

Tiziano VARGIOLU

Dipartimento di Matematica "Tullio Levi-Civita"
Via Trieste, 63 - 35121 Padova
telefono:
email:

049 / 8271383
vargiolu@math.unipd.it

Curriculum vitae et studiorum

Data e luogo di nascita:
Residenza:
Cittadinanza: italiana
Stato civile:

Studi

- 1996 – 1998** corso di perfezionamento in Matematica presso la Scuola Normale Superiore di Pisa; diploma conseguito il 25/7/2002 con la votazione di **70/70 con lode**;
- 1996 – 1997** corso di Diplome d'Etudes Approfondies (equivalente ad un master) di Probabilità e Applicazioni (indirizzo Finanza) all'Università di Parigi VI "Pierre et Marie Curie" (Francia); diploma conseguito il 23/9/1997 con la votazione **bien**;
- 1992 – 1995** corso ordinario presso la Scuola Normale Superiore di Pisa; diploma conseguito il 24/7/1997 con la votazione di **70/70 con lode**;
- 1991 – 1995** laurea in Matematica presso l'Università degli Studi di Pisa; diploma conseguito il 14/9/1995 con la votazione di **110/110 con lode**;

Esperienze professionali

- 2011** – professore associato nel settore scientifico-disciplinare MAT/06 (Probabilità e Statistica Matematica) nel Dipartimento di Matematica dell'Università di Padova.
- 2004 – 2011** professore associato (confermato nel 2007) nel settore scientifico-disciplinare MAT/06 (Probabilità e Statistica Matematica) nella facoltà di Scienze Matematiche, Fisiche e Naturali dell'Università di Padova.
- 1998 – 2003** ricercatore in ruolo del settore scientifico-disciplinare A02B (Probabilità e Statistica Matematica) nella facoltà di Scienze Matematiche, Fisiche e Naturali dell'Università di Padova.
- 1998** contratto di collaborazione esterna con l'Università di Pisa per consulenza tecnica e predisposizione di materiale didattico per il modulo didattico di Metodi Probabilistici e Statistici e Processi Stocastici del Diploma Universitario in Ingegneria Logistica e della Produzione
- 1995** contratto di collaborazione studenti-università come consulente FORTRAN al Centro di Calcolo della Scuola Normale Superiore (150 ore): sviluppo di miniguide di riferimento per compilatori e di guide per principianti all'utilizzo delle piattaforme UNIX e VMS della Scuola Normale Superiore
- 1994** contratto di collaborazione studenti-università al servizio prestiti della biblioteca della Scuola Normale Superiore (150 ore): esperienza con il software per gestione di biblioteche Alpha

Competenze

- Modellizzazione di fenomeni economici e finanziari attraverso equazioni differenziali stocastiche ordinarie e alle derivate parziali e attraverso processi di Markov a tempi discreti.
- Insegnamento a livello universitario in corsi di analisi e calcolo delle probabilità e statistica.

Conoscenze informatiche

- linguaggi di programmazione conosciuti: C, FORTRAN, BASIC, Maple, Mathematica, MATLAB, VBA, HTML, $\text{\TeX}$, $\text{\LaTeX}$
- sistemi operativi conosciuti: Macintosh, MS DOS, MS Windows, UNIX, OPEN VMS, Linux
- strumenti Internet conosciuti: telnet, ftp, e-mail, WWW browsers (Lynx, Mosaic, Netscape)

Lingue conosciute

italiano: madrelingua

inglese: corrente

francese: letta, parlata e scritta, perfezionata con una permanenza di 6 mesi in Francia per frequentare i corsi del DEA

tedesco: nozioni

polacco: nozioni

Articoli pubblicati su riviste

1. A. Awerkin and T. Vargiolu. Optimal installation of renewable electricity sources: the case of Italy. *Decisions in Economics and Finance*, 44(2):1179–1209, 2021
2. T. Koch and T. Vargiolu. Optimal installation of solar panels with price impact: a solvable singular stochastic control problem. *SIAM Journal of Control and Optimization*, 59(4):3068–3095, 2021
3. F. Fontini, T. Vargiolu, and D. Zormpas. Investing in electricity production under a reliability options scheme. *Journal of Economics, Dynamics and Control*, 126:104004, 2021
4. A. Picarelli and T. Vargiolu. Optimal management of pumped hydroelectric production with state constrained optimal control. *Journal of Economics, Dynamics and Control*, 126:103940, 2021
5. M. Soloviova and T. Vargiolu. Efficient representation of supply and demand curves on day-ahead electricity markets. *Journal of Energy Markets*, 14(1):99–126, 2021
6. M. Piccirilli, M. D. Schmeck, and T. Vargiolu. Capturing the power options smile by an additive two-factor model for overlapping futures prices. *Energy Economics*, 95:105006, 2021
7. L. Andreis, M. Flora, F. Fontini, and T. Vargiolu. Pricing Reliability Options under different electricity price regimes. *Energy Economics*, 87:104705, 2020
8. G. Ferrari and T. Vargiolu. On the singular control of exchange rates. *Annals of Operations Research*, 292:795–832, 2020
9. J. Hinz and T. Vargiolu. Variables reduction in sequential resource allocation problems. *Applied System Innovation*, 3(2):21, 2020
10. R. Aid, M. Basei, G. Callegaro, L. Campi, and T. Vargiolu. Nonzero-sum stochastic differential games with impulse controls: a verification theorem with applications. *Mathematics of Operations Research*, 45(1):205–232, 2020
11. M. Flora and T. Vargiolu. Price dynamics in the European Union Emissions Trading System and evaluation of its ability to boost emission-related investment decisions. *European Journal of Operational Research*, 280(1):383–394, 2020
12. F. E. Benth, M. Piccirilli, and T. Vargiolu. Mean-reverting additive energy forward curves in a Heath-Jarrow-Morton framework. *Mathematics and Financial Economics*, 13(4):543–577, 2019
13. L. Latini, M. Piccirilli, and T. Vargiolu. Mean-reverting no-arbitrage additive models for forward curves in energy markets. *Energy Economics*, 79:157–170, 2019
14. E. Edoli, M. Gallana, and T. Vargiolu. Optimal intra-day power trading with a Gaussian additive process. *Journal of Energy Markets*, 10(4):23–42, 2017
15. G. Callegaro, L. Campi, V. Giusto, and T. Vargiolu. Utility indifference pricing and hedging for structured contracts in energy markets. *Mathematical Methods for Operations Research*, 85(2):265–303, 2017
16. S. Pagliarani and T. Vargiolu. Portfolio optimization in a defaultable Levy driven market model. *OR Spectrum*, 37(3):617–654, 2015
17. A. Capponi, S. Pagliarani, and T. Vargiolu. Pricing vulnerable claims in a Levy driven model. *Finance and Stochastics*, 18(4):755–789, 2014
18. M. Basei, A. Cesaroni, and T. Vargiolu. Optimal exercise of swing contracts in energy markets: an integral constrained optimal control problem. *SIAM Journal on Financial Mathematics*, 5(1):581–608, 2014
19. E. Edoli and T. Vargiolu. Stochastic optimization for the pricing of structured contracts in energy markets. *Argo*, 2:27–36, 2013
20. E. Edoli, D. Tasinato, and T. Vargiolu. Calibration of a multifactor model for the forward markets of several commodities. *Optimization*, 62(11):1553–1574, 2013
21. M. Rosestolato, T. Vargiolu, and G. Villani. Robustness for path-dependent volatility models. *Decisions in Economics and Finance*, 36(2):137–167, 2013

22. E. Edoli, S. Fiorenzani, S. Ravelli, and T. Vargiolu. Modeling and valuing *make-up* clauses in gas swing contracts. *Energy Economics. Winner of the RWE Award as Best Applied Paper.*, 35:58–73, 2013
23. L. Pasin and T. Vargiolu. Optimal portfolio for CRRA utility functions where risky assets are exponential additive processes. *Economic Notes*, 39(1/2):65–90, 2010
24. G. De Rossi and T. Vargiolu. Optimal prepayment and default rules for mortgage-backed securities. *Decisions in Economics and Finance*, 33(1):23–47, 2010
25. G. Callegaro and T. Vargiolu. Optimal portfolio for HARA utility functions in a pure jump multidimensional incomplete market. *International Journal of Risk Assessment and Management - Special Issue on Measuring and Managing Financial Risk*, 11(1/2):180–200, 2009
26. G. Favero and T. Vargiolu. Shortfall risk minimising strategies in the binomial model: characterisation and convergence. *Mathematical Methods of Operations Research*, 64(2):237–253, 2006
27. S. Romagnoli and T. Vargiolu. Pricing and hedging of a general kind of multiasset option. *Statistica*, LXIII(1):1–23, 2003
28. C. Scagnellato and T. Vargiolu. Explicit solutions for shortfall risk minimization in multinomial models. *Decisions in Economics and Finance*, 25(2):145–155, 2002
29. A. Altieri and T. Vargiolu. Optimal default boundary in discrete time models. *Rendiconti per gli Studi Economici Quantitativi*, 2001:1–20, 2002
30. F. Gozzi and T. Vargiolu. Superreplication of European multiasset derivatives with bounded stochastic volatility. *Mathematical Methods of Operations Research*, 55(1):69–91, 2002
31. S. Romagnoli and T. Vargiolu. Robustness of the Black-Scholes approach in the case of options on several assets. *Finance and Stochastics*, 4(3):325–341, 2000
32. T. Vargiolu. Invariant measures for the Musiela equation with deterministic diffusion term. *Finance and Stochastics*, 3(4):483–492, 1999

Articoli pubblicati su libri

33. A. Valdez and T. Vargiolu. Optimal portfolio in a regime-switching model. In *Seminar on Stochastic Analysis, Random Fields and Applications VII - Centro Stefano Franscini - Ascona*. DOI:10.1007/978-3-0348-0545-2, volume 67 of *Progress in Probability*, pages 435–449. Springer, 2013
34. V. Hallulli and T. Vargiolu. Robustness of the Hobson-Rogers model with respect to the offset function. In *Seminar on Stochastic Analysis, Random Fields and Applications V - Centro Stefano Franscini - Ascona, May 2005*, volume 59 of *Progress in Probability*, pages 469–492. Birkhauser, 2008
35. V. Hallulli and T. Vargiolu. Financial models with dependence on the past: a survey. In *Applied and Industrial Mathematics in Italy*, volume 69 of *Series on Advances in Mathematics for Applied Sciences*, pages 348–359. World Scientific, 2005
36. F. Gozzi and T. Vargiolu. On the superreplication approach for European interest rates derivatives. In *Seminar on Stochastic Analysis, Random Fields and Applications III - Centro Stefano Franscini, Ascona, September 1999*, volume 52 of *Progress in Probability*, pages 173–188. Birkhauser, 2002
37. W. J. Runggaldier, B. Trivellato, and T. Vargiolu. A Bayesian adaptive control approach to risk management in a binomial model. In *Seminar on Stochastic Analysis, Random Fields and Applications III - Centro Stefano Franscini, Ascona, September 1999*, volume 52 of *Progress in Probability*, pages 243–258. Birkhauser, 2002
38. A. Altieri and T. Vargiolu. Optimal default boundary in a discrete time setting. In S. Tang M. Kohlmann, editor, *Mathematical Finance*, Trends in Mathematics, pages 49–58. Birkhauser, 2001

Interventi pubblicati su atti di convegni

39. F. Carassus and T. Vargiolu. Super-replication price: it can be OK. Number 64, pages 54–64. ESAIM: Proceedings and Surveys. DOI: 10.1051/proc/201864054, 2018
40. L. Pasin and T. Vargiolu. Optimal portfolio for HARA utility functions where risky assets are exponential additive processes. Macerata, 2010. XXXIV Convegno AMASES
41. M. Rosestolato, T. Vargiolu, and G. Villani. Robustness for path-dependent volatility models. Parma, 2009. XXXIII Convegno AMASES
42. G. De Rossi and T. Vargiolu. Optimal prepayment rule for mortgage-backed securities. Trento, 2008. XXXII Convegno AMASES
43. G. Callegaro and T. Vargiolu. Optimal portfolio for HARA utility functions in a pure jump multidimensional incomplete market. Lecce, 2007. XXXI Convegno AMASES

44. M. Cucicea and T. Vargiolu. Weak convergence of shortfall risk minimizing portfolios. Trieste, 2006. XXX Convegno AMASES
45. V. Hallulli and T. Vargiolu. Robustness of the Hobson-Rogers model. Palermo, 2005. XXIX Convegno AMASES
46. V. Hallulli and T. Vargiolu. Financial models with dependence on the past: a survey. Venezia, 2004. VII Congresso SIMAI
47. V. Hallulli and T. Vargiolu. Financial models with dependence on the past: a survey. Modena, 2004. XXVIII Convegno AMASES
48. V. Hallulli and T. Vargiolu. Financial models with dependence on the past: a survey. Venezia, 2004. Atti del Workshop Didattico di Finanza Quantitativa, 4 giugno 2004
49. G. De Silvestro and T. Vargiolu. Optimal design of derivatives in illiquid markets: an alternative approach. Cagliari, 2003. XXVII Convegno AMASES
50. G. Favero and T. Vargiolu. Robustness of shortfall risk minimising strategies in the binomial model. Cagliari, 2003. XXVII Convegno AMASES
51. G. De Silvestro and T. Vargiolu. Optimal design of derivatives in illiquid markets: an alternative approach. Venezia, 2003. Atti della Giornata di Studio "Metodi Numerici per la Finanza", 30 maggio 2003
52. G. Favero and T. Vargiolu. Robustness of shortfall risk minimising strategies in the binomial model. Venezia, 2003. Atti della Giornata di Studio "Metodi Numerici per la Finanza", 30 maggio 2003
53. C. Scagnellato and T. Vargiolu. Shortfall risk minimisation in multinomial models. Firenze, 2001. XXV Convegno AMASES
54. A. Altieri and T. Vargiolu. Optimal default boundary in a discrete time setting. Padenghe sul Garda (BS), 2000. XXIV Convegno AMASES
55. A. Altieri and T. Vargiolu. Optimal default boundary in discrete time models. Ischia (NA), 2000. V Convegno SIMAI
56. W. J. Runggaldier, B. Trivellato, and T. Vargiolu. A Bayesian adaptive control approach to risk management with a binomial model. Ischia (NA), 2000. V Convegno SIMAI
57. W. J. Runggaldier, B. Trivellato, and T. Vargiolu. A Bayesian adaptive control approach to risk management with a binomial model. Auronzo di Cadore (BL), 2000. Scuola Estiva "Finanza Computazionale"
58. F. Gozzi, S. Romagnoli, and T. Vargiolu. Links between superhedging strategies and viscosity solutions of the Black-Scholes-Barenblatt equation. Ulm (Germania), 1999. 10th INFORMS Applied Probability Conference
59. F. Gozzi, S. Romagnoli, and T. Vargiolu. Links between superhedging strategies and viscosity solutions of the Black-Scholes-Barenblatt equation. Hammamet (Tunisia), 1999. International Conference of Mathematical Finance
60. F. Gozzi, S. Romagnoli, and T. Vargiolu. Robustness of the Black-Scholes model in the case of options on several assets. Treviso, 1998. Convegno AIRO *Logistica, Trasporti e Qualità*
61. T. Vargiolu. Calibration of the Gaussian Musiela model using the Karhunen-Loeve expansion. Genova, 1998. XXII Convegno AMASES
62. S. Romagnoli and T. Vargiolu. Pricing and hedging of the currency multiple option on the maximum of several bonds. Genova, 1998. XXII Convegno AMASES
63. S. Romagnoli and T. Vargiolu. Robustness of the Black-Scholes model in the case of options on several assets. Giardini Naxos (CT), 1998. IV Convegno SIMAI

Preprint e rapporti tecnici

64. F. Carassus and T. Vargiolu. Super-replication price for asset prices having bounded increments in discrete time. hal-00511665, HAL: hal.archives-ouvertes.fr
65. G. Favero and T. Vargiolu. Robustness of shortfall risk minimising strategies in the binomial model. Preprint n. 14, Università degli Studi di Padova, Dipartimento di Matematica Pura ed Applicata, 2002
66. T. Vargiolu. Existence, uniqueness and smoothness for the Black-Scholes-Barenblatt equation. Rapporto interno n. 5, Università degli Studi di Padova, Dipartimento di Matematica Pura ed Applicata, 2001
67. T. Vargiolu. Invariant measures for a Langevin equation describing forward rates in an arbitrage free market. Preprint di Matematica n. 20, Scuola Normale Superiore, Pisa, 1996

Tesi di perfezionamento

68. T. Vargiolu. *The Black-Scholes-Barenblatt equation and its applications in Mathematical Finance*. Tesi di perfezionamento in Matematica, Scuola Normale Superiore, Pisa, 2002

Collaborazione alla stesura di libri

69. I. Ekeland. *Exterior Differential Calculus and Applications to Economy Theory*. Quaderni. Scuola Normale Superiore, Pisa, 2000

Libri

70. E. Edoli S. Fiorenzani, T. Vargiolu. *Optimization methods in gas and power markets*. Palgrave McMillan, UK, 2016
71. T. Vargiolu. *Elementi di Probabilità e Statistica*. CLEUP, Padova, 2005

Altre pubblicazioni didattiche

72. B. Trivellato and T. Vargiolu. Un approccio bayesiano alla gestione del rischio in un modello binomiale. *Finanza Computazionale. Atti della scuola estiva 2000*, Dipartimento di Matematica Applicata, Università Ca' Foscari, Venezia, 2000
73. T. Vargiolu. *Teoria della misura*. CLEUP, Padova, 1999

Attività didattica

- 2021**– corso di "Fondamenti di Analisi Matematica e Probabilità" al Corso di Laurea in Ingegneria Informatica dell'Università di Padova
- 2016–2021** corso di "Matematica con elementi di Informatica" al Corso di Laurea Magistrale a ciclo unico in Chimica e Tecnologia Farmaceutiche dell'Università di Padova
- 2015**– corso "Stochastic Differential Equations with Numerics" (in inglese) al Corso di Laurea Magistrale in Ingegneria Matematica dell'Università di Padova
- 2008–2020** corsi "Mathematical Finance", "Topics in Stochastic Analysis" e "Topics in Mathematical Finance" (in inglese) della Scuola di Dottorato in Matematica dell'Università di Padova
- 2003–2016** corsi di Statistica ai Corsi di Laurea triennale in Biologia, Biologia Molecolare e Biotecnologie dell'Università di Padova
- 2012–2015** corso di Metodi Stocastici per la Finanza al Corso di Laurea Magistrale in Matematica dell'Università di Padova
- 2009–2012** affidamento gratuito del corso di Metodi Stocastici per la Finanza (modulo B) al Corso di Laurea Magistrale in Matematica dell'Università di Padova
- 2003–2004, 2005–2006, 2007–2008, 2010–2012** corso di Calcolo delle Probabilità al Corso di Laurea triennale in Matematica dell'Università di Padova
- 2010–2011** affidamento retribuito del corso "Mathematical Finance" per la classe di Scienze Naturali della Scuola Galileiana dell'Università di Padova
- 2004–2005, 2006–2007, 2008–2010** corso di Probabilità e Statistica al Corso di Laurea triennale in Matematica dell'Università di Padova
- 2008–2009** affidamento retribuito del corso di Metodi Stocastici per la Finanza (modulo B) al Corso di Laurea Magistrale in Matematica dell'Università di Padova
- 2007–2008** affidamento retribuito del corso di Analisi Stocastica al Corso di Laurea Specialistica in Matematica dell'Università di Padova
- 2005–2007** corso di Probabilità (tenuto insieme a Paolo Dai Pra) della Scuola di Dottorato in Matematica dell'Università di Padova
- 2002–2003** affidamento gratuito del corso di Calcolo delle Probabilità modulo B al Corso di Laurea in Matematica dell'Università di Padova
- 2002–2003** esercitazioni del corso di Analisi 2 al Corso di Laurea in Astronomia dell'Università di Padova
- 2001–2003** esercitazioni dei corsi di Metodi Probabilistici e Statistici ai Corsi di Laurea di Biologia e Biologia Molecolare dell'Università di Padova
- 2001–2002** affidamento retribuito del corso di Statistica al Corso di Laurea in Biotecnologie Industriali dell'Università di Padova

- 1998–2002** esercitazioni del corso di Istituzioni di Analisi Superiore al Corso di Laurea in Matematica dell'Università di Padova
- 1999–2001** affidamento retribuito del corso di Istituzioni di Matematiche II al Corso di Laurea in Biotecnologie dell'Università di Padova
- 28 – 31 marzo 2000** missione *Teaching staff — periodo di insegnamento all'estero* a Besancon, nel quadro del programma Socrates/Erasmus
- 1999–2000** affidamento retribuito del corso semestrale di Calcolo delle Probabilità (modulo B) al Corso di Laurea in Matematica dell'Università di Padova
- 1997–1998** assistenza alle esercitazioni di laboratorio del corso di Metodi Probabilistici e Statistici e Processi Stocastici per i Corsi di Diploma Universitario in Ingegneria Logistica e della Produzione dell'Università di Pisa

Seminari su invito

- 6 settembre 2021** intervento su invito alla *GEM Summer School* online, dal titolo *Energy Finance*
- 3 dicembre 2020** *Optimal installation of solar panels with price impact* alla Libera Università di Bolzano
- 14 settembre 2020** intervento su invito alla *GEM Summer School* online, dal titolo *Energy Finance*
- 20-21 marzo 2020** intervento su invito all'Intensive Program a Bologna, dal titolo *Stochastic models for the energy market*
- 13 dicembre 2019** intervento su invito all'*Energy Finance Christmas Workshop* a Dublino (Irlanda), dal titolo *Optimal installation of solar panels with price impact*
- 18 settembre 2019** intervento su invito alla *GEM Summer School* a Baku (Azerbaijan), dal titolo *Energy Finance*
- 5 aprile 2019** *Mean-reverting additive energy forward curves in a Heath-Jarrow-Morton framework* a Dublino (Irlanda)
- 14-15 marzo 2019** intervento su invito all'Intensive Program a Bologna, dal titolo *Stochastic models for the energy market*
- 17 gennaio 2019** intervento su invito al Thirteenth Bachelier Colloquium on Mathematical Finance and Stochastic Calculus a Metabief (Francia), dal titolo *Mean-reverting additive energy forward curves in a Heath-Jarrow-Morton framework*
- 12-13 Dicembre 2018** intervento su invito all'*Energy Finance Christmas Workshop* a Bolzano/Bozen, dal titolo *Efficient representation of supply and demand curves on day-ahead electricity markets*
- 23 novembre 2018** *Pricing and optimal investment timing in reliability options* a Bielefeld (Germania)
- 6 settembre 2018** intervento su invito al convegno *Innovative Research in Mathematical Finance* a Marsiglia, dal titolo *On the singular control of exchange rates*
- 23 luglio 2018** intervento su invito alla *GEM Summer School* a Milano Bicocca e Biella, dal titolo *Energy Finance*
- 13-14 marzo 2018** intervento su invito all'Intensive Program a Bologna, dal titolo *Stochastic models for the energy market*
- 29 gennaio 2018** intervento su invito alla *GEM Winter School* a La Laguna - Tenerife (Spagna), dal titolo *Energy Finance*
- 17 gennaio 2018** intervento su invito al Twelfth Bachelier Colloquium on Mathematical Finance and Stochastic Calculus a Metabief (Francia), dal titolo *Stochastic impulse games*
- 13 dicembre 2017** intervento su invito all'Energy Finance Christmas Workshop a Cracovia (Polonia), dal titolo *Capacity markets and the pricing of reliability options*
- 29 agosto 2017** intervento su invito alla *GEM Summer School* ad Astana (Kazakistan), dal titolo *Energy Finance*
- 5 luglio 2017** intervento su invito alla *2nd Conference on the Mathematics of Energy Markets* a Vienna (Austria), dal titolo *Capacity markets and the pricing of reliability options*
- 16 dicembre 2016** intervento su invito al Energy Finance Christmas Workshop ad Essen (Germania), dal titolo *Additive models for forward curves in multicommodity energy markets*
- 9 settembre 2016** intervento su invito alla *GEM Summer School* ad Erice (TP), dal titolo *The evaluation of structured products and of power plants*
- 9 marzo 2016** *Controllo stocastico ottimale ed una applicazione al trading intra-day nei mercati elettrici* all'Università di Bologna, polo di Rimini
- 21 luglio 2015** intervento su invito alla *GEM Summer School* all'Università di Milano "Bicocca", dal titolo *The evaluation of structured products and of power plants*

- 2 dicembre 2014** *Utility indifference pricing and hedging for structured contracts in energy markets* presso Prometeia SpA, Bologna
- 9 aprile 2013** *Portfolio Optimization in a Defaultable Levy Driven Market Model* all'Università degli Studi di Verona
- 8 aprile 2013** intervento su invito al workshop *Econometric, Energy and Finance* a Londra, dal titolo *Calibration of a multifactor model for the forward markets of several commodities*
- 1 marzo 2013** intervento su invito alla conferenza *QUANT 2013 - Quantitative & Asset Management Workshop* a Venezia, dal titolo *The right time to enter*
- 23 maggio 2012** *Modeling and valuing make-up clauses in gas swing contracts* all'Università di Duisburg-Essen ad Essen
- 3 maggio 2011** *Optimal portfolio and utility-indifference pricing and hedging in a regime-switching model* al Politecnico di Milano
- 25 marzo 2010** *Optimal portfolio for HARA utility functions where risky assets are geometric Levy processes*, all'Università di Parma
- 15 luglio 2009** intervento su invito alla *Summer School: Frontiers of Financial Market Mathematics - 2009: Pricing Illiquid Securities* a Bologna, dal titolo *A Risk Measure at Work: the Shortfall Risk*
- 31 marzo 2000** *A Bayesian adaptive control approach to risk management under restricted information* al *Bachelier Colloquium* a Besancon (Francia)
- 15 marzo 2000** *Un approccio di controllo adattativo bayesiano alla gestione del rischio con un modello binomiale* all'Università di Bologna
- 19 dicembre 1996** *Misure invarianti per una equazione di Langevin, e una applicazione ai mercati finanziari* al Politecnico di Milano

Seminari tenuti

- 17 settembre 2021** *Linear transformation of multivariate AR processes in infinite dimensions*, presentato al *XLV Convegno AMASES*, online
- 18 Giugno 2021** *Optimal installation of solar panels with price impact*, presentato alla *5th Commodity and Energy Markets Conference*, online
- 29 aprile 2020** *Optimal installation of solar panels with price impact*, presentato alla *Online International Conference in Actuarial Science, Data Science and Finance*
- 11 febbraio 2020** *Optimal installation of solar panels with price impact*, presentato al *Workshop Energy Finance Italia 5* a Roma
- 31 gennaio 2020** *Optimal installation of solar panels with price impact*, presentato al *XXI Workshop in Quantitative Finance* a Napoli
- 11 ottobre 2019** *Optimal management of pumped hydroelectric production with state-constrained optimal control*, presentato al *Freiburg-Padova-Wien-Zurich Seminar* a Zurigo (Svizzera)
- 10 settembre 2019** *Optimal installation of solar panels with price impact*, presentato al *XLIII Convegno AMASES* a Perugia
- 19 Giugno 2019** *Optimal installation of solar panels with price impact*, presentato al *Second Italian Conference on Probability and Mathematical Statistics* a Vietri sul Mare (SA)
- 16 maggio 2019** *Optimal installation of solar panels with price impact*, presentato al *Freiburg-Padova-Wien-Zurich Seminar* a Padova
- 26 aprile 2019** *Variables reduction in sequenziale re source allocation problems*, presentato al workshop *Investments, Energy, and Green Economy* a Brescia
- 23 gennaio 2019** *Efficient representation of supply and demand curves on day-ahead electricity markets*, presentato al *XX Workshop in Quantitative Finance* a Zurigo (Svizzera)
- 14 settembre 2018** *Pricing reliability options under different electricity price regimes*, presentato al *XLII Convegno AMASES* a Napoli
- 20 giugno 2018** *Pricing reliability options under different electricity price stochastic behavior*, presentato alla *3rd Energy and Commodity Markets Conference* a Roma
- 15 febbraio 2018** *Capacity markets and the pricing of reliability options*, presentato al *Workshop Energy Finance Italia 3* a Pescara
- 26 gennaio 2018** *Capacity markets and the pricing of reliability options*, presentato al *XIX Workshop in Quantitative Finance* a Roma
- 20 dicembre 2017** *Verification theorem for stochastic impulse non-zero sum games and applications*, presentato alla *Opening Conference of the thematic semester on "Stochastic modeling"* a Verona

- 15 settembre 2017** *Capacity markets and the pricing of reliability options*, presentato al XXXXI Convegno AMASES a Cagliari
- 22 giugno 2017** *Verification theorem for stochastic impulse non-zero sum games and applications*, presentato al *First Italian Conference on Probability and Mathematical Statistics* a Torino
- 14 giugno 2017** *Mean-reverting no-arbitrage additive models for forward curves in energy markets*, presentato a *2nd Energy and Commodity Finance Conference* a Oxford (Regno Unito)
- 27 gennaio 2017** *Additive models for forward curves in multicommodity energy markets*, presentato al *XVIII Workshop in Quantitative Finance* a Milano
- 1 dicembre 2016** *Additive models for forward curves in multicommodity energy markets*, presentato al *58th meeting of the Euro Working Group on Commodity and Financial Modelling* a York (Regno Unito)
- 25 ottobre 2016** *Verification theorem for stochastic impulse non-zero sum games and applications*, presentato alla conferenza *Stochastic analysis of dynamical systems, stochastic control and games* a Leeds (Regno Unito)
- 16 settembre 2016** *Optimal intra-day power trading with a Gaussian additive process*, presentato al XXXX Convegno AMASES a Catania
- 20 luglio 2016** *Verification theorem for stochastic impulse non-zero sum games and applications*, presentato al *7th European Congress of Mathematics* a Berlino (Germania)
- 5 luglio 2016** *Additive models for forward curves in multicommodity energy markets*, presentato alla *Conference on the Mathematics of Energy Markets* a Vienna (Austria)
- 24 giugno 2016** *Optimal intra-day power trading with a Gaussian additive process*, presentato al *Energy and Commodity Finance Conference* a Parigi (Francia)
- 29 gennaio 2016** *Optimal intra-day power trading with a Gaussian additive process*, presentato al *XVII Workshop in Quantitative Finance* a Pisa
- 10 dicembre 2015** *Optimal intra-day power trading with a Gaussian additive process*, presentato al *Workshop Energy Finance Italia* a Camerino
- 12 novembre 2015** Poster *Additive models for forward curves in multicommodity energy markets*, presentato alla conferenza *Dependence and Risk Measures* a Milano
- 23 marzo 2015** *Optimal pricing strategy for an energy retailer*, presentato ad *INREC 2015* ad Essen (Germania)
- 29 gennaio 2015** *Optimal pricing strategy for an energy retailer*, presentato al *XVI Workshop in Quantitative Finance* a Parma
- 4 settembre 2014** *Utility indifference pricing and hedging for structured contracts in energy markets*, presentato al XXXVIII Congresso AMASES a Reggio Calabria
- 28 marzo 2014** *Utility indifference pricing and hedging for structured contracts in energy markets*, presentato al *2nd International Symposium on Energy and Finance Issues* a Parigi (Francia)
- 24 gennaio 2014** *Optimal exercise of swing options in energy markets: an integral constrained stochastic optimal control problem*, presentato al *XV Workshop in Quantitative Finance* a Firenze
- 10 ottobre 2013** *Optimal exercise of swing options in energy markets: an integral constrained stochastic optimal control problem*, presentato al *2013 Energy & Finance Conference* ad Essen (Germania)
- 20 settembre 2013** poster riguardanti il lavoro *Portfolio optimization in a defaultable Lévy driven market model*, presentato al *Control Day 2013* a Padova
- 6 giugno 2013** poster riguardanti i lavori *Optimal exercise of swing options in energy markets: an integral constrained stochastic optimal control problem* e *Portfolio optimization in a defaultable Lévy driven market model*, presentati al convegno *Frontiers in Mathematical Finance* a Dublino (Irlanda)
- 24 gennaio 2013** *Calibration of a multifactor model for the forward markets of several commodities*, presentato al *XIV Workshop on Quantitative Finance* a Rimini
- 4 ottobre 2012** *Calibration of a multifactor model for the forward markets of several commodities*, presentato al *2012 Energy & Finance Conference* a Trondheim (Norvegia)
- 14 settembre 2012** *Calibration of a multifactor model for the forward markets of several commodities*, presentato al XXXVI Congresso AMASES a Vieste (FG)
- 12 settembre 2012** *Calibration of a multifactor model for the forward markets of several commodities*, presentato al Convegno finale del PRIN *Probability and Finance* a Pescara
- 20 marzo 2012** *Modeling and valuing make-up clauses in gas swing contracts*, presentato al *First French-Italian Workshop on energy markets and models* a Brescia
- 26 gennaio 2012** *Modeling and valuing make-up clauses in gas swing contracts*, presentato al *XIII Workshop on Quantitative Finance* a L'Aquila
- 5 ottobre 2011** *Modeling and valuing make-up clauses in gas swing contracts*, presentato al *2011 Energy &*

- Finance Conference* a Rotterdam (Olanda), vincitore del *Best paper award - applied*
- 27 agosto 2011** *Optimal portfolio and utility-indifference pricing and hedging in a regime-switching model*, presentato al *Workshop on Stochastic Methods in Financial Markets* a Lubiana (Slovenia)
- 23 maggio 2011** *Optimal portfolio and utility-indifference pricing and hedging in a regime-switching model*, presentato al *Seventh Seminar on Stochastic Analysis, Random Fields and Applications* ad Ascona (Svizzera)
- 25 giugno 2010** *Optimal portfolio for HARA utility functions where risky assets are geometric Levy processes*, al *VI World Congress of the Bachelier Finance Society* a Toronto (Canada)
- 5 maggio 2010** *Optimal portfolio for HARA utility functions where risky assets are geometric Levy processes*, alla *V General Conference on Advanced Mathematical Methods in Finance - AMaMeF 2010* a Bled (Slovenia)
- 28 gennaio 2010** *Optimal portfolio for HARA utility functions where risky assets are geometric Levy processes*, presentato al *XI Workshop on Quantitative Finance* a Palermo
- 9 settembre 2009** *Optimal portfolio for HARA utility functions where risky assets are geometric Levy processes*, presentato alla *Research week on financial mathematics and econometrics* a Firenze
- 8 aprile 2009** *Optimal prepayment rule for mortgage-backed securities*, presentato alla *Giornata di Finanza Matematica* a Milano
- 3 aprile 2009** poster riguardante il lavoro *Optimal prepayment rule for mortgage-backed securities*, presentato al *Control Day Patavinus* a Padova
- 30 gennaio 2009** *Optimal prepayment rule for mortgage-backed securities*, presentato al *X Workshop on Quantitative Finance* a Milano
- 29 gennaio 2009** *Robustness for path-dependent volatility models*, presentato al *X Workshop on Quantitative Finance* a Milano
- 4 luglio 2008** *Optimal prepayment rule for mortgage-backed securities*, presentato al Convegno finale del PRIN *Metodi stocastici in finanza* a Torino
- 27 giugno 2008** *Optimal prepayment rule for mortgage-backed securities*, presentato al *International Workshop: Credit Risk* ad Evry (Francia)
- 19 maggio 2008** *Optimal portfolio for HARA utility functions in a pure jump multidimensional incomplete market*, al *Sixth Seminar on Stochastic Analysis, Random Fields and Applications* ad Ascona (Svizzera)
- 25 gennaio 2008** *Optimal portfolio for HARA utility functions in a pure jump multidimensional incomplete market*, presentato al *IX Workshop on Quantitative Finance* a Roma
- 21 giugno 2007** *Weak convergence of shortfall risk minimizing portfolios*, presentato al Convegno *Skorohod space: 50 years on* a Kiev (Ucraina)
- 20 aprile 2007** *Optimal portfolio for HARA utility functions in a pure jump multidimensional incomplete market*, alla *4th international conference on Computational Management Science* a Ginevra (Svizzera)
- 15 settembre 2006** *Weak convergence of shortfall risk minimizing portfolios*, presentato al Convegno finale del PRIN *Metodi stocastici in finanza matematica* a Lecce
- 17 agosto 2006** poster riguardante il lavoro *Weak convergence of shortfall risk minimizing portfolios*, presentato al *IV World Congress of the Bachelier Finance Society* a Tokyo (Giappone)
- 17 settembre 2005** *Robustness of the Hobson-Rogers model*, presentato al Convegno PRIN "Metodi stocastici in finanza matematica" a Roma
- 2 giugno 2005** *Robustness of the Hobson-Rogers model*, presentato al *Fifth Seminar on Stochastic Analysis, Random Fields and Applications* ad Ascona (Svizzera)
- 29 gennaio 2004** *Modelli finanziari con dipendenza dal passato*, al *V Workshop di Finanza Quantitativa* a Siena
- 16 settembre 2003** *Optimal design of derivatives in illiquid markets: an alternative approach*, presentato al Convegno finale del PRIN *Processi Stocastici e applicazioni a Filtraggio, Controllo, Simulazione e Finanza Matematica* a Bologna
- 13 febbraio 2003** *Optimal design of derivatives in illiquid markets: an alternative approach*, presentato alla conferenza *Applied Mathematics and Applications of Mathematics* a Nizza (Francia)
- 30 – 31 gennaio 2003** poster riguardante il lavoro *Optimal design of derivatives in illiquid markets: an alternative approach*, presentato al convegno *IV Workshop di Finanza Quantitativa* a Torino
- 9 settembre 2002** *Robustness of shortfall risk minimising strategies*, presentato al *Probability Workshop* a Bologna
- 12 – 15 giugno 2002** poster riguardante il lavoro *Robustness of shortfall risk minimising strategies*, presentato al convegno *Second World Congress of the Bachelier Finance Society* a Agia Pelagia (Grecia)
- 29 maggio 2002** *Robustness of shortfall risk minimising strategies* al *V Convegno SIMAI* a Chia (CA)

- 30 gennaio 2002** *Robustezza delle strategie che minimizzano il rischio di scoperto* al III Workshop di Finanza Matematica a Verona
- 8 dicembre 2001** *Robustness of shortfall risk minimising strategies* al Workshop on Stochastic Control a Karlsruhe (Germania)
- 17 settembre 2001** *Shortfall risk minimisation in multinomial models* alla Summer School in Mathematical Finance a Dubrovnik (Croazia)
- 13 settembre 2001** *Shortfall risk minimisation in multinomial models* al Convegno Processi Stocastici, Calcolo Stocastico ed Applicazioni a Pisa
- 7 luglio 2001** *Shortfall risk minimisation in multinomial models* al V Convegno SAET a Ischia (NA)
- 14 giugno 2001** *Shortfall risk minimisation in multinomial models* al meeting DYNSTOCH a Parigi (Francia)
- 27 aprile 2001** *Minimizzazione del rischio di scoperto in modelli multinomiali* al workshop Metodi numerici e computazionali per la finanza a Venezia
- 14 febbraio 2001** *Shortfall risk minimisation in multinomial models* al Probability Workshop in Bologna
- 2 febbraio 2001** *Minimizzazione del rischio di scoperto in modelli multinomiali* al Workshop di Finanza Matematica a Pisa
- 4 agosto 2000** *A Bayesian adaptive control approach to risk management under restricted information* al convegno Quantitative Risk Management in Finance a Pittsburgh, PE (USA)
- 28 giugno – 1 luglio 2000** poster riguardante il lavoro *A Bayesian adaptive control approach to risk management in a binomial model*, presentato al convegno First World Congress of the Bachelier Finance Society a Parigi (Francia)
- 17 maggio 2000** *Un approccio di controllo adattativo bayesiano alla gestione del rischio con un modello binomiale* all'Università degli Studi di Torino
- 23 febbraio 2000** *Sull'approccio di superreplicazione per titoli derivati europei* all'Università di Padova
- 29 gennaio 2000** *Frontiera di fallimento ottimale a tempi discreti* al Workshop di Finanza Matematica a Pescara
- 14 maggio 1999** *Links between superhedging strategies and viscosity solutions of the Black-Scholes-Barenblatt equation* al convegno Evolution Equations and Applications a Cortona (AR)
- 11 maggio 1999** *Links between superhedging strategies and viscosity solutions of the Black-Scholes-Barenblatt equation* al secondo Atelier FIQUAM Fonds pension et optimization a Carqueiranne (Francia)
- 16 settembre 1998** *Robustness of the Black-Scholes model in the case of options on several assets* al convegno Processi Stocastici e Applicazioni a Padova
- 28 agosto 1998** *Calibration of the Gaussian Musiela model using the Karhunen-Loeve expansion* al corso CIME SPDE and Kolmogorov equations in infinite dimensions a Cetraro (CS)
- 24 novembre 1997** *Robustness of the Black-Scholes model in the case of options on several assets* al convegno Matematyki Finansowej a Varsavia (Polonia)
- 31 ottobre 1997** *Equazioni di Hamilton-Jacobi-Bellman che sorgono da problemi di robustezza in modelli finanziari* alla Scuola Normale Superiore di Pisa
- 13 luglio 1997** *Stochastic control* al corso estivo di Finanza Matematica 1997 della Scuola Matematica Interuniversitaria a Cortona (AR)
- 26 – 30 maggio 1997** poster riguardanti i lavori *Pricing and hedging of the currency multiple option on the maximum of several bonds* e *Invariant measures for a Langevin equation describing forward rates in an arbitrage free market*, presentati al convegno III Italian Conference on Mathematical Finance a Povo (TN)
- 2 maggio 1997** *Misure invarianti per una equazione di Langevin, e una applicazione ai mercati finanziari* alla Scuola Normale Superiore di Pisa
- 30 gennaio 1997** *The Musiela model with deterministic volatility* all'Università di Parigi VI

Progetti di ricerca e fondi

- 2021–2024** responsabile scientifico di un posto da RTDa PON "green" SSD MAT/06 e di una borsa di dottorato PON "green"
- 2019–2021** membro del Progetto di Ricerca SID *Term Structure Dynamics in Interest Rate and Energy Markets: Modelling and Numerics* (responsabile prof. Claudio Fontana)
- 2020** responsabile scientifico di una borsa dell'Università di Padova "Visiting Scientist" di un mese (vincitore prof. Giorgio Ferrari, University of Bielefeld)

- 2019** responsabile scientifico locale di una borsa dell'Università di Milano "Bicocca" - EFI4 di un mese (vincitrice dott. Maren Diane Schmeck, università di Bielefeld)
- 2019** responsabile scientifico di una borsa dell'Università di Padova "Visiting Scientist" di un mese (vincitore prof. Giorgio Ferrari, University of Bielefeld)
- 2018** responsabile scientifico di una borsa dell'Università di Padova "Visiting Scientist" di un mese (vincitore prof. Giorgio Ferrari, University of Bielefeld)
- 2018** responsabile scientifico del progetto nazionale ACRI-YITP-EFI3 (5 borse di un mese ciascuna)
- 2018** responsabile scientifico locale di una borsa della Fondazione ACRI-YITP-EFI3 *Research Prize Young Investigator Training Program* di un mese (vincitrice dott. Maren Diane Schmeck, università di Bielefeld)
- 2018** responsabile scientifico locale di una borsa della Fondazione ACRI-YITP-WQF *Research Prize Young Investigator Training Program* di un mese (vincitore dott. Mesias Alfeus, università di Sydney)
- 2018** membro del Progetto di Ricerca G.N.A.M.P.A. *Nuovi indicatori di instabilità dei mercati finanziari*
- 2017–2019** membro del Progetto di Ricerca SID *New perspectives in stochastic methods for finance and energy markets* (responsabile prof. Giorgia Callegaro)
- 2017–2019** responsabile scientifico di un assegno di ricerca biennale "I mercati della capacità e la definizione del valore delle Reliability Options" (vincitrice dott.ssa Luisa Andreis, che lascia l'incarico dopo 7 mesi; per i successivi 12 mesi, vincitore dott. Dimitrios Zormpas), del Centro Interdipartimentale di Ricerca per l'Economia e Tecnica dell'Energia "Giorgio Levi Cases"
- 2017** responsabile scientifico di una borsa dell'Università di Padova "Visiting Scientist" di un mese (vincitore prof. Juri Hinz, University of Technology Sydney)
- 2017** responsabile scientifico locale di una borsa della Fondazione ACRI *Research Prize Young Investigator Training Program* di un mese (vincitore prof. Giorgio Ferrari, università di Bielefeld)
- 2015–2017** membro del Progetto di Ricerca di Ateneo *Multidimensional polynomial processes and applications to new challenges in mathematical finance and in energy markets (CPDA158845)* (responsabile prof. Martino Grasselli)
- 2014–2016** vincitore di un "Bando per attività di networking" dell'Università di Padova
- 2014** responsabile scientifico di una borsa dell'Università di Padova "Visiting Scientist" di un mese (vincitore prof. Luciano Campi, London School of Economics)
- 2013–2015** coordinatore del Progetto di Ricerca di Ateneo *Stochastic models with spatial structure and applications to new challenges in Mathematical Finance, with a focus on the post-2008 financial crisis environment and on energy markets.*
- 2010–2012** membro del Progetto di Rilevante Interesse Nazionale *Probability and Finance*
- 2008–2010** membro del Progetto di Ricerca di Ateneo *Modelli probabilistici per la meccanica statistica di polimeri, sistemi di particelle interagenti e applicazioni*
- 2007–** coordinatore del gruppo di ricerca ex-60% *Processi Stocastici ed Applicazioni* dell'Università di Padova
- 2004–2006** membro del Progetto di Ricerca di Ateneo *Metodi di meccanica statistica nelle applicazioni con agenti finanziari interagenti*
- 2004–2008** membro del Progetto di Rilevante Interesse Nazionale (ex-40%) *Modelli stocastici, filtraggio e controllo stocastico per i mercati finanziari*
- 2003–2006** membro del gruppo di ricerca F.I.R.B.
- 2003–2006** membro del gruppo di ricerca ex-60% *Metodi probabilistici e statistici nello studio dei sistemi* dell'Università di Padova
- 2001–** membro del Progetto Strategico CNR *Metodi di filtraggio, identificazione e controllo stocastico in finanza*
- 2000–** coordinatore di una unità locale del Progetto Strategico CNR *Metodi di ottimizzazione e controllo*
- 2000** responsabile di un *Progetto di Ricerca Giovani Ricercatori* dell'Università di Padova
- 1999–2003** membro del Progetto di Rilevante Interesse Nazionale (ex-40%) *Processi stocastici, calcolo stocastico e applicazioni*
- 1998–2002** membro del gruppo di ricerca FIQUAM - *Methodes quantitatives en Finance* del CNRS
- 2000–** membro del gruppo GNAMPA del CNR
- 1998–2000** membro del gruppo GNAFA del CNR

Premi e riconoscimenti

- 2018** *Best paper award* per il lavoro *Optimal cross-border electricity trading* presentato (dalla coautrice

- Maria Flora) alla *3rd Energy and Commodity Markets Conference* a Roma
- 2014** premio *Baccin Valentino* della "Fondazione Baccin Valentino" per la tesi di laurea magistrale di Matteo Basei, di cui ero relatore
- 2011** *Best paper award - applied* per il lavoro *Modeling and valuing make-up clauses in gas swing contracts* presentato al *2011 Energy & Finance Conference* a Rotterdam (Olanda)
- 2009** premio *inTESI 2009* del "Parco Scientifico e Tecnologico Galileo" per la tesi di laurea specialistica di Anna Lazzaretti
- 1998** premio AMASES 1998 per il lavoro *Calibration of the Gaussian Musiela model using the Karhunen-Loeve expansion* presentato al XXII Convegno AMASES a Genova

Supervisione di tesi di dottorato in Matematica

- 2021** Mariia Soloviova, *Modeling and forecasting electricity market variables using functional data analysis*, Università di Padova
- 2019** Maria Flora, *Essays on Energy Markets*, Università di Padova, Dottorato in Economia e Management
- 2019** Marco Piccirilli, *Additive models for energy markets*, Università di Padova
- 2018** membro esterno della commissione finale della tesi di dottorato in Matematica di Anastasia Borovykh e Sidy Diop, Università di Bologna
- 2018** referee e membro esterno della commissione finale della tesi di dottorato di Wenfeng Dong, *The evaluation of gas sales agreements*, Università di York, relatore prof. Boda Kang
- 2016** Matteo Basei, *Topics in stochastic control and differential game theory, with application to mathematical finance*, Università di Padova
- 2014** referee e membro esterno della commissione finale della tesi di dottorato di Marcus Karl Viren Eriksson, *Valuation of energy derivatives: a stochastic control approach*, Università di Oslo, relatore prof. Fred Espen Benth
- 2014** Stefano Pagliarani, *Portfolio optimization and option pricing under defaultable Levy driven models*, Università di Padova
- 2013** Enrico Edoli, *Pricing of gas swing contracts with indexed strike: a viscosity solution approach with applications*, Università di Padova
- 2006** Mihaela Antonia Cucicea, *Weak convergence of shortfall risk minimizing portfolios*, Università di Padova
- 2005** Vera Blaka Hallulli, *Stochastic delay differential equations and applications to Mathematical Finance*, Università di Padova (corelatore, relatore prof. Di Masi)

Supervisione di tesi di laurea magistrale/specialistica/quadriennale in Matematica

- 2020** Ulisse Del Giudice
- 2018** Marta Baldon, Beatrice Brigo
- 2017** Gaetano Adamo (corelatore, relatrice prof. Callegaro), Nicolò Fabio Bordin (laurea in Mathematical Engineering, corelatore dott. Edoli), Giulia Fiacca, Gianluca Maguolo (corelatrice prof. Callegaro), Daniela Romeo, Marika Sistoni
- 2016** Beatrice Rizzato
- 2015** Riccardo Barone, Fabio Casarotti (corelatore dott. Edoli), Marco Gallana (corelatore dott. Edoli), Valeria Giusto (corelatore, relatrice prof. Callegaro), Luca Latini, Mauro Timini, Francesca Turris
- 2014** Carlo Montanari (Università di Ferrara, corelatore, relatore prof. Miranda)
- 2013** Valentina Barigelli, Arianna Chiminazzo, Antonio Menegon (corelatore prof. Bonollo)
- 2012** Francesca Agatolio, Giuditta Baldacci (corelatore prof. Kolokoltsov), Matteo Basei (corelatore prof. Cesaroni, vincitrice del premio *Baccin Valentino* della "Fondazione Baccin Valentino"), Francesco Di Giambattista, Valentina Favero, Angela Nardo, Paolo Nicolini (corelatore prof. Marcuzzi), Davide Tasinato (corelatore dott. Edoli), Lara Tonello
- 2011** Federica Basaglia, Alessio Cappello (corelatore prof. De Marchi), Marcella Virgili (corelatore prof. Marcuzzi)
- 2009** Nicola Lanaro (corelatore prof. Marcuzzi), Anna Lazzaretti (vincitrice del premio *inTESI 2009* del "Parco Scientifico e Tecnologico Galileo"), Laura Pasin, Martina Pedrotta
- 2008** Ilaria Albertini, Giulia De Rossi, Mauro Rosestolato
- 2006** Giovanna Villani

- 2002** Marko Bastianić, Grazia De Silvestro (corelatore, relatore prof. Runggaldier)
2001 Stefania Mangano (corelatore, relatore prof. Runggaldier)
2000 Caterina Scagnellato (corelatore, relatore prof. Runggaldier)
1999 Agata Altieri (corelatore, relatore prof. Runggaldier)

Organizzazione di conferenze

- 2021** membro dei comitati scientifico e organizzatore della *10th General AMAmEF Conference*, Padova, 22–25 giugno 2021
2021 membro dei comitati scientifico e organizzatore della conferenza *Energy Finance Italia VI*, online (organizzato dall'Università di Brescia), 22 – 23 febbraio 2021
2021 membro del comitato scientifico del *XXII Workshop in Quantitative Finance*, online (organizzato dall'Università di Verona), 28 – 29 gennaio 2021
2020 membro del comitato scientifico della Summer School "Green Energy Management - Energy Solutions for Sustainable Environment ", online (organizzato dall'Università di Milano Bicocca), September 16 - 24
2020 membro del comitato organizzatore del *44° Convegno AMASES* - edizione online, 18 settembre
2020 membro dei comitati scientifico e organizzatore della conferenza *Energy Finance Italia V*, Roma, 10 – 11 febbraio 2020
2020 membro del comitato scientifico del *XXI Workshop in Quantitative Finance*, Napoli, 29 – 31 gennaio 2020
2019 membro del comitato organizzatore della Summer School "Green Energy Management - Energy Solutions for Sustainable Environment ", Baku (Azerbaijan), September 16 - 24
2019 membro del comitato organizzatore della *XII European Summer School in Financial Mathematics* (inserita nella serie *EMS Summer Schools*), Padova, 2 – 6 settembre 2019
2019 membro del comitato organizzatore del *Freiburg-Padova-Wien-Zürich Seminar*, Padova, 16 - 17 maggio 2019
2019 membro dei comitati scientifico e organizzatore della conferenza *Energy Finance Italia IV*, Milano, 4 – 5 febbraio 2019
2019 membro del comitato scientifico del *XX Workshop in Quantitative Finance*, Zurigo (Svizzera), 23 –25 gennaio 2019
2018 membro del comitato organizzatore della Summer School "Green Energy Management", Biella, 16 – 27 luglio 2018
2018 membro del comitato scientifico della conferenza *Energy Finance Italia III*, Pescara, 15 – 16 febbraio 2018
2018 membro del comitato organizzatore della Winter School "Green Energy Management", Tenerife (Spain), 25 gennaio – 2 febbraio 2018
2018 membro del comitato scientifico del *XIX Workshop on Quantitative Finance*, Roma, 24 – 26 gennaio 2018
2017 membro del comitato organizzatore della Summer School "Green Energy Management", evento satellite di EXPO 2017 "Future Energy", Astana (Kazakistan), 28 agosto - 9 settembre 2017
2017 membro del comitato scientifico/organizzatore della conferenza *La ricerca in gioco, il gioco nella ricerca*, Padova, 16 marzo 2017
2017 membro del comitato scientifico del *XVIII Workshop on Quantitative Finance*, Milano, 25 – 27 gennaio 2017
2016 membro del comitato scientifico e presidente del comitato organizzatore della conferenza *Energy Finance Italia II*, Padova, 5 – 6 dicembre 2016
2016 membro del comitato organizzatore del workshop *Mercati energetici e metodi quantitativi: un ponte tra Università e Aziende*, Padova, 13 ottobre 2016
2016 membro del comitato organizzatore della Winter School *Frontiers in Stochastic Modelling for Finance*, Padova, 8 – 12 febbraio 2016
2016 membro del comitato organizzatore della conferenza internazionale *Frontiers in Stochastic Modelling for Finance*, Padova, 2 – 5 febbraio 2016
2016 membro del comitato scientifico del *XVII Workshop on Quantitative Finance*, Pisa, 28 – 29 gennaio 2016
2015 membro del comitato organizzatore del workshop *Energy Finance Italia*, Camerino (MC), 10 – 11 dicembre 2015

- 2015** membro del comitato organizzatore del workshop *Mercati energetici e metodi quantitativi: un ponte tra Università e Aziende*, Padova, 8 ottobre 2015
- 2015** membro del comitato organizzatore del *39° Convegno AMASES* a Padova, 10 – 12 settembre 2015
- 2015** membro del comitato scientifico del *XVI Workshop on Quantitative Finance*, Parma, 29 – 30 gennaio 2015
- 2014** membro del comitato organizzatore della *2014 Energy & Finance Conference* ad Erice (TP), 24 – 26 settembre 2014
- 2014** membro del comitato organizzatore del workshop *Recent trends in Mathematical Finance*, Padova, 22 settembre 2014
- 2014** membro del comitato organizzatore del workshop *Mercati energetici e metodi quantitativi: un ponte tra Università e Aziende*, Padova, 22 – 23 maggio 2014
- 2014** membro del comitato scientifico del *XV Workshop on Quantitative Finance*, Firenze, 23 – 24 gennaio 2014
- 2013** membro del comitato organizzatore del workshop *Mercati energetici e metodi quantitativi: un ponte tra Università e Aziende*, Padova, 10 maggio 2013
- 2013** membro del comitato scientifico del *XIV Workshop on Quantitative Finance*, Rimini, 24 – 25 gennaio 2013
- 2012** membro del comitato organizzatore della conferenza in onore dei 70 anni di Wolfgang J. Runggaldier, Padova, 21 – 22 settembre 2012
- 2012** membro del comitato scientifico del *XIII Workshop on Quantitative Finance*, L'Aquila, 26 – 27 gennaio 2012
- 2011** presidente dei comitati scientifico e organizzatore del *XII Workshop on Quantitative Finance*, Padova, 27 – 28 gennaio 2011
- 2007** membro del comitato organizzatore della conferenza *Stochastic processes: theory and applications, on the occasion of the 65th birthday of Wolfgang Runggaldier*, Bressanone/Brixen (BZ), 16 – 20 luglio 2007

Varie

- 2021–** guest editor di *Annals of Operations Research* per la special issue *[NOME?]*
- 2017–2019** guest editor di *Energy Economics* per la special issue *Energy Markets Dynamics in a changing environment*
- 2017–** membro della Commissione Scientifica di Area 1 "Scienze Matematiche" dell'Università di Padova
- 2016–** membro della Commissione GAV del Corso di Laurea Magistrale in Mathematical Engineering dell'Università di Padova
- 2015–2018** rappresentante del Dipartimento di Matematica nel Consiglio Direttivo del Centro Interdipartimentale di ricerca per l'Economia e la Tecnica dell'Energia "Giorgio Levi Cases"
- 2010–** membro del Collegio Docenti della Scuola di Dottorato in Matematica dell'Università di Padova
- 2007–** membro della squadra di primo soccorso dell'edificio "Torre Archimede" all'Università di Padova
- 2006–** coordinatore del Seminario della scuola di dottorato in Matematica dell'Università di Padova (indirizzo Matematica Computazionale).
- 2004–** relatore di 23 tesi di laurea triennale in Matematica e in Statistica
- 2003–2015** membro della Commissione Didattica e Tutorato del Corso di Studi in Matematica dell'Università di Padova (presidente dal 2012)
- 1999–** referee per le riviste *Abstract and Applied Analysis*, *Annals of Operations Research*, *Applied Mathematical Finance*, *Applied Probability Journals*, *Control*, *Optimization and Calculus of Variations*, *Decisions in Economics and Finance*, *Energy Economics*, *European Journal of Operational Research*, *Insurance: Mathematics and Economics*, *International Journal of Theoretical and Applied Finance*, *Journal of Applied Probability*, *Journal of Banking and Finance*, *Journal of Credit Risk*, *Journal of Economic Dynamics and Control*, *Journal of Mathematical Analysis and Applications*, *Journal of Optimization Theory and Applications*, *Mathematical Finance*, *Quantitative Finance*, *Rendiconti per gli studi economici quantitativi*, *Revue Finance*, *Risks*, *SIAM Journal of Control and Optimization*, *SIAM Journal on Financial Mathematics*, *Stochastics* e *Quantitative Finance*.
- 1998–** controrelatore di diverse tesi di laurea in Matematica all'Università di Padova
- novembre 1997** borsa dell'IMPAN (Istituto di Matematica dell'Accademia delle Scienze Polacca) a Varsavia

1999–2003 rappresentante dei ricercatori nel Consiglio di Facoltà di Scienze MM. FF. NN. dell'Università di Padova

1998 rappresentante degli studenti nella Commissione Personale della Scuola Normale Superiore

1996 rappresentante dei perfezionandi nella Commissione Contributi della Classe di Scienze della Scuola Normale Superiore

1993–1995 rappresentante degli studenti nel Consiglio di Facoltà di Scienze MM. FF. NN. dell'Università di Pisa

Io sottoscritto Tiziano Vargiolu, nato a Saronno (VA) il 30 - 8 - 1972, residente a Padova, Via Dardanelli 9, dichiaro che tutto quanto qui dichiarato corrisponde a verità ai sensi degli artt. 2 e 4 della L. 15/68 e successive modificazioni.

Padova, 15 marzo 2022

