

# **Lorenzo Peccati**

## **Données personnelles**

Né à Sabbioneta (Mantoue), le 26 février 1944.

Résident à 20136, Milan, via Ripamonti, 40

e-mail: lorenzo.peccati@unibocconi.it

## **Positions académiques et service institutionnel**

1967: Maîtrise en Economie et Gestion, Université “Luigi Bocconi”, Milan.

1969 – 1980: Maître de Conférences, Faculté d’Economie, Université de Parme.

1980 – 1982: Professeur de Mathématiques Financières, Faculté d’Economie, Université de Turin.

1982 – 1985: Professeur de Mathématiques Appliquées à l’Economie et aux Sciences Sociales, Faculté de Sciences Politiques, Université de Milan.

1985 – 1993: Professeur de Mathématiques Financières, Faculté d’Economie, Université de Turin.

1993 - Professeur de Mathématiques Appliquées, Université “Luigi Bocconi”, Milan.

2002- 2007: Prorecteur pour la Recherche et les Ressources Humaines, Université “Luigi Bocconi”, Milan.

2007 - : Prorecteur pour les Ressources Humaines, Université “Luigi Bocconi”, Milan.

J’ai été aussi Directeur pour plusieurs années de l’Institut de Mathématiques Financières de l’Université de Turin. Dans cette Université j’ai enseigné “Processus de décisions” dans le programme MBA de la Business School.

J’ai été Professeur Visiteur à l’ENS et à l’ESTP de Cachan, à l’ESSI de Sophia Antipolis, à l’Université di Budapest, à l’Université de Vienne et à l’”University of San Diego”.

## **Associations Scientifiques et activités éditorielles**

J’ai été Secrétaire Général et Vice-président de l’”Associazione per la Matematica Applicata alle Scienze Economiche e Sociali” et j’ai été l’Editeur de la “Rivista di Matematica per le scienze economiche e sociali” (à présent devenue “Decisions in Economics and Finance”).

Je suis Vice-président de l’”Istituto Italiano degli Attuari”.

Je suis un des éditeurs du “European Journal of Operational Research” (dès 2002).

Je suis co-éditeur en chef de la série de volumes “Bocconi & Springer Series” (Bocconi University Press & Springer).

## Publications

Auteur de plus de 120 publications (articles et livres).

### Liste (partielle)

E. Borgonovo, L. Peccati (2012). **Value of Information in the Appraisal of Industrial Investments**, Pre-prints, International Working Seminar on Production Economics (IWSPE) - Innsbruck.

E. Borgonovo, L. Peccati (2011). **Finite Change Comparative Statics for Risk-Coherent Inventories**. *INTERNATIONAL JOURNAL OF PRODUCTION ECONOMICS* (ISSN:0925-5273) pp.52- 62 Vol.131,

E. Borgonovo, L. Peccati (2011). **Managerial Insights from Service Industry Models: A New Scenario Decomposition Method**. *ANNALS OF OPERATIONS RESEARCH* (ISSN:0254-5330) pp.161- 179 Vol.185,

E. Borgonovo, S. Gatti, L. Peccati (2010). **What Drives Value Creation in Investment Projects? An Application of Sensitivity Analysis to Project Finance Transactions**. *EUROPEAN JOURNAL OF OPERATIONAL RESEARCH* (ISSN:0377-2217) pp.227- 236 Vol.205,

E. Castagnoli, M. Cigola, L. Peccati (2010). **Matematica in azienda 2: Complementi di analisi**. EGEA, pp. 195.

E. Borgonovo; Peccati L. (2010). **Moment Calculations for Piecewise-Defined Functions: An Application to Stochastic Optimization with Coherent Risk Measures**. *ANNALS OF OPERATIONS RESEARCH* (ISSN:0254-5330) pp.235- 258 Vol.176,

E. Borgonovo ; Peccati L (2009). **Financial Management in Inventory Problems: Risk Averse vs Risk Neutral Policies**. *INTERNATIONAL JOURNAL OF PRODUCTION ECONOMICS* (ISSN:0925-5273) pp.233- 242 Vol.118.

E. Castagnoli, M. Cigola, L. Peccati (2009). **Probability: a brief introduction**. EGEA, pp. 154.

Borgonovo E., Peccati L. (2008). **Finite Change Comparative Statics for Risk Coherent Inventories**, pre-print IWSPE Innsbruck

E. Borgonovo ; PECCATI L (2008). **Sensitivity Analysis in Decision Making: a Consistent Approach**. In ABDELLAOUI M.; HEY J. (Eds) *Advances in Decision Making under Risk and Uncertainty*. Springer.

E. Borgonovo ; PECCATI L (2007). **Global Sensitivity Analysis in Inventory Management**. *INTERNATIONAL JOURNAL OF PRODUCTION ECONOMICS* (ISSN:0925-5273) pp.302- 313 Vol.108

E. BORGONOVO, L. PECCATI (2007). **On the Quantification and Decomposition of**

**Uncertainty.** M. ABDELLAOUI; R.D. LUCE; M. MACHINA AND B. MUNIER EDITORS (a cura di) *Uncertainty and Risk: Mental, Formal, Experimental Representations.* Springer, pp.41-pp.59.

E. Borgonovo ; PECCATI L (2006). **The Importance of Assumptions in Investment Evaluation.** *INTERNATIONAL JOURNAL OF PRODUCTION ECONOMICS* (ISSN:0925-5273) pp.298- 311 Vol.101

E. Borgonovo ; Peccati L (2006). **Uncertainty and Global Sensitivity Analysis in the Evaluation of Business Projects.** *INTERNATIONAL JOURNAL OF PRODUCTION ECONOMICS* (ISSN:0925-5273) pp.62- 73 Vol.104.

M. CIGOLA; L. PECCATI (2005). **On the comparison between the APV and the NPV computed via the WACC.** *EUROPEAN JOURNAL OF OPERATIONAL RESEARCH* (ISSN:0377-2217) pp.377- 385 Vol.161,

E. Borgonovo ; PECCATI L (2004). **Sensitivity Analysis in Investment Project Evaluation.** *INTERNATIONAL JOURNAL OF PRODUCTION ECONOMICS* (ISSN:0925-5273) pp.17- 25 Vol.70.

E. LUCIANO ; L. PECCATI; D.M. CIFARELLI ; (2003). **VaR as a risk measure for multiperiod static inventory models.** *INTERNATIONAL JOURNAL OF PRODUCTION ECONOMICS* (ISSN:0925-5273) pp.375- 384 Vol.81-82,

M. CIGOLA; M. MASSARI; L. PECCATI; L. ZANETTI (2003). **On the valuation of a growing levered firm,** - EWGFM - London

D.M. CIFARELLI; D. MASCIANDARO; L. PECCATI; S. SALSA; A. TAGLIANI (2002). **Success or failure of a firm under different financing policies: a dynamic stochastic model.** *EUROPEAN JOURNAL OF OPERATIONAL RESEARCH*, Invited Survey, (ISSN:0377-2217) pp.471- 482 Vol.136/3,

M. CIGOLA; L. PECCATI (2002). **Evaluating the marginal and the total productivity of inputs.** *Engineering Economics*, pp.87- 96 Vol.74.

L. PECCATI; L. BASSO (2001). **Optimal resource allocation with minimum activation levels and fixed costs.** *EUROPEAN JOURNAL OF OPERATIONAL RESEARCH* (ISSN:0377-2217) pp.536- 549 Vol.131.

M. CIGOLA; L. PECCATI (2001). **Multiattribute Utility and Intertemporal Choices: the role of certainty equivalent manifold.** FUR Conference, Torino.

L. PECCATI; LUCIANO E. (2001). **Cycles Optimization: the Equivalent Annuity and the Net Present Value Approach.** *INTERNATIONAL JOURNAL OF PRODUCTION ECONOMICS.*

F. Beccacece, P. Gallo, L. Peccati (2001). **Survival Risk & Project Evaluation.** Da Ruan, Kacprzyk, Fedrizzi (a cura di) *Soft Computing for Risk Evaluation and Management.* Physica-Verlag, pp.397- pp.409.

- L. PECCATI; LUCIANO E. (1999). **Some Basic Problems in Inventory Theory: the Financial Perspective.** *EUROPEAN JOURNAL OF OPERATIONAL RESEARCH* (ISSN:0377-2217) pp.294- 303 Vol.114,
- D.M. Cifarelli, L. Peccati, A. Tagliani (1998). **Antiusury laws and market interest rate dynamics.** -- Zopounidis eds, *New Operational approaches for financial modelling.* , Physica-Verlag, pp.311- pp.322.
- L. PECCATI; LUCIANO E. (1998). **Capital Structure and Inventory Management: the Temporary Sale Price.** *INTERNATIONAL JOURNAL OF PRODUCTION ECONOMICS* (ISSN:0925-5273) pp.169- 178 Vol.59,
- L. PECCATI; LUCIANO E.; GALLO P. (1997). **Revision of Industrial Supply Conditions and Game Theory.** *INTERNATIONAL JOURNAL OF PRODUCTION ECONOMICS* (ISSN:0925-5273) pp.17- 28 Vol.49.
- L. PECCATI; CIFARELLI D. M.; TAGLIANI A. (1997). **Antiusury Laws and Market Interest Rate Dynamics.** in (Zopounidis ed.) *New Operational Approaches for Financial Modelling.* Physica-Verlag, HEIDELBERG pp.311- pp.322.
- L. PECCATI; CENCI M.; CERQUETTI M. (1996). **Imitation and Stability in a Stock Market.** *EUROPEAN JOURNAL OF OPERATIONAL RESEARCH* (ISSN:0377-2217) pp.301- 305 Vol.91.
- M. Cigola, L. Peccati (1993). **Su un problema di collant,** Convegno AMASES.
- F. Beccacece, L. Peccati (1994). **Immunization strategies in linear models.** R. L. D'Ecclesia, S.A. Zenios (a cura di) *Operations Research Models in Quantitative Finance.* Physica Verlag, , pp.65- pp.75
- E. Castagnoli, L. Peccati (1973). **Alcune considerazioni in tema di classificazione degli investimenti.** *GIORNALE DEGLI ECONOMISTI E ANNALI DI ECONOMIA* (ISSN:0017-0097) pp.235- 252