

Allegato 1/1

PRIMA PROVA

27.01.09

Sottosegretario

Stefano Gualtieri

STATISTICA E PROBABILITÀ

Tema n. 3

Illustri il candidato il rapporto esistente tra diffusione, martingale e equazioni alle derivate parziali. Si discuta in particolare il caso di diffusioni descritte da equazioni differenziali stocastiche autonome (e cioè i cui coefficienti non dipendano dal tempo) in connessione al problema agli autovalori/autofunzioni di Sturm e Liouville.



27 gennaio 2009

Stefano Gualtieri

Giovanni Gualtieri, 27
Luisa Gualtieri

CONSOB
CONCORSO PUBBLICO
A 5 POSTI DI COADIUTORE
(statistici-quantitativi)
sede di Roma

Allegato 5/A

SECONDA PROVA

MATEMATICA

Tema n. 1

Il candidato descriva come l'utilizzo di equazioni differenziali alle derivate parziali di tipo parabolico risulti uno strumento efficace nelle applicazioni economiche e finanziarie. Il candidato evidenzi in quali casi tale strumento permetta di individuare risultati analitici e fornisca qualche esempio di modelli risolvibili in forma chiusa e di modelli risolvibili mediante algoritmi numerici.

28 gennaio 2009



[Handwritten signatures]
Riletti
Gino Manni


[Handwritten signature]
Giovanni Manno

CONSOB
CONCORSO PUBBLICO
A 5 POSTI DI COADIUTORE
(statistici-quantitativi)
sede di Roma

(119/08)

Tema n. 2

Il candidato illustri il collegamento tra la valutazione di tali strumenti e le metodologie sviluppate nell'ultimo decennio per misurare rischio di credito e rischio di liquidità, evidenziando le principali criticità presenti, relativamente a questi aspetti, in una delle misure di rischio più comuni: il *Value-at-Risk*.

280104
Kitt
Licht

Giovanni Maria P.

(119/08)