



SEMINARIO PUBBLICO 8 OTTOBRE 2024 – DOTT. MASSIMILIANO FREZZA

Avviso seminario pubblico della dott. Massimiliano Frezza ai sensi dell'art. 11, comma 1, lett. k) dello Statuto per la proposta di chiamata di ricercatore a tempo determinato in Tenure Track (RTT) Settore Concorsuale 13/D4 – Settore Scientifico Disciplinare SECS-S/06

Sul portale Trasparenza del sito di “Sapienza” Università di Roma, è stato pubblicato il Decreto Rettorale n. 2391 del 3 ottobre 2024 di approvazione degli atti della Commissione giudicatrice che ha dichiarato il dott. Massimiliano Frezza vincitore della procedura selettiva per n. 1 posto di ricercatore a tempo determinato in Tenure Track (RTT) SC13/D4 – SSD SECS-S/06 – presso il Dipartimento di Metodi e modelli per l'economia il territorio e la finanza – Facoltà di Economia. Pertanto si comunica che il giorno 8 ottobre 2024, alle ore 11.30, con collegamento da remoto il dott. Massimiliano Frezza, terrà, presso il Laboratorio Informatico “Giuseppe Burgio” del Dipartimento, il seminario ai sensi dell'art. 11, comma 1, lett. k) dello Statuto sull'attività di ricerca svolte e in corso di svolgimento.

Titolo: (multi)fractional processes in finance.

The seminar will focus on the application of (multi)fractional models in finance. In particular, the candidate's main achievements over the years will be shown with reference to the following topics:

- Volatility and regularity.
- Efficiency.
- Liquidity.
- Roughness.

Particular attention will be devoted to the concept of “rough volatility” that is currently attracting the interest of many scholars in finance. In fact, rough volatility models incorporate the idea that market volatility exhibits complex patterns like high frequency fluctuations, clustering and heavy tails, revealed by trajectories that are less Hölder continuous than those of Brownian motion. The proposed methodology is based on the study of the roughness of the log-volatility process by testing the self-similarity of the process obtained by the de-Lampertized realized volatility.

Il seminario potrà essere seguito anche a distanza accedendo al seguente link:
<https://meet.google.com/rst-msmr-ems>

la Direttrice del Dipartimento
Prof.ssa Donatella Strangio