



ESPERIENZA LAVORATIVA

UNIVERSITÀ DI SIENA – SIENA, ITALIA

RICERCATORE A TEMPO DETERMINATO RTT – 10/2024 – ATTUALE

STAT-04/A Metodi matematici dell'economia e delle scienze attuariali e finanziarie (già SSD SECS-S/06).

GSD 13/STAT-04 (già SC 13/D4)

Dipartimento di Economia politica e statistica (DEPS)

UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI PERUGIA – PERUGIA, ITALIA

ASSEGNISTA DI RICERCA – 04/2024 – 09/2024

GSD: 13/STAT-04 (già SSD: SECS-S/06)

Dipartimento di Economia

SAPIENZA UNIVERSITÀ DI ROMA – ROMA, ITALIA

ASSEGNISTA DI RICERCA – 04/2023 – 04/2024

SSD: SECS-S/06

Dipartimento di Metodi e Modelli per l'Economia, il Territorio e la Finanza

Facoltà di Economia

ISTRUZIONE E FORMAZIONE

2019 – 2023 Roma

DOTTORATO DI RICERCA IN MODELLI PER L'ECONOMIA E LA FINANZA Sapienza Università di Roma - Facoltà di Economia

Voto finale lode | **Tesi** Discrete time models for bid-ask pricing under Dempster-Shafer theory

2017 – 2019 Perugia

LAUREA MAGISTRALE IN FINANZA E METODI QUANTITATIVI PER L'ECONOMIA (LM-16) Università degli studi di Perugia -

Dipartimento di Economia

Voto finale 110/110 e lode | **Tesi** L'analisi del rischio sistemico nel contesto bancario: una generalizzazione del modello di Marshall-Olkin

2014 – 2017

LAUREA IN ECONOMIA (L-18) Università degli studi di Perugia - Dipartimento di Economia

Voto finale 110/110 e lode

COMPETENZE LINGUISTICHE

Lingua madre: **ITALIANO**

Altre lingue:

	COMPRENSIONE		ESPRESSIONE ORALE		SCRITTURA
	Ascolto	Lettura	Produzione orale	Interazione orale	
INGLESE	B2	B2	B2	B2	B2

Livelli: A1 e A2: Livello elementare B1 e B2: Livello intermedio C1 e C2: Livello avanzato

COMPETENZE

R, Python, Matlab | Utilizzo e gestione della piattaforma e-learning Moodle | Padronanza del pacchetto Microsoft Office, compreso l'utilizzo avanzato con VBA di MS Excel

PUBBLICAZIONI

2025

[A two-player newsvendor game with competition on demand under ambiguity](#)

DOI = 10.1016/j.ijar.2025.109546

Cinfrignini A., Lorenzini S., Petturiti D., International Journal of Approximate Reasoning, 187, 109546

Link <https://www.sciencedirect.com/science/article/pii/S0888613X25001872?via%3Dihub>

2025

Behavioral dynamic portfolio selection with S-shaped utility and epsilon-contaminations

European Journal of Operational Research, Volume 325, Issue 3, 2025, Pages 500-515, ISSN 0377-2217, <https://doi.org/10.1016/j.ejor.2025.03.029>.

Cinfrignini A., Petturiti D., Vantaggi B., European Journal of Operational Research, 2025

Autori: Cinfrignini A., Petturiti D., Vantaggi B. | **Nome della pubblicazione:** European Journal of Operational Research | **Volume, numero, pagine:** 10.1016/j.ejor.2025.03.029

Link <https://www.sciencedirect.com/science/article/pii/S0377221725002267?via%3Dihub>

2025

Behavioral Dynamic Portfolio Selection via Epsilon-Contaminations

In: Lesot, MJ., *et al.* Information Processing and Management of Uncertainty in Knowledge-Based Systems. IPMU 2024. Lecture Notes in Networks and Systems, vol 1176. Springer, Cham. https://doi.org/10.1007/978-3-031-73997-2_16

<https://link.springer.com/book/10.1007/978-3-031-73997-2>

Cinfrignini A., Petturiti D., Vantaggi B.. IPMU 2024

Link <https://link.springer.com/book/10.1007/978-3-031-73997-2>

2024

Imprecise Dynamic Value-at-Risk Induced by a DS-Bivariate Random Walk

In: Destercke, S., Martinez, M.V., Sanfilippo, G. (eds) Scalable Uncertainty Management. SUM 2024. Lecture Notes in Computer Science(), vol 15350. Springer, Cham. https://doi.org/10.1007/978-3-031-76235-2_9

Cinfrignini A., Petturiti D., Vantaggi B., SUM 2024

Link https://link.springer.com/chapter/10.1007/978-3-031-76235-2_9

2024

Newsvendor problem with discrete demand and constrained first moment under ambiguity

Decisions in Economics and Finance

<https://link.springer.com/article/10.1007/s10203-024-00477-7>

Cinfrignini A., Petturiti D., Stabile G.

2024

Market consistent bid-ask option pricing under Dempster-Shafer uncertainty

<https://www.tandfonline.com/doi/full/10.1080/14697688.2024.2353318>

Cinfrignini A., Petturiti D., Vantaggi B.. Quantitative Finance, 1–20.

2023

Discrete time models for bid-ask pricing under Dempster-Shafer uncertainty

<https://iris.uniroma1.it/handle/11573/1683614>

Cinfrignini A.. PhD Thesis

2023

Dynamic bid-ask pricing under Dempster- Shafer uncertainty

<https://www.sciencedirect.com/science/article/pii/S0304406823000642?via%3Dihub>

2023
Envelopes of equivalent martingale measures and a generalized no-arbitrage principle in a finite setting

DOI: 10.1007/s10479-022-05126
<https://link.springer.com/article/10.1007/s10479-022-05126-z>

Cinfrignini A., Petturiti D., Vantaggi B.. Annals of Operations Research, 321, pp. 103–137.

2023
Dynamic pricing in a frictional market under Dempster-Shafer uncertainty

Extended abstract at Workshop Annuale del Dipartimento di Economia 2023
<https://zenodo.org/records/10053875>

Cinfrignini A., Petturiti D., Vantaggi B.. Extended abstract, WADE 2023

2023
Dynamic risk measures and non-linear pricing rules generated by a bivariate Dempster-Shafer process

Extended abstract in book of abstract Dynamics of socio economic systems- DySES 2023, Paula Ortega Peralas (coord), Editorial Universidad de Almeria. ISBN: 978-84-1351-264-8
https://editorial.ual.es/libro/dynamics-of-socio-economics-systems_149901/

Cinfrignini A., Petturiti D., Vantaggi B.. Extended abstract DySES 2023

2022
Markov and Time-Homogeneity Properties in Dempster-Shafer Random Walks

In: Ciucci D., Couso I., Medina J., Ślęzak D., Petturiti D., Bouchon-Meunier B., Yager R.R. (Eds.), Information Processing and Management of Uncertainty in Knowledge-Based Systems, Volume 1601 of Communications in Computer and Information Science, Springer, pp. 784-797 - 19th International Conference, IPMU 2022, Milan, Italy, July 11-15, 2022, Proceedings.

https://link.springer.com/chapter/10.1007/978-3-031-08971-8_63

Cinfrignini A., Petturiti D., Vantaggi B.. IPMU 2022

2022
Pricing through the Choquet integral

Annali del dipartimento di Metodi e Modelli per l'Economia, il Territorio e la Finanza, pp. 1-17, DOI: 10.13133/2611-6634/1392 - ISSN 2611-6634
https://rosa.uniroma1.it/rosa02/annali_memotef/article/view/1392/1331

Cinfrignini A. Annali del dipartimento di MEMOTEF

● **PARTECIPAZIONE A CONFERENZE COME RELATORE**

23/05/2025 – 23/05/2025
Workshop on the activities of the research project PRIN 2022

Workshop on the activities of the research project PRIN 2022 Models for dynamic reasoning under partial knowledge to make interpretable decisions - 2022AP3B3B – CUP: J53D23004340006

Titolo della presentazione: "An epsilon-contaminated two-player neesvendor game with competition on demand". Co-autori: S. Lorenzini, D. Petturiti.
Perugia (Italy)

15/04/2025 – 18/04/2025
Workshop on Quantitative Finance (QFW2025)

Titolo della presentazione: "Lower and upper dynamic Value-at-Risk measures induced by a DS-bivariate random walk". Co-autori: D. Petturiti, B. Vantaggi.
Università di Palermo, Palermo.

27/11/2024 – 30/11/2024
The 16th International Conference on Scalable Uncertainty Management

Titolo della presentazione: "Imprecise dynamic Value-at-Risk induced by a DS-Bivariate random walk". Co-autori: D. Petturiti, B. Vantaggi.
Palermo (IT)

05/09/2024 – 07/09/2024

XLVIII Annual meeting of the Italian Association for Mathematics Applied to Social and Economic Sciences (AMASES)

Titolo della presentazione: "Behavioral Dynamic Portfolio Selection via Epsilon-Contaminations"
Co-autori: D. Petturiti, B. Vantaggi.
Ischia (IT)

21/07/2024 – 26/07/2024

The 20th International Conference On Information Processing and Management of Uncertainty In Knowledge-Based Systems (IPMU24)

Titolo della presentazione: "Behavioral Dynamic Portfolio Selection via Epsilon-Contaminations". Co-autori: D. Petturiti, B. Vantaggi.
Lisbona (PT)

26/03/2024 – 27/03/2024

XIV giornata della ricerca MEMOTEF

Titolo della presentazione: "Bid-ask option pricing model under Dempster-Shafer uncertainty". Co-autori: D. Petturiti, B. Vantaggi.
Roma (IT)

17/10/2023 – 20/10/2023

Dynamics of Socio Economic Systems 2023 (DySES)

Titolo della presentazione: "Dynamic risk measures and non-linear pricing rules generated by a bivariate Dempster-Shafer process".
Co-autori: D. Petturiti, B. Vantaggi.
Almeria (SP)

20/09/2023 – 22/09/2023

XLVII Annual meeting of the Italian Association for Mathematics Applied to Social and Economic Sciences (AMASES)

Titolo della presentazione: "Dynamic risk measures generated by a bivariate Dempster-Shafer multiplicative binomial process". Co-autori: D. Petturiti, B. Vantaggi.
Milano (IT)

27/06/2023 – 28/06/2023

XIII giornata della ricerca MEMOTEF

Titolo della presentazione: "Multiplicative binomial processes under ambiguity". Co-autori: D. Petturiti, B. Vantaggi.
Roma (IT)

22/09/2022 – 24/09/2022

XLVI Annual meeting of the Italian Association for Mathematics Applied to Social and Economic Sciences (AMASES)

Titolo della presentazione: "Modeling no-arbitrage in Dempster-Shafer theory to cope with frictions in the market". Co-autori: D. Petturiti, B. Vantaggi.
Palermo (IT)

11/07/2022 – 15/07/2022

The 19th International Conference On Information Processing and Management of Uncertainty In Knowledge-Based Systems (IPMU22)

Titolo della presentazione: "Markov and Time-Homogeneity Properties in Dempster-Shafer Random Walks". Co-autori: D. Petturiti, B. Vantaggi.
Milano (IT)

31/05/2022 – 01/06/2022

XII giornata della ricerca MEMOTEF

Titolo della presentazione: "A generalized no-arbitrage principle in a finite setting". Co-autori: D. Petturiti, B. Vantaggi.
Roma (IT)

19/12/2020 – 21/12/2020

13th International Conference of the ERCIM WG on Computational and Methodological Statistics

Titolo della presentazione: "Envelopes of equivalent martingale measures in an n-nomial market model" Co-autori: D. Petturiti, B. Vantaggi.
Londra (UK)

●	AFFILIAZIONI SCIENTIFICHE
	2022 – ATTUALE AMASES
	2024 – ATTUALE GNAMPA-INdAM
	2024 – ATTUALE EUSFLAT
	2022 – ATTUALE SIPTA

Autorizzo il trattamento dei miei dati personali presenti nel CV ai sensi dell’art. 13 d. lgs. 30 giugno 2003 n. 196 - “Codice in materia di protezione dei dati personali” e dell’art. 13 GDPR 679/16 - “Regolamento europeo sulla protezione dei dati personali”.