

*Luogo e data di nascita:* Roma, 8/3/1958

*Titolo di studio:* Laurea in Matematica, Università di Roma “La Sapienza“, 1981

*Posizione attuale:* Professore associato di Probabilità e Statistica Matematica

*Posizioni precedenti:* Ricercatore di Calcolo delle Probabilità e Statistica Matematica, Università di Roma “Tor Vergata“, 16/11/1984-31/10/2004.

*Attività di ricerca:* Inizialmente è stata dedicata allo studio di problemi riguardanti il comportamento qualitativo e l'approssimazione di equazioni differenziali stocastiche, la modellizzazione stocastica, la simulazione e i metodi Monte Carlo. È stata successivamente concentrata sul filtraggio non lineare: identificazione della soluzione, convergenza di schemi di approssimazione e maggiorazioni esplicite dell'errore. Poi è stata rivolta allo studio di problemi di filtraggio non lineare per sistemi parzialmente osservabili con ritardo nell'osservazione o in tutta la dinamica, con particolare interesse alle applicazioni in finanza matematica. Attualmente è incentrata sullo studio di teoremi di rappresentazione di martingale con applicazione all'analisi della completezza di particolari modelli di mercato finanziario.