

CECI CLAUDIA
Curriculum Vitae

Parte I – Informazioni Generali

Nome	CLAUDIA CECI
E-mail	c.ceci@unich.it

Abilitazione Scientifica Nazionale per la I fascia, 13/D4, SSD SECS-S06, decorrenza dal 05/02/2014 e scadenza il 05/02/2023.

Parte II – Formazione

Tipologia	Anno	Istituzione	Titolo, Esperienza
Laurea	10 luglio 1990	Dip. Castelnuovo, Università La Sapienza	Laurea in Matematica, 110 cum lode, relatore Prof. Anna Gerardi
Borsa di studio	AA 1989/90	Dip. Castelnuovo, Università La Sapienza	Borsa di studio C.N.R. per laureandi (bando n.209.01.52 del 23/09/89, settimo posto su 30 borse), tutor Prof. Anna Gerardi
Borsa di studio	AA 1990/91	INdAM presso Università La Sapienza	Tutor Prof. Anna Gerardi
Scuola estiva	Agosto 1990	Università di Perugia	Scuola estiva di Perugia
Borsa di studio per l'estero	AA 1991/92	"Laboratoire des Probabilites" Università di Parigi VI, Francia	Borsa C.N.R. per l'estero (bando n.203.01.58 del 03/08/90, terzo posto su 23), tutor Prof. Nicole El Karoui
Scuola estiva	Agosto 1993	Università di Columbus, Ohio, USA	Summer School in Probability Theory
PhD	26 gennaio 1996	Dip. Castelnuovo, Università La Sapienza	Analisi Matematica e Probabilità, supervisore Prof. Anna Gerardi

Premi

Anno	Istituzione	Tipologia
1990	Dip. Castelnuovo, Università La Sapienza	Premio di laurea in ricordo della Prof. Gabriella Del Grosso

Part III

III.A – Posizioni accademiche

Inizio	Fine	Istituzione	Posizione
22/09/1993	30/08/1997	Istituto di Matematica, Facoltà di Architettura, Università di Firenze	Ricercatore Universitario A02B (Probabilità e Statistica Matematica).
01/09/1997	30/10/1998	Dip. di Scienze, Facoltà d'Economia, Università "G. d'Annunzio" di Chieti-Pescara	Ricercatore Universitario A02B (Probabilità e Statistica Matematica).
01/11/1998	30/03/2011	Facoltà d'Economia, Università "G. d'Annunzio" di Chieti-Pescara	Professore associato MAT/06 (Probabilità e Statistica Matematica)
31/03/2011	-	Dipartimento di Economia, Università "G. d'Annunzio" di Chieti-Pescara	Professore ordinario MAT/06 (Probabilità e Statistica Matematica)

III.B – Attività universitarie gestionali e/o partecipazione ad organi collegiali elettivi

Inizio	Fine	Istituzione	Posizione
01/11/2011	28/02/2012	Università “G. d’Annunzio” di Chieti-Pescara	Direttore del Dipartimento di Scienze
18/01/2013	30/10/2014	Università “G. d’Annunzio” di Chieti-Pescara	Coordinatore Dottorato di Ricerca in Scienze
01/11/2014	30/10/2017	Università “G. d’Annunzio” di Chieti-Pescara, Dipartimento di Economia	Presidente del Corso di laurea in Economia e Commercio L-33
01/11/2017	30/10/2020	Università “G. d’Annunzio” di Chieti-Pescara, Dipartimento di Economia	Presidente del Corso di laurea in Economia e Commercio L-33
01/11/2020	–	Università “G. d’Annunzio” di Chieti-Pescara, Dipartimento di Economia	Componente della Giunta di Dipartimento
01/11/2020	–	Università “G. d’Annunzio” di Chieti-Pescara, Dipartimento di Economia	Componente del Collegio di Dottorato BIM (Business Institutions and Markets)
01/11/2004	30/10/2014	Università “G. d’Annunzio” di Chieti-Pescara, Dipartimento di Scienze	Componente del Collegio di Dottorato in Scienze
01/11/2020	–	Università “G. d’Annunzio” di Chieti-Pescara, Dipartimento di Economia	Commissione Pratiche Studenti del Corso di laurea in Economia e Commercio L-33
01/11/2020	–	Università “G. d’Annunzio” di Chieti-Pescara, Dipartimento di Economia	Comitato d’Indirizzo (Rapporti con gli Stakeholders) Corso di laurea in Economia e Commercio L-33
15/01/2015	15/06/2015	Università “G. d’Annunzio” di Chieti-Pescara, Dipartimento di Economia	Componente della Commissione di Revisione Regolamento di Studio Corsi di laurea in Economia e Commercio triennale e magistrale (CLEC L33, CLECM, LM 56). Istituzione del Percorso di Economia e Finanza CLECM, LM 56.

III.C - Commissioni di Dottorato

Data	Tipologia	Istituzione
5/07/2010	Esame finale di Dottorato in Metodi Matematici per l'Economia, la Finanza e le Assicurazioni	Università Luiss Guido Carli in co-tutela con l'Université de Paris
11/10/2010	Esame finale di Dottorato in Matematica Computazionale	Dipartimento di Matematica Pura e Applicata, Università degli studi di Padova
10/11/2010	Ammissione al Dottorato di Ricerca in Scienze	Dipartimento Di Scienze, Università “G. d’Annunzio” di Chieti-Pescara
18/05/2011	Esame finale di Dottorato in Metodi Matematici per l'Economia, la Finanza e le Assicurazioni	Università Luiss Guido Carli
04/04/2013	Presidente di Commissione, esame finale di Dottorato in Scienze	Dipartimento Di Scienze, Università “G. d’Annunzio” di Chieti-Pescara

12/02/2016	Presidente di Commissione, esame finale di Dottorato di Ricerca in Matematica, Analisi probabilistica dei fenomeni tellurici	Università di Roma "La Sapienza"
10/2016	Ammissione al Dottorato Business, Institutions, Markets	Dipartimento di Economia, Università "G. d'Annunzio" di Chieti-Pescara
9/11/2018	Esame finale di Dottorato di Ricerca in "Mathematics in natural, social and life sciences"	Gran Sasso Science Institute (GSSI), L'Aquila
5/10/2020	Esame finale "École Doctorale de Sciences Mathématiques de Paris Centre"	Université de Paris, LPSM (Laboratoire de Probabilités, Statistique et Modélisation)
20/07/2021	Esame finale di Dottorato di Ricerca in Economia	Università degli Studi di Perugia

III.D Commissioni di Concorso

Anno	Tipologia	Istituzione
2005	Ricercatore Settore Scientifico disciplinare MAT/06	Università di Roma "La Sapienza"
2006	Ricercatore Settore Scientifico disciplinare MAT/06	Università di Padova
23/03/06 - 23/03/08	Conferma in ruolo dei ricercatori SSD MAT/06	
2016	RTDB settore concorsuale 01/A3, SSD MAT/06	Università del Salento, Lecce
2017	RTDB settore concorsuale 01/A3, SSD MAT/06	Università degli Studi di Bologna
2018	Professore di seconda fascia, settore concorsuale 01/A3, SSD MAT/06	Università di Padova
2018	RTDB settore concorsuale 01/A3, SSD MAT/06	Università degli Studi di Milano
4/12/2018	"Habilitation à diriger des recherches" (HDR),	Laboratoire de Mathématiques et Modélisation d'Evry, Equipe de Probabilités et Mathématiques financière, Francia
2019	RTDA, settore concorsuale 01/A3, SSD MAT/06	Università "G. d'Annunzio" di Chieti-Pescara
2019	RTDB, settore concorsuale 01/A3, SSD MAT/06	Università di Pisa
2020	Tenure track, settore concorsuale 01/A3, SSD MAT/06	Università di Verona

2021		Tenure track, settore concorsuale 01/A3, SSD MAT/06	Università di Padova
2021		Professore di I fascia, settore concorsuale 01/A3, SSD MAT/06	Università degli Studi di Milano
2021		RTDA, settore concorsuale 01/A3, SSD MAT/06, valutazione attività per proroga	Università di Roma "La Sapienza"
2022 corso	in	RTDB, settore concorsuale 01/A3, SSD MAT/06	Università di Macerata
2022 corso	in	RTDB, settore concorsuale 01/A3, SSD MAT/06	Università di Perugia

Part IV – Attività didattica

IV.A - Titolarità di insegnamenti CdS triennali, magistrali ed a ciclo unico

Anno accademico	Istituzione	Nome del corso
2021/22 2020/21 2019/20 2018/19 2017/18	Università di Chieti-Pescara, Corso di laurea in Economia e Commercio- Percorso Economia e Finanza (CLEC-EF L-18)	Titoli Derivati e Gestione del Rischio I
2021/22 2020/21 2019/20 2018/19 2017/18	Università di Chieti-Pescara, Corso di laurea magistrale in Economia e Commercio- Percorso Economia e Finanza (CLECM-EF LM-56)	Titoli Derivati e Gestione del Rischio II
2016/17	Anno sabbatico	
2015/16 2014/15 2013/14 2012/13 2011/12	Università di Chieti-Pescara, Corso di laurea in Economia e Commercio- Percorso Economia e Finanza (CLEC-EF L-18)	Titoli Derivati e Gestione del Rischio
2010/11 2009/10 2008/09 2007/08	Università di Chieti-Pescara Corso di laurea in Economia e Finanza	Titoli Derivati e Gestione del Rischio
2020/21	Università di Chieti-Pescara, Corso di laurea in Economia e Commercio- Percorso Economia e Finanza (CLEC-EF LM-56)	Modelli matematici per le decisioni di investimento
2006/07 2005/06	Università di Chieti-Pescara, Corso di laurea in Economia e Finanza	Matematica Finanziaria
1997/98	Università di Chieti-Pescara, Corso di laurea in Economia Politica	Matematica Finanziaria
2007/08 2006/07 2005/06 2004/05 2003/04 2002/03	Università di Chieti-Pescara, Corso di laurea in Economia Informatica	Complementi di Matematica per l'Economia e la Finanza
2015/16 2014/15	Università di Chieti-Pescara, Corso di laurea in Economia Aziendale	Matematica Generale

2013/14 2012/13 2011/12		
1998/99	Università di Chieti-Pescara, Corso di laurea in Economia Politica	Matematica Generale I
2006/07 2005/06 2004/05 2003/04 2002/03	Università di Chieti-Pescara, Corso di laurea in Economia informatica e Corso di laurea in Economia e finanza	Calcolo delle Probabilità
2009/10 2008/09 2007/08	Università di Chieti-Pescara, Corso di laurea in Economia informatica e Corso di laurea in Economia e finanza	Statistica Matematica
2000/01	Università di Chieti-Pescara, Corso di laurea in Economia Aziendale	Teoria delle decisioni
2001/02	Università di Chieti-Pescara, Corso di laurea in Economia e finanza	Ricerca Operativa
1998/99	Università di Chieti-Pescara, Corso di laurea in Economia Politica	Processi Stocastici
1996/97 1995/96 1993/94	Università di Firenze, Corso di laurea a ciclo unico in Architettura	Complementi di Matematica

Esercitazioni di Istituzioni di Matematica I e Matematica Generale II, periodo 1993-97 presso la Facoltà di Architettura dell'Università di Firenze.

IV.B - Attività didattico integrativa e di servizio agli studenti

Periodo	Attività
2017 – ad oggi	Tutor in itinere per gli studenti del Corso di laurea in Economia e Commercio magistrale (CLECM, LM 56), Università di Chieti-Pescara.
2018 – ad oggi	Referente convenzione Dipartimento di Economia, Università di Chieti-Pescara e l'ARPM (Advanced Risk and Portfolio Management) New York, per la partecipazione degli studenti al Quant-Bootcamp https://www.dec.unich.it/pagina-studiare-allestero-9 Presidente della Commissione per la selezione studenti
03/2022	Organizzazione del ciclo di seminari “Finanza comportamentale” a cura dell'ANASF (Associazione Nazionale Consulenti Finanziari) (3 incontri), Corso di laurea in Economia e Commercio triennale e magistrale (CLEC L33, CLECM, LM 56), Università di Chieti-Pescara
02/2021- 04/2021	Organizzazione del ciclo di seminari “Finanza e dintorni” (4 incontri), Corso di laurea in Economia e Commercio triennale e magistrale (CLEC L33, CLECM, LM 56), Università di Chieti-Pescara.
12/2019-01/2020	Organizzazione del ciclo di seminari “Credit Risk Rating Models” (2 incontri), Corso di laurea in Economia e Commercio triennale e magistrale (CLEC L33, CLECM, LM 56), Università di Chieti-Pescara.
28/11/2018	Organizzazione del Career Day ANASF (Associazione Nazionale Consulenti Finanziari), Università di Chieti-Pescara.
02/2018 – 03/2018	Organizzazione del ciclo di seminari “Credit Risk Management da Basilea 1 a Basilea 2” (2 incontri), Corso di laurea in Economia e Commercio triennale e magistrale (CLEC L33, CLECM, LM 56), Università di Chieti-Pescara.
03-05/2017	Organizzazione del ciclo di seminari “Incontro con la professione dei

	Consulenti Finanziari” (3 incontri) a cura dell’ANASF (Associazione Nazionale Consulenti Finanziari), Corso di laurea in Economia e Commercio triennale e magistrale (CLEC L33, CLECM, LM 56), Università di Chieti-Pescara
12/2015	Organizzazione del ciclo di seminari “Gestione del rischio di tasso d’interesse tramite gli Interest Rate Swaps” (3 incontri), Corso di laurea in Economia e Commercio triennale - Percorso Economia e Finanza, Università di Chieti-Pescara.

IV.C - Relatore di tesi di laurea triennali e magistrali:

73 tesi triennali in Economia e Commercio- Percorso Economia e Finanza, Università di Chieti-Pescara
 15 tesi Magistrali in Economia e Commercio Magistrale - Percorso Economia e Finanza, Università di Chieti-Pescara;

1 tesi Magistrale in Matematica, Università de L’Aquila.

Part V - Appartenenze a Società, riconoscimenti e cariche elettive

Periodo	Posizione
2021 -	Componente della Commissione Scientifica Unione Matematica Italiana, organo direttivo UMI, eletta per il triennio 2021-24 (https://umi.dm.unibo.it/organi-direttivi/) Incarichi: Comitato Relazioni Scientifiche, Comitato Premi, Comitato Comunicazione e Divulgazione, Osservatorio Dottorati
2020 -	Giunta del Gruppo UMI-PRISMA (Probability In Statistics, Mathematics and Applications), eletta per il triennio (http://www.umi-prisma.polito.it/organization.html)
2007 -	Socia AMASES
2011 -	Socia UMI
1999 -	Adesione allo GNAMPA, Gruppo Nazionale di Ricerca per l'Analisi Matematica, la Probabilità e le loro applicazioni, INdAM (Istituto Nazionale di Alta Matematica)

Part VI – RESPONSABILITA’ E PARTECIPAZIONE A PROGETTI DI RICERCA

VI.A - Finanziamenti competitivi in qualità di PI-principal investigator

Periodo	Titolo del Progetto	Programma	Finanziamento
24 mesi a decorrere dal 26/11/1999	“Processi Stocastici, Calcolo Stocastico e Applicazioni”	COFIN 1999, Responsabile Unità locale di Chieti-Pescara, Coordinatore nazionale Prof. M. Pratelli.	Cofinanziamento MIUR assegnato all’unità di ricerca 22.724€
24 mesi a decorrere dal 09/02/2007	“Metodi Stocastici in Finanza”	PRIN 2006, Responsabile Unità locale di Chieti-Pescara, Coordinatore nazionale Prof. W. Runggaldier	Cofinanziamento MIUR assegnato all’unità di ricerca 9.900€ (cofinanziamento totale 14.200€)
24 mesi a decorrere dal 22/03/2010	“Probabilità e Finanza”	PRIN 2008, Responsabile Unità locale di Chieti-Pescara, Coordinatore nazionale Prof. M. Frittelli	Cofinanziamento MIUR assegnato all’unità di ricerca 19.000€ (cofinanziamento totale 27.141€)
02/2016-02/2017	”Il problema della copertura di titoli derivati soggetti a rischio di credito in informazione parziale”	GNAMPA 2016 (INdAM), Responsabile del Progetto Componenti: A. Cretarola, K.Colaneri,	1.200€
06/2021-12/2021	“Una classe di problemi di ottimizzazione in ambito attuariale ed economico”	GNAMPA 2020 (INdAM) Responsabile del Progetto Componenti: M. Brachetta, A.	2.250€

		Cretarola, K. Colaneri, I. Oliva, B. Salterini	
16/05/2022-31/05/2022	“Problemi di riassicurazione e investimento ottimi per dinamiche di tipo Hawkes”	GNAMPA 2022 (INdAM) Responsabile del Progetto Componenti: M. Brachetta, A. Cretarola, G. Callegaro, B. Salterini	2.500€

Responsabile di 15 Progetti di Ricerca su fondi di Ateneo

VI.B - Partecipazione a Progetti di Ricerca competitivi

Periodo	Titolo	Progetto
12 mesi a decorrere dal 15/02/1998	Processi Stocastici	PRIN 1997 Coordinatore nazionale P. Baldi
24 mesi a decorrere dal 12/12/2001	Processi Stocastici e applicazioni a Filtraggio, Controllo, Simulazioni e Finanza Matematica	PRIN 2001, Coordinatore nazionale M. Pratelli
24 mesi a decorrere dal 30/11/2004	Metodi Stocastici in Finanza Matematica	PRIN 2004, Coordinatore nazionale M. Pratelli
02/2014-02/2015	Strategie di copertura in mercati finanziari/assicurativi incompleti con informazione parziale	GNAMPA 2014 (INdAM), Responsabile K. Colaneri
02/2015-02/2016	Equazioni differenziali stocastiche retrograde con informazione incompleta e applicazioni alla finanza	GNAMPA 2015 (INdAM), Responsabile A. Cretarola
02/2017-02/2018	Prezzo di indifferenza e strategie di copertura ottimali per derivati assicurativi in contesto di informazione parziale	GNAMPA 2017 (INdAM), Responsabile K. Colaneri
03/2019-03/2020	Problemi di controllo ottimo stocastico con osservazione parziale in dimensione infinita	GNAMPA 2019 (INdAM), Responsabile A. Calvia

VI.C- Supervisore di studenti di Dottorato

Periodo	Nome	Titolo della tesi	Dottorato
2003-2006	Federica Morbidi	Emissione ottima dei titoli di Stato: studio di un problema di controllo stocastico SSD: SECS-S06	Dottorato in Scienze, XIX ciclo, Università di Chieti-Pescara
2010-2013	Katia Colaneri (posizione attuale: RTDB SECS-S06 Università di Tor Vergata)	Characterization of the filter for jump-diffusion observations via the filtering equation. An application to risk-minimizing hedging. SSD: SECS-S06	Dottorato in Scienze, <i>Doctor Europaeus</i> , XXV ciclo, Università di Chieti-Pescara
2016-2019	Matteo Brachetta (posizione attuale: RTDA SECS-S06 Politecnico di Milano)	Optimal reinsurance and investment problems with different levels of informations SSD: SECS-S06	PhD in Business, Institutions, Markets (BIM), <i>Doctor Europaeus</i> , XXXII ciclo, Università di Chieti-Pescara

Reviewer di 6 tesi di Dottorato in Italia e all'estero.

Tutor di 6 tra assegni e borse di ricerca presso l'Università "G. d'Annunzio" di Chieti-Pescara

Part VII – Attività di Ricerca

Keywords	Breve descrizione
Valutazione e copertura di derivati finanziari e assicurativi in mercati incompleti.	<p>Risk-minimizing e local risk-minimizing hedging per derivati finanziari, studio in informazione completa e parziale;</p> <p>Risk-minimizing and local risk-minimizing hedging per derivati assicurativi, studio in informazione completa e parziale;</p> <p>Prezzo d'indifferenza di derivati finanziari in mercati con salti;</p> <p>Prezzo d'indifferenza di derivati assicurativi sulla vita unit-linked in informazione completa e parziale;</p> <p>Prezzo d'indifferenza di derivati finanziari tramite l'approccio della misura martingala di minima entropia.</p>
Problemi di controllo stocastico e applicazioni alla finanza, l'economia, e le assicurazioni.	<p>Problemi di massimizzazione dell'utilità attesa in mercati con dati ad alta frequenza (High Frequency Data);</p> <p>Problemi di scelta di portafoglio ottimo (consumo-investimento) in mercati finanziari di tipo diffusivo con salti in informazione incompleta;</p> <p>Problemi di riassicurazione e investimento ottimi per modelli di rischio in presenza di fattori stocastici, studio in informazione completa e incompleta;</p> <p>Problemi di gestione del debito pubblico in contesto di informazione completa e parziale.</p>
Rischio di credito e rischio di controparte.	<p>Rischio di controparte di portafogli di derivati creditizi per modelli d'intensità interattive ed effetto contagio;</p> <p>Rischio di controparte in ambito assicurativo.</p>
Modelli finanziari in contesto di osservazione parziale.	Filtraggio stocastico con osservazione processi di punto, di punto marcati e di diffusioni con salti e applicazioni ai mercati finanziari.
Equazioni differenziale retrograde (BSDE) e applicazioni finanziarie.	BSDE guidate da processi di punto, martingale generali e processi di punto marcati, applicazione alle decomposizioni ortogonali finanziarie.
Problemi di arresto ottimo e di tipo misto (controllo e arresto) con applicazioni economiche e assicurative.	<p>Problemi di arresto ottimo e di tipo misto, regolarità della funzione valore nel caso di funzioni guadagno semicontinue e soluzioni viscosità;</p> <p>Applicazioni a problemi decisionali con più agenti;</p> <p>Applicazioni al problema di riassicurazione ottima con costi fissi.</p>

VII.A - Periodi di Ricerca all'estero

Periodo	Istituzione
AA 1991/92 (1 anno)	Laboratoire de Probabilités, Jussieu-University of Paris VI, Francia
1993 (2 settimane)	Laboratoire de Probabilités, Jussieu-University of Paris VI, Francia
1994 (1 settimana)	Laboratoire de Probabilités, Jussieu-University of Paris VI, Francia
1995 (1 settimana)	Laboratoire de Probabilités, Jussieu-University of Paris VI, Francia
1999 (1 settimana)	Laboratoire de Probabilités, Jussieu-University of Paris VI, Francia
2002 (1 settimana)	Laboratoire de Probabilités, Jussieu-University of Paris VI, Francia
11/2016-12/2016 (2 settimane)	Institute for Statistics and Mathematics, Vienna University for Economics and Business WU, Austria
01/2017 (1 settimana)	Unité de Mathématiques Appliquées (UMA), ENSTA ParisTech, Paris, Francia
05/2017 (1 settimana)	Département de Mathématiques, University of Evry, Paris, Francia

VII.B - Partecipazione in qualità di relatore a Convegni, Conferenze e Workshop dal 2005 ad oggi

Periodo			Istituzione
15-17/09/2005	Invited speaker: (in memory of prof. B.Bassan): Optimal stopping and mixed problems with semicontinuous reward: regularity of the value function and viscosity solutions	Workshop Stochastic Methods in Mathematical Finance	Università Sapienza di Roma
23-26/01/2006	Invited speaker: Optimal stopping problems with semicontinuous reward: regularity of the value function and viscosity solutions	Symposium “Optimal Stopping with Applications”	University of Manchester (UK)
22-25/05/2006	Talk: Option hedging for high frequency data models	VIII Congresso Società Italiana di Matematica Applicata e Industriale	Baia Samuele (Ragusa)
14-16/09/2006	Talk: Pricing for geometric marked point processes under partial information: entropy approach	Convegno PRIN “Metodi Stocastici in Finanza”	Università di Lecce
11-16/06/2007	Talk: An HJB approach to exponential utility maximization for jump processes	Risk Measurement and Control Summer School	Istituto Svizzero di Roma
3-6/09/2007	Talk: Utility-based hedging and pricing with a nontraded asset for jump processes	Convegno AMASES	Università di Lecce
19-23/05/2008	Talk: Optimal investment problems with marked point stock dynamics	Sixth Seminar on Stochastic Analysis, Random Fields and Applications	Ascona, Svizzera
2-9/07/2008	Invited speaker: Utility-based hedging and pricing with a nontraded asset for jump processes	Fifth World Congress of Nonlinear Analysts	Orlando, Florida, USA
29-30/01/2009	Talk: Wealth optimization and dual problems for jump stock dynamic with	X Workshop on Quantitative Finance	Politecnico di Milano

	stochastic factor		
1-4/09/2009	Talk: Indifference valuation via Backward SDE's driven by Poisson martingales	Convegno AMASES	Università di Parma
28-29/01/2010	Talk: Indifference valuation via Backward SDE's driven by Poisson martingale	XI Workshop on Quantitative Finance	Università di Palermo
1-4/09/2010	Talk: Portfolio optimization in partially observed jump market model	Convegno AMASES	Università di Macerata
27-28/01/2011	Talk: Restricted information and utility maximization for jump market models	XII Workshop on Quantitative Finance	Università di Padova
23-25/05/2011	Invited speaker: Optimal investment-consumption for partially observed jump-diffusions	Seventh Seminar on Stochastic Analysis, Random Fields and Applications	Ascona, Svizzera
6-8/07/2011	Talk: Optimal investment-consumption under restricted information for jump-diffusion processes	International Conference on Mathematical Finance and Economics (ICMFE 2011)	Istanbul Technical University, Turchia
23-24/01/2014	Talk: Local risk-minimization under restricted information to asset prices	XV Workshop on Quantitative Finance	Università di Firenze
06/10/2014	Invited speaker: Risk-Minimization for semimartingale financial market models under partial information via BSDEs and filtering	Information in Finance & Insurance: partial information/filtering	Institut Henri Poincare, Parigi, Francia
11-12/06/2015	Talk: Local risk-minimization under restricted information on asset prices	1st Symposium on Quantitative Finance and Risk Analysis	Santorini, Grecia
13-17/07/2015	Talk: BSDEs under partial information and applications to local risk-minimization for semimartingale financial markets	38th Conference on Stochastic Processes and their Applications	Oxford, UK
21-22/01/2016	Invited speaker: The Föllmer-Schweizer decomposition under incomplete information and financial applications	Stochastic Models and Related Topics	Università di Salerno
02-05/02/2016	Invited speaker: The Föllmer-Schweizer decomposition under partial information and application to local risk-minimization	Frontiers in Stochastic Modelling for Finance	Università di Padova e Venezia
3-5/07/2017	Talk: Unit-linked life insurance policies: optimal hedging in partially	21st International Congress on Insurance: Mathematics and Economics	Università di Vienna, Austria

	observable market models		
10-12/09/2018	Invited speaker: On optimal reinsurance and investment for partially observable reinsurance models; a BSDEs approach	BSDEs, Information and McKean-Vlasov Equations	University of Leeds, UK
22-25/01/2019	Talk: Locally Risk-Minimizing Hedging of Counterparty Risk for Portfolio of Credit Derivatives	Quantitative Finance Workshop	ETH Zurich, Svizzera
30/05-01/06/2019	Invited speaker: Locally Risk-Minimizing Hedging of Counterparty Risk for Portfolio of Credit Derivatives	New Frontiers in Stochastics for Economics and Finance	Università di Siena
04-07/06/2019	Invited speaker di sessione: Optimal Reinsurance and Investment Problems under Partial Information	SIAM Conference on Financial Mathematics & Engineering (FM19)	Toronto, Canada
15-19/07/2019	Invited speaker di sessione: Optimal Reinsurance and Investment Problems under Partial Information	International Congress on Industrial and Applied Mathematics	Valencia, Spagna
9-11/09/2019	Invited speaker di sessione: Optimal reduction of public debt under partial observation of the economic growth	Convegno AMASES	Università di Perugia
29-31/01/2020	Talk: Value adjustments and dynamic hedging of reinsurance counterparty risk	XXI Quantitative Finance Workshop	Università di Napoli
22-25/06/2021	Talk: Optimal reinsurance and investment under common shock dependence between financial and actuarial markets	10th General AMaMeF Conference (virtual)	Università di Padova
26/11/2021	Invited speaker: Optimal reinsurance and investment problems for stochastic factor risk models	Workshop Dynamic Optimization on Economics, Finance and Insurance	Università Cattolica di Milano
14-18/03/2022	Talk: Optimal reinsurance in a partially observable contagion model	13th International Workshop on Stochastic Models and Control	Lübeck-Travemünde, Germania
31/03-01/04/2022	Talk: Optimal reinsurance and investment under common shock dependence between financial and actuarial markets	XXIII Quantitative Finance Workshop	Università di Roma Tor Vergata

28-29/04/2022	Invited speaker: Optimal reinsurance via BSDEs in a partially observable exciting model	3rd edition of the Spring Colloquium on Probability and Finance (dedicated to Prof. W. J. Runggaldier)	Università di Padova
13-17/06/2022	Invited speaker di sessione: Optimal reinsurance via BSDEs in a partially observable contagion model	World Congress of the Bachelier Finance Society (online)	Hong Kong
27/06-01/07/2022	Invited speaker di sessione: Optimal reinsurance via BSDEs in a partially observable contagion model (organizers M.Jeanblanc and P. di Tella)	9 th Colloquium on Backward Stochastic Differential Equations and Mean Field Systems	Annecy, Francia

VII.C - Organizzazione di Convegni, Conferenze, Workshop e seminari periodici negli ultimi 10 anni

Data	Titolo	Istituzione
26-27/01/2012	Comitato scientifico e organizzativo: XIII Workshop on Quantitative Finance	Università de L'Aquila
10-12/09/2012	Responsabile comitato scientifico e organizzativo: Convegno finale Prin 2008 Probabilità e Finanza	Università "G. d'Annunzio" di Chieti-Pescara
24-25/01/2013	Comitato scientifico e organizzativo: XIV Workshop on Quantitative Finance	Università di Bologna, Rimini
03/07/2013	Organizzatrice di sessione di Convegno: BSDEs and different levels of Information in Finance, Convegno EURO XXVI	Università di Roma "La Sapienza"
19-22/06/2017	Comitato Scientifico: First Italian National Meeting on Probability and Mathematical Statistics Organizzatrice di sessione: Stochastic processes and applications to Finance and Insurance,	Università e Politecnico di Torino
17-19/06/2019	Comitato Scientifico: Second Italian Meeting on Probability and Mathematical Statistics	Università di Salerno, Vietri
01/01/2020 - ad oggi	Organizzatrice (insieme a D. Marinucci) dei Webinar mensili del Gruppo PRISMA http://www.umi-prisma.polito.it/webinars.html	UMI
13-16/06/2022	Comitato Scientifico: Third Italian Meeting on Probability and Mathematical Statistics Organizzatrice della sessione: partial information: stochastic models and applications	Università di Bologna

VII.D - Seminari su invito in Italia e all'estero negli ultimi 10 anni

Data	Titolo	Istituzione
19/10/2010	Utility maximization for jump stock dynamics under complete and partial information	Università LUSPIO di Roma
18/01/2011	Utility optimization in a market model with	Università Sapienza di Roma

	jumps under full and partial information	
11/04/2013	Risk minimizing hedging under partial information via BSDEs	Prometeia SpA Bologna
02/12/2016	Locally risk-minimizing strategies for defaultable claims under incomplete information	Institute for Statistics and Mathematics, Vienna University for Economics and Business WU, Austria
18/01/2017	Hedging of Counterparty Credit Risk	Dipartimento di Economia e Finanza, Università di Tor Vergata, Roma
23/01/2017	Hedging of credit derivatives and unit-linked insurance contracts via local risk-minimization	ENSTA ParisTech, Parigi, Francia
14/03/2017	Credit derivatives and unit-linked life insurance contracts: optimal hedging in partially observable market models	Università di Padova
18/05/2017	Unit-linked life insurance policies: optimal hedging in partially observable market models	Département de Mathématiques of the University of Evry, Francia
21/12/2017	Indifference pricing of pure endowment life insurance contracts under partial information	Laboratoire de Probabilités et Modèles, Paris Diderot University (ParisVII), Francia
27/04/2020	A BSDE-based approach for the optimal reinsurance problem under partial information	Webinar Università de L'Aquila

Part VIII.

VIII.A - Attività editoriale

Periodo		
2020 -	Associate Editor	Journal Stochastic Analysis and Applications (Print ISSN: 0736-2994 Online ISSN: 1532-9356), https://www.tandfonline.com/loi/ljaa2 ;
2018 -	Associate Editor	AIMS Mathematics (AIMS Press), http://www.aimspress.com/journal/Math
2020 – 21	Guest Editor (con Matteo Brachetta)	Special Issue <i>Stochastic Optimization Methods in Economics, Finance and Insurance</i> , Mathematics ISSN 2227-7390 https://www.mdpi.com/journal/mathematics .

VIII.B- Referee di riviste internazionali

Finance and Stochastics
Annals of Applied Probability
Insurance: Mathematics and Economics
Annals of Operations Research
European Journal of Operational Research
Scandinavian Actuarial Journal
Mathematical Methods of Operations Research
Operation Research Letters
Decisions in Economics and Finance
Journal of Applied Probability
Applied Mathematics and Optimization
Journal of Stochastic Analysis and Applications
IEEE Transaction and Automatic Control,
Journal of Mathematical Analysis and Applications
Stochastics: An International Journal of Probability and Stochastic Processes
International Journal of Theoretical and Applied Finance
ASMB Applied Stochastic Models in Business and Industry

IMA Journal of Management Mathematics
AIMS Quantitative Finance and Economics
RISKS
Brazilian Journal of Probability and Statistics
Hacettepe Journal of Mathematics and Statistics

VIII.C- Referee VQR e Valutazione Progetti di Ricerca

Periodo	Tipologia
10/2021 – 10/2022	Valutazione quadriennale della Ricerca VQR, 2015-2019
2015	Valutazione quadriennale della Ricerca VQR, 2011-2014
2011	University Research Project, Università di Milano
2013	University Research Project, Dipartimento di Statistica, Università di Roma “La Sapienza”
2014	University Research Project, Università di Padova (prot. CPDA143827)
2017	University Research Project, Università di Padova, 2017 (prot. BIRD172407).

Part IX– Pubblicazioni

1. M.Brachetta, C.Ceci “A Stochastic Control Approach to Public Debt Management”, <http://arxiv.org/abs/2107.10491>, in corso di accettazione su *Mathematics and Financial Economics* **2022**.
2. C.Ceci, K.Colaneri, A.Cretarola “Optimal Reinsurance and Investment under Common Shock Dependence Between Financial and Actuarial Markets”, *Insurance: Mathematics and Economics* **2022**. <https://doi.org/10.1016/j.insmatheco.2022.04.011>
3. M.Brachetta, C.Ceci: “Optimal reinsurance problem under fixed cost and exponential preferences”, *Mathematics*, vol. 9 (295), pp. 1-20. **2021**.
4. M.Brachetta and C.Ceci: “A BSDE-based approach for the optimal reinsurance problem under partial information”, *Insurance: Mathematics and Economics*, 95, pp. 1-16, **2020**.
5. C.Ceci, K.Colaneri, A.Cretarola: “Indifference pricing of pure endowments via BSDEs under partial information”, *Scandinavian Actuarial Journal*, published online **2020**, <https://doi.org/10.1080/03461238.2020.1790030>.
6. G.Callegaro, C.Ceci, G.Ferrari: “Optimal reduction of public debt under partial observation of the economic growth”, *Finance and Stochastics*, **2020**, <https://doi.org/10.1007/s00780-020-00438-z>.
7. C.Ceci, K.Colaneri, R.Frey, V.Koeck :“Value adjustments and dynamic hedging of Reinsurance Counterparty Risk”, *SIAM Journal on Financial Mathematics*, 11 (3), pp. 788-814. **2020**.
8. L.Bo-C.Ceci: “Locally Risk-Minimizing Hedging of Counterparty Risk for Portfolio of Credit Derivatives”, *Applied Mathematics and Optimization* (First Online 01 January 2019), 82, pp. 799-850, **2020**.
9. M.Brachetta-C.Ceci: “Optimal Excess-of-Loss Reinsurance for Stochastic Factor Risk Models”, *RISKS*, special issue: Applications of Stochastic Optimal Control to Economics and Finance, **2019**, 7 (2), [doi:10.3390/risks7020048](https://doi.org/10.3390/risks7020048)
10. M.Brachetta-C.Ceci: “Optimal proportional reinsurance and investment for stochastic factor models”, *Insurance: Mathematics and Economics*, 87, pp. 15-33, **2019**.
11. C.Ceci-K.Colaneri-A.Cretarola: “Unit-linked life insurance policies: optimal hedging in partially observable market models”, *Insurance: Mathematics and Economics* 76, pp 149-163, **2017**.
12. C.Ceci-K.Colaneri-A.Cretarola: “The Follmer-Schweizer decomposition under incomplete information”, *Stochastics*, 89, pp 1166-1200, **2017**.
13. C.Ceci, K.Colaneri: “Recent Advances in Nonlinear Filtering with a Financial Application to Derivatives Hedging under Incomplete Information”, in *Bayesian Inference*, ISBN 978-953-51-3578-4, INTECH **2017**.
14. C.Ceci-K.Colaneri-A.Cretarola: “Local risk-minimization under restricted information on asset prices”, *Electronic Journal of Probability*, 20 (96) pp 1–30, **2015**.

15. C.Ceci-K.Colaneri-A.Cretarola: "Hedging of unit-linked life insurance contracts with unobservable mortality hazard rate via local risk-minimization", *Insurance: Mathematics and Economics*, 60, p. 47-60, **2015**.
16. C.Ceci, A.Cretarola, F.Russo: "BSDES under partial information and financial applications", *Stochastic Processes and their Applications*, 124, p. 2628-2653, **2014**, <http://dx.doi.org/10.1016/j.spa.2014.03.003>.
17. C.Ceci, K.Colaneri, A.Cretarola: "A benchmark approach to risk-minimization under partial information", *Insurance: Mathematics and Economics*, 55, p.129-146, **2014**.
18. C.Ceci, K.Colaneri: "The Zakai equation of nonlinear filtering for jump-diffusion observation: existence and uniqueness", *Applied Mathematics and Optimization*, 69 (1), p.47-82, **2014**. *Online first*. <http://link.springer.com/article/10.1007/s00245-013-9217-1>.
19. C.Ceci, A.Cretarola, F.Russo: "GKW representation theorem under restricted information. An application to risk-minimization", *Stochastics and Dynamics*, 14 (2), **2014**. *Online first*. <http://www.worldscientific.com/doi/abs/10.1142/S0219493713500196>.
20. C.Ceci: "Optimal investment-consumption for partially observed jump-diffusions" **Progress in Probability**, Vol. 67, 337-361, **2013**, *Seminar on Stochastic Analysis, Random Fields and Applications VI (Ascona, Switzerland, May 23- May 25, 2011)* R. C. Dalang, M. Dozzi, F. Russo, eds, Springer.
21. C.Ceci, K.Colaneri: "Nonlinear filtering for jump diffusion observations", *Advances in Applied Probability*, 44 (3) p. 678-701, **2012**.
22. C. Ceci: "Utility maximization with intermediate consumption under restricted information for jump market models", *International Journal of Theoretical and Applied Finance*, 15 (6) **2012**, p. 24-58.
23. C.Ceci, A.Gerardi: "Utility indifference valuation for jump risky assets", *Decisions in Economics and Finance*, 34 (2) **2011**, p. 85-120.
24. C.Ceci: "Optimal investment problems with marked point stock dynamics", **Progress in Probability**, Vol. 63, 385-412, **2011**, *Seminar on Stochastic Analysis, Random Fields and Applications VI (Ascona, Switzerland, May 19- May 23, 2008)* R. C. Dalang, M. Dozzi, F. Russo, eds, Birkhäuser Verlag Basel/Switzerland.
25. C.Ceci, A.Gerardi: "Wealth optimization and dual problems for jump stock dynamics with stochastic factor" *Stochastics*, 82 (5) October **2010**, 403-425.
26. Ceci, A. Gerardi: "Utility-based hedging and pricing with a nontraded asset for jump processes", *Nonlinear Analysis* 71 (12) e1953-e1969, **2009**.
27. C.Ceci: "An HJB approach to exponential utility maximization for jump processes", *International Journal of Risk Assessment and Management*, 11 (1/2) 104-121, **2009**.
28. C.Ceci, A. Gerardi: "Pricing for geometric marked point processes under partial information: entropy approach" *International Journal of Theoretical and Applied Finance*, 12 (2) 179-207, **2009**.
29. C.Ceci: "Option hedging for high frequency data models", *Applied and Industrial Mathematics in Italy II*, selected Contributions from the 8th SIMAI Conference, edited by V. Cutello, G. Fotia, L. Puccio **2007**.
30. C.Ceci: "Risk minimizing hedging for a partially observed high frequency data model", *Stochastics*, 78 (1) 13-31, **2006**.
31. C.Ceci, A.Gerardi: "A model for high frequency data under partial information: a filtering approach", *International Journal of Theoretical and applied Finance*, 9 (4)555-576, **2006**.
32. C.Ceci, A.Gerardi: "Modelling a multitype branching brownian motion: filtering of a measure-valued process" *Acta Applicandae Mathematicae*, 91, 39-66, **2006**.
33. C.Ceci, A.Gerardi: "Multitype branching processes observing particles of a given type", *Journal of Applied Probability*, 42 (2) 305-325, **2005**.
34. C.Ceci, B.Bassan: "Mixed optimal stopping and stochastic control problems with semicontinuous final reward for diffusion processes", *Stochastics and Stochastic Reports*, 76 (4) 323-337, **2004**.
35. C.Ceci, L.Mazliak: "Optimal design in nonparametric life testing", *Statistical Inference for Stochastic Processes*, 7 (3) 305-325, **2004**.
36. B.Bassan, C.Ceci: "Regularity of the value function and viscosity solutions in optimal stopping problems for general Markov processes", *Stochastics and Stochastic Reports*, 74, 633-649, **2002**.
37. C.Ceci, A.Gerardi, P.Tardelli: "Existence of optimal controls for partially observed jump processes", *Acta Applicandae Mathematicae*, 74 (2) 155-175, **2002**.
38. B.Bassan, C.Ceci: "Optimal stopping with discontinuous reward: regularity of the value function and viscosity solution", *Stochastics and Stochastic Reports*, 72, 55-77, **2002**.
39. C.Ceci, A.Gerardi: "Conditional law of a branching process observing a subpopulation", *Journal of Applied Probability*, 39 (1) 112-122, **2002**.

40. C.Ceci, A.Gerardi: "Controlled partially observed jump processes: dynamics dependent on the observed history", *Nonlinear Analysis*, 47 (4) 2449-2460, **2001**.
41. C.Ceci, A.Gerardi, P.Tardelli: "An approximation method for partially observed controlled discrete jump processes", *IEEE Trans. Automat. Control*, 46 (12) 1850-1859, **2001**.
42. C.Ceci, A.Gerardi: "Nonlinear filtering equation of a jump process with counting observations", *Acta Applicandae Mathematicae*, 66 (2) 139-154, **2001**.
43. C.Ceci, A.Gerardi, P.Tardelli: "An estimate of the approximation error in the filtering of a discrete jump Markov process", *Math. Models Methods Appl. Sci.*, 11, 2, 181-198, **2001**.
44. C.Ceci, A.Gerardi: "Filtering of a Markov jump process with counting observations", *Applied Mathematics and Optimization* 42 (1) 1-18, **2000**.
45. C.Ceci, A.Gerardi: "Optimal control and filtering of the reproduction law of a branching process", *Acta Applicandae Mathematicae*, 55 (1) 27-50, **1999**.
46. C.Ceci, A.Gerardi: "Partially observed control of a Markov jump process with counting observations: equivalence with the separated problem", *Stochastic Processes and their Applications*, 78 (2) 245-260, **1998**.
47. B.Bassan, C.Ceci: "An optimal stopping problem arising from a decision model with many agents", *Probab. Engrg. Inform. Sci.*, 12, 3, 393-408, **1998**.
48. C.Ceci, A.Gerardi: "Filtering of a branching process given its split times", *Journal of Applied Probability*, 34 (3) 565-574, **1997**.
49. C.Ceci, A.Gerardi, L.Mazliak: "Some results about stopping times on the marked tree space", *Theory of Probability and Its Applications*, 41 (3) 425-435, **1996**.
50. C.Ceci, A.Gerardi, L.Mazliak: "Optimal stopping of branching Brownian motion: an estimation about the smallest optimal stopping time", *Forecasting and modelling for chaotic and stochastic system*, A.Bellacicco, G.Koch, A.Vulpiani (eds), coll. scient. F. Angeli, pp.75-89, **1995**.
51. C.Ceci: "Alberi e moto browniano ramificato: discussione di alcuni problemi di controllo", tesi di dottorato, **1995**.
52. C.Ceci, L.Mazliak: "Controlled Trees", *Rebrape*, 8 (2) 93-105, **1994**.
53. C.Ceci, L.Mazliak: "Une propriete forte de branchements", *C.R. Acad. Sci. Paris*, t.315, Ser.I, 851-853, **1992**.

PREPRINTS

1. M.Brachetta, G. Callegaro, C.Ceci, C.Sgarra (2022) "Optimal reinsurance via BSDEs in a partially observable contagion model", in progress.
2. C.Ceci, M. Bufalo, G. Orlando (2022) "Modelling the industrial production of electric and gas utilities through a stochastic three-factor model", sottomesso per pubblicazione;
3. M. Bufalo, C.Ceci, G. Orlando (2022) "Tackling the cost of natural disasters in the time of global warming", sottomesso per pubblicazione.

Data: 17 giugno 2022