

Scuola Normale Superiore
Piazza dei Cavalieri, 7
Pisa

Mercoledì 11 maggio 2011
Aula Bianchi
Palazzo della Carovana
ore 14-16



SCUOLA
NORMALE
SUPERIORE

NORMALE
200
1810
2010



L'instabilità nei mercati finanziari: il Flash Crash un anno dopo

Durante l'incontro verrà presentata una cronaca degli eventi accaduti durante il Flash Crash del 6 maggio 2010 sul mercato azionario americano ed una rassegna della letteratura scientifica apparsa nei mesi successivi

intervengono

STEFANO MARMI | Scuola Normale Superiore di Pisa

6 maggio 2010: l'effetto farfalla si abbatte sul ping pong del trading ad alta frequenza

FULVIO CORSI | Università della Svizzera Italiana Lugano

Ordini tossici e crisi di liquidità: un punto di vista accademico sul Flash Crash

FABRIZIO LILLO | Scuola Normale Superiore di Pisa

Trading ad alta frequenza ed instabilità sistemica: il punto di vista dei regolatori e dell'industria sul Flash Crash

GIACOMO BORMETTI | Scuola Normale Superiore di Pisa

Modelli quantitativi del panico di mercato

Per informazioni: giacomo.bormetti@sns.it, webpage <http://mathfinance.sns.it>