

LORENZO MERCURI

INFORMAZIONI PERSONALI:

Residenza: Via Tolmino, n. 65, 20099, Sesto san Giovanni
E-mail: lorenzo.mercuri@unimi.it
Cell: 339/7018414
Nazionalità: Italiana
Data e luogo di nascita: 14/03/1978 Petritoli (FM)

POSIZIONI

Ricercatore a tempo determinato in MAT/06 presso il dip. di Economia e Management e Metodi Quantitativi.
Università di Milano dal 20/12/2013.

Assegnista di ricerca presso il dip. di Economia e Management e Metodi Quantitativi.
Università di Milano dal 01/05/2013 al 19/12/2013

Titolo della tematica: “**Inferenza per processi COGARCH: teoria e implementazione numerica**”

Responsabile: Prof. Stefano M. Iacus.

Assegnista di ricerca presso il dip. Dipartimento di Matematica statistica informatica e applicazioni,
Università di Bergamo dal 01/07/2012 al 30/04/2013

Titolo della tematica: “**Ottimizzazione Stocastica e Teoria dei Giochi**”

Responsabile: Prof. Gianfranco Gambarelli

Assegnista di ricerca presso il dip. Metodi Quantitativi per le Scienze Economiche ed Aziendali,
facoltà di Economia, Università degli studi di Milano-Bicocca dal 01/01/2009 al 28/06/2012.

Titolo della tematica: “**Valutazioni di Opzioni in Modelli di tipo Garch**”

Responsabile: Prof. Fabio Bellini.

TITOLI DI STUDIO:

04/12/2006, Università degli Studi Milano-Bicocca. *Dottorato di Ricerca in Matematica per l'Analisi dei Mercati Finanziari*. Tesi di dottorato: “Valutazione delle opzioni in modelli Garch”

04/07/2003. Università Politecnica delle Marche. Laurea in Economia e Commercio (Facoltà di Economia “Giorgio Fuà”). Indirizzo in Economia delle Istituzioni e dei Mercati Finanziari.
Voto 110/110.

BORSE DI STUDIO

Gennaio 2004 – Dicembre 2006, percepito borsa di studio per il Dottorato di Ricerca in Matematica per l'Analisi dei Mercati Finanziari.

PERIODO DI STUDIO ALL'ESTERO

Marzo - Luglio 2005. Aarhus, Danimarca. Visiting Ph.D student Department of Business Studies

ATTIVITA' DI RICERCA:

Pubblicazioni: *Option Pricing in a Conditional Bilateral Gamma model.* con Bellini, F.

Central European Journal of Operations Research (2013) in press .
Presentato al 50th EWGFM Meeting (2012)

Portfolio allocation using multivariate variance gamma models. Con Hitaj, A.
Financial Markets and Portfolio Management (2012) Vol. 27(1) pp 65-99.
Presentato al MAF 2012 Venezia.

Approximation of the Variance Gamma Model with a Finite Mixture of Normals.
Con Loregian, A. e Rroji, E.
Statistics and Probability Letters Vol. 82 (2012) n. 2 Pag. 217-224.
Presentato al XXXV Convegno A.M.A.S.E.S (2011).

Option Pricing in a Dynamic Variance Gamma Model. con Bellini, F.
The Journal of Financial Decision Making Vol. 7 (2011) n. 1 Pag. 37-51.
Presentato al XXXIV Convegno A.M.A.S.E.S (2010).

Pricing Asian Options in affine Garch models. Vol. 14 (2011), n.2 Pag. 313-333.
International Journal of Theoretical and Applied Finance.
Presentato al X Workshop on Quantitative Finance (2009).

Option Pricing in a Garch Models with Tempered Stable Innovations
Finance Research Letters Vol.5 (2008), n. 3 Pag. 172-182.
Presentato al XXXI Convegno A.M.A.S.E.S (2007)

Capitoli di libri:

Portfolio Allocation with Higher Moments. Con Hitaj A.
“Advances in Risk Management” Palgrave MacMillan Series co-Editors
Prof. Batten J. A., Prof. Mackay P. e Prof. Wagner F,.

Risk Measurement Using the Mixed Tempered Stable Distribution con Rroji E.
“Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance”
Springer co-Editors Prof.ssa Cira Perna e Prof.ssa Marilena Sibillo.

Working papers:

Estimation and Calibration of a Dynamic Variance Gamma Model Using Vix Data
Working paper n. 192, Università degli Studi Milano-Bicocca (2010).

A New Affine Stochastic Volatility Model with Normal Variance-Mean Mixture
Working paper n. 172, Università degli Studi Milano-Bicocca (2009).
Presentato al 45th EWGFM Meeting (2009)

Option Pricing in Garch Models. con Bellini, F.
Working paper n. 124, Università degli Studi di Milano-Bicocca, (2007).
Presentato al XL Convegno EWGFM (2007)

Seminari su invito:

• “*Pricing Asian Options in Affine Garch models*”
Giornata di Finanza Matematica CNR-IMATI (2009).

• “*Option Pricing in Garch Models*”
Seminario didattico Politecnico di Milano (2009) **su invito**

ESPERIENZE DIDATTICHE:

Università	Derivatives I Laurea Magistrale ECOFIN, aa (2012-2013)
Milano-Bicocca	Derivatives II Laurea Magistrale ECOFIN, aa (2010-2011) e (2009-2010).
Assistente per i corsi:	Fondamenti di Finanza Quantitativa Laurea Triennale ECOBAN aa (2011-2012), (2010-2011), (2009-2010), (2008-2009).
	Matematica Finanziaria

Laurea Triennale ECOBAN, ECOCOM e ECOTUR.
aa (2008-2009), (2007-2008), (2006-2007), (2005-2006)

Matematica Generale I Laurea Triennale ECOAMM.
aa (2008-2009), (2007-2008), (2005-2006).

Derivatives (Laboratorio Matlab)
master of *Finance and Risk Management*
master of *Energy Risk Management* (2007).

Politecnico di Milano Metodi Matematici per la Finanza
Assistente per i corsi: Laurea Triennale in Ingegneria Gestionale. aa (2007-2008).

Finanza Matematica II.
Laurea Magistrale in Ingegneria Matematica. aa (2009-2010) e (2006-2007).

Università di Bergamo
Assistente per il corso: **Matematica Finanziaria.**
Laurea Triennale in Economia e Commercio. aa (2012-2013).

ALTRE ESPERIENZE:

Responsabile in qualità di tutor per il **terminale Bloomberg** presso la facoltà di Economia, Università degli studi di Milano-Bicocca a.a. 2009-2010. Mansioni svolte:

- Supporto a studenti nell'utilizzo di Bloomberg e delle sue principali funzioni, scarico di dati in Excel e costruzione di grafici
- Supporto a tesisti nella ricostruzione di serie storiche finanziarie e nell'analisi delle stesse
- Costruzione di dataset per attività di ricerca

ALTRE ATTIVITA' E CONOSCENZE:

Lingue straniere: Inglese.

Linguaggi di programmazione: MatLab.

Programmi: QuantLibXL, Pacchetto MicroSoft Office.

Altro: Bloomberg, LaTeX e Referee per "The Journal of Banking & Finance".

Autorizzo il trattamento dei dati personali contenuti nel mio curriculum vitae in base art. 13 del D. Lgs. 196/2003

Firma