

Cecilia Mancini

Affiliatione: Università di Verona

Researcher unique identifier: ORCID n. 0000-0002-5155-3495

Web: <https://www.dse.univr.it/?ent=persona&id=55236&lang=it>

Nazionalità: italiana



Gennaio 2024

CURRICULUM SCIENTIFICO

POSIZIONI ACCADEMICHE

- 2019- **Professore Ordinario** in Metodi Matematici dell'economia e delle scienze attuariali e finanziarie, Università di Verona, dall'1/9/2019, Dipartimento di Scienze per l'Economia
- 2018 **Abilitazione a Professore Ordinario** (bando di concorso con scadenza 4/2018), scadenza 2024
- 2014 **Abilitazione a Professore Ordinario** (bando di concorso con scadenza 20/11/2012), scadenza 2020
- 2011-2019 **Professore Associato** in Metodi Matematici dell'economia e delle scienze attuariali e finanziarie, Università di Firenze, dal 23/12/2011, confermato il 23/12/2014. Fino al 31/12/2012 presso il Dipartimento di Matematica per le Decisioni, Facoltà di Economia; dall'1/1/2013 presso il Dipartimento di Scienze per l'Economia e per l'Impresa (DiSEI)
- 2010 **Idoneità** per la chiamata a Professore Associato, Settembre, presso l'Università Bocconi di Milano
- 2000-2010 **Assegnataria dell'affidamento** dell'insegnamento di Metodi Matematici, dal 2000-2001 al 2009-2010, CdL Marketing ed Internazionalizzazione, sede distaccata di Prato dell'Univ. di Firenze. Dal 2005 un tale affidamento dà il titolo di **Professore Aggregato**
- 1997-2011 **Ricercatrice** di ruolo dal 24/12/1997 al 23/12/2011 in Metodi Matematici dell'economia e delle scienze attuariali e finanziarie presso il Dipartimento di Matematica per le Decisioni, Facoltà di Economia, Firenze (confermata il 24/12/2000)

FORMAZIONE

- 1999 Diploma di **Dottorato** di Ricerca in Matematica, Università di Roma Tor Vergata: dall'a.a. 93-94 all'a.a. 96-97 (con proroga senza borsa per l'anno 97-98); relatore della tesi Prof. F. Moriconi, tutore del corso di dottorato Prof. P. Baldi; titolo della tesi (difesa in Aprile 1999): *A jump-diffusion version of the CIR bivariate model*
- 1995 **Diplome d'Etudes** Approfondies de Probabilités et Applications, Università di Parigi 6, a.a. 94-95; responsabili del corso: Prof N. El Karoui, Prof. H. Geman; titolo del Rapport de stage (ottobre 1995): *Le modèle CIR trivarié*
- 1995 **Stage** di ricerca ed applicativo da aprile a luglio, a Perugia, presso l'Istituto di Matematica Generale e Finanziaria della Facoltà di Economia, direttore della ricerca Prof. F. Moriconi; argomento delle ricerche: *Il modello CIR trivariato, pricing e stime dei parametri*
- 1993 **Laurea** in Matematica, indirizzo applicativo, Università di Pisa (corso di laurea quadriennale), 110/110 e lode; relatore della tesi: M. Pratelli; titolo della tesi: *Modello per un mercato finanziario esente da Arbitraggio: esistenza di una legge equivalente che rende il processo stocastico dei prezzi una Martingala*
- 1988 **Maturità scientifica**, Liceo U.Dini, Pisa

LINGUE STRANIERE

inglese, francese

CONOSCENZE INFORMATICHE

programmazioni fatte nei linguaggi Fortran, SAS, S-Plus, Maple, Excell, Matlab

PUBBLICAZIONI

- 2023 C. Mancini, *Drift burst test statistic in the presence of infinite variation jumps*, **Stochastic Processes and their Applications** 163, pp.535-591, ISSN 0304-4149, DOI: 10.1016/j.spa.2023.06.010
- 2019 J. E. Figueroa-Lopez, C. Mancini, *Optimum thresholding using mean and conditional mean squared error*, **Journal of Econometrics**, 208(1), pp. 179-210, ISSN 0304-4076, **CLASSE A** area 13, 2018
- 2018 C. Mancini, *Non-parametric threshold estimation for models with stochastic diffusion coefficient and jumps*, contributo in libro **Volatility**, volume II, n. 24, Eds: T.G.Andersen e T.Bollerslev, *Volatility The International Library of Critical Writings in Economics series*, Edward Elgar publishing, ISBN: 978 1 78811 061 7
- 2017 C. Mancini, *Truncated Realized Covariance when prices have infinite variation jumps*, **Stochastic Processes and their Applications** 127 (6), 1998–2035, ISSN: 0304-4149, **CLASSE A** area 13, 2018
- 2015 C. Mancini, V. Mattiussi, R. Renò, *Spot Volatility Estimation Using Delta Sequences*, **Finance and Stochastics**, 19(2), 261-293, ISSN: 0949-2984
ISI journal, IF 2012: **1.212**, **CLASSE A** area 13, 2018
- 2013 C. Mancini, *Measuring the relevance of the microstructure noise in observed financial data*, **Stochastic Processes and their Applications** 123, 2728–275, ISSN: 0304-4149
ISI journal , IF 2012: **0.953**, **CLASSE A** area 13, 2018
- 2012 C. Mancini, F. Gobbi, *Identifying the Brownian covariation from the co-jumps given discrete observations*, **Econometric Theory**, 28 (2), pp. 249-273, ISSN: 0266-4666
ISI journal, IF 2010: **1.015**, **CLASSE A** area 13, 2012
- 2012 Mancini, C., Calvori, F., *Jumps*, chapter of the **Wiley Handbook** in: Financial Engineering and Econometrics: Volatility Models and Their Applications, Editors: Luc Bauwens, Christian Hafner and Sébastien Laurent, April, ISBN: 978-0-470-87251-2
- 2011 Cecilia Mancini, *The speed of convergence of the threshold estimator of integrated variance*. **Stochastic processes and their applications**, 121(4), 845-855, ISSN: 0304-4149
ISI journal, IF 2010: **0.951**, **CLASSE A** area 13 anno 2012
- 2011 R. Cont, C. Mancini, *Nonparametric tests for pathwise properties of semimartingales*, **Bernoulli**, 17(2), 781–813, ISSN: 1350-7265, ISI journal, IF 2010: **1.000**, **CLASSE A** area 13 anno 2012
- 2011 C. Mancini, R. Renò, *Threshold estimation of Markov models with jumps and interest rate modeling*, **Journal of Econometrics**, 160 (1), 77-92, ISSN 0304-4076
ISI journal, IF 2010: **1,815**, **CLASSE A** area 13 anno 2012
- 2009 C. Mancini, *Non-parametric threshold estimation for models with stochastic diffusion coefficient and jumps*, **Scandinavian Journal of Statistics**, 36, 270-296, ISSN 0303-6898
ISI journal, IF 2008: **1,268**, **CLASSE A** area 13 anno 2012, **327 citazioni** su google scholar 11/2018
- 2008 C. Mancini, *Large deviation principle for an estimator of the diffusion coefficient in a jump diffusion process*, **Statistics and Probability Letters**, 78, 869-879, ISSN 0167-7152, ISI journal, IF 2008: **0,445**, classe 4 del GEV Area 1 anno 2012, presente in lista Anvur 2016 delle riviste scientifiche
- 2007 F. Gobbi, C. Mancini, *Estimating the diffusion part of the covariation between two volatility models with jumps of Lévy type*. In: ed.s V. Cutello, G. Fotia, L. Puccio. *Applied and Industrial Mathematics in Italy II, Atti, selected contributions* from the 8th SIMAI Conference, Baia Samuele (Ragusa), Italy, 22 – 26 May 2006, vol. 75 of **Series on advances in mathematics for applied sciences**, pp. 399-409, Hackensack, NJ 07601 USA: World Scientific, ISBN: 978-981-270-938-7, **ISI** publication
- 2004 C. Mancini, *Estimation of the characteristics of the jumps of a general Poisson-diffusion model*, **Scandinavian Actuarial Journal**, 1, 42-52, ISSN 0346-1238 (ISI journal from 2008, IF 2010: **0.613**, classi B e B per il GEV area 13 anno 2012)
- 2003 C. Mancini, *Uniqueness of the solution to a difference-partial differential equation for finance*, **Mathematical Models & Methods in Applied Sciences**, vol. 13, n.7, July, 919-943, ISSN: 0218-202, ISI, journal, IF 2008: **2,333**, classe 1 per il GEV area 1 nel 2012, presente in lista Anvur 2016 delle riviste scientifiche
- 2003 C. Mancini, **Metodi matematici per le decisioni aziendali**, Pitagora Editrice Bologna, ISBN 88-371-1415-X
- 2002 C. Mancini, *The European options hedge perfectly in a Poisson-Gaussian stock market model*, **Applied Mathematical Finance** 9, 87-102, ISSN 1350-486X, non ISI, senza IF, classi B e B per il GEV area 13 anno 2012, presente in lista Anvur 2016 delle riviste scientifiche, **13 citazioni** google scholar 11/2018

2001 C. Mancini, *Disentangling the jumps of the diffusion in a geometric jumping Brownian motion*, **Giornale dell'Istituto Italiano degli Attuari**, volume LXIV, Roma, 19-47, ISSN: 0390-5780, **161 citazioni** su google scholar 11/2018, non ISI, senza IF, classi D e D per il GEV area 13 anno 2012, nov 2017, presente in lista Anvur 2016 delle riviste scientifiche

1998 C. Mancini, *Completing a jump-diffusion version of the bivariate Cox-Ingersoll-Ross model*, **Atti** del XXII convegno AMASES, Genova, 9-12 sett., pubblicato da Bozzi, Maggio, **premio AMASES** 1998

Minori

2022 C. Mancini, Academic research on Quantitative Finance in Italy today, <https://docentia.it>

2021 Rachele Foschi, Francesca Lilla, Cecilia Mancini (2021). Warnings about future jumps: properties of the exponential Hawkes model. **Abstract in Atti**: 35th EBES conference book, p. 62, EBES publications, ISBN: 978-605-80042-5-2

2021 C. Mancini, **Preface** to the XXII Workshop On Quantitative Finance Book of Abstracts. In: Book of Abstracts, XXII Workshop On Quantitative Finance. p. 1-9

2021 C. Mancini, Risk that an observed cluster of price jumps has not yet exhausted: performance of an estimate on simulated data, **software**, p. 1-5

2021 C. Mancini, Drift Burst test statistic in a pure jump semimartingale model, **working paper series**, DSE, Verona; SSRN; ideas.repec

2020 R. Foschi, F. Lilla, C. Mancini: Warnings about future jumps: properties of the exponential Hawkes model, **working paper series**, DSE, Verona; SSRN; ideas.repec

2010 R. Renò, C. Mancini: *Introduction to the Special Issue: Financial Mathematics and Econometrics*, Special Issue for the research week on Financial Mathematics and Econometrics, Florence, September 9-11, 2009, **Economic Notes** by Banca Monte dei Paschi di Siena SpA, Volume 39, n.1/2, ISSN 0391-5026, non ISI, senza IF, classi C e C per il GEV Area 13 anno 2012, presente in lista Anvur 2016 delle riviste scientifiche

2007 F. Gobbi, C. Mancini: *Diffusion covariation and co-jumps in bidimensional asset price processes with stochastic volatility and infinite activity Lévy jumps*, <http://arxiv.org/pdf/0705.1268.pdf>

2003 C. MANCINI. Statistics of a Poisson-Diffusion process. **Abstract in Atti** Convegno AMASES 2003. p. 302-303, AMASES, Cagliari, 3-6 Sett.

2003 C. Mancini, *Statistics of a Poisson-Gaussian process*, **Quaderni** del DiMaD, Firenze, n.7

2002 C. Mancini, *Are the Brownian motion and the Poisson process independent?*, **Quaderni** del DiMaD n.10

2001 C. MANCINI. Estimation of the parameters of jump of a general Poisson-diffusion model. Abstract in: **Atti** AMASES. p. 281-284, Firenze, 5-8 Sett.

2000 C. Mancini, *Modello bivariato di Cox-Ingersoll-Ross guidato da diffusione e salti: valutazione, completamento, stimatori dei parametri*, **Bollettino U.M.I.**, Serie VIII, Vol. III-A, Supplemento Tesi di dottorato, Aprile, 121-124, pubblicato a Bologna **ISI** journal, senza IF, classe 4 per il GEV area 1 anno 2012

1999 C. Mancini, *A jump-diffusion version of the CIR bivariate model*, **tesi di dottorato**, discussa ad aprile, Roma Tor Vergata

1998 C. Mancini, *Estimators for the parameters of a jump-diffusion process*, **Abstract in Atti** del IV congresso SIMAI, Messina, Giugno

1996 C. Mancini, *Modello per un mercato finanziario esente da arbitraggio: esistenza di una legge equivalente che rende il processo stocastico dei prezzi una martingala*, **tesi di laurea, premio Bruno De Finetti**, pubblicazione in proprio, Pisa, 20/1/1996

1995 C. Mancini, *Il modello CIR trivariato*, **rappporto di stage** del DEA, Università Parigi 6

Working papers non pubblici

2022 J. Figueroa-Lopez, C. Mancini: Optimum conditional mean error for the square Truncated Realized Variance with infinite activity jumps

2022 J. Figueroa-Lopez, C. Mancini: Optimum conditional mean error for the square Truncated Realized Variance in the presence of leverage

2019 C. Mancini, L. Torricelli: Target volatility strategies in semimartingale models

FINANZIAMENTI

PER PROGETTO

| | |
|-----------|---|
| 2020 | FIP 4000 Eu Fondi di dipartimento di incentivazione alla progettualità |
| 2020 | RiBa (Ricerca di Base), ateneo Verona, PI Roberto Renò |
| 2018 | GNAMPA 3000 Eu, finanziamento di progetto di ricerca annuale, <i>Nuovi indicatori di instabilità dei mercati finanziari</i> |
| 2015 | grant of 32'000 Euro from University of Florence for the strategic project <i>Previsori di instabilità dei mercati finanziari</i> , other members of the group: Maria Elvira Mancino, Salvatore Federico |
| 2013 | grant of 10'000 Euro by Europlace Institute of Finance Louis Bachelier (EIF) for the research project <i>Small Jumps and Default Contagion</i> , other members of the group: Giampiero Maria Gallo, Mark Podolskij and Peter Tankov |
| 2002 | Ateneo fiorentino, finanziamento del progetto Giovani Ricercatori , <i>Strategie di investimento ottimali secondo il criterio di limited off-hedging</i> , di cui sono stata promotrice, 2000 Eu |
| 2001 | Ateneo fiorentino: finanziamento del progetto Giovani Ricercatori , <i>Problemi di controllo ottimo stocastico: aspetti teorici e applicazioni alla finanza</i> , di cui sono stata promotrice; altri partecipanti del gruppo: Sandra Cerrai, 4'000'000 Lire |
| 2009 | ho usufruito di fondi GNAMPA quale membro di progetto di ricerca di Marcello Galeotti |
| 1998-2006 | Membro di progetti finanziati dal MIUR : PRIN 2006, Coordinatore Scientifico nazionale Elisa Luciano PRIN 2004, Coordinatore Scientifico nazionale Giovanni Alessandrini FIRB 2003, Principal Investigator Marcello Galeotti PRIN 2002, Coordinatore Scientifico nazionale Giovanni Alessandrini PRIN 2000, Coordinatore Nazionale Lorenzo Peccati PRIN 1998, Coordinatore Scientifico nazionale Lorenzo Peccati |
| 1998-2001 | ho usufruito di finanziamenti del CNR grazie ad un progetto di ricerca diretto da Marcello Torrigiani |

PER INVITI

| | |
|------|--|
| 2021 | Università di Verona: 3500 Euro per invito di José Figueroa-Lopez a Verona, nel 2022 |
| 2021 | GNAMPA 3000 Euro per invito di José Figueroa-Lopez a Verona, nel 2022 |
| 2017 | INdAM 2000 Eu per invito Olafsson a nov 2017 o gen 2018, convertiti poi in 1500 Eu per invito di José Figueroa-Lopez 15-29 maggio 2018 |
| 2016 | grant PIA dall' Ateneo fiorentino , 3000 Eu, per invito di Imma Curato della Ulm University, visiting DiSEI 30 giorni a Marzo 2017, per ricerche sull'estensione del metodo di Fourier per la stima della volatilità in presenza di rischio di liquidità e rischio sistematico per il titolo sottostante |
| 2016 | grant INdAM (600 Eu) per invito di Jose Figueroa-Lopez a Firenze a giugno 2016 |
| 2014 | grant of 600 Eu from GNAMPA for Mark Podolskij visiting DISEI in December 2014 |

PER ORGANIZZAZIONE DI EVENTI

| | |
|------|---|
| 2013 | grant dall' Ateneo fiorentino (1400 Eu) per l'invito di Peter Tankov come keynote speaker al XV workshop on Quantitative Finance a Firenze, gennaio 2014 |
| 2012 | finanziamenti da GNAMPA e dalla Facoltà di Economia dell'Università di Firenze per l'organizzazione del workshop <i>Fifth Florence Ritsumeikan workshop</i> , marzo 2013 |
| 2010 | finanziamenti dalla Fondazione Cassa di Risparmio di Firenze (3'000 Eu) e dalla Facoltà di Economia dell'Università di Firenze per l'organizzazione dei due workshop <i>Third Florence Ritsumeikan workshop e Statistical inference and numerical analysis of stochastic processes: probabilistic tools and application to financial econometrics</i> di Marzo 2011 a Firenze |
| 2010 | finanziamento GNAMPA per l'organizzazione del workshop <i>Statistical inference and numerical analysis of stochastic processes: probabilistic tools and application to financial econometrics</i> di Marzo 2011 a Firenze |
| 2009 | Rivista Economic Notes del Monte dei Paschi di Siena (2000 Eu), Facoltà di Economia di Firenze, Istituto Nazionale di Alta Matematica e Ateneo fiorentino : sponsors della research week organizzata a Firenze in occasione delle visite di Jean Jacod e Nour Meddahi |
| 2007 | Ateneo fiorentino : finanziamento per l'invito Prof. Jean Jacod in Marzo, professore di chiara fama |
| 2005 | Ateneo fiorentino : finanziamento per l'invito Prof. Rama Cont in Ottobre, professore di chiara fama |

BORSE DI STUDIO e RICERCA

| | |
|------|---|
| 1998 | Università di Roma Tor Vergata (Borsa di studio per l'estero di durata 3 mesi – non frutta perché già ricercatrice) e Stockholm school of economics : finanziamento del periodo di visiting alla Stockholm school of economics, gennaio |
| 1994 | Borsa di studio Mino Bontempelli, bandita dall' Accademia Nazionale dei Lincei per l'a.a. 94-95 |

FONDI ex 60%

| | |
|-----------|--|
| 2019-2023 | fondi FUR (ex 60%) del DSE 1400 Eu in media ogni anno |
| 2020 | FUR polo Vicenza 1656 Eu + fondi per didattica 1080 Eu |

| | |
|-----------|---|
| 2017-2019 | responsabile ogni anno di un progetto di ricerca annuale locale (distribuita dal dipartimento sulla base del merito scientifico), ottenuti in media 1900 Eu ogni volta |
| 2010-2016 | 2010, 2011, dal 2013 al 2016: responsabile ogni anno di un progetto di ricerca biennale locale (distribuita dal dipartimento sulla base del merito scientifico), ottenuti in media 2500 Eu ogni volta |
| 1998-2009 | ogni anno ho partecipato ad un progetto di ricerca locale |

PREMI E RICONOSCIMENTI

| | |
|------|---|
| 2005 | Econometric Society: contributo per il progetto di ricerca <i>Estimating the integrated volatility in stochastic volatility models with Lévy type jumps</i> , Agosto, 500 Eu |
| 1998 | Premio AMASES a pubblicazione di giovane autore che abbia presentato un lavoro a nome singolo al XXII convegno AMASES, Genova, settembre |
| 1997 | Premio di laurea B. De Finetti, conferito dall'Accademia Nazionale dei Lincei, Roma, giugno |

MEMBRO DI SOCIETÀ SCIENTIFICHE

| | |
|-----------------|--|
| 2016,2018 | Membro Ordinario di SoFiE, the Society of Financial Econometrics |
| 1997-2018,2020- | Membro di GNAMPA, Gruppo Nazionale per l'Analisi Matematica, la Probabilità e Applicazioni |
| 2005 | Econometric Society |
| 2001-2004 | Bachelier Finance Society |

ATTIVITÀ EDITORIALE

| | |
|-----------|--|
| 2021 | Atti (abstracts) del XXII Workshop On Quantitative Finance, in collaborazione con Roberto Renò |
| 2009-2010 | Guest Editor , assieme a Roberto Renò, di <i>Economic Notes</i> , 2010, Volume 39, Issue 1: Special Issue Financial Mathematics and Econometrics , dedicato alla pubblicazione di articoli collegati alla Research week <i>Stochastic processes and financial econometrics</i> , che si è svolta a Firenze dal 9 all'11 settembre 2009 |

ATTIVITÀ DI REFERAGGIO

Per riviste scientifiche:

| | |
|-------|--|
| 1997- | Journal of Nonparametric Statistics (2023), Annals of Applied Probability (2023), Journal of Applied Econometrics (2022); Mathematical Finance (2020); Stochastic Analysis and Applications (2019); Review of derivatives research (2019); Stochastic Processes and their Applications (2017); The Open Statistics & Probability Journal (2017); Economics Letters: 2015 (IF2013: 0.457); Annals of Actuaries (2014); Annals of Statistics: 2012, 2007, 2008 (IF 2010: 2.940); Bernoulli: 2012, 2011 (ImpactFactor 2010: 1.000); Econometric Theory (IF 2010: 1.015): 2014, 2013, 2011 e 2007; ESAIM Probability and Statistics (no ISI): 2010; Journal of Econometrics (IF 2010: 1.815): 2016, 2015, 2009; Journal of Financial Econometrics (IF 2010: 0.846): 2009; Review of economic studies (IF 2010: 3.113): 2008; Finance & Stochastics (IF 2010: 1.326): 2008 e 1997; European Journal of Operational Research (IF 2010: 2.159): 2006; Proceedings del convegno StochFin2004, Lisbona, editore Springer, 2004; Econometrica (IF 2010: 3.185): 2003, 2004 |
|-------|--|

Per progetto di ricerca

| | |
|------|--|
| 2015 | per la Research Commission of the Università della Svizzera italiana |
|------|--|

Per convegni

| | |
|-----------|--|
| 2014 | Scientific committee member for the XV Workshop on Quantitative Finance, Florence 23-24/1/2014 |
| 2012-2021 | 2012, 2013, 2015, 2016, 2020, 2021: Membro del program committee della Annual Conference of the Society for Financial Econometrics (SoFiE), hosted at: University of Oxford (June 20-22, 2012), where I was invited to participate as Chairperson ; Singapore Management University (12-14 June, 2013); Aarhus University (June 24-26, 2015, with Preconference on 23); Hong Kong (June 14-17, 2016, with Pre-Conference on 14) |

Referee per i comitati scientifici dei convegni:

| | |
|--------------------|--|
| 2009, 2014 2016 | IRCM (International Risk Management Conference): Firenze, 22-24/6/2009; Warsaw, 23-24/6/2014 ICASQF (International Conference on Actuarial Science and Quantitative Finance): Cartagena, Colombia, 15-18/6/2016 |
|--------------------|--|

Per tesi di dottorato/laurea specialistica

- 2007, 2011 Referaggio di tesi di dottorato:
2007, *Modélisaton de séries financières, estimation, ajustement de modèles et test d'hypotheses*, di Alexander Alvarez Hernández, Università Paul Sabatier, Tolosa III; 2011, Mario Dell'Era, Università di Pisa
- 2016, 2018 **Controrelatore di tesi di Laurea Specialistica:**
14/12/2018 Serena Visi, CdS Accounting e Libera Professione;
10/2018 Lorenzo Nesi, CdS Accounting e Libera Professione;
12/2016 Giacomo Toscano, CdS in Finance and Risk Management

Revisore per libri

- 2003 Correzione e revisione del capitolo 7, "Stochastic calculus for jump processes", del libro *Financial modelling with jump processes*, autori Rama **Cont** e Peter **Tankov**, Settembre 2003
- 2004 Revisione scientifica della traduzione del "**Manuale** di algebra e geometria" della **GIUNTI**, ed. 2004 (la parte di matematica finanziaria)

RESPONSABILITÀ DI ALTA FORMAZIONE

- 2023 **supervisor** PhD student Matheus Lima, DSE, Verona
- 2022 **advisor** della **tesi di laurea specialistica** in Banca e Finanza: Giulia Schiesaro, *Stochastic volatility*
- 2019-2020 **advisor** della **tesi di laurea specialistica** in Accounting e Libera Professione di Martina Bartoli, *Estimating the parameters of an exponential Hawkes model for the jumps of asset prices, a comparison of ML with the GMM by Ait-Sahalia, Cacho-Diaz and Laeven (2015)*, correlatrice Maria Elvira Mancino, Univ. di Firenze
- 2018 **co-advisor**, assieme a Paulo Eduardo Oliveira, della tesi di Zokhir Kosymov, joint **PhD** programme in Economics delle Scuole di Economia e Management delle Università di Coimbra e Minho, *Extension of jump robust estimation of integrated variance using the "nearest neighbour truncation" method including infinite activity jumps*
- 2017 Responsabile dell'**assegno di ricerca** della Dott.ssa Francesca Lilla, finanziato dall'Ateneo fiorentino, *Previsori di instabilità dei mercati finanziari*
- 2016 Responsabile dell'**assegno di ricerca** della Dott.ssa Rachele Foschi, finanziato dall'Ateneo fiorentino, *Previsori di instabilità dei mercati finanziari*
- 2012 **advisor** della **tesi di laurea specialistica** in Scienze Fisiche e Astrofisiche di Giulio Lorenzini, *Estimating integrated variance with noisy data*, correlatore Politi Antonio, controrelatore Matera Francesco, referee Livi Roberto, Univ. di Firenze
- 2011 **co-advisor**, assieme a Giampiero Maria Gallo, della **tesi di dottorato** di Francesco Calvori, *Financial modelling with ultra high frequency data: issues and (possible) solutions*, dottorato in Statistica, Università di Firenze. Tesi discussa 26/2/2013
- 2006-2007 Responsabile dell'**assegno di ricerca** finanziato da Dipartimento di Matematica per le Decisioni e dal Dipartimento di Statistica "Parenti" dell'Università di Firenze per il progetto *Correlazioni e co-jumps nei prezzi di titoli finanziari: identificazione di un opportuno modello, ricostruzione dei coefficienti ed applicazione a dati di mercato*, assegnista Dott. Fabio Gobbi
- 2005-2006 **Advisor** della **tesi di dottorato** di Fabio Gobbi, Dipartimento di Statistica dell'Università di Firenze, *Correlations among the diffusions and the jump parts in multivariate models with stochastic volatility and jumps*, difesa in Febbraio 2006

SOGGIORNI DI RICERCA ALL'ESTERO

- 2023 visiting Mark Podolskij, Université Luxembourg, April, 3-6
- 2022 visiting Ester Mariucci, Département de mathématiques, Université **Versailles** Saint Quentin, 30/5-3/6
- 2019 visiting Jose Figueroa-Lopez at the **Washington University in St. Louis**, 18 May-13 June
- 2018 **Oxford, Mathematical Institute**, visiting Alvaro Cartea, 27/2-3/3
- 2017 visiting Jose Figueroa-Lopez at the **Washington University in St. Louis**, 7-19 of May
- 2016 visiting Raphael Douady, **University Paris Pantheon-Sorbonne**, aprile 2016
- 2015 visiting Peter Tankov, **University Paris 7**, 22/3/15-3/4/15, to work for the EIF project
- 2014 visiting Peter Tankov, **University Paris 7**, 30/3/14-12/4/14, to work for the EIF project
- 2013 visiting Takaki Hayashi, **Keio University, Yokohama**, 20/23 March 2013
- 2012 visiting Emmanuel Gobet, **Ecole Polytechnique** of Palaiseau (**Paris**), 16-22 December (funded by the Polytechnique)

| | |
|---------|--|
| 2012 | visiting Markus Reiss, Humboldt University in Berlino , 1-8 July (funded by the Humboldt Univ.) |
| 2011 | visiting il Laboratoire de Probabilités, Univ. Parigi 6 , 21/27-11-2011 (funded by the University of Florence, funds DiMaD ex 60%) |
| 2011 | visiting Mark Podolskij, Heidelberg University , April 11-15, 2011 (funded by the Heidelberg University) |
| 2010 | visiting Prof. Nakahiro Yoshida, Tokyo University , Graduate School of Mathematical Sciences, 6-20 March (funded by the University of Tokyo) |
| 2010 | visiting Proff. Jean Jacod and Rama Cont, University Paris 6 , 13-20 January (funded by the University of Florence, funds DiMaD ex 60%, and GNAMPA) |
| 2009 | visiting Prof. Shigeyoshi Ogawa, Ritsumeikan University (Kyoto), funded by Ritsumeikan University, 14/28-2-2009 |
| 2007 | visiting Prof. Rama Cont at Columbia University , New York, 7-12/5/2007 (funded by Columbia University and InDaM) |
| 2006 | visiting Jeannette Woerner, Institut für Mathematische Stochastik, Göttingen (Germania), 4-8/12 |
| 2006 | visiting Prof. Jorge Zubelli, IMPA (Instituto nacional de Matemática Pura e Aplicada), Rio de Janeiro, 26-10/4-11 |
| 2006 | Palaiseau, visiting Rama Cont al Centro di Matematica per le Applicazioni dell' Ecole Polytechnique , 2/7-9/7 e 3/9-13/9 per realizzare il progetto di ricerca: " <i>Nonparametric tests for analyzing the nature of price trajectories</i> " |
| 2005 | Palaiseau, visiting Rama Cont al Centro di Matematica per le Applicazioni dell' Ecole Polytechnique , 14/2-10/3, per ricerche sul progetto: " <i>Detecting the presence of the Brownian noise and the jump activity in financial asset prices</i> " |
| 2005 | Newton Institue , Cambridge: visting 31/1-4/2 e 4/7-8/7, semester on Mathematical Finance |
| 2004 | Palaiseau, Ecole Polytechnique , visiting Rama Cont al Centro di Matematica per le Applicazioni 1/3-30/3, per ricerche sul tema: " <i>Estimating the integrated volatility in asset prices models with Lévy jumps</i> " |
| 1998 | visiting T. Bjork al Dipartimento di Matematica della Stockholm School of Economics , 11.1-20.2, per ricerche sul tema: " <i>Completing a Poisson-Gaussian stock market model using Call Options</i> " |
| 1994-95 | 7 mesi a Parigi 6 , per la frequenza dei corsi di DEA ed il conseguimento del diploma, a.a. 94-95 |

SEMINARI INVITATI

| | |
|------------|---|
| 6/4/2023 | Département de mathématiques at Université du Luxembourg |
| 31/5/2022 | Département de mathématiques at Université Versailles Saint Quentin |
| 10/5/2022 | PhD Seminar: Advanced Stochastic Modelling, Vienna-Verona group |
| 8/4/2022 | StatFin Webinar, IISER (Indian institute of science education and research), Pune, India |
| 9/5/2019 | Dipartimento di Economia e Finanza, Luiss Guido Carli, Roma |
| 4/5/2018 | Berlino, Humboldt University |
| 3/5/2018 | Otto-von-Guericke Universität, Magdeburgo (Germania) |
| 1/3/2018 | Mathematical Institute, Oxford University |
| 10/5/2017 | Washington Univ. in St. Louis |
| 6/4/2016 | Centre d'Economie Sorbonne, Univ. Parigi Pantheon-Sorbonne |
| 2/4/2015 | Università di Parigi 7 |
| 2/3/2015 | Econometrics Seminar at CORE , UCL (Université Catholique de Louvain), Louvain-la-Neuve |
| 24/11/2014 | Università di Pisa , Dipartimento di Economia e management |
| 12/11/2014 | Purdue University |
| 17/12/2012 | Ecole Politechnique Palaiseau (Paris) |
| 25/10/2012 | Luiss Guido Carli, Roma |
| 4/7/2012 | Humboldt University, Berlin |
| 7/5/2012 | Scuola Normale Superiore di Pisa , No free lunch seminars, seminari di finanza quantitativa |
| 24/11/2011 | Laboratoire de Probabilités, Università di Parigi 6 |
| 11-4-2011 | Faculty of mathematics and information technology of Heidelberg University |
| 16-6-2010 | Univ. Perugia , Dip. di Economia, Finanza e Statistica, (finanziatore della missione) |
| 15-3-2010 | University of Tokyo , Graduate School of Mathematical Sciences |
| 25/2/2010 | Università di Parma , Dipartimento di Economia, Sezione di Matematica "E. Levi |
| 8/2/2010 | Università di Bologna , Dipartimento di Matematica |
| 7/2009 | Institute of Number Theory and Probability Theory, Ulm University, Germany |
| 4/6/2008 | Roma Tor Vergata , Dipartimento SEFEMEQ |
| 21/2/2008 | London School of Economics , STICERD Econometrics Seminars, invitation funded by LSE |
| 6/12/2006 | Göttingen (Germania), Institut für Mathematische Stochastik, Seminario invitato nell'ambito dello Stochastics Colloquium presso l'Institut für Mathematische Stochastik (funded of my visit) |
| 12/7/2006 | Univ. Perugia , Dip. di Economia, Finanza e Statistica, (finanziatore della missione) |
| 3/3/05 | Ecole Polytechnique , Palaiseau (Paris) |
| 15/12/2004 | Cosenza , Dipartimento di Scienze Aziendali, finanziato dall'Università di Cosenza |
| 18/3/2004 | Ecole Polytechnique , Palaiseau: a February 2004 preprint of Barndorff-Nielsen and Shephard |

| | |
|-----------|--|
| 7.4.1998 | Firenze , DIMADEFAS |
| 7/1997 | Cortona |
| 7/1997 | Politecnico di Milano , missione finanziata dal Politecnico di Milano |
| 6/1996 | Roma Tor Vergata , Dipartimento di Matematica |
| 3.5.1996 | Perugia , Istituto di Mat. Gen. e Fin. |
| 24.4.1996 | Perugia , Istituto di Mat. Gen. e Fin. |
| 12.4.1996 | Perugia , Istituto di Mat. Gen. e Fin. |
| 6/1994 | Roma , Istituto Nazionale di Alta Matematica |

COMUNICAZIONI INVITATE

- 17/12/2023 CMStatistics (Computational and Methodological Statistics), **Berlin**, invited by Nakahiro Yoshida in a parallel session
- 24/11/2022 Workshop on Non-parametric estimation of stochastic volatility models, **Firenze**
- 17-19 /12/2022 CMStatistics (Computational and Methodological Statistics), King's College **London**
- 4-7/6/2019 **SIAM** conference on Financial mathematics and engineering, parallel session, **Toronto**
- 29/9/2017 I Gran Sasso Workshop on Mathematical Finance, 27/29-9-2017, **L'Aquila**
- 9-11/3/2017 Vienna–Copenhagen Conference on Financial Econometrics, **Vienna**, I also was **Chairperson**
- 30/9/2016 presenter of paper and discussant of the paper by M.W.D.Kurtz, **Siena** Finance Workshop
- 12-13/6/2016 Financial Engineering and Risk Management International Symposium, **Guangzhou**, China
- 2-5/2/2016 Conference Frontiers in Stochastic Modelling for Finance, **Padova and Venezia**
- 22-23/5/2015 discussant to a paper by J.Li at the Financial Econometrics Conference, **Toulouse** (declined)
- 12-13/12/2014 conference on Realized volatility, **Montreal**: declined for teaching duties
- 20-21/11/2014 workshop on statistics of high-frequency data, **Humboldt University, Berlin**, declined for teaching duties
- 13-15/11/2014 **SIAM** conference on Financial mathematics and engineering, parallel session, **Chicago**
- 22-25/9/2014 workshop on Statistical Inference for Lévy Processes, Lorentz Center, **Leiden**, The Netherlands
- 24/1/2014 Discussant at XV Workshop on Quantitative Finance, **Firenze**
- 18-19/12/2013 convegno Statistics for Stochastic Processes and Analysis of High Frequency Data, Univ. **Paris 6**
- 14-16/12/2013 7th International Conference on Computational and Financial Econometrics (CFE), Univ. **London**
- 27-29/6/2013 conference Measuring and modeling financial risk with high frequency data, EUIInstitute, **Fiesole**
- 18-19/3/2013 JAFEE-Columbia-Institute of Statistical Mathematics (ISM) International Conference on mathematical/quantitative finance, financial engineering and related fields, **Tokyo**
- 12-13/3/2012 workshop Statistics for Stochastic Processes: Inference, Limit Theorems, Finance and Data Analysis, Institut L. Bachelier, Palais Brongniart, **Paris**
- 7-8/10/2011 conference: Measuring risk, Bendheim center for Finance, **Princeton** University. Invitation completely funded by the Bendheim center
- 23-24/5/2011 Seventh Seminar on Stochastic Analysis, Random Fields and Applications, **Ascona**
- 21-22/5/2010 **Toulouse School of Economics**, France, invited discussant of a paper by Taesuk Lee and Werner Ploberger. Invitation funded by Toulouse School of Economics and Firenze University grants
- 24-4-2010 **Field Institute Toronto**, Workshop on Financial Econometrics, organized by Yacine Ait-Sahalia (Chair), Jianqing Fan, Per Mykland, Thematic Program on Quantitative finance January-June 2010, missed out travel because of Iceland volcano dust cloud
- 20-4-2010 Johns Hopkins Carey **Business School, Baltimore**, Maryland, Workshop on Econometrics, missed out travel because of Iceland volcano dust cloud
- 12-3-2010 **Ritsumeikan** University, Workshop on Stochastic Processes and Applications to Mathematical Finance, 11-12/3/2010
- 15-16/5/2009 **Toulouse School of Economics**, France, invited talk, funded by Toulouse School of Economics and Firenze University grants
- 12-13/6/2008 **Munich University of Technology**, invited talk, conference Risk modelling and high-frequency data, invitation funded by the Institute for advanced study of TUM
- 28/5/2008 **London, UCL**, invited talk at the workshop Continuous-time financial econometrics, invitation funded by UCL
- 26/5/2008 **Parigi, Hec** campus, invited talk, Methematical finance conference, invitation funded by HEC
- 19-23/5/2008 **Ascona**: Invited talk (declined), Sixth Seminar on Stochastic Analysis, Random Fields and Applications, Centro Stefano Franscini, Switzerland
- 16-17/5/2008 **London, Imperial College**, invited discussant of a paper by Todorov and Tauchen, at the Financial econometrics conference (funded by Imperial College and DiMaD research funds, head of project PierLuigi Zezza)
- 16-20/7/2007 **Zurich**: invited talk in the Minisymposium Inverse problems in financial modelling, organized by J. Zubelli, Convegno ICIAM (funded by ICIAM and DiMaD)
- 4-5/5/2007 **Montreal**: Invited discussant del paper di Ait-Sahalia e Jacod Testing for jumps in a discretely observed Process, CIREQ annual conference of Financial Econometrics (funded by CIREQ)
- 22-02-2007 **Toulouse**: miniworkshop organizzato da Monique Pontier, Università di Tolosa III, funded by the University Tolouse III

| | |
|---------------|--|
| 30/10-1/11/06 | IMPA , Rio de Janeiro: Convegno Mathematics and finance: from theory to practice, invited speaker, funded by IMPA |
| 6-8/9/2006 | Ecole Polytechnique , Palaiseau (France), Workshop on Financial Modelling with Jump Processes, funded by AMAMEF-ESF |
| 29/8-2/9/2006 | Rimini : invited talk, Convegno Small open economies in a globalized world, Rimini, sessione di Econometria, funded by DiMaD and by the conference organization |
| 18-22/7/2005 | Politecnico di Torino : 22-esimo convegno IFIP, funded by MIUR project directed by Sergio Vessella |
| 19/11/2004 | Perugia , II giornata di studio "Dati ad alta frequenza: modelli e Applicazioni", invited speaker |
| 9-15/5/1999 | Cortona : convegno "Evolution equations and applications", invited speaker, partecipazione finanziata dall'organizzazione del convegno |

COMUNICAZIONI A CONVEGNI E CONGRESSI

| | |
|------|---|
| 2023 | XXIV Quantitative Finance Workshop, 20-22 aprile, Gaeta |
| 2023 | Brown bag seminar, Università di Verona , 21 febbraio |
| 2022 | XXIII Quantitative Finance Workshop, 27-28 gennaio, U. Roma Tor Vergata |
| 2021 | IME (Insurance, Mathematics and Economics) conference (on line), Giugno 5-9 |
| 2021 | 35th EBES (Eurasia Business Economics Society) conference (on line), Aprile 7-9 |
| 2020 | XXI Quantitative Finance Workshop, 29-31 gennaio, U. Napoli Parthenope |
| 2019 | XX Quantitative Finance Workshop, 23-25 gennaio, ETH, Zurich |
| 2018 | Frontiers in High-Frequency Financial Econometrics, 28-29 settembre, Scuola Normale Superiore Pisa , I also was Chairperson |
| 2018 | SoFiE conference, Lugano 12-14 June |
| 2017 | Accepted paper at SoFiE conference, New York 21-23 June |
| 2017 | XVIII Workshop on Quantitative Finance, Milano Bicocca, 25-27/1, I also was Chairperson |
| 2016 | 9 th SoFiE conference 15/17-6-2016, Hong Kong |
| 2016 | accepted for presentation at ICASQF conference 6/2016, Colombia , and at the Bachelier Finance Society conference, 7/2016 in New York, both declined for teaching duties |
| 2016 | MAF (mathematical and statistical Methods for Actuarial sciences and Finance) conference, Parigi 30/3-1/4 |
| 2016 | XVII Workshop on quantitative finance, SNS Pisa , 28-29/1 |
| 2015 | DynStoch conference, Lund , 27-29/5/2015 |
| 2013 | XIV Workshop on quantitative finance Rimini , 24-25 of January |
| 2011 | Workshop Statistical inference and numerical analysis of stochastic processes: probabilistic tools and application to financial econometrics, 17-18 Marzo, Firenze |
| 2011 | Padova 27,28 gennaio, XII Workshop on quantitative finance |
| 2011 | convegno Modeling and managing financial risks, Paris 10-13 gennaio |
| 2010 | XI Workshop on quantitative finance, Palermo 28-29 Gennaio |
| 2009 | Research week in Florence Stochastic processes and financial econometrics , DiMaD, 9-11 settembre |
| 2009 | Eurandom, Statistical inference for Lévy processes with applications to finance, Eindhoven , 15/7 |
| 2009 | Firenze-Ritsumeikan workshop, Firenze , 12-13 marzo |
| 2009 | X Workshop in Quantitative Finance, Politecnico di Milano , 29-30 gennaio |
| 2007 | conference Multivariate Volatility models, Faro (Portugal), 27-28/10 |
| 2007 | Workshop on Quantitative Finance, Venezia , 25-26 Gennaio |
| 2005 | Palermo , XXIX Convegno AMASES 12-15 Settembre |
| 2005 | Econometric Society IX World Congress, Londra , 19/24 Agosto |
| 2005 | Summer School Risk management and control, Roma , 9-17 Giugno |
| 2004 | XXVIII Convegno AMASES, Modena , 8-12 Settembre |
| 2004 | 3rd World Congress of the Bachelier Finance Society , Chicago , 21-24 Luglio |
| 2003 | XXVII Convegno AMASES, Cagliari , 3-6 Settembre |
| 2003 | poster, "Blaise Pascal international conference on financial modelling", organizzato dal Bachelier-Paris group, Villiers-le-Mahieu , 1-3 luglio |
| 2003 | 32-esimo meeting dell' "Euro working group on financial modelling", Londra , 24-26 aprile |
| 2003 | meeting "Mathematical Finance Seminars", organizzato dal Prof. Frittelli, al Dipartimento di Matematica per le Decisioni di Firenze , 18 marzo, in occasione delle visite dei Proff. M.Schweizer e P.Embrechts |
| 2002 | poster, "II world congress of the Bachelier Finance Society ", Creta , 12-15 giugno |
| 2002 | meeting del progetto strategico "Integrazione dei mercati finanziari europei", coordinatore Prof. Galeotti dell' Univ. di Firenze, Firenze , 20 febbraio |
| 2001 | XXV Convegno AMASES, Firenze 5-8 settembre |
| 2000 | I workshop di Matematica finanziaria, Pescara 28-29/1, organizzato dai Proff. Antonelli, Barucci, Mari |
| 1999 | incontro del gruppo ex-40\% coordinato dal Prof. L.Peccati, Milano , 29/30 giugno |
| 1999 | International conference of mathematical finance, Hammamet , 13/18 giugno |
| 1998 | XXII Convegno Nazionale AMASES, Genova 9/12 settembre |
| 1998 | IV congresso nazionale SIMAI (Società italiana di matematica applicata e industriale), Taormina, 1-5/6 |

1997 poster al convegno "III Italian conference on mathematical finance", organizzato dal CIRM (Centro internaz. per la ricerca matemat.), **Trento**, 26-30 maggio

ORGANIZZAZIONE DI EVENTI SCIENTIFICI

Minicorsi (organizzazione)

2007 *Jump processes and finance* by Prof. **Jean Jacod**, Univ. Paris 6, 7-9/3, Firenze
2006 *Copulas, multidimensional Lévy processes and applications in finance*, by Prof. **Peter Tankov**, Univ. Paris 7, 15-17 /11, Firenze

Convegni (organizzazione in capo)

2022 **Sessione Modeling financial asset prices**, all'interno del 3rd Italian meeting on Probability and Mathematical Statistics, Bologna, 13-16/6/2022
2018 **Convegno internazionale** Portfolio managing, stochastic processes and financial econometrics, 18 maggio, Firenze
2013 **Fifth Florence-Ritsumeikan Workshop** on Stochastic Processes and Applications to Finance and Risk Management, Firenze 12/13 Marzo
2011 **Workshop Statistical inference and numerical analysis of stochastic processes: probabilistic tools and application to financial econometrics**, Firenze, 17-18 March
2011 **Third Florence-Ritsumeikan Workshop on Probability and Finance: Modeling and pricing finance and insurance assets in a risk management perspective**, Firenze 16/17 Marzo
2009 **Reserach week** in Florence *Stochastic processes and financial econometrics*, in occasione delle visite di Jean Jacod e Nour Meddahi, 9-11 settembre, Firenze

Convegni (co-organizzazione)

2025 12th General Amamef conference (Advanced Mathematical Methods For Finance, research network on Mathematical Finance), June 23-27, Verona (with Alessandro Gnoatto, Athena Picarelli, Sara Svaluto Ferro, Andrea Mazzon, Cosimo Munari)
2025 5-Day Workshop "Inference and Calibration of Financial Models based on High-Frequency and LOB Data" at the Banff International Research Station (BIRS programme for Mathematical Innovation and Discovery), summer (with José Figueroa-Lopez and Mark Podolskij)
2023 SIAM minisymposium Inference and Calibration based on High-Frequency and LOB Data, of 3 sessions (with José Figueroa-Lopez)
2023 **Workshop** on Eco-Stat asymptotics, 11/9, Verona (with Catia Scricciolo and Francesca Rossi)
2021 **XXII Workshop on Quantitative Finance**, web edition, Verona, 28-29/1
2014 **Workshop Dependence in risk measurement and risk management**, 18-19/12, Florence, jointly organized with Giovanni Puccetti and Valeria Bignozzi
2014 **XV Workshop on Quantitative Finance**, Firenze 23-24/1, co-organizzatrice Maria Elvira Mancino
2005 *New Mathematical Methods in Risk Theory*, **Workshop** in honour of Hans Bühlmann, Firenze 6-8/10, organizzatore M.Galeotti
2004 **meeting Mathematical Finance Seminars**, organizzato da M.Frittelli e M.Galeotti, al DiMaD, 28/4, in occasione della visita di H. Bühlmann, Firenze
2003 **meeting Mathematical Finance Seminars**, organizzato da M.Frittelli, al DiMaD, 18/3, in occasione delle visite di M.Schweizer and P.Embrechts, Firenze

SEMINARI A VERONA (organizzazione)

14/2/24 Francesco Benvenuti (Department of Mathematical Sciences, Aalborg University), A seismometer for Itô semimartingales
20/03/23 Yacine Ait-Sahalia (Princeton University), How and When are High-Frequency Prices Predictable?
15/02/23 Chiara Amorino (University of Luxembourg), Parameter estimation of discretely observed interacting particle systems
23/2/2022 José Figueroa-Lopez, Washington University in St. Louis
22/9/2021 Jean Jacod, Università Sorbonne di Parigi

SEMINARI A FIRENZE (organizzazione)

23/4/2018 Simone Scotti, Università di Parigi 7
28/3/2017 Imma Curato, Ulm University (co-organizzato)
6/3/2017 Nien-Li Liu, Ritsumeikan University (co-organizzato)

- 14/2/2017 Francesca Lilla, Università di Bologna, e
 Susana Martins, Università di Minho (Portogallo) (co-organizzato)
 31/5/2016 Luca Spadafora (Banco Popolare di Verona)

Responsabile di seminari: dall'a.a. 2009-2010 all'a.a. 2012-2013 Responsabile per il DiMaD del coordinamento e dell'organizzazione del ciclo di seminari congiunto con il Dipartimento di Scienze Economiche dell'Università di Firenze

Seminari da me invitati

- 20/6/2013 Lorenzo Torricelli, University College London
- 27/9/2012 Rama Cont, CNRs and Univ. Paris 6
- 7/2/2012 Peter Reinhard Hansen, Stanford University
- 20/3/2012 Giacomo Bormetti, Scuola Normale Superiore di Pisa
- 15/5/2012 Fausto Gozzi, Luiss di Roma
- 26/6/2012 Stefano Marmi, Scuola Normale Superiore di Pisa
- 3/11/2011 Roberto Renò, Univ. Di Siena
- 22.2.2011 Yoichi NISHIYAMA, Institute of Statistical Mathematics, Tokyo
- 12/1/2010 Federico Bandi, The Johns Hopkins Carey Business School, Baltimore, Maryland
- 18/2/2010 Álvaro Cartea, Universidad Carlos III de Madrid and Birkbeck University of London
- 2/3/2010 Marina Pireddu, Università di Firenze
- 8/6/2010 Irene Crimaldi, Università di Bologna
- 15/12/2009 Davide Canestraro, Univ. di Roma 1, e Philipp Arbenz, ETH di Zurigo

19-05-2009 **II Giornata di seminari ECONOMETRICS AND MATHEMATICS OF FINANCE**, Firenze

- Gianna Figà-Talamanca, Università di Perugia
- Peter Tankov, Polytechnique di Palaiseau
- Álvaro Cartea, Universidad Carlos III de Madrid and Birkbeck University of London
- Angelica Gianfreda, Università di Verona
- Gabriele Fiorentini, Università di Firenze

20/1/2009 **giornata di seminari ECONOMETRICS AND MATHEMATICS OF FINANCE**, Firenze

- Sabrina Mulinacci, Univ. Of Bologna
- Fulvio Corsi, Univ. Of Siena
- Giampiero Gallo, Univ. Of Florence
- Simona Sanfelici, Univ. of Parma
- Roberto Renò, univ. of Siena

27/2/2008 **mezza giornata di seminari DATI AD ALTA FREQUENZA**, Firenze

- Christian T. Brownlees, Univ. di Firenze
- Roberto Renò, Univ. di Siena, Volatility forecasting: the jumps do matter

31/5/2007 Álvaro Cartea, University of London - Birkbeck College

28/2/07 Taro Kanatani

14/2/7 Gabriele Fiorentini, Univ. of Florence

31/1/07 Giampiero M. Gallo, Univ. of Florence

13/7/2006 Mark Podolskij, Ruhr-University, Bochum (Germania), al DiMaD

5/5/1999 Silvia Totaro, Univ. di Siena

16,17/11/1998 Giulia Rotundo, Univ. of Roma La Sapienza

15/6/1998 Thomas Bjork, Stockholm School of Economics

Altri seminari a Firenze (co-organizzazione):

24/5/2000 Maurizio Pratelli, Univ. di Pisa, Florence

19/5/1999 Marco Frittelli, Univ. di Milano Bicocca

9/4/1999 Giovanni Peccati, Univ. Bocconi di Milano

12/3/1999 Andrea Roncoroni, Univ. di Parigi 6

3/3/1999 Paul Embrechts, ETH di Zurigo

ATTIVITÀ DIDATTICA

CORSI TENUTI ALL'ESTERO

- 2018 Markowits Portfolio theory, a course to Bachelor students and a course to Master students, **IPAG Business School (Grandes Écoles), Paris**, 9-12/4, programma Erasmus

2009 Stochastic processes, jumps and some applications to finance, Master and PhD students course,
Ritsumeikan University, Japan, 17-24/2

SCUOLA SUPERIORE

1993 Supplenza per l'insegnamento di Matematica,Istituto Tecnico I.Pannaggi di Macerata, dal 23-10 al 9-11

PRESSO L'UNIVERSITÀ DI PISA

1993 precorso di matematica presso l'Università di Pisa, Facoltà di Scienze fisiche e naturali, CdL Matematica (le funzioni trigonometriche)

PRESSO L'UNIVERSITÀ DI VERONA

2023/2024 Matematica Finanziaria (42 ore), Laurea triennale Economia e Commercio
Finanza Matematica (9 CFU), Laurea Magistrale in Banca e Finanza
Continuous Time Econometrics (20 ore), PhD in Economics and Finance, track Data Analysis and Finance

2022/2023 International Financial Modeling (6 CFU), Laurea magistrale in International Economics and Business, sede di Vicenza
Finanza Matematica (9 CFU), Laurea Magistrale in Banca e Finanza

Finance (20 ore), PhD in Economics and Finance

2021/2022 International Financial Modeling (6 CFU), Laurea magistrale in International Economics and Business, sede di Vicenza
Finanza Matematica (9 CFU), Laurea Magistrale in Banca e Finanza

Finance (20 ore), PhD in Economics and Finance

2020/2021 International Financial Modeling (6 CFU), Laurea magistrale in International Economics and Business, sede di Vicenza
Finanza Matematica (9 CFU), Laurea Magistrale in Banca e Finanza

PhD course: Mathematics (10 ore)

Finance (20 ore), PhD in Economics and Finance

2019/2020 Quantitative Models for Business Management (9 CFU), Laurea magistrale in International Economics and Business Management, sede di Vicenza
Finanza Matematica (9 CFU), Laurea Magistrale in Banca e Finanza

Finance (20 ore), PhD in Economics and Finance

2018/2019 Docente di Matematica Finanziaria per i CdS di Ec. e Comm. e di Ec. Az. (6 CFU), Scuola di Economia
Docente del corso Complementi di matematica finanziaria, CdLM in Accounting e Libera Professione, 6 CFU, Scuola di Economia

2015-2017 Docente di Matematica per le Applicazioni Economiche per i corsi di laurea di Ec. e Comm. e di Ec. Az. (9 CFU), Scuola di Economia: I semestre 2015, 2016, 2017
Docente del corso Complementi di matematica finanziaria, corso di Laurea Magistrale in Accounting e Libera Professione, 6 CFU, Scuola di Economia: I semestre 2015, 2016, 2017

2014/2015 Co-docente di 2 corsi Matematica per le Applicazioni Economiche per i corsi di laurea di Ec. e Comm. e di Ec. Az. 6 CFU in tutto di mia competenza), Scuola di Economia
Co-docente del corso Portfolio choice and optimization, del corso di Laurea Magistrale in Financial Risk Management (FiRM), 6 CFU di mia competenza, Scuola di Economia

Corso integrativo sui prerequisiti di Matematica per gli studenti della Scuola di Economia (6 ore)

2013/2014 Co-docente del corso Matematica per le Applicazioni Economiche per i corsi di laurea di Ec. e Comm. e di Ec. Az. (4,5 CFU di mia competenza), Scuola di Economia

| | |
|-----------|---|
| | Co-docente del corso Portfolio choice and optimization, del corso di Laurea Magistrale in Financial Risk Management (FiRM), 6 CFU di mia competenza, Scuola di Economia |
| 2012/2013 | <p>Co-docente del corso Matematica per le Applicazioni Economiche per i corsi di laurea di Ec. e Comm. e di Ec. Az. (9 CFU in totale)</p> <p>Co-docente del corso Portfolio choice and optimization, del corso di Laurea Magistrale in Financial Risk Management (FiRM), 6 CFU di mia competenza: corso non svolto per mancanza di studenti, essendo del II anno della LM appena partita</p> <p>Co-docente del precorso di Matematica per i corsi di laurea di Ec. e Comm. e di Ec. Az.</p> |
| 2011/2012 | <p>Esercitazioni al corso Matematica - Applicazioni Economiche, per 3 CFU, CdL Economia Aziendale</p> <p>Co-Docente del corso Matematica finanziaria e teoria dei mercati per 3 CFU, CdL Economia e Commercio, curriculum "Analisi economica", terzo anno</p> |
| 2010/2011 | Esercitazioni al corso Metodi Matematici per le Applicazioni Economiche (3 CFU), CdL Economia Aziendale (anno di sciopero) |
| 2009/2010 | <p>Metodi Matematici 1 (6 CFU), CdL Management Internazionalizzazione e Qualità, affidamento nella sede di Prato</p> <p>Metodi Matematici 2 e Matematica Finanziaria (3 CFU), CdL Management Internazionalizzazione e Qualità, affidamento nella sede di Prato</p> <p>Probabilità e Statistica Matematica, tutoraggio (corso da 6CFU), CdL Economia Aziendale a distanza (Nettuno)</p> |
| 2008/09 | <p>Metodi Matematici 1 (6 CFU), CdL Management Internazionalizzazione e Qualità, affidamento nella sede di Prato</p> <p>Metodi Matematici 2 e Matematica Finanziaria (3 CFU), CdL Management Internazionalizzazione e Qualità, affidamento nella sede di Prato</p> <p>Probabilità e Statistica Matematica, tutoraggio (corso da 6CFU), CdL Economia Aziendale a distanza (Nettuno)</p> <p>Logica, corso di recupero (sui prerequisiti, per i test di accesso alla Facoltà di Economia), per gli studenti del CdL Management Internazionalizzazione e Qualità, sede di Prato</p> |
| 2007/08 | <p>Calcolo 1, CdL Statistica (3 CFU), esercitazioni</p> <p>Metodi Matematici per la Gestione aziendale (6 CFU), CdL Marketing ed Internazionalizzazione, affidamento nella sede di Prato</p> |
| 2006/07 | <p>Metodi Matematici (6 CFU), CdL Marketing ed Internazionalizzazione, affidamento nella sede di Prato</p> <p>Metodi Matematici (Polo Penitenziario Prato), CdL Economia Aziendale</p> |
| 2005/06 | <p>Metodi Matematici (6 CFU), CdL Marketing ed Internazionalizzazione, affidamento nella sede di Prato</p> <p>Metodi matematici, CdL Economia Aziendale, Polo universitario penitenziario di Prato</p> <p>Calcolo delle probabilità e statistica, tutoraggio (corso da 6CFU), CdL Economia Aziendale a distanza (Nettuno)</p> |
| 2004/05 | <p>precorsi di matematica (uno di 4 moduli) per le matricole della Facoltà di Economia di Firenze</p> <p>corso ed esercitazioni di METODI MATEMATICI (6 CFU), CdL Marketing del Tessile e Abbigliamento, affidamento nella sede di Prato</p> <p>corso ed esercitazioni (uno dei due moduli) di METODI MATEMATICI PER LA QUALITÀ (3 CFU), CdL Economia e Ingegneria della Qualità, affidamento nella sede di Prato</p> <p>corso di MATEMATICA GENERALE (CdL Economia Aziendale), Polo Universitario Penitenziario, Prato</p> |
| 2003/04 | <p>precorsi di matematica (8 ore, uno di 4 moduli) per le matricole della facoltà di Economia di Firenze</p> <p>corso ed esercitazioni di METODI MATEMATICI (6 CFU), CdL Marketing del Tessile e Abbigliamento, affidamento nella sede di Prato</p> <p>corso ed esercitazioni (uno dei due moduli) di METODI MATEMATICI PER LA QUALITÀ (3 CFU), CdL Economia e Ingegneria della Qualità, affidamento nella sede di Prato</p> <p>esercitazioni al corso di MATEMATICA FINANZIARIA (2.5 CFU), CdL Economia Aziendale</p> |

| | |
|--|--|
| 2002/03 | corso ed esercitazioni di METODI MATEMATICI (6 CFU), CdL Marketing del Tessile e Abbigliamento, affidamento nella sede di Prato esercitazioni al corso di MATEMATICA FINANZIARIA (2.5 CFU), CdL Economia Aziendale ed Economia e Commercio |
| 2001/02 (misurazione del carico didattico in CFU del DM 509/99 entrata in vigore a Firenze con l'a.a. 2001-2002) | corso ed esercitazioni di METODI MATEMATICI (6 CFU), CdL Marketing del Tessile e Abbigliamento, affidamento nella sede di Prato esercitazioni al corso di MATEMATICA FINANZIARIA (2.5 CFU), CdL Economia Aziendale ed Economia e Commercio corso ed esercitazioni di CALCOLO DELLE PROBABILITA', CdL Statistica, Scienze statistiche ed attuariali, Scienze statistiche ed economiche, Economia e commercio, supplenza |
| 2000/01 (ogni singolo incarico didattico dal 1997-98 al 2000/01 si è svolto su un arco temporale semestrale) | corso ed esercitazioni di METODI MATEMATICI PER LA GESTIONE DELLE AZIENDE, Diploma Universitario triennale in marketing e management internazionale, affidamento nella sede di Prato esercitazioni al corso di MATEMATICA PER LE APPLICAZIONI ECONOMICHE E FINANZIARIE, CdL Economia Aziendale |
| 1999/00 | esercitazioni al corso Matematica per le applicazioni economiche e finanziarie, CdL Economia Politica esercitazioni al corso Matematica per le applicazioni economiche e finanziarie, CdL Economia Aziendale Introduzione alla matematica finanziaria, corso per il Dottorato del DiMaD |
| 1998/99 | esercitazioni al corso di MATEMATICA GENERALE, CdL Economia e Commercio, Economia Politica, Economia Aziendale esercitazioni al corso di Matematica per le applicazioni economiche e finanziarie, CdL Economia e Commercio modulo del corso di MATEMATICA FINANZIARIA, CdL Economia e Commercio |
| 1997/98 | esercitazioni al corso di MATEMATICA FINANZIARIA, CdL Scienze Statistiche ed Attuariali esercitazioni al corso di PROCESSI STOCASTICI, CdL Scienze Statistiche ed Attuariali |

ALTRI INCARICHI ISTITUZIONALI

| | |
|-----------|--|
| 2023- | gruppo AQ del corso di dottorato in Economia e Finanza, DSE, Verona |
| 2021- | collegio di dottorato in Economia e Finanza, DSE, Verona |
| 2019-2022 | co-referente del Team di Assicurazione della Qualità – Ricerca per il Dipartimento di Scienze Economiche, Univ. Verona |
| 2013-2015 | Referente per i piani di studio (a.a. 2013-2014, 2014-2015) per gli studenti di Economia e Commercio, iscritti dall'a.a. 2012-2013, Firenze |
| 2005- | Tutor universitario per lo stage aziendale di: Pierlorenzo Zocca (2023); Tiberio D'Elia (2023); Matteo Cornale (2022:12/9-25/10 presso Banca BCC Verona e Vicenza); Jacopo Pennisi (2022, presso Gruppo Formazione srl, dal 7/7 al 30/9), Omar Giovannini (2022, presso A.M. Fishery SRL, Verona, dal 6/5 al 19/5), Monica Braggion (Vicenza, 2022, presso Corichem SRL dal 21/2 al 4/3), Pretto Sarah (Vicenza, 2019), Salassa Angelica (Firenze, presso Valentino SpA, da ottobre 2018 a gennaio 2019), Lorenzini Giulio (presso Societé Generale, da marzo a settembre 2013), Guarducci Romana (2006), Pieragnoli Laura (2006) |

MEMBRO DI COMMISSIONI PER L'ASSEGNAZIONE DEL TITOLO DI DOTTORATO

| | |
|------|---|
| 2022 | Washington Univ. in St. Louis , August: candidate Yuchen Han |
| 2011 | Università di Pisa , candidato Mario Dell'Era, novembre |
| 2007 | Università di Tolosa III , 22/2, candidato Alexander Alvarez Hernández |

MEMBRO DI COMMISSIONI PER RECLUTAMENTO

| | |
|------|--|
| 2022 | Ricercatore RTDB, presso l'università di Siena |
| 2022 | Procedure valutative per passaggio da RTDB a PA: Verona; Roma Tor Vergata |
| 2021 | Ricercatore RTDB, presso l'università di Torino |

| | |
|-------|--|
| 2020 | professore associato presso l'Università di Cassino |
| 2017 | ricercatore RTDA presso l'Università di Firenze |
| 2008 | ricercatore RTI presso l'Università di Roma Tor Vergata , 2-3/4/2008 e 3/6/2008 |
| 2006 | ricercatore RTI presso l'Università di Milano Bicocca , 22-24/11 |
| 2004- | assegnista di ricerca: 2024 (2 assegni, responsabile Athena Picarelli) 2004(resp. Frittelli), 2006 (Mancini), 2016 (Mancini), 2017 (Mancini), 2018(Mancino) |
| 2017 | commissione di concorso per professore a contratto per il corso <i>Matematica per le applicazioni economiche</i> , 3 CFU, per l.a.a. 2017-2018, giugno, Firenze |

ALTRE COMMISSIONI

| | |
|-----------|--|
| 2023 | Commissione selezione progetti per borse di dottorato a valere sul PNNR, Verona |
| 2019 | Gruppo di Riesame , CdLM Accounting e Libera Professione, Università di Firenze |
| 2009-2018 | commissione test di accesso alla Facoltà di Economia di Firenze (sett 2009 e sett. 2011) e alla Scuola di Economia (Sett. 2013, Sett. 2016, Sett. 2018), Firenze |
| 2013,2014 | commissione test di conoscenza della lingua italiana per l'accesso degli studenti stranieri all'Ateneo Fiorentino (luglio e settembre 2013; luglio e settembre 2014), Firenze |
| 2011-1015 | commissione selezione tutor per il corso di Matematica della Facoltà di Economia di Firenze (2011, 2012, 2015) |
| 2013-2015 | Comitato per la Didattica (Giunta) del Corso di Laurea in Economia e Commercio (dal maggio 2013 al gennaio 2015), Firenze |
| 2000-2010 | Giunta dei CdL MTA-MIQ dal 2000-2001 al 2009-2010, Prato |
| 2005 | Giunta dei DiMaD, Firenze |
| 2001- | commissione di dipartimento per la ripartizione dei fondi ex 60%: 2001, 2004, 2005, 2012, 2018, Firenze |
| 2003-2008 | commissioni elettorali (Presidente di CdL FiRM, 2012; Direttore di Dipartimento, 2008; Preside di Facoltà, 2003, 2006), Firenze |

TESI DI LAUREA

| | |
|------------|--|
| 2024 | Relatrice della tesi di Carlo Alberto Boari, Laurea Magistrale in Banca e Finanza in tema Hawkes processes in Finance |
| 2023 | Relatrice della tesi di Giulia Schiesaro, Laurea Magistrale in Banca e Finanza in tema volatility of financial assets |
| 2013 | Relatrice della tesi di laurea triennale in Economia e Commercio di Elvin Biba, <i>Modeling the effects and propagation of business financial distress on financial markets</i> , laureato il 17/10/13 |
| 2000, 2002 | Ho seguito le tesi di laurea, presso la Facoltà di Economia di Firenze, di: F.Fazzi, <i>tesi Metodologie di calcolo del Value at Risk. Stime del VAR per alcuni prodotti derivati</i> , laureato il 19 settembre 2002, relatore Prof. M. Galeotti; I. Zei, tesi <i>Il Capital Asset Pricing Model a tre momenti</i> , laureata l'11 febbraio 2000, relatore Prof. M. Torrigiani |
| 1998-2012 | Contro-relatrice di tesi di laurea: n. 15 tesi ante 2012, Facoltà di Economia di Firenze |

COMMISSIONI DI LAUREA triennale/magistrale

| | |
|----------|--|
| VERONA: | 9/4/2020 (CdLM BF): 3 correlazioni; 4/4/23: 2 correlazioni, 1 laureanda |
| FIRENZE: | 10/2020 Bartoli Martina (LM ALP), 14/12/2018 (LM ALP), 19/4/2018 (EA), 26/2/2018 (EA); 15/12/2016 CdLM FiRM), 15/7/2014 CdLM BAMF, 17/2/14 CdLM BAMF; 12/12/13 laurea triennale di Innocenti Francesco; 17/10/2013 CdS Economia e Commercio, laureando Biba; 10/10/13 CdLM BAMF; 16/2, 1/7, 2/7, 12/7, 20/9 2004; 25/9, 18/10, 28/10 2003; 11/2, 28/6, 25/9, 30/9, 10/12 2002; 23/6 e 2/7 1999; 21/4 e 24/9 1998 |