

**CICLO DI LEZIONI NELL'AMBITO DEL DOTTORATO DI METODI  
STATISTICI PER L'ECONOMIA E L'IMPRESA (DMSEI)**

**Prof. FABIO SPIZZICHINO**

Dipartimento di Matematica - Università La Sapienza

**SEMI-COPULE E LORO USO NELLA RAPPRESENTAZIONE DI  
PROPRIETÀ DI FAMIGLIE DI CURVE DI INDIFFERENZA**

**Abstract**

Dopo aver inizialmente richiamato la nozione di copula ed il suo ruolo nella descrizione di proprietà di dipendenza fra variabili aleatorie verrà illustrata, quale naturale generalizzazione, la nozione di semi-copula. Verrà quindi discusso l'interesse che le semi-copule possono avere nella descrizione delle curve di indifferenza per funzioni monotone di più variabili. Una tale linea di ricerca, che era stata iniziata qualche anno fa in collaborazione con Bruno Bassan nell'ambito dell'affidabilità e dell'analisi di sopravvivenza, si era rivelata efficace per studiare delle relazioni esistenti fra nozioni di "ageing" e nozioni di dipendenza stocastica. In questo ambito le funzioni monotone di interesse sono le funzioni di sopravvivenza di vettori di variabili aleatorie non negative. Illustrerò dunque tale tematica, richiamando in particolare significato e definizioni di alcune fondamentali proprietà di "ageing". Verrà infine illustrato il legame fra semi-copule e i concetti di capacità e "distorted probabilities" e discusso il fatto che lo stesso approccio potrebbe risultare proficuo per descrivere, sotto forma di proprietà di dipendenza, proprietà (di famiglie di curve di indifferenza di funzioni) con significato economico.

**Martedì 27 aprile 2010 aula 11 - 1° piano  
dalle ore 15:30 alle ore 17:30**

~ ~ ~

**Giovedì 29 aprile 2010 aula 12 - 1° piano  
dalle ore 15:30 alle ore 17:30**

**Facoltà di Economia**  
**Università degli Studi Roma Tre**  
*Via Silvio D'Amico 77, 00145 Roma*