

PERSONAL INFORMATION **Silvana Musti** silvana.musti@unifg.it <https://www.unifg.it/it/rubrica/silvana-musti>

ESPERIENZE LAVORATIVE

2006 – Oggi **Professore Associato**

Dipartimento di Economia, Management e Territorio (DEMeT)
Università degli Studi di Foggia

SECS-S/06 METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCIENZE ATTUARIALI E FINANZIARIE

2000 – 2006 **Ricercatore**

Facoltà di Economia
Università degli Studi di Foggia

SSD S04B MATEMATICA FINANZIARIA E SCIENZE ATTUARIALI (poi SSD SECS-S/06 METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCIENZE ATTUARIALI E FINANZIARIE)

2000 **Assegnista di Ricerca**

Dipartimento di Matematica
Università degli Studi di Bologna

Approssimazioni di un sistema stocastico non Markoviano per la rappresentazione della struttura per scadenza dei tassi di interesse nell'ambito del modello Heath-Jarrow-Morton

ISTRUZIONE E FORMAZIONE

1997–2001 **Dottorato di Ricerca - Titolo della Tesi: *Numerical Investigations of the Heath-Jarrow-Morton Model with Forward Rate Dependent Volatility***

Dottorato di Ricerca in Matematica per l'Analisi dei Mercati Finanziari
Università degli Studi di Brescia

2000–2001 **Master of Business (Research) in Finance and Economics**

School of Finance and Economics, University of Technology, Sydney, Australia

1985–1990 **Laurea in Economia e Commercio**

Università degli Studi di Bologna

ATTIVITÀ DIDATTICA RECENTE

- aa 2022/23 **Titolare del corso di MATEMATICA FINANZIARIA, 8 cfu, SSD SECS-S/06**
CdL triennale in Gestione Aziendale, DEMeT, Università degli Studi di Foggia
- dal 2021/22 al 2022/23 **Titolare del corso di METODI MATEMATICI PER LA FINANZA INTERNAZIONALE, 8 cfu, SSD SECS-S/06**
CdL Magistrale in Imprenditorialità e Management Internazionale, DEMeT, Università degli Studi di Foggia.
- dal 2006/07 al 2020/21 **Titolare del corso di MATEMATICA FINANZIARIA, 8 cfu, SSD SECS-S/06**
CdL Triennale in Economia Aziendale, Dipartimento (già Facoltà) di Economia, Università degli Studi di Foggia.
- dal 2011/12 al 2021/22 **Incarico di supplenza per il corso di FINANZA QUANTITATIVA, 8 cfu, SSD SECS-S/06**
CdL Magistrale in Banca, Finanza e Mercati (già Corso di Laurea in Finanza), Dipartimento (già Facoltà) di Economia, Università degli Studi di Foggia
- dal 2020/21 al 2022/23 **Incarico di supplenza per il Modulo di Matematica (5 cfu) nel corso di METODI QUANTITATIVI PER LA FINANZA, SSD SECS-S/06**
CdL Magistrale in Analisi, Consulenza e Gestione Finanziaria, Università degli Studi di Modena e Reggio Emilia
- 2021 e 2022 **Incarico per lo svolgimento del Modulo IV – Studio dei flussi finanziari nella PA**
Corso Valore PA (edizione 2020) di II livello tipo A

PRINCIPALI PUBBLICAZIONI

- [1] Viviana Fanelli, Silvana Musti, and Valerio Poti. "Pricing a spark spread in the presence of counterparty risk". In: *Submitted to Applied Stochastic Models in Business and Industry* (2023).
- [2] Traduzione a cura di Silvana Musti. *Possiamo evitare un'altra crisi finanziaria?* Impri-matur editore, 2017.
- [3] Viviana Fanelli, Lucia Maddalena, and Silvana Musti. "Asian options pricing in the day-ahead electricity market". In: *Sustainable cities and society* 27 (2016), pp. 196–202.
- [4] Viviana Fanelli, Lucia Maddalena, and Silvana Musti. "Modelling electricity futures prices using seasonal path-dependent volatility". In: *Applied energy* 173 (2016), pp. 92–102.
- [5] Viviana Fanelli, Silvana Musti, and Lucia Maddalena. "Electricity market equilibrium model with seasonal volatilities". In: *Procedia engineering* 118 (2015), pp. 1217–1224.
- [6] Viviana Fanelli, Lucia Maddalena, and Silvana Musti. "La diffusione di tecnologie per la produzione di energia da fonte rinnovabile in Puglia: modelli a confronto". In: (2012).
- [7] Viviana Fanelli, Lucia Maddalena, and Silvana Musti. "Investigating the diffusion of renewable energy technologies in Italy". In: *Advances and Applications in Mathematical Sciences* 12.1 (2012), p. 59.
- [8] Carl Chiarella, Viviana Fanelli, and Silvana Musti. "Modelling the evolution of credit spreads using the Cox process within the HJM framework: A CDS option pricing model". In: *European Journal of Operational Research* 208.2 (2011), pp. 95–108.

- [9] Viviana Fanelli and Silvana Musti. "Why did CPDOs Fail? An Analysis Focused on Credit Spread Modeling." In: *International Review of Applied Financial Issues & Economics* 2.4 (2010).
- [10] Silvana Musti and Rita Laura D'Ecclesia. "Term structure of interest rates and the expectation hypothesis: The euro area". In: *European Journal of Operational Research* 185.3 (2008), pp. 1596–1606.
- [11] Carl Chiarella, Les Clewlow, and Silvana Musti. "A volatility decomposition control variate technique for Monte Carlo simulations of Heath Jarrow Morton models". In: *European journal of operational research* 161.2 (2005), pp. 325–336.