

Antonio Luciano Martire
Curriculum Vitale

INFORMAZIONI GENERALI

Cognome e Nome Antonio Luciano Martire

ATTIVITA' DI RICERCA

• Date (da – a) 01.08.2022 – in corso
• Nome e indirizzo del datore di lavoro Dipartimento di Economia Aziendale– Università degli Studi di Roma 3
• Tipo di impiego Ricercatore universitario ai sensi dell'art. 24, c. 3, lettera A) L. 240/2010, settore scientifico-disciplinare SECS-S/06 METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCEINZE ATTUARIALI E FINANZIARIE

• Date (da – a) 01.02.2022 – 31.07.2022
• Nome e indirizzo del datore di lavoro Dipartimento di Economia – Università degli Studi di Genova
• Tipo di impiego contratto relativo al conferimento di un assegno a tempo determinato per la collaborazione ad attività di ricerca (art. 22 L. 240/2010) per il programma denominato "Metodi matematici per l'economia, la finanza e le assicurazioni", settore scientifico-disciplinare SECS-S/06 METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCEINZE ATTUARIALI E FINANZIARIE

• Date (da – a) 01.12.2020 – 30.11.2021
• Nome e indirizzo del datore di lavoro Dipartimento di Metodi e Modelli per l'Economia, il Territorio e la Finanza della Sapienza Università di Roma
• Tipo di impiego contratto per il conferimento di un assegno di collaborazione ad attività di ricerca ai sensi dell'art. 22 L. 240/2010, settore scientifico-disciplinare SECS-S/06 METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCEINZE ATTUARIALI E FINANZIARIE

• Date (da – a) 01.10.2019 – 30.09.2020
• Nome e indirizzo del datore di lavoro Dipartimento di Metodi e Modelli per l'Economia, il Territorio e la Finanza della Sapienza Università di Roma
• Tipo di impiego contratto per il conferimento di un assegno di collaborazione ad attività di ricerca ai sensi dell'art. 22 L. 240/2010, settore scientifico-disciplinare SECS-S/06 METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCEINZE ATTUARIALI E FINANZIARIE

• Date (da – a) 01.10.2018 – 30.09.2019
• Nome e indirizzo del datore di lavoro Dipartimento di Metodi e Modelli per l'Economia, il Territorio e la Finanza della Sapienza Università di Roma
• Tipo di impiego contratto per il conferimento di un assegno di collaborazione ad attività di ricerca ai sensi dell'art. 22 L. 240/2010, settore scientifico-disciplinare SECS-S/06 METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCEINZE ATTUARIALI E FINANZIARIE

ISTRUZIONE E FORMAZIONE

• Date (da – a) Da novembre 2013 ad ottobre 2014
• Nome e tipo di istituto di istruzione o formazione Scuola Superiore dell'Economia e delle Finanze
• Titolo di studio conseguito Diploma di Specializzazione in Econometria Applicata VIII Edizione

- Date (da – a) 17 febbraio 2012
- Nome e tipo di istituto di istruzione o formazione Sapienza – Università di Roma – Scuola di Dottorato in Economia
- Titolo di studio conseguito Dottorato di Ricerca in Matematica per le applicazioni economico-finanziarie

- Date (da – a) 15 luglio 2008
- Nome e tipo di istituto di istruzione o formazione Sapienza – Università di Roma – Facoltà di Scienze Matematiche Fisiche e Naturali
- Titolo di studio conseguito Laurea in Matematica (quadriennale)

PROGETTI DI RICERCA (partecipazione)

- Progetto di Ateneo 2019 - Participation to the research project Life market: a renewal boost for quantitative management of longevity and lapse risks, Sapienza Università di Roma.
- Progetto di Ateneo 2020 - Participation to the research project Actuarial and financial risk management solutions in a pandemic mortality framework, Sapienza Università di Roma.

PUBBLICAZIONI

Tesi di dottorato: Embedded surrender option pricing for equity-linked policies: comparisons and solutions for bivariate models, Roma, Febbraio 2012

Paolo De Angelis, Antonio Luciano Martire & Emilio Russo (2016). A bivariate model for evaluating equity-linked policies with surrender option. *Scandinavian Actuarial Journal*, 2016:3, 246-261, DOI: 10.1080/03461238.2014.924433

Paolo De Angelis, Roberto De Marchis, Antonio Luciano Martire (2020). A new numerical method for a class of Volterra and Fredholm integral equations. *Journal of Computational and Applied Mathematics* 379, 112944

Paolo De Angelis, Roberto De Marchis, Antonio Luciano Martire, Immacolata Oliva (2020). A mean-value Approach to solve fractional differential and integral equations. *Chaos, Solitons and Fractals* 138, 109895

Paolo De Angelis, Roberto De Marchis, Antonio Luciano Martire, Stefano Patri (2020). Non-Standard Volterra Integral Equations: A Mean-Value Theorem Numerical Approach. *Applied Mathematical Sciences*, Vol. 14, 2020, no. 9, 423 - 432

Paolo De Angelis, Roberto De Marchis, Mario Marino, Antonio Luciano Martire, Immacolata Oliva (2021). Betting on bitcoin: a profitable trading between directional and shielding strategies. *Decisions in Economics and Finance*, 44:883–903. <https://doi.org/10.1007/s10203-021-00324-z>

Paolo De Angelis, Roberto De Marchis, Mario Marino, Antonio Luciano Martire, Immacolata Oliva. Evaluating Ruin Probabilities: a Streamlined Approach. *Applied Mathematics E-Notes* 21(2021), 634-642.

Paolo De Angelis, Roberto De Marchis, Antonio Luciano Martire, Emilio Russo (2022). A flexible lattice framework for valuing options on assets paying discrete dividends and variable annuities embedding GMWB riders. *Decisions in Economics and Finance*, 45:415–446. <https://doi.org/10.1007/s10203-022-00371-0>

Antonio Luciano Martire (2022), Volterra integral equations: An approach based on Lipschitz-continuity. *Applied Mathematics and Computation*, Volume 435, 2022, 127496, ISSN 0096-3003. <https://doi.org/10.1016/j.amc.2022.127496>.

Denis Velu, Roberto De Marchis, Mario Marino, Antonio Luciano Martire, (2022). An Alternative Numerical Scheme to Approximate the Early Exercise Boundary of American Options. *Mathematics*, 11, 187. <https://doi.org/10.3390/math11010187>

Antonio Martire, Emilio Russo, Alessandro Staino, (2023). Surrender and path-dependent guarantees in variable annuities: integral equation solutions and benchmark methods. *Decisions in Economics and Finance* <https://doi.org/10.1007/s10203-022-00383-w>

Libri

P. De Angelis, R. De Marchis, M. Marino; A. L. Martire - *Lezioni di Matematica Finanziaria* - G. Giappichelli EDITORE, Torino, 2019

P. De Angelis, R. De Marchis, M. Marino; A. L. Martire - *Lezioni di Matematica Finanziaria* - G. Giappichelli EDITORE, Torino, 2021 (seconda edizione)

Recenti atti di convegno in qualità di relatore

XXXVI Conferenza AMASES, Vieste (Fg), Settembre 2012

A lattice model for valuing options on assets with discrete dividends. XXXVII Convegno AMASES, Stresa (VB), Settembre 2013

A bivariate lattice for valuing options on assets paying discrete dividends, Convegno DYSES 2014, Siviglia (Spagna), Settembre 2014

A different numerical method for a class of Volterra and Fredholm integral equations. X Giornata della Ricerca, Facoltà di Economia dell'Università degli Studi di Roma "La Sapienza", Febbraio 2019

Non-Standard Volterra Integral Equations: a Weighted Mean-Value Theorem Approach. XI Giornata della Ricerca, Facoltà di Economia dell'Università degli Studi di Roma "La Sapienza", Febbraio 2020

Betting on Bitcoin: a profitable trading between directional strategies and Deep Learning. Online International Conference in Actuarial science, data science and finance, Aprile 2020

Virtual 24th International Congress on Insurance: Mathematics and Economics (luglio 2021). Relatore del lavoro: A Volterra Integral Equation Numerical Approach to Evaluate Variable Annuities Embedding Different Guarantees

Longevity 16 – Agosto 2021. Relatore del lavoro: A Volterra Integral Equation Numerical Approach to Evaluate Variable Annuities Embedding Different Guarantees

AMASES 2021 – Settembre 2021. Relatore del lavoro: Surrender and path-dependent guarantees in variable annuities: integral equation solutions

AMASES 2022 – Settembre 2022. Relatore del lavoro: Ruin Probabilities in the Classical Compound Poisson Risk Model: an approach based on Lipschitz-continuity

Poster

XIX Workshop on Quantitative Finance Roma, Gennaio, 2018.

XXI WORKSHOP ON QUANTITATIVE FINANCE, Napoli, Gennaio 2020

ATTIVITA' DIDATTICA

Attività didattica

Febbraio 2013 - Settembre 2013 – professore a contratto a seguito della stipula di contratto di supporto alla didattica per lo svolgimento di attività connesse alla materia di Matematica Finanziaria – I Canale per l'a.a 2012/2013, Facoltà di Economia, Università degli Studi di Roma Tre

Febbraio 2018 - Gennaio 2019 - Docente a contratto del Corso Finanza Quantitativa (9 CFU) presso la Facoltà di Economia – Sapienza, Università di Roma.

Febbraio 2019 - Gennaio 2020 - Docente a contratto del Corso Finanza Quantitativa (9 CFU) presso la Facoltà di Economia – Sapienza, Università di Roma.

Gennaio 2022 - Docente del corso Neural Network for Economists (16 ore) - European Ph.D. in Socio-Economics and Statistical Studies – Sapienza, Università di Roma.

Giugno 2022 - Matlab application in Finance (10 ore) - Master of Science in Financial Engineering and Risk Management - Metropolitan Tirana University, Tirana (Albania).

Settembre 2022 - Docente del corso Precorso di Matematica Generale (30 ore) - Dipartimento di Economia Aziendale – Facoltà di Economia, Università degli Studi di Roma 3.

Ottobre 2022 – Dicembre 2022 - Docente del corso Matematica Generale (20 ore) - Dipartimento di Economia Aziendale – Facoltà di Economia, Università degli Studi di Roma 3.

ATTIVITA' EDITORIALI

Academic editor della rivista Plos One, Topical Advisory Panel Member della rivista Axioms. Attività di referaggio per Mathematics, Axioms, Helyon. Open Mathematics; Iranian Journal of Science and Technology, Transactions A: Science, Symmetry, Risks, Mathematics, Energies.

09/01/2023

Antonio Luciano Martire