

Curriculum Vitae

ALBERTO ZAFFARONI

Maggio 2023

INFORMAZIONI PERSONALI E RECAPITI

Nato a Milano, il 1 Settembre 1964.
Dipartimento di Economia 'Marco Biagi'
Università di Modena e Reggio Emilia
Viale Berengario, 51
41100 Modena, ITALY
phone 39-059-2056741
e-mail alberto.zaffaroni@unimore.it

POSIZIONE ATTUALE E PASSATE

Professore Ordinario di Metodi Matematica dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie
(SSD SECS S/06 – 13/D4) Università di Modena e Reggio Emilia (dal Dicembre 2010)

Professore Ordinario di Metodi Matematica dell'Economia
Università del Salento, Lecce (da Novembre 2006 a Dicembre 2010)

Professore Associato di Metodi Matematica dell'Economia
Università del Salento, Lecce (da Novembre 1998 a Ottobre 2006)

Ricercatore Universitario di Metodi Matematica dell'Economia
Università Bocconi, Milan (da Luglio 1994 a Ottobre 1998)

TITOLI DI STUDIO

Dottorato di Ricerca in Matematica Applicata ai Problemi Economici, Università di Trieste, 1996.

Laurea in Discipline Economiche e Sociali, Università Bocconi, Milano, March 1990.

ATTIVITA' PROFESSIONALE

Presidente del Consiglio Didattico del Corso di Laurea in Economia e Finanza e del Corso di Laurea Magistrale in Economia, Finanza e Assicurazioni, Università del Salento, 2009-10.

Coordinatore del Dottorato di Ricerca in Economia, Università del Salento, 2007-09.

Referee: Mathematical Programming, SIAM Journal of Optimization, Journal of Optimization Theory and Applications, Journal of Convex Analysis, Optimization, Mathematical Methods of Operations Research, Pacific Journal of Optimization, Journal of Global Optimization, RAIRO Operations Research, Mathematical Reviews.

ESPERIENZA DI INSEGNAMENTO

Corsi di Laurea

Matematica (Università di Modena, Università del Salento, Università Bocconi)
Matematica per l'Economia (Università di Modena, Università del Salento, Università Bocconi)
Finanza Matematica (Università del Salento)
Matematica Finanziaria (Università di Modena, Università Bocconi)

Corsi post-laurea

Matematica per l'Economia (Algebra Lineare, Ottimizzazione, Sistemi Dinamici), Corsi di Dottorato di Ricerca dell'Università del Salento, Università di Milano, Università di Pavia.
Option Pricing e Selezione del Portafoglio, Master in Finanza, Università del Salento.

INTERESSI DI RICERCA

Metodi Matematici dell'Analisi Economica, Analisi Convessa, Dualità, Ottimizzazione, Efficienza Paretiana, Analisi Non Differenziabile

PUBBLICAZIONI

- A. Zaffaroni – Separation, convexity and polarity in the space of normlinear functions, *Optimization*, 71 (4), 2022, pp. 1213-1248.
- G. Campisi, S. Muzzioli, A. Zaffaroni - Nonlinear dynamics in asset pricing: the role of a sentiment index, *Nonlinear Dynamics*, 105, 2021, pp.2509–2523.
- E. Ernst, A. Zaffaroni – New representations of sets of lower bounds and of sets with supremum in Archimedean order-unit vector spaces, *DEMB Working paper series*, Università di Modena e Reggio Emilia, 2018.
- E. Ernst, A. Zaffaroni - Characterizing sets of lower bounds: a hidden convexity result, *Set Valued and Variational Analysis*, 25, 2017, pp.639-650.
- A. Zaffaroni, Convex radiant costarshaped sets and the least sublinear gauge, *Journal of Convex Analysis*, 20, 2013, pp.307-328.
- E. Caprari, A. Zaffaroni, Conically equivalent convex sets and applications, *Pacific J. of Optimization*, 6, 2010, pp. 281-303.
- A. Zaffaroni, Convex coradiant sets with a continuous concave cogauge, *Journal of Convex Analysis*, 15, 2008, pp. 325-243.
- A.G. Quaranta, A. Zaffaroni – Robust Optimization of Conditional Value at Risk and Portfolio Selection, *Journal of Banking and Finance*, 2008.
- A. Zaffaroni - Superlinear separation for radiant and coradiant sets, *Optimization*, 56, 2007, pp. 267-285.
- A. Zaffaroni – Monotonicity along rays and consumer duality with nonconvex preferences, in: *Recent Developments on Applied Mathematics*, L. Carosi and L. Martein eds., Pisa, 2007.
- A. Zaffaroni – Superlinear separation and dual properties of radiant functions, *Pacific Journal of Optimization*, 2 (1), 2006, pp.181-202.
- A. Zaffaroni - Is every radiant function the sum of quasiconvex functions?, *Mathematical Methods of Operations Research*, 59 (2), 2004, pp.221-233.
- A. Zaffaroni - Degrees of efficiency and degrees of minimality, *SIAM J. Control and Optimization*, 42 (3), 2003, pp. 1071-86.

- A. Zaffaroni – Monotonicity along rays in the framework of Abstract Convexity, in: Optimization in Economics, Finance and Industry, Crespi et al. eds., Datanova 2002, pp.205-222.
- A. Zaffaroni - Continuous approximations, codifferentiable functions and minimization methods, in: Quasidifferentiability and related topics, V.F. Demyanov, A.M. Rubinov eds., Kluwer 2000, pp. 361-391
- A.M. Rubinov, A. Zaffaroni - Continuous approximations of nonsmooth mappings, in: Progress in Optimization, Contributions from Australasia, A. Eberhart, R. Hill, D. Ralph, B.D. Glover eds., Kluwer, 1999, pp. 27-56
- L. Carosi, A. Zaffaroni - On the existence of maximal elements for partial preorders, *Journal of Information and Optimization Sciences*, 20, 1999, pp. 271-286.
- A. Zaffaroni - Set valued derivatives of nonsmooth mappings, in: Generalized Convexity and Optimization for Economic and Financial Decisions, G. Giorgi and F. Rossi eds., Pitagora 1999, pp. 359-383.
- E. Molho, A. Zaffaroni - Quasiconcavity of sets and connectedness of the efficient frontier in ordered vector spaces, in: Generalized Convexity, Generalized Monotonicity, J.-P. Crouzeix, J.-E. Martinez-Legaz, M. Volle eds. Kluwer 1998, pp. 407-424.
- A. Zaffaroni - Codifferentiable mappings with applications to vector optimization, *Pliska - Studia Mathematica Bulgarica*, 12, 1998, pp.255-266.
- A. Zaffaroni, B.M. Glover - Vector subdifferentials via recession mappings, *Optimization*, 39, 1997, pp.203-237.
- V. Jeyakumar, A. Zaffaroni - Asymptotic conditions for weak and proper optimality in infinite dimensional convex vector optimization, *Numerical Functional Analysis and Optimization*, vol. 17, 1996, pp.323-343
- A. Zaffaroni - Vector Subdifferentials, Proceedings of the II Optimization Miniconference, (eds. B.M. Glover, V. Jeyakumar), University of New South Wales, Sydney, Australia, 1995.
- A. Guerraggio, E. Molho, A. Zaffaroni - On the notion of proper efficiency in vector optimization, *Journal of Optimization Theory and Applications*, vol. 82, 1994, pp.1-21.