



Elenco dei titoli e delle pubblicazioni scientifiche

Settore Concorsuale: 13/D4 - METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCIENZE ATTUARIALI E FINANZIARIE Prima Fascia

Emilio BARUCCI

Posizione accademica

Settore Scientifico Disciplinare:	SECS-S/06 - Metodi matematici dell'economia e delle scienze attuariali e finanziarie
Qualifica:	Professore Ordinario
Anzianità nel ruolo:	01/09/2001
Sede Universitaria:	Politecnico di MILANO
Struttura di afferenza (dipartimento o altro):	Matematica

Posizioni ricoperte precedentemente nel medesimo ateneo o in altri

Periodo	Fascia	Ateneo
30/03/1993	Ricercatore Universitario	Università degli Studi di FIRENZE
01/11/1998	Professore II Fascia	Università di PISA

01/09/2001	Professore I Fascia	Università di PISA
01/05/2005	Professore I Fascia	Politecnico di MILANO

Pubblicazioni scientifiche

1	2018	<p>Articolo in rivista</p> <p>Barucci, Emilio, la Bua, Gaetano, Marazzina, Daniele (2018). On relative performance, remuneration and risk taking of asset managers. ANNALS OF FINANCE, vol. online first, p. 1-29, ISSN: 1614-2446, doi: 10.1007/s10436-018-0324-5</p>
2	2018	<p>Articolo in rivista</p> <p>Barucci, Emilio, Baviera, Roberto, Milani, Carlo (2018). The Comprehensive Assessment: What lessons can be learned?. EUROPEAN JOURNAL OF FINANCE, vol. 24, p. 1-19, ISSN: 1351-847X, doi: 10.1080/1351847X.2017.1414703</p>
3	2017	<p>Monografia o trattato scientifico</p> <p>Barucci, Emilio, Fontana, Claudio (2017). Financial markets theory. LONDON:Springer, ISBN: 978-1-4471-7321-2, doi: 10.1007/978-1-4471-7322-9</p>
4	2016	<p>Articolo in rivista</p> <p>BARUCCI, EMILIO, MARAZZINA, DANIELE (2016). Asset management, High Water Mark and flow of funds. OPERATIONS RESEARCH LETTERS, vol. 44, p. 607-611, ISSN: 0167-6377, doi: 10.1016/j.orl.2016.07.002</p>
5	2016	<p>Articolo in rivista</p> <p>Barucci Emilio, Baviera Roberto, Milani Carlo (2016). Is the Comprehensive Assessment able to capture banks' risks?. FINANCE RESEARCH LETTERS, vol. 19, p. 98-104, ISSN: 1544-6123, doi: 10.1016/j.frl.2016.06.010</p>
6	2016	<p>Contributo in Atti di convegno</p> <p>Barucci Emilio, Baviera Roberto, Milani Carlo (2016). Is the comprehensive assessment really comprehensive?. In: The SSM at 1. p. 95-106, Vienna:Suerf - Deutsche Bundesbank, ISBN: 978-3-902109-82-8, Frankfurt - Germany</p>
7	2015	<p>Articolo in rivista</p> <p>Barucci Emilio, Cosso Andrea (2015). Portfolio choices and VaR constraint with a defaultable asset. QUANTITATIVE FINANCE, vol. 15, p. 853-864, ISSN: 1469-7688, doi: 10.1080/14697688.2013.871643</p>
8	2015	<p>Articolo in rivista</p> <p>EMILIO BARUCCI, DANIELE MARAZZINA (2015). RISK SEEKING, NONCONVEX REMUNERATION AND REGIME SWITCHING. INTERNATIONAL JOURNAL OF THEORETICAL AND APPLIED FINANCE, vol. 18, p. 1550009.1-1550009.25, ISSN: 0219-0249, doi: 10.1142/S0219024915500090</p>

9	2014	Articolo in rivista Barucci Emilio, Casna Marco (2014). On the Market Selection Hypothesis in a Mean Reverting Environment. COMPUTATIONAL ECONOMICS, vol. 44, p. 101-126, ISSN: 0927-7099, doi: 10.1007/s10614-013-9400-0
10	2014	Articolo in rivista E. Barucci, F. Gazzola (2014). Prices in the utility function and demand monotonicity. KODAI MATHEMATICAL JOURNAL, vol. 37, p. 544-567, ISSN: 0386-5991
11	2014	Contributo in volume (Capitolo o Saggio) Barucci Emilio, Messori Marcello (2014). the need for a true back-stop. In: (a cura di): emilio barucci;marcello messori, Towrds the European banking union. p. 137-144, passigli editore, ISBN: 978-88-368-1490-9
12	2014	Contributo in volume (Capitolo o Saggio) Barucci Emilio, Messori Marcello (2014). The limits of the bail in process. In: (a cura di): emilio barucci;marcello messori, Towrds the European banking union. p. 129-136, passigli editore, ISBN: 978-88-368-1490-9
13	2014	Contributo in volume (Capitolo o Saggio) Barucci Emilio (2014). I profili finanziari del processo di privatizzazione. Effetti sui mercati finanziari. In: (a cura di): roberto artoni, Storia dell'IRI. Crisi e privatizzazione. p. 451-504, laterza editore, ISBN: 978-88-581-0572-6
14	2013	Articolo in rivista E.Barucci, L. Del Viva (2013). Dynamic Capital Structure and the Contingent Capital Option. ANNALS OF FINANCE, vol. 9, p. 1-30, ISSN: 1614-2446, doi: 10.1007/s10436-012-0188-z
15	2012	Articolo in rivista e.barucci, d.magno, m.e. mancino (2012). Fourier volatility forecasting with high frequency data and microstructure noise. QUANTITATIVE FINANCE, vol. 12, p. 281-294, ISSN: 1469-7688, doi: 10.108/1497680903413589
16	2012	Articolo in rivista e.barucci, m.tolotti (2012). Social interaction and conformism in a random utility model. JOURNAL OF ECONOMIC DYNAMICS & CONTROL, vol. 36, p. 1855-1866, ISSN: 0165-1889
17	2012	Articolo in rivista E. Barucci, L. Del Viva (2012). Countercyclical Contingent Capital. JOURNAL OF BANKING & FINANCE, vol. 36, p. 1688-1709, ISSN: 0378-4266, doi: 10.1016/j.jbankfin.2012.01.016
18	2012	Articolo in rivista E Barucci, D Marazzina (2012). Optimal Investment, Stochastic Labor Income and Retirement. APPLIED MATHEMATICS AND COMPUTATION, vol. 218, p. 5588-5604, ISSN: 0096-3003, doi: 10.1016/j.amc.2011.11.05

19	2011	Articolo in rivista e. barucci, m. tolotti (2011). Identity, reputation and social interaction with an application to sequential voting . JOURNAL OF ECONOMIC INTERACTION AND COORDINATION, vol. 7, p. 79-98, ISSN: 1860-711X, doi: 10.1007/s11403-011-0083-0
20	2010	Articolo in rivista e. barucci, m.e. mancino (2010). Computation of volatility in stochastic volatility models with high frequency data. INTERNATIONAL JOURNAL OF THEORETICAL AND APPLIED FINANCE, vol. 13, p. 767-787, ISSN: 0219-0249, doi: 10.1142/S0219024910005991
21	2010	Contributo in volume (Capitolo o Saggio) BARUCCI E (2010). Dopo la crisi: il confine tra Stato e mercato. In: e.barucci, m. grillo, c. de vincenti. Idee per l'Italia. p. 155-162, ISBN: 978-88-95399-29-4
22	2010	Contributo in volume (Capitolo o Saggio) BARUCCI E, F. PIEROBON (2010). stato imprenditore e regolatore: quale confine?. In: e.barucci, c. de vincenti, m. grillo. idee per l'italia. p. 1-14, ISBN: 978-88-95399-29-4
23	2010	Monografia o trattato scientifico E. Barucci, F.Pierobon (2010). Stato e mercato nella seconda repubblica. il mulino, ISBN: 9788815138859
24	2009	Contributo in volume (Capitolo o Saggio) BARUCCI E, F. PIEROBON (2009). Investment banking: non la causa ma il cuore della crisi. In: E.Barucci, M.Messori. Oltre lo shock. p. 95-110, MILANO:EGEA Editore, ISBN: 8823832306
25	2009	Contributo in volume (Capitolo o Saggio) BARUCCI E, D. MAGNO (2009). Il propagarsi della crisi: svalutazioni, rischio liquidità, ricapitalizzazioni. In: e. barucci, m. messori. oltre lo shock. p. 139-174, ISBN: 8823832306
26	2009	Contributo in volume (Capitolo o Saggio) BARUCCI E, M. MORINI (2009). Cartolarizzazioni: un meccanismo che non ha funzionato. In: e.barucci, m.messori. Oltre lo shock. p. 47-72, ISBN: 8823832306
27	2009	Contributo in volume (Capitolo o Saggio) BARUCCI E, M. MESSORI (2009). Oltre la crisi: come combinare stabilità ed efficienza dei mercati finanziari. In: e. barucci, m. messori. oltre lo shock. p. 251-276, ISBN: 8823832306
28	2009	Monografia o trattato scientifico E. Barucci, C. Marsala, M. Nencini, C. Sgarra (2009). INGEGNERIA FINANZIARIA. EGEA, ISBN: 9788823820951

29	2008	Articolo in rivista E. BARUCCI, MATTESINI F (2008). Bank shareholding and lending: complementarity or substitution? Some evidence from a panel of large Italian firms. JOURNAL OF BANKING & FINANCE, vol. 32, p. 2237-2247, ISSN: 0378-4266
30	2007	Monografia o trattato scientifico BARUCCI E, F. PIEROBON (2007). le privatizzazioni in italia. p. 1-144, ROMA:Carucci, ISBN: 978-88-430-4066-7
31	2006	Articolo in rivista BARUCCI E, C. BIANCHI, M. FREDIANI (2006). CEO turnover in the Italian financial market. GIORNALE DEGLI ECONOMISTI E ANNALI DI ECONOMIA, vol. 65, p. 127-154, ISSN: 0017-0097
32	2006	Articolo in rivista BARUCCI E, C. BIANCHI, A. MANCONI (2006). internal dealing regulation and insiders' trades in the italian financial market. EUROPEAN JOURNAL OF LAW AND ECONOMICS, vol. 22, p. 107-119, ISSN: 0929-1261, doi: 10.1007/s10657-006-0306-3
33	2006	Articolo in rivista e.barucci, c. bianchi, f. casciari, e. squillantini (2006). Definizione di una metodologia per l'individuazione di fenomeni di market abuse. STATISTICA APPLICATA, p. 559-571, ISSN: 1125-1964
34	2006	Monografia o trattato scientifico BARUCCI E (2006). Financial Markets Theory: Equilibrium, Efficiency and Information. p. 1-413, ISBN: 7810986279
35	2006	Monografia o trattato scientifico BARUCCI E (2006). Mercato dei capitali e corporate governance. p. 1-210, ROMA:Carucci, ISBN: 88-430-3927-X
36	2005	Articolo in rivista BARUCCI E, A. MONTI (2005). Una analisi della reazione del mercato alle variazioni delle partecipazioni rilevanti delle società quotate nel mercato finanziario italiano. BANCA IMPRESA SOCIETÀ, vol. 23, p. 379-399, ISSN: 1120-9453, doi: 10.1435/21159
37	2005	Articolo in rivista BARUCCI E, J. FALINI (2005). Determinants of corporate governance in the Italian financial market. ECONOMIC NOTES, vol. 34, p. 371-405, ISSN: 0391-5026
38	2005	Articolo in rivista BARUCCI E, C. BIANCHI, A. PASSAPONTI (2005). Comportamenti imitativi tra gli analisti finanziari nel mercato finanziario italiano. RIVISTA DI POLITICA ECONOMICA, vol. XCV, p. 103-137, ISSN: 0035-6468

39	2004	<p>Articolo in rivista E.Barucci, R.Monte, R.Renò (2004). Asset price anomalies under bounded rationality. COMPUTATIONAL ECONOMICS, vol. 23, p. 255-269, ISSN: 0927-7099</p>
40	2004	<p>Articolo in rivista e.barucci, v.faralli (2004). Una metodologia per l'individuazione di fenomeni di market abuse nei mercati finanziari. BANCA IMPRESA SOCIETÀ, p. 515-532, ISSN: 1120-9453</p>
41	2003	<p>Articolo in rivista BARUCCI E, MALLIAVIN, MANCINO, RENÒ, THALMAIER (2003). THE PRICE VOLATILITY FEEDBACK RATE: AN IMPLEMENTABLE MATHEMATICAL INDICATOR OF MARKET STABILITY. MATHEMATICAL FINANCE, vol. 13, p. 17-35, ISSN: 0960-1627</p>

Titoli

Direzione di enti o istituti di ricerca di alta qualificazione internazionale

- niente
dal 01-01-1950 al 01-01-1950

Responsabilità scientifica per progetti di ricerca internazionali e nazionali, ammessi al finanziamento sulla base di bandi competitivi che prevedano la revisione tra pari

- niente
dal 01-01-1950 al 01-01-1950

Direzione o partecipazione a comitati editoriali di riviste, collane editoriali, enciclopedie e trattati di riconosciuto prestigio

- niente
dal 01-01-1950 al 01-01-1950

Incarichi di insegnamento o di ricerca (fellowship) presso qualificati atenei e istituti di ricerca esteri o sovranazionali

- niente
dal 01-01-1950 al 01-01-1950

Premi e riconoscimenti per l'attività scientifica, inclusa l'affiliazione ad accademie di riconosciuto prestigio nel settore

- niente
dal 01-01-1950 al 01-01-1950

Nei settori concorsuali in cui è appropriato, risultati ottenuti nel trasferimento tecnologico in termini di partecipazione alla creazione di nuove imprese (spin off), sviluppo, impiego e commercializzazione di brevetti

- niente
dal 01-01-1950 al 01-01-1950

Altri titoli che contribuiscano a una migliore definizione del profilo scientifico

- niente
dal 01-01-1950 al 01-01-1950

