

Giovanni Longo

Curriculum

Laurea in Economia e Commercio presso l'Università degli Studi di Torino, 1992; tesi di Matematica Finanziaria.

Borsista presso l'Università Bocconi nel periodo 1993-1994.

Dottorato di ricerca in 'Matematica per le Decisioni Economiche' presso l'Università degli Studi di Trieste conseguito nel 1999. Tesi di Finanza Matematica.

Ricercatore dal maggio 1998 presso l'Università del Piemonte "Avogadro" nel raggruppamento SECS S06.

Attività didattica

Titolare, negli anni accademici a partire dall'a.a. 99/00, dei corsi "Metodi matematici 1", "Metodi matematici 2", "Modelli matematici per i mercati finanziari", "Pricing di derivati e di prodotti strutturati", "Finanza quantitativa" presso la facoltà di Economia e poi dipartimento DISEI dell'Università del Piemonte orientale. Titolare del corso di "Metodi quantitativi per l'asset management" presso il Master di Economia e gestione degli intermediari finanziari della stessa università negli anni dal 2004 al 2010.

Precedenti attività didattiche presso l'Università di Torino, l'Università Bocconi e la Scuola di Amministrazione Aziendale di Torino (master e diploma).

Docente nel 2006, 2007 e 2009 del corso di Metodi Quantitativi nel Master in Private Banking dell'Università di Torino organizzato congiuntamente con Unicredit Private Banking.

Co-titolare nel corso "Quantitative methods for decision making" alla SAA Torino nel 2021 e 2022.

Interessi scientifici:

Finanza Matematica, in particolare, dinamiche della struttura a termine dei tassi di interesse, valutazione di derivati e di prodotti strutturati, dynamic asset allocation e protezione di portafoglio, scelte finanziarie. Usura e trasparenza di contratti finanziari.

Lavori scientifici:

- “Portfolio insurance by dynamic asset allocation”, presentato al *3rd AFIR International Colloquium*, Roma 1993.
- “GAPV di investimenti industriali e cambi” (con Claudia Battaglio), *Atti del XVII Convegno A.M.A.S.E.S.*, Ischia 1993.
- “Sul cosiddetto effetto paratasse”, *Atti del XVIII Convegno A.M.A.S.E.S.*, Modena 1994.
- “Restyling of fees in consumers credit and their optimization” (con Claudia Battaglio e Lorenzo Peccati), *European Journal of Operational Research* n. 91, 1996.
- “*Derivati dei tassi di interesse e raccolta di istituti di credito*”, Tesi di Dottorato, Università di Trieste, 1998.
- “*Hedging strategies for interest rate derivatives in one factor models*”, Quaderni di Dipartimento, Dipartimento Semeq, Novara, 2001
- “*Valutazione della raccolta tramite c/c di istituti di credito*”, Quaderni di Dipartimento, Dipartimento Semeq, Novara, 2001
- “*Probabilistic techniques for contingent claims evaluation*” (con Fusai, Marena, Vulcano), Atti del convegno di finanza computazionale, Auronzo 2002
- “*Valutazione di barrier option tramite FFT*” (con Gianluca Fusai, Marina Marena), atti del convegno AMASES, Palermo 2005
- “*Grid based full portfolio revaluation for VaR computation*” (con Chinelli, Demartini, Fusai, Marena), *Proceedings of Science*, Palermo, 2006
- “*Calcolo del valore a rischio*” (con Fusai, Marena), ChartAgeos, maggio 2006
- “*Lévy Processes and Option Pricing by Recursive Quadrature*” (con Fusai, Marena, Recchioni), *Journal of Current Issues in Finance, Business, and Economics*, 2008
- “*Handbook of Multi-Commodity Markets and Products: Structuring, Trading and Risk Management*” (con Fusai, Marena), Chapter 18 Asian Option (p. 827-876), Wiley Finance Series, 2015
- “*Interest Rate Structured Products: Can They Improve the Risk-return Profile?*” (con Fusai e Zanotti), <http://dx.doi.org/10.2139/ssrn.2140678>, 2021

Altri lavori

- “Matematica per le Applicazioni Finanziarie” (con Claudia Battaglio), EtasLibri, Milano 1994.