

Lorenzo Peccati

Decision Analysis

LORENZO.PECCATI@UNIBOCCONI.IT

Via Roentgen 1, room 3-D2-05

Tel. +39 02 5836.5624 Fax. +39 02 5836.5630

Curriculum Vitae

Laurea in economia presso l'Università Bocconi, Milano, Italia

Posizione accademica e/o attività professionali

Professore a contratto Senior del dipartimento di decisione e Scienze presso l'Università Bocconi.

Vice Rettore per la ricerca e lo sviluppo delle risorse umane.

È membro dell'Associazione per la Matematica Applicata alle Scienze Economiche e Sociali (di cui egli è stato il Segretario generale, membro del comitato scientifico e Vice-Presidente), l'Istituto Italiano degli Attuari (di cui egli è attualmente un membro del Comitato), l'Unione Matematica Italiana, dell'Associazione Italiana per la Ricerca Operativa, American Mathematical Society, l'International Actuarial Association ed EURO - Working Group on Financial Modelling (di cui è attualmente Vice-Presidente).

Egli è membro del Consiglio editoriale del International Journal of Economics di produzione e problemi di funzionalità in Financial Modelling di European Journal of Operational Research. È co-redattore del giornale europeo di ricerca operativa. Ha diretto l'Istituto di matematica finanziaria all'Università di Torino. Ha insegnato nelle Università di Parma, Torino, l'Università statale di Milano, l'Università di San Diego, l'Ecole Normale Supérieure de Cachan (Parigi), in

Interessi di ricerca

- Mercati finanziari in generale.
- Compagnia di assicurazione.
- Finanza aziendale, controllo e gestione.
- Ricerca operativa.
- Economia dell'informazione e incertezza.

Pubblicazioni

Selezione

- Valutazione analitica e sintetica di attività finanziarie, Laterza, 1992;
- Financial Modelling: Recent Research, (with M. Virén, eds.), Physica-Verlag, 1994.
- "Qualitative Analysis of a Nonlinear Stock Price Model, Applied Mathematics and Computation" (with L.L. Ghezzi), 1994;
- "Imitation and stability in a stock market" (with M. Cenci and A. Cerquetti), in European Journal of Operational Research, 1996;
- "Restyling of Fees in Consumer Credit Agreements" (with C. Battaglio and G. Longo), in European Journal of Operational Research, 1996;
- "Revision of Industrial Supply Conditions and Game Theory" (with P. Gallo and E. Luciano), in International Journal of Production Economics, 1997;
- "Antiusury Laws and Market Interest Rate Dynamics" (with D.M. Cifarelli, A. Tagliani), in New Operational Approaches for Financial Modelling, C. Zopounidis (eds.), Physica-Verlag, 1997, 311-322;
- "Corporate Finance and Inventory Management" (with E. Luciano), in International Journal of Production Economics, 1998;
- "Survival Risk and Evaluation of Energy Investment Projects" (with F. Beccacece and P. Gallo), in EURO Working Group on Financial Modelling, Meeting of Vienna, 1999;
- "On Rational Credit Sizing" (with G. Bonaldo and R. Piccarreta), in EURO Working Group on Financial Modelling, Meeting of Valencia, 1999;
- "Cycles optimization: The equivalent annuity and the NPV approaches" (with E. Luciano), in International Journal of Production Economics, 2001;
- "Success of Failure of a Firm under Different Financing Policies: A Dynamic Stochastic Model", in European Journal of Operational Research, 2002;
- "VaR as a Risk Measure for Multiperiod Static Inventory Models" (with E. Luciano and D.M. Cifarelli), International Journal of Production Economics, 81-82 (2003);
- "Sensitivity Analysis in Investment Project Evaluation" (with E. Borgonovo), in International Journal of Production Economics, 81-82 (2004),
- "On the Comparison between the APV and the NPV Computed via the WACC" (with M. Cigola), in European Journal of Operational Research, 161, 2005, 377-385;
- Uncertainty and Global Sensitivity Analysis in the Evaluation of Business Projects, with (E. Borgonovo) International Journal of Production Economics, 2006, 104 (1), pp. 62-73.
- The Importance of Assumptions in Investment Evaluation, (with E. Borgonovo), International Journal of Production Economics, 2006, 101 (2), pp. 298-311;
- On the Quantification and Decomposition of Uncertainty, (with E. Borgonovo) in "Uncertainty and Risk: Mental, Formal, Experimental Representations," M. Abdellaoui, R.D. Luce, M. Machina and B. Munier Editors, Springer-Verlag, 2006, forthcoming;
- Global Sensitivity Analysis in Inventory Management, (with E. Borgonovo), International Journal of Production Economics, 2007, 108 (1-2), pp. 302-313;
- Financial Management in Inventory Problems: Risk Averse vs Risk Neutral Policies, (with E. Borgonovo), International Journal of Production Economics, 2007, forthcoming;
- Sensitivity Analysis in Decision Making: a Consistent Approach, with (E. Borgonovo) in Advances in Decision Making under Risk and Uncertainty, M. Abdellaoui and J. Hey Editors, Springer-Verlag, 2007, forthcoming.