

Silvana Musti

Curriculum vitae

Luogo e data di nascita

Bologna, 2-11-1965

Titoli accademici

- *Laurea in Economia e Commercio* conseguita presso l'Università degli Studi di Bologna.
- *Master of Business (Research) in Finance and Economics* presso la School of Finance and Economics, University of Technology, Sydney, Australia.
- *Titolo di Dottore di Ricerca* in "Matematica per l'Analisi dei Mercati Finanziari" dell'Università degli Studi di Brescia.
- *Vincitrice di concorso ad un posto da ricercatore universitario* presso la Facoltà di Economia dell'Università degli Studi di Foggia, per il s.s.d. S04B "Matematica Finanziaria e Scienze Attuariali".

Ruolo universitario

Professore associato, s.s.d. SECS-S/06 "Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie", afferente al Dipartimento di Economia, Università degli Studi di Foggia.

Email: silvana.musti@unifg.it.

Formazione ed esperienze scientifiche e/o professionali

- *Laurea in Economia e Commercio* conseguita presso l'Università degli Studi di Bologna con votazione 110/110 con lode.
- *Master of Business (Research) in Finance and Economics* presso la School of Finance and Economics, University of Technology, Sydney, Australia.
- *Titolo di Dottore di Ricerca* in "Matematica per l'Analisi dei Mercati Finanziari" dell'Università degli Studi di Brescia conseguito discutendo il 16 marzo 2001 la Tesi di Dottorato "Numerical Investigations of the Heath-Jarrow-Morton Model with Forward Rate Dependent Volatility".
- *Visiting researcher* presso il *Department of Finance* della *Stockholm School of Economics*, Stoccolma, Svezia, 17-22 Settembre 2002 e dal 4 novembre al 30 dicembre 2003.

Attuali interessi di ricerca e recenti progetti finanziati

I principali interessi di ricerca riguardano la struttura a termine dei tassi di interesse, option pricing, energy pricing.

Responsabile scientifico dell'attività di ricerca *Modelli stocastici per l'analisi delle dinamiche dei prezzi spot e future dell'energia elettrica* presso il Dipartimento di Scienze Economiche, Matematiche e Statistiche dell'Università degli Studi di Foggia, nell'ambito del progetto "Lo sviluppo del mercato energetico in Puglia: energie rinnovabili ed implicazioni economico finanziarie", finanziato dalla Fondazione Cassa di Risparmio di Puglia. (2011)

Altre attività scientifiche

Partecipazione a Collegi Docenti formazione scientifica post laurea

Dottorato di Ricerca in "Metodi matematici per le decisioni economiche e finanziarie",
Dottorato di Ricerca in "Economia e Finanza",

Dottorato di Ricerca in “Economia e Diritto dell'Ambiente, del Territorio e del Paesaggio”, presso il Dipartimento di Scienze economiche, matematiche e statistiche dell'Università degli Studi di Foggia.

Componente del Comitato Organizzatore del XXXVI Convegno Nazionale AMASES, Vieste, 13-15 settembre 2012.

Incarichi d'insegnamento dell'ultimo triennio

2013-2014

- Titolare del corso di *Matematica Finanziaria*, Facoltà di Economia, Università degli Studi di Foggia.
- Incarico di supplenza per il corso di *Finanza Quantitativa*, Corso di Laurea in Finanza, Facoltà di Economia, Università degli Studi di Foggia.

2014-2015

- Titolare del corso di *Matematica Finanziaria*, Facoltà di Economia, Università degli Studi di Foggia.
- Incarico di supplenza per il corso di *Finanza Quantitativa*, Corso di Laurea in Finanza, Facoltà di Economia, Università degli Studi di Foggia.

2015-2016

- Titolare del corso di *Matematica Finanziaria*, Facoltà di Economia, Università degli Studi di Foggia.
- Incarico di supplenza per il corso di *Finanza Quantitativa*, Corso di Laurea in Finanza, Facoltà di Economia, Università degli Studi di Foggia.

Principali pubblicazioni scientifiche dell'ultimo quinquennio

- 1) Carl Chiarella, Viviana Fanelli, Silvana Musti (2011). *Modelling the Evolution of Credit Spreads using the Cox process within the HJM framework: a CDS Option Pricing Model*. European Journal of Operational Research, **208**(2), 95-108.
- 2) Viviana Fanelli, Lucia Maddalena, Silvana Musti (2012). *Investigating the diffusion of renewable energy technologies in Italy*. Advances and Applications in Mathematical Sciences, **12**(1), 59-70, ISSN:0974-6803.
- 3) Viviana Fanelli, Lucia Maddalena, Silvana Musti, (2012) *Implementazione di un modello di equilibrio per la determinazione del prezzo forward dell'energia elettrica*, In: Lucia Maddalena. Lo sviluppo del mercato energetico in Puglia: energie rinnovabili ed implicazioni economico-finanziarie. Milano: Franco Angeli
- 4) Viviana Fanelli, Lucia Maddalena, Silvana Musti (2014). *Electricity market equilibrium model with seasonal volatility*. Poster programme at the International Conference on Sustainable Design, Engineering and Construction 2015, Chicago 2015.
- 5) Viviana Fanelli, Lucia Maddalena, Silvana Musti (2016). *Modelling electricity futures prices using seasonal path-dependent volatility*. Applied Energy 173, 92-102.
- 6) Viviana Fanelli, Lucia Maddalena, Silvana Musti (2016). *Asian options in the day-ahead electricity market*. Under revision in Sustainable Cities and Society.