

## Curriculum vitae Silvestro Lo Cascio

Full Name : Silvestro Antonio Basilio Lo Cascio  
Birth date : Catania, 13.03.1964.  
Tel. : +39-957537735  
e-mail : [silvestrolocascio@gmail.com](mailto:silvestrolocascio@gmail.com) [locascio@unict.it](mailto:locascio@unict.it)

### Studi

**Laurea** 1989: Laurea in Economia e Commercio con votazione 110/110 e lode, Università di Catania. Tesi in Matematica Finanziaria II : *"Organizzazione dell'informazione per scopi decisionali: un modello per la scelta di un investimento obbligazionario"* relatore Ch.mo Prof. B. Matarazzo. Il lavoro di tesi è stato realizzato presso l'Erasmus University di Rotterdam (NL), sotto la supervisione del Prof. J. Spronk.

**Lingue parlate:** Italiano, Inglese, Francese ed Olandese.

### Esperienze di lavoro

- 2010-data Professore aggregato di Matematica Finanziaria ed Attuariale per i corsi di laurea in Economia ed Economia Aziendale.
- 2005-2009 Professore aggregato di Metodi matematici per il rischio finanziario, di Modelli matematici per i mercati finanziari ed assicurativi e di Modelli matematici per le decisioni finanziarie presso la Facoltà di Economia dell'Università di Catania. Sito della Facoltà: [http://www.economia.unict.it/docente.asp?ID\\_Docente=70](http://www.economia.unict.it/docente.asp?ID_Docente=70)
- 2005 Docente presso ERMES alta formazione nel Master in European Financial Advising su efficienza dei mercati, stili di gestione e metodi di valutazione della gestione di un fondo. Sito dell'istituto: <http://www.ermesformazione.com/docenti.htm>
- 2003-2005 Professore incaricato di Matematica Finanziaria II e Matematica Finanziaria I presso la Facoltà di Economia dell'Università di Catania
- 2001-2002 Professore incaricato di Matematica Generale e di Matematica Finanziaria I presso la Facoltà di Economia dell'Università di Catania
- 1996-data Ricercatore confermato per il settore disciplinare della Matematica Applicata presso la Facoltà di Economia dell'Università di Catania.
- 1990-1994 Assistente Ricercatore per il Tinbergen Institute presso la Faculty of Economics, Erasmus University Rotterdam (NL).

### Attività di ricerca

**Finanza quantitativa:** modelli Multi-Fattoriali e valutazione del rischio di investimento (azioni ed obbligazioni su mercati internazionali). Valutazione di investimenti e valutazioni d'impresa. Anomalie di mercato nella Borsa di Milano. Valutazione del rischio di portafogli obbligazionari. IPOs nella Borsa di Milano. Valutazione e gestione del rischio valutario. Modelli evolutivi dei mercati finanziari, applicazioni e possibili condizioni di equilibrio. Il concetto di qualità dei mercati finanziari per superare i limiti della teoria dei mercati efficienti. Prospect Theory e sue applicazioni ai modelli evolutivi di mercato. Mental Accounting e stima dell'evoluzione dei prezzi di riferimento degli investitori.

**Teoria dei giochi** per la valutazione delle tariffe e delle quote di mercato nel settore della telefonia mobile.

**Economia ambientale** e modelli per la valutazione collettiva delle risorse naturali.

### Pubblicazioni

1) De Marchi B., Funtowicz S., Lo Cascio S., Munda G., *"Combining participative and institutional approaches with multicriteria evaluation. An empirical study for water issues in Troina. Sicily"*, Ecological Economics (34) 2 August 2000.

2) Funtowicz S. O., Lo Cascio S., Munda G., *"The Troina Perceived Water Issue: a Multicriteria Evaluation Process"*. in M. O' Connor (editor, 2000) Environmental Evaluation, Volume 1 in the International Library of Ecological Economics, Edward Elgar, Cheltenham.

3) De Marchi B., Funtowicz S., Lo Cascio S., Munda G., *"The Troina Water Valuation Case Study"*. Research report, European Commission, Joint Research Center, ISIS, Ispra (1998). Internet address of this report: <http://alba.jrc.it/valse.htm>

4) Lo Cascio S (2012). Efficiency and Economic Quality of Financial Markets: Implications of AMH and Prospect Theory. In: EURO Working Group on Financial Modelling 50th meeting. p. 24-25, Roma, 3 - 5 maggio 2012.

5) Lo Cascio S. *"Efficiency and quality of financial markets: an empirical investigation of the Italian Stock Market"*. XXXV<sup>^</sup> meeting dell'EURO Working Group on Financial Modelling. Almeria, 16 oct 2004.

6) *"Portfolio Performance in the Italian Stock Exchange through the eyes of monkeys"* with J. Spronk. XXII<sup>^</sup> meeting dell'EURO Working Group on Financial Modelling. Paris, 14 may 1998.

7) Lo Cascio S., Matarazzo B., Greco S. *"Rough sets approach to stock selection: an application to the Italian market"* in Bertocchi, M., E. Cavalli, S. Komlòsi eds. "Modelling techniques for financial markets and bank management". Physica-Verlag, Heidelberg, 1996.

8) Lo Cascio S. *"Information flow and calendar anomalies in the Italian Stock Market"*. Atti del XXI convegno A.M.A.S.E.S., Roma. 1997.

9) Lo Cascio S., Spronk J. *"Multi-Factor models for stock returns and new informations"*. Atti del XVI convegno A.M.A.S.E.S., Treviso. 1992.

Citazioni su google scholar, 288

Indice isi, 3

Indice research gate 3,16