

Gianluca Cassese

Università di Milano–Bicocca,
Dipartimento di Economia,
Metodi Quantitativi e Strategie d'Impresa
Edificio U7
via Bicocca degli Arcimboldi, 8
20126 - Milano

Telefono: (39) 02 - 6448.5815
Fax: (39) 02 - 6448.5878
Email: gianluca.cassese@unimib.it
Homepage: <http://www.unimib.it/gianluca-cassese>

Dati Personali

Data di Nascita: 11 dicembre 1963.

Stato civile: coniugato, 4 figli.

Posizione accademica

Professor associato in Economia Politica, 2005;

Abilitazione Scientifica Nazionale, Fascia I, Settore 13/D4, "Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie", 2022.

Istruzione

Laurea in Discipline Economiche e Sociali, Univeristà "Luigi Bocconi", Milano, 1989;

Master of Science, Economics, London School of Economics and Political Science, 1992;

Dottorato di Ricerca, Economia Politica, Università degli Studi di Ancona, 1993;

Visiting Scholar, Department of Economics, Stanford University, 1996.

Occupazione

Università di Milano Bicocca, professore associato confermato SECS P/01, 2008–presente.

Università del Salento, professore associato SECS P/01, 2005–2008.

Università “L. Bocconi”, Milano, ricercatore SECS P/01, 1990–2005.

Aree di Ricerca

Finanza Matematica.

Microeconomia e Teoria delle Decisioni.

Probabilità e Processi Stocastici.

Analisi funzionale: teoremi di rappresentazione.

Teoria della misura.

Pubblicazioni

Articoli su Riviste Internazionali

[Complete and Competitive Financial Markets in a Complex World](#)

Finance and Stochastics

Vol. 25, (2021), 659–688;

<https://doi.org/10.1007/s00780-021-00463-6>;

[A Special Issue on the Mathematics of Subjective Probability,](#)

(con P. Rigo e B. Vantaggi),

Decisions in Economics and Finance,

Vol. 43, (2020), 1–2;

<https://doi.org/10.1007/s10203-020-00286-8>

Citato in: *Math., J. Intel. Fuzzy Sys.*;

[Semilattices, Canonical Embeddings and Representing Measures,](#)

Decisions in Economics and Finance,

Vol. 43, (2020), 55–74;

<https://doi.org/10.1007/s10203-019-00264-9>;

[Nonparametric Estimates of Option Prices and Related Quantities](#),
International Journal of Theoretical and Applied Finance,
Vol. 22, No. 7 (2019), 1950040;
<https://doi.org/10.1142/S0219024919500407>;

[Control Measures on Boolean Algebras](#),
Journal of Mathematical Analysis and Applications
Vol. 478, No. 2 (2019), 764–775;

[Conglomerability and Representations](#),
Journal of Convex Analysis,
Vol. 25, No. 3 (2018), 789–815,
Citato in: *Theo. Dec.*;

[Asset Pricing in an Imperfect World](#),
Economic Theory,
Vol. 64, No. 3 (2017), 539–570,
Citato in: *Appl. Econ., Econometrica, Finance Stoch.*;

[The Theorem of Halmos and Savage under Finite Additivity](#),
Journal of Mathematical Analysis and Applications,
Vol. 437, No. 2 (2016), 870–881;

[A Version of Komlós Theorem for Additive Set Functions](#),
Sankhyā A,
Vol. 78, No. 1 (2016), 105–123
Citato in : *Axioms, J. Func. Anal.*;

[Convergence in Measure under Finite Additivity](#),
Sankhyā A,
Vol. 75, No. 2 (2013), 171–193
Citato in: *J. Math.*;

[Supermartingale Decomposition with a General Index Set](#),
Stochastic Processes and Their Applications,
Vol. 120, No. 7 (2010), 1060–1073;

[Quasi-Martingales wit a Linearly Ordered Index Set](#),
Statistics and Probability Letters,
Vol. 80, No. 5-6 (2010), 421–426;

[Sure Wins, Separating Probabilities and the Representation of Linear Functionals](#),
Journal of Mathematical Analysis and Applications,
Vol. 354, No. 2 (2009), 558–563;

[Finitely Additive Supermartingales](#),
Journal of Theoretical Probability,
Vol. 21, No. 3 (2008), 586–603;

[Asset Pricing With no Exogenous Probability Measure,](#)*Mathematical Finance,*

Vol. 18, No. 1 (2008), 23–54

Citato in : *Econ. Theory, Finance Stoch. (5), Math. Finance;*[Yan Theorem in \$L^\infty\$ with Applications to Asset Pricing,](#)*Acta Mathematicae Applicatae Sinica (English Series),*

Vol. 23, No. 4 (2007), 551–562

Citato in: *Elect. J. Probab., Sib. Math. J., Stat. Meth. Appl., Theo. Probab. Appl., Positivity;*[Decomposition of Supermartingales Indexed by a Linearly Ordered Set,](#)*Statistics and Probability Letters,*

Vol. 77, No. 8 (2007), 795–802;

[Modelling the Italian MIB30 Implied Volatility Surface. Does Market Efficiency Matter?,](#)

(con Massimo Guidolin)

International Review of Financial Analysis,

Vol. 15, No. 5 (2006), 145–178.

Citato in: *Ann. Oper. Res., Applied Econ., Asia-Pacific J. Financ. Stud., Bus. Econ., Comp. Stat. Data Anal., Econ. Model., Emerg. Mkts Fin. Trade, Int. J. Financ. Eng., Int. J. Stat. Probab., Int. Rev. Financ. Anal., J. Algorith., Manag. Sc. Financ. Eng., Quant. Finance, Rev. Behav. Finance, Stat. Comp.;*[A Note on Asset Bubbles in Continuous Time,](#)*International Journal of Theoretical and Applied Finance,*

Vol. 8, No. 4 (2005), 523–536

Citato in: *Ann. Finance, Finance Stoch., Int. J. Theor. Appl. Finance, Mach. Learn. Financ. Engin., Math. Finance (2);*[Pricing and Informational Efficiency of the MIB30 Index Options Market. An Analysis with High Frequency Data,](#)

(con Massimo Guidolin)

Economic Notes,

Vol. 33, No. 2 (2004), 275–321.

Citato in: *Glob. Bus. Econ., Int. J. Manag., Rev. Finance.**Articoli su Riviste Nazionali*

Il Mercato Italiano delle Opzioni sull'Indice di Borsa,

Bancaria,

No. 1 (2003), 87–95;

Arbitrage Theory with Bounded Prices,

International Review of Economics and Business,

Vol. 46 (1999), 233–244;

Incompleteness of Markets and Vagueness of Beliefs,
International Review of Economics and Business,
Vol. 44 (1997), 837–855;

Asset Evaluation under Continuous-time: Some Remarks,
International Review of Economics and Business,
Vol. 42 (1995), 469–483.

Libri

Teoria dei Mercati Finanziari. Un'introduzione, Roma, Carocci 2017.

Contributi a Volumi (con referaggio)

The Representation of Conglomerative Functionals,
in Ferraro M. B., Giordani P., Vantaggi B., Gagolewski M., Gil M. A., Grzegorzewski P. and
Hryniewicz O. (a cura di), *Soft Methods for Data Science*,
Berlin, Springer 2017, 103–112
Citato in: *Theo. Dec.*

Contributi a Volumi

Mercati finanziari, politica monetaria e distribuzione del reddito. Un'interpretazione teorica,
in G. Nardozi (a cura di), *Politica monetaria, profitti e finanza: contributi per l'analisi di alcuni
recenti sviluppi*,
Roma, LUISS Univeristy Press 2007, 87–122;

Il Mercato degli Strumenti Derivati in Italia,
in Fondazione Rosselli, *Settimo Rapporto sul Sistema Finanziario Italiano*,
Roma, Edibank 2002, 163-180.

Lavori non ancora pubblicati

[A Minimax Lemma and the Domination Property](#)

lavoro sottoposto per la pubblicazione, 2021, ArXiv 2103.16454;

[Kelley's Theorem and Some Related Results,](#)

lavoro sottoposto per la pubblicazione, 2020, ArXiv 1909.10465;

[Positively Ordered Monoids, \$\kappa\$ -ideals, Projections,](#)

lavoro sottoposto per la pubblicazione, 2020, ArXiv 1907.10400;

Convegni e conferenze

Conferenze organizzate

Second Workshop on The Mathematics of Subjective Probability,

Università Milano-Bicocca,

Milano, 1 - 3 Settembre 2021

(membro del comitato organizzatore e del comitato scientifico);

Fisrt Workshop on The Mathematics of Subjective Probability,

Università Milano-Bicocca, Università degli Studi di Pavia e Università "L. Bocconi",

Milano, 3 - 5 Settembre 2018

(membro del comitato organizzatore e del comitato scientifico);

Conferenze internazionali

XLIII Riunione AMASES

Perugia, 9 Settembre – 11 Settembre 2019

(relatore);

Society for the Advancement of Economic Theory

2019 World Conference,

Ischia, 30 Giugno – 6 Luglio 2019

(relatore);

Bachelier Finance Society,

2018 World Congress,

Dublino, 16 – 20 Luglio 2018

(relatore e chair della sessione);

XIX Workshop on Quantitative Finance,
Università degli Studi di Roma Tre,
Roma, 24 – 26 gennaio 2018
(relatore);

First Italian Meeting on Probability and Mathematical Statistics,
Università degli Studi di Torino e Politecnico di Torino,
Torino, 19 – 22 Giugno 2017
(relatore);

Model Uncertainty and Robust Finance,
Università degli Studi di Milano,
Milano, 10 – 11 Novembre 2016
(relatore);

Soft Methods in Probability and Statistics,
Università “La Sapienza”,
Roma, 12 – 14 Settembre 2016
(relatore);

XXXI Convegno AMASES,
Università di Lecce,
Lecce, 3 – 6 Settembre 2007;

VIII Workshop on Quantitative Finance,
Università degli Studi di Perugia,
Milano, 27 – 28 gennaio 2007
(relatore);

VI Workshop of Quantitative Finance,
Università “L. Bocconi”,
Milano, 27 – 28 gennaio 2005
(relatore);

Annual Meeting of the Northern Finance Association,
Calgary, 8 – 10 Ottobre 2002
(relatore);

Econometric Society European Meeting,
Venezia, 25 – 27 Agosto 2002
(relatore);

International Conference on Mathematical Finance,
Hammamet, Tunis, 15 – 17 Giugno 1999
(relatore);

Econometric Society European Meeting,
Toulouse, 25 – 27 Agosto 1997
(relatore).

Seminari recenti

Università di Milano, Dipartimento di Matematica (2016);
Università di Bielefeld (2015);
Università della Svizzera Italiana (2015);
Università di Bologna, Dipartimento di Matematica (2010);
Università degli studi dell'Aquila, Dipartimento di Matematica (2007).

Visiting

Visiting Professor, Institute of Finance, University of Lugano, 1996 – 2018;
Visiting Scholar, Department of Economics, Stanford University, gennaio – settembre 1996.

Partecipazioni scientifiche

Socio dell' *A.M.A.S.E.S.* (Associazione per la Matematica Applicata alle Scienze Economiche e Sociali);
Socio della *SAET* (Society for the Advancement of Economic Theory).

Attività Editoriale

Editorial board

Decisions in Economics and Finance, Springer-Verlag,
Guest Editor dello special issue su
The Mathematics of Subjective Probability.

Attività di referee

Acta Applicanda Mathematica;
Annales Mathematicae Silesianae;
Annals of Applied Probability;
Axioms;
Computational Statistics and Data Analysis;
Finance and Stochastics;
Journal of Applied Mathematics and Computing;
Journal of Economic Theory;
Journal of Mathematical Analysis and Applications;
The Financial Review;
Mathematical Reviews;
Zentralblatt MATH.

Didattica

Laurea triennale

Economia dei Mercati Finanziari, Università Milano Bicocca, 2014-presente;
Teoria dei Mercati Finanziari, Università della Svizzera Italiana, 2012-presente;
Economia Monetaria, Università del Salento, 2006–2008;
Macroeconomia, Università del Salento, 2005–2008;
Economia Internazionale, Università del Salento, 2006–2008.

Laurea magistrale

Finanza Matematica, Università Milano Bicocca, 2013–presente;
Risk Management, Università Milano Bicocca, 2008–presente;
Forme di Mercato, Università Milano Bicocca, 2008–2012;
Financial Modeling, Università della Svizzera Italiana, 2004–2012;
Introduction to Financial Engineering, Università della Svizzera Italiana, 2004–2014;
Teoria dei giochi e Voting, Università del Salento, 2006–2008.

Dottorato di ricerca

DEFAP - Dottorato in Economia Pubblica,
Università Milano-Bicocca, 2010 – 2014.

Continuous-time Finance,
Università di Lugano, 2009–2013;

Dottorato in Scienze Economiche e Matematico-Statistiche,
Università del Salento, 2006–2008.

Dispense didattiche

Finanza Matematica. pp. 1-163,
Università Milano Bicocca.

Risk Management. pp. 1-112,
Università di Milano Bicocca.

Giochi e Strategie per la Politica e le Relazioni Internazionali, pp. 1-69,
Università del Salento, 2006.

An Introduction to Financial Engineering, pp. 1-68,
Università della Svizzera Italiana, 2006.

Uncertainty, Choice and Equilibrium. A Bird's Eye View, pp. 1-63,
Università del Salento, 2005.

Financial Modeling, pp. 1-86,
Università della Svizzera Italiana, 2004.

Options and Futures. An Introduction to Binomial Models, pp. 1-63,
Università Bocconi, 2000.