Professore Associato presso l’Università di Roma “Sapienza”, Facoltà di Economia, Dipartimento di Metodi e Modelli per l’Economia, il Territorio e la Finanza (MEMOTEF), Settore Scientifico-Disciplinare SECS-S/06 “Metodi matematici dell’Economia e delle Scienze attuariali e finanziarie”.

Attualmente, docente di Matematica corso base (Corso di Laurea in Scienze Economiche L33) e di Matematica attuariale per le assicurazioni private (Corso di Laurea Magistrale in Finanza e Assicurazioni LM16).

Dall’1 ottobre 1996 al 28 dicembre 2003

Ricercatore presso l’Università di Roma “Sapienza”, Facoltà di Economia, Dipartimento di Matematica per le decisioni economiche, finanziarie ed assicurative, Cattedra di Matematica finanziaria, Settore Scientifico-Disciplinare SECS-S/06 (ex S04B).

11 dicembre 1995

Dottore di Ricerca in “Matematica per l’analisi dei mercati finanziari”; titolo conseguito presso l’Università degli Studi di Brescia, Facoltà di Economia, discutendo la Tesi di Dottorato dal titolo: *Le funzioni con memoria come strumento di valutazione delle opzioni americane.*

14 novembre 1990

Laureata con lode e dignità di pubblicazione in Economia e Commercio presso la Libera Università Internazionale degli Studi Sociali (LUISS) di Roma discutendo la Tesi di Laurea in Matematica finanziaria dal titolo: *La valutazione delle obbligazioni convertibili. Una interpretazione mediante i modelli della fisica.*

Attività didattica

Dall’A.A. 2012-13

Docente di Matematica attuariale per le assicurazioni private (Corso di Laurea Magistrale in Finanza e Assicurazioni) presso l’Università di Roma “Sapienza“, Facoltà di Economia, sede di Roma.

Dall’A.A. 2013-14

Docente di Matematica corso base (Corso di Laurea in Scienze Economiche) presso l’Università di Roma “Sapienza“, Facoltà di Economia, sede di Roma.

Dall’A.A. 2008-09 all’A.A. 2012-13

Docente di Matematica corso base (Corso di Laurea in Management e Diritto d’impresa) presso l’Università di Roma “Sapienza“, Facoltà di Economia, polo didattico di Latina.

Dall’A.A. 2009-10 all’A.A. 2010-11

Docente di Asset allocation strategica e pricing degli strumenti derivati (Corso di Laurea Magistrale in Economia, Finanza e Diritto d’impresa) presso l’Università di Roma “Sapienza“, Facoltà di Economia, polo didattico di Latina.

Dall'A.A. 2003-04 all'A.A. 2007-08

Docente di Matematica generale e di Modelli matematici e computazionali per l'Economia e l'azienda presso l'Università di Roma "Sapienza", Facoltà di Economia, polo didattico di Latina.

Dall'A.A. 2003-04 all'A.A. 2004-05

Docente di Matematica generale (Corso di Laurea in Economia della cooperazione internazionale e dello sviluppo) presso l'Università di Roma "Sapienza", Facoltà di Economia, sede di Roma.

Dall'A.A.1999-00 all'A.A. 2006-07

Docente a contratto di Matematica finanziaria (corso progredito) presso la LUISS di Roma, Facoltà di Economia.

Dall'A.A.1999-00 all'A.A. 2000-01

Docente di Matematica finanziaria (Corso di Diploma Universitario in Economia e amministrazione delle imprese) presso l'Università di Roma "Sapienza", Facoltà di Economia, polo didattico di Latina.

Dall'A.A. 1996-97 all'A.A. 1998-99

Titolare di contratto integrativo d'insegnamento di Matematica finanziaria (corso progredito) presso la LUISS di Roma, Facoltà di Economia.

Dall'A.A. 1991-92 all'A.A. 1995-96

Titolare della Borsa di Studio Amici della LUISS per il perfezionamento didattico e scientifico in Matematica finanziaria.

Dall'A.A. 1993-94 all'A.A. 1994-95

Cultore della Materia in Matematica generale presso la LUISS di Roma, Facoltà di Economia e Commercio.

A.A. 1993-94

Cultore della Materia in Matematica finanziaria presso l'Università degli Studi di Roma "La Sapienza", Facoltà di Economia e Commercio.

A.A. 1990-91

Cultore della Materia in Matematica finanziaria presso la LUISS di Roma, Facoltà di Economia e Commercio.

Altri incarichi istituzionali

Dall'A.A. 2011-12

Membro della Commissione Pubblicazioni, Dipartimento MEMOTEF, Università di Roma "Sapienza".

Dall'A.A. 2014-15

Membro del Gruppo Stage del Corso di Laurea Magistrale in Finanza e Assicurazioni (FINASS).

Dall'A.A. 2016-17

Docente di riferimento e membro del gruppo di Riesame per il Corso di Laurea Magistrale in Finanza e Assicurazioni (FINASS).

Tutor per il Corso di Laurea in Scienze economiche.

A.A. 2012-13

Membro del Team Qualità del Corso di Laurea Magistrale in Finanza e Assicurazioni (FINASS), Facoltà di Economia, Università di Roma "Sapienza".

Dall'A.A. 2011-12 all'A.A. 2012-13

Membro della Commissione Didattica, Dipartimento MEMOTEF, Università di Roma "Sapienza".

Dall'A.A. 2004-05

Membro e Tutor del Collegio Docenti del Dottorato in "Matematica per le applicazioni economico-finanziarie", Scuola di Dottorato in Economia, "Sapienza" Università di Roma.

Dall'A.A. 2007-08 all'A.A. 2009-10

Membro della Commissione Biblioteca, Facoltà di Economia, polo didattico di Latina, Università di Roma "Sapienza".

Dall'A.A. 1999-00 all'A.A. 2003-04

Membro affiliato del Collegio Docenti del Dottorato in "Scienze attuariali e finanziarie", Università di Roma "Sapienza", Facoltà di Statistica.

Altre attività ed incarichi professionali

Da febbraio a giugno 2016

Membro effettivo della Commissione di concorso per Coadiutori con orientamento nelle discipline economico-finanziarie, Banca d'Italia.

Maggio 2002

Docente del corso di aggiornamento per il personale della consulenza professionale statistico-attuariale dell'INPDAP.

Ottobre 1998

Docente del corso di formazione per promotori finanziari organizzato dalla PRAXI S.p.A. per conto di Banca di Roma.

Dall'1 febbraio 1994 al 30 settembre 1996

Coadiutore a contratto presso la Commissione Nazionale per le Società e la Borsa (Co.N.So.B.) di Roma, Divisione Mercati, Ufficio Organizzazione Mercati.

Attività per riviste scientifiche

Dal 2012

Referee per i Working Paper del Dipartimento MEMOTEF e per la rivista Annali MEMOTEF.

Dal 2014

Membro dell'Editorial Board della rivista Annali MEMOTEF.

Dal 2015

Referee per la rivista Annali MEMOTEF.

Nel 2016

Referee per la rivista Insurance: Mathematics and Economics.

Nel 2015 e 2016

Managing Editor della rivista Annali MEMOTEF.

Nel 1998

Referee per la rivista Physica A.

Progetti di ricerca e associazioni scientifiche

Dal 1996

Fa parte di diversi progetti ministeriali e iniziative universitarie di ricerca.

Dal 1999

Socio dell'Associazione di Matematica Applicata alle Scienze Economiche e Sociali (AMASES).

Dal 2000

Socio dell'Associazione Attuariale Internazionale (AAI), Sezione "Actuarial Studies in Non Life Insurance" (ASTIN).

Dal 1998 al 2017

Socio dell'Istituto Italiano degli Attuari (IIA).

Convegni e seminari (dal 2006)

Dall'1 al 3 novembre 2006

Ha partecipato alla "10th WSEAS International Conference on Applied Mathematics", Dallas.

In occasione del convegno, ha presentato il lavoro dal titolo: *On the Calculation of Convolution in Actuarial Applications. A Case Study using Discrete Random Variables*, scritto con A. Tomassetti e pubblicato negli Atti.

Publicazioni (dal 2006)

Bruno M.G., Grande A., Marino M., Modica E. (2016), Valutazione e copertura del rischio mortalità, *Annali MEMOTEF* 2016, 81-94, ISSN: 2385-0825.

Bruno M.G., De Rose A. (2016), Prefazione, *Annali MEMOTEF* 2016, 7-9, ISBN: 9788855533614.

Bruno M.G. (a cura di) (2016), *Annali MEMOTEF* 2016, Bologna: Patron editore, ISBN: 9788855533614.

Bruno M.G., Grande A., Oliva C.F. (2015), Anomalous demand and supply in cat risk insurance market, *Annali MEMOTEF* 2015, 51-62, ISSN: 2385-0825.

Bruno M.G., De Rose A. (2015), Prefazione, *Annali MEMOTEF* 2015, 7-9, ISBN: 9788855533331.

Bruno M.G. (a cura di) (2015), *Annali MEMOTEF* 2015, Bologna: Patron editore, ISBN: 9788855533331.

Bruno M.G., Grande A. (2015), Pricing arithmetic average options and basket options using Monte Carlo and Quasi- Monte Carlo methods, *Working Paper MEMOTEF* n. 143, Dicembre 2015.

Bruno M.G., Grande A. (2014), A new algorithm for the quantile function of the standard gaussian distribution. A financial application, *submitted*.

Bruno M.G., Grande A. (2014), Un nuovo algoritmo di inversione della distribuzione normale standardizzata e sue applicazioni finanziarie, *Working Paper MEMOTEF* n. 131, Giugno 2014.

Bruno M.G. (2012), Manuale di calcolo delle opzioni finanziarie, *preprint*.

Santarpia D., Bruno M.G. (2011), Procedure numeriche per la discretizzazione di processi stocastici diffusivi nella valutazione delle opzioni finanziarie, *Working Paper MEMOTEF* n. 78, Febbraio 2011.

Bruno M.G., Tomassetti A. (2006), On the Calculation of Convolution in Actuarial Applications. A Case Study using Discrete Random Variables, *Proceedings of the 10th WSEAS International Conference on Applied Mathematics*, Dallas, November 1-3, 2006, 538-546, WSEAS Stevens Point, Wisconsin, USA, ISBN: 9608457556.

Bruno M.G., Tomassetti A. (2006), Algorithms for the Sum of Discrete Random Variables. Actuarial Applications, *WSEAS Transactions on Business and Economics* **3**, No. 8, 577-585, ISSN: 1109-9526, doi: 10.1007/s10072-006-0704-x.

Bruno M.G., Camerini E., Manna A., Tomassetti A. (2006), A New Method for Evaluating the Distribution of Aggregate Claims, *Applied Mathematics and Computation* **176**, 488-505, ISSN: 0096-3003, doi: 10.1016/j.amc.2005.09.038.

Argomenti di interesse scientifico

Matematica finanziaria e attuariale; Valutazione di strumenti finanziari derivati; Valutazione di Fondi pensione; Teoria del rischio; Misure coerenti di rischio; Processi stocastici markoviani e non markoviani applicati alla finanza e alle assicurazioni; Aspetti matematici e computazionali della somma di variabili aleatorie; Applicazioni dei metodi Montecarlo e Quasi-Montecarlo.