

Relazioni triennali - Terza sessione 2014
Data Chiusura 23/01/2015

Cognome BASSO
Nome Antonella
Qualifica Professori Ordinari
Dipartimento Dipartimento di Economia
Ha usufruito di un periodo di congedo per motivi di studio nel triennio No
Descrizione attività di ricerca L'attività di ricerca nel triennio si è concentrata in particolare sullo studio di modelli per la valutazione della performance dei fondi comuni di investimento.

Tale studio ha consentito di proporre dei modelli DEA (Data Envelopment Analysis) che possono essere utilizzati a tale scopo e superano alcune limitazioni dei modelli precedenti.

La principale limitazione che viene superata è data dalla richiesta di positività del valore delle variabili considerate, che ne rende problematico l'utilizzo nei periodi di crisi, dove i rendimenti medi osservati per molti fondi comuni (quando non addirittura per la maggior parte di essi) sono negativi. I modelli proposti hanno il pregio di derivare da solide considerazioni finanziarie e di essere al contempo di diretta interpretazione economica e di poter essere utilizzati in qualsiasi fase del ciclo economico e finanziario.

Lo studio si è inoltre focalizzato sull'analisi della finanza etica ed in particolare dei fondi comuni etici, che negli ultimi anni si sono diffusi in molti paesi. A tale riguardo, da un lato si sono studiati dei modelli per la valutazione della performance dei fondi etici e dall'altro si è cercato di confrontare in maniera approfondita la performance ottenuta dai fondi etici con quella degli altri fondi comuni di investimento.

I principali risultati della ricerca a tale riguardo sono confluiti nei seguenti lavori:

Socially responsible mutual funds: an efficiency comparison among the European countries; presentato al XIII Iberian-Italian Congress of Financial and Actuarial Mathematics, Cividale, 5-7 luglio 2012, e al Fifth International Conference MAF 2012 – Mathematical and Statistical Methods for Insurance and Finance, Venice, 10-12 April 2012

Constant and variable returns to scale DEA models for socially responsible investment funds; presentato al XIV Workshop on Quantitative Finance, Rimini, January 24-25, 2013

DEA models with a constant input for SRI mutual funds with an application to European and Swedish funds, presentato al XV Workshop on Quantitative Finance, Firenze, January 23-24, 2014

The Role of Fund Size and Returns to Scale in the Performance of Mutual Funds; presentato al Sixth International Conference on MATHEMATICAL AND STATISTICAL METHODS FOR ACTUARIAL SCIENCES AND FINANCE, April 22-24, 2014, Vietri e al 38° Convegno AMASES, Reggio Calabria, 4-6 settembre 2014

The role of fund size in the performance of mutual funds assessed with DEA models (con ulteriori sviluppi)
DEA performance assessment of mutual funds.

Inoltre, si è proseguito nello studio della matematica finanziaria classica e moderna, da un lato per risolvere i più comuni problemi che si presentano nelle applicazioni sia in azienda che negli investimenti e finanziamenti personali, dall'altro per migliorare la presentazione degli argomenti al fine di ottimizzare il loro apprendimento. Il risultato di tale studio è presentato nel libro:

Introduzione alla matematica finanziaria

Un altro argomento di studio è relativo ai rischi dei derivati, che tanti problemi hanno causato negli ultimi anni in campo finanziario. A tale riguardo si sono organizzati i workshop:

Laboratorio sui Derivati e i loro Rischi, Feltre, 15-16 giugno 2012

Laboratorio sui Derivati e i loro Rischi, Venezia, 13-14 giugno 2013

e si è effettuata la comunicazione:

A. Basso, M. Tolotti, "I prodotti derivati: analisi e valutazione dei rischi".

Elenco delle
pubblicazioni degli
ultimi 3 anni solari

in corso di stampa

Antonella Basso, Stefania Funari.

[DEA performance assessment of mutual funds](#)

In: Data Envelopment Analysis - A Handbook of Empirical Studies and Applications.
Springer

Contributo in volume 

2014

Antonella Basso, Stefania Funari.

[Constant and variable returns to scale DEA models for socially responsible investment funds](#)

EUROPEAN JOURNAL OF OPERATIONAL RESEARCH, 235; pp. 9

Articolo in rivista 

Antonella Basso, Stefania Funari.

[DEA models with a constant input for SRI mutual funds with an application to European and Swedish funds](#)

INTERNATIONAL TRANSACTIONS IN OPERATIONAL RESEARCH, 21; pp. 22

Articolo in rivista 

Antonella Basso, Stefania Funari.

[The role of fund size in the performance of mutual funds assessed with DEA models](#)

In: Working Paper Series. 18/2014, pp. 16, Department of Management, Università Ca'Foscari Venezia

Contributo in volume 

Antonella Basso, Stefania Funari.

[The Role of Fund Size and Returns to Scale in the Performance of Mutual Funds](#)

In: Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance. pp. 5,
Springer, ISBN: 9783319050133

Contributo in volume 

2013

Basso A., Funari S..

[Socially responsible mutual funds: an efficiency comparison among the European countries](#)

In: Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance. Springer,
ISBN: 9783319024981

Contributo in volume 

2012

A. Basso, P. Pianca.

[Introduzione alla matematica finanziaria](#)

Wolters Kluwer Italia srl, pp. 244, ISBN: 9788813336035

Monografia o trattato scientifico 

BASSO A., FUNARI S. .

[Socially responsible mutual funds: An efficiency comparison among the European countries](#)

In: Working Paper Series - Department of Management. 3/2012, Department of Management, Università Ca'Foscari Venezia

Contributo in volume 

A. Basso, S. Funari.

[Constant and variable returns to scale DEA models for socially responsible investment funds](#)

In: WORKING PAPER-DEPARTMENT OF ECONOMICS, CÀ FOSCARI. UNIVERSITY OF

VENICE. 20/WP/2012, DEPARTMENT OF ECONOMICS CA' FOSCARI UNIVERSITY OF VENICE

Contributo in volume 

A. Basso, S. Funari.

[Socially responsible mutual funds: an efficiency comparison among the European countries](#)

In: XIII Iberian-Italian Congress of Financial and Actuarial Mathematics. Cividale, 5-7 luglio 2012, Forum, Editrice Universitaria Udinese srl, ISBN: 9788884207609

Abstract in Atti di convegno 

Elenco delle pubblicazioni in corso di stampa
Antonella Basso, Stefania Funari.
[DEA performance assessment of mutual funds](#)
In: Data Envelopment Analysis - A Handbook of Empirical Studies and Applications. Springer
Contributo in volume 

Altri prodotti scientifici Dato non presente

Partecipazione a comitati editoriali di riviste/collane scientifiche

Mathematical Methods in Economics and Finance Decisions in Economics and Finance

Partecipazione come referee di progetti di ricerca nazionali ed internazionali

PRIN 2008 Futuro in Ricerca 2010

Menzioni e premi ricevuti

Diversi paper sono entrati più volte nella "SSRN's Top Ten download list".

Relazioni invitate presso convegni o workshops

"Optimal resource allocation with minimum activation levels and fixed costs and DEA models with a constant input for SRI mutual funds", relazione invitata al Workshop in Honor of Lorenzo Peccati, Milano, 22 settembre 2014

Seminari su invito tenuti presso altre Università, Centri di Ricerca, Aziende,...

Dato non presente

Altre attività scientifiche:

Partecipazione al comitato scientifico delle seguenti conferenze:

partecipazione a comitato scientifico di conferenze, peer-review di articoli sottomessi a riviste o convegni, etc.

Fifth International Conference MAF 2012 – Mathematical and Statistical Methods for Insurance and Finance, Venice, 10-12 April 2012
Laboratorio sui Derivati e i loro Rischi, Feltre, 15-16 giugno 2012 (Organizzatore)
Laboratorio sui Derivati e i loro Rischi, Venezia, 13-14 giugno 2013 (Organizzatore)
XIII Iberian-Italian Congress of Financial and Actuarial Mathematics, Cividale, 5-7 July 2012
Amases 2012, XXXVI Convegno Annuale dell'Associazione per la Matematica Applicata alle Scienze Economiche e Sociali, Vieste (Foggia), 13- 15 settembre 2012
INTERNATIONAL SCHOOL ON EMERGENCY ACCOUNTING, Venice, 17-21 June 2013
AMASES 2013, XXXVII Convegno Annuale dell'Associazione per la Matematica Applicata alle Scienze Economiche e Sociali, Stresa (VB), 5-7 settembre 2013
Sixth International Conference on MATHEMATICAL AND STATISTICAL METHODS FOR ACTUARIAL SCIENCES AND FINANCE, April 22-24, 2014, Vietri
AMASES 2014, XXXVIII Convegno Annuale dell'Associazione per la Matematica Applicata alle Scienze Economiche e Sociali, Reggio Calabria, 4-6 settembre 2014

Referee per vari convegni e per le seguenti riviste:

European Journal of Operational Research, OPSEARCH, Mathematical Methods in Economics and Finance, International Transactions in Operational Research, Journal of Cultural Economics.

Partecipazione come referee di un progetto di ricerca per l'Università di Trieste.

Organizzazione dei seguenti workshop:

"Laboratorio sui Derivati e i loro Rischi", Feltre, 15-16 giugno 2012 (ottenendo un finanziamento dalla Fondazione per l'Università e l'Alta Cultura in provincia di Belluno)
 "Laboratorio sui Derivati e i loro Rischi", Venezia, 13-14 giugno 2013

Contratti di Ricerca e Finanziamenti esterni del triennio	Dato non presente				
Attività Didattica: insegnamenti negli ultimi tre anni accademici	Anno accademico	Nome corso	Codice corso	Voto medio	Voto medio ponderato di facoltà
	2014	FINANCIAL MATHEMATICS PROBLEMS FOR BUSINESS	EM4035		
	2014	MATEMATICA FINANZIARIA	ET0046		
	2014	COMPUTATIONAL FINANCE	EM5004		
	2014	DERIVATIVES AND INSURANCE	EM5022		
	2013	MATEMATICA FINANZIARIA	ET0046	3,13/4	2,95/4
	2013	DERIVATIVES AND INSURANCE	EM5022	3,11/4	2,95/4
	2013	COMPUTATIONAL FINANCE	EM5004	3,55/4	2,95/4
	2012	MATEMATICA PER L'ECONOMIA E LA FINANZA	ET3009	3,1/4	3,2/4
	2012	MATEMATICA FINANZIARIA	ET0046	3,1/4	3,2/4
	2012	TECNICA DEI PRODOTTI FINANZIARI E ASSICURATIVI	EM5014	3,3/4	3,1/4
	2011	TECNICA DEI PRODOTTI FINANZIARI E ASSICURATIVI	EM5014	3,1/4	3,1/4
	2011	MATEMATICA FINANZIARIA	ET0046	3,2/4	3,1/4
	2011	LABORATORIO DI MATEMATICA FINANZIARIA	ET4002	3,7/4	3,1/4
	2010	MATEMATICA FINANZIARIA	ET0046		
	2010	TECNICA DEI PRODOTTI FINANZIARI E ASSICURATIVI	EM5014		
Altra attività didattica (attività integrativa, insegnamenti di master o dottorato, etc.)	Anno accad.	Titolo del corso	Sede	Note	
	2012-13	Stochastic Processes for Finance	Università Ca' Foscari Venezia	Insieme a M. Nardon	
	2013-14	Stochastic Processes for Finance	Università Ca' Foscari Venezia	Insieme a M. Nardon	
Tesi di laurea seguite come relatore	n. Tesi				

Anno solare	n. Tesi triennali	magistrali	n. Tesi dottorato
2014	7	9	0
2013	2	9	0
2012	2	6	0
2011	0	2	0

Incarichi accademici e attività organizzative

Incarichi accademici/attività organizzative/partecipazione commissioni giudicatrici	Ateneo/Facoltà/Dipartimento/altri organi collegiali	Compiti istituzionali/cariche elettive/nomine dirette
Membro della Commissione nazionale per i giudizi di conferma dei ricercatori per il biennio 2012-2013	Membro del Senato accademico fino al 30 settembre 2012	Commissione elettorale centrale, elezioni del Senato accademico 2012
Membro interno commissione posto da associato SECS-S/06, Venezia 2012-13	Direttore del Centro di Economia Quantitativa da marzo 2013 a ottobre 2014	Prorettore alla Valutazione e Programmazione da ottobre 2014
Membro supplente commissione di dottorato, Università di Padova	Membro del collegio didattico del corso di laurea magistrale Economia e Finanza – Economics and Finance	Referente del curriculum in lingua inglese Economics and finance (da aprile 2013 a ottobre 2014)
Membro di Commissione giudicatrici di procedura per posto da associato bandita nel 2014 dall'Università di Bologna	Dato non presente	Membro del Gruppo Responsabili dell'Assicurazione della Qualità per il Corso di Studi in Economia Finanza – Economics and Finance
Membro dell'Associazione per la Matematica Applicata alle Scienze Economiche e Sociali (A.M.A.S.E.S.)	Dato non presente	Dato non presente
Membro della commissione di ateneo per l'alloggio agli studenti stranieri più meritevoli	Dato non presente	Dato non presente

Attività Professionali esterne

Incarichi esterni non accademici -partecipazione a collegi/comitati/commissioni -consulenze-associazioni professionali-attività editoriali	Ente o istituzione	Compiti istituzionali/cariche elettive/nomine dirette	periodo
Membro del Comitato Scientifico della rivista scientifica "Decisions in Economics and Finance"	Associazione per la Matematica Applicata alle Scienze Economiche e Sociali (A.M.A.S.E.S.)	Segretario Generale dell'Associazione per la Matematica Applicata alle Scienze Economiche e Sociali (A.M.A.S.E.S.)	Da ottobre 2011
Membro del Comitato	GRETA (Gruppi di Ricerca)	Dato non presente	Dal 2013

scientifico di GRETA

Economica e
Teorica
Applicata)

Membro del Comitato
Scientifico della rivista
scientifica "Mathematical
Methods in Economics and
Finance"

Dato non
presente

Dato non presente

Dato non
presente

Altre informazioni Dato non presente