

# Cecilia Mancini

Affiliazione: Università di Verona  
Researcher unique identifier: ORCID n. 0000-0002-5155-3495  
web: <http://www.dse.univr.it/?ent=persona&id=55236&lang=it>  
Nazionalità: italiana



Settembre 2019

## 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 Probabilites 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 ricerca: *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

- 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, IF2010: **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, IF2010: **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, IF2010: **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, IF2008: **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, IF2008: **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 8<sup>th</sup> 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, IF2010: **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, IF2008: **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

- 2000 C. Mancini, *Modello bivariato di Cox-Ingersoll-Ross guidato da diffusioni 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
- 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.
- 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*, **rapporto di stage** del DEA, Università Parigi 6

## Working papers

- 2019 F.Lilla, R.Foschi, C.Mancini: Warnings about future jumps: properties of the exponential Hawkes model, **working paper**
- 2019 J. Figueroa-Lopez, C. Mancini: Optimum conditional mean error for the square Truncated Realized Variance with infinite activity jumps, **working paper**
- 2019 C. Mancini, L. Torricelli: Target volatility strategies in semimartingale models, **working paper**

## FINANZIAMENTI

- 2018 **GNAMPA 3000** Eu, finanziamento di progetto di ricerca annuale, *Nuovi indicatori di instabilità dei mercati finanziari*
- 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 sistemico per il titolo sottostante
- 2016 grant **IndAM** (600 Eu) per invito di Jose Figueroa-Lopez a Firenze a giugno 2016
- 2015 grant of **32'000** Euro from University of Florence for the **strategic project** *Previsori di instabilità dei mercati finanziari*, other members of the group: Maria Elvira Mancino, Salvatore Federico
- 2014 grant of 600 Eu from **GNAMPA** for Mark Podolskij visiting DiSEI in December 2014

- 2013 grant of **10'000** Euro by **Eurolplace Institute of Finance Louis Bachelier** (EIF) for the research project *Small Jumps and Default Contagion*, other members of the group: Giampiero Maria Gallo, Mark Podolskij and Peter Tankov
- 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 *Fifth Florence Ritsumeikan workshop*, 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 *Third Florence Ritsumeikan workshop* e *Statistical inference and numerical analysis of stochastic processes: probabilistic tools and application to financial econometrics* di Marzo 2011 a Firenze
- 2010 finanziamento **GNAMPA** per l'organizzazione del workshop *Statistical inference and numerical analysis of stochastic processes: probabilistic tools and application to financial econometrics* 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
- 2002 Ateneo fiorentino, finanziamento del **progetto Giovani Ricercatori**, *Strategie di investimento ottimali secondo il criterio di limited off-hedging*, di cui sono stata promotrice, **2000** Eu
- 2001 Ateneo fiorentino: finanziamento del **progetto Giovani Ricercatori**, *Problemi di controllo ottimo stocastico: aspetti teorici e applicazioni alla finanza*, di cui sono stata promotrice; altri partecipanti del gruppo: Sandra Cerrai, **4'000'000** Lire
- 2017-2019 responsabile ogni anno di un **progetto di ricerca annuale locale** (ex quota 60%, finanziata dall'Ateneo fiorentino e 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** (ex quota 60%, finanziata dall'Ateneo fiorentino e distribuita dal dipartimento sulla base del merito scientifico), ottenuti in media **2500** Eu ogni volta
- 1998 Università di **Roma Tor Vergata (Borsa di studio** per l'estero di durata 3 mesi – non fruita 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
- 2009 ho usufruito di fondi **GNAMPA** quale membro di progetto di ricerca di Marcello Galeotti
- 1998-2009 ogni anno ho partecipato ad un **progetto di ricerca locale** (ex quota 60%)
- 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

## PREMI E RICONOSCIMENTI

- 2005 **Econometric Society**: contributo per il progetto di ricerca *Estimating the integrated volatility in stochastic volatility models with Lévy type jumps*, 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
- 1996- membro di GNAMPA, Gruppo Nazionale per l'Analisi Matematica, la Probabilità e Applicazioni

## ATTIVITÀ EDITORIALE

2009-2010 **Guest Editor**, assieme a Roberto Renò, di *Economic Notes*, 2010, Volume 39, Issue 1: **Special Issue Financial Mathematics and Econometrics**, dedicato alla pubblicazione di articoli collegati alla Research week *Stochastic processes and financial econometrics*, che si è svolta a Firenze dal 9 all'11 settembre 2009

## ATTIVITÀ DI REFERAGGIO

### Per riviste scientifiche:

1997- 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

2012-2016 2012, 2013, 2015, 2016: **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 IRCM (International Risk Management Conference): Firenze, 22-24/6/2009; Warsaw, 23-24/6/2014  
2016 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, *Modélisation de séries financières, estimation, ajustement de modèles et test d'hypothèses*, di Alexander Alvarez Hernández, Università Paul Sabatier, Tolosa III; 2011, Mario Dell'Era, Università di Pisa

2016, 2018 Controrelatore di tesi di Laurea Specialistica: Giacomo Toscano, CdS in Finance and Risk Management, Dicembre 2016; Lorenzo Nesi, CdS Accounting e Libera Professione, ottobre 2018; Serena Visi, CdS Accounting e Libera Professione, dicembre 2018

### 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

2019 **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 and the moments based method 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

- 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: "*Nonparametric tests for analyzing the nature of price trajectories*"
- 2005 Palaiseau, visiting Rama Cont al Centro di Matematica per le Applicazioni dell'**Ecole Polytechnique**, 14/2-10/3, per ricerche sul progetto: "*Detecting the presence of the Brownian noise and the jump activity in financial asset prices*"
- 2005 **Newton Institute**, 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: "*Estimating the integrated volatility in asset prices models with Lévy jumps*"
- 1998 visiting T. Bjork al Dipartimento di Matematica della **Stockholm School of Economics**, 11.1-20.2, per ricerche sul tema: "*Completing a Poisson-Gaussian stock market model using Call Options*"
- 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

- 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	<b>Washington Univ.</b> in St. Louis
6/4/2016	Centre d'Economie Sorbonne, Univ. <b>Parigi Pantheon-Sorbonne</b>
2/4/2015	Università di <b>Parigi 7</b>
2/3/2015	Econometrics Seminar at <b>CORE</b> , UCL (Université Catholique de Louvain), Louvain-la-Neuve
24/11/2014	Università di <b>Pisa</b> , Dipartimento di Economia e management
12/11/2014	<b>Purdue University</b>
17/12/2012	<b>Ecole Polytechnique</b> Palaiseau (Paris)
25/10/2012	<b>Luiss</b> Guido Carli, <b>Roma</b>
4/7/2012	<b>Humboldt University, Berlin</b>
7/5/2012	<b>Scuola Normale Superiore</b> di <b>Pisa</b> , No free lunch seminars, seminari di finanza quantitativa
24/11/2011	Laboratoire de Probabilites, Università di <b>Parigi 6</b>
11-4-2011	Faculty of mathematics and information technology of <b>Heidelberg</b> University
16-6-2010	Univ. <b>Perugia</b> , Dip. di Economia, Finanza e Statistica, (finanziatore della missione)
15-3-2010	University of <b>Tokyo</b> , Graduate School of Mathematical Sciences
25/2/2010	Università di <b>Parma</b> , Dipartimento di Economia, Sezione di Matematica "E. Levi
8/2/2010	Università di <b>Bologna</b> , Dipartimento di Matematica
7/2009	Institute of Number Theory and Probability Theory, <b>Ulm</b> University, Germany
4/6/2008	<b>Roma Tor Vergata</b> , Dipartimento SEFEMEQ
21/2/2008	<b>London School of Economics</b> , STICERD Econometrics Seminars, invitation funded by LSE
6/12/2006	<b>Göttingen</b> (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. <b>Perugia</b> , Dip. di Economia, Finanza e Statistica, (finanziatore della missione)
3/3/05	<b>Ecole Polytechnique</b> , Palaiseau (Paris)
15/12/2004	<b>Cosenza</b> , Dipartimento di Scienze Aziendali, finanziato dall'Università di Cosenza
18/3/2004	<b>Ecole Polytechnique</b> , Palaiseau: a February 2004 preprint of Barndorff-Nielsen and Shephard
7.4.1998	<b>Firenze</b> , DIMADEFAS
7/1997	<b>Cortona</b>
7/1997	<b>Politecnico di Milano</b> , missione finanziata dal Politecnico di Milano
6/1996	<b>Roma Tor Vergata</b> , Dipartimento di Matematica
3.5.1996	<b>Perugia</b> , Istituto di Mat. Gen. e Fin.
24.4.1996	<b>Perugia</b> , Istituto di Mat. Gen. e Fin.
12.4.1996	<b>Perugia</b> , Istituto di Mat. Gen. e Fin.
6/1994	<b>Roma</b> , Istituto Nazionale di Alta Matematica

## COMUNICAZIONI INVITATE

4-7/6/2019	<b>SIAM</b> conference on Financial mathematics and engineering, parallel session, <b>Toronto</b>
29/9/2017	I Gran Sasso Workshop on Mathematical Finance, 27/29-9-2017, <b>L'Aquila</b>
9-11/3/2017	Vienna-Copenhagen Conference on Financial Econometrics, <b>Vienna</b> , I also was <b>Chairperson</b>
30/9/2016	presenter of paper and discussant of the paper by M.W.D.Kurtz, <b>Siena</b> Finance Workshop
12-13/6/2016	Financial Engineering and Risk Management International Symposium, <b>Guangzhou</b> , China
2-5/2/1016	Conference Frontiers in Stochastic Modelling for Finance, <b>Padova and Venezia</b>
22-23/5/2015	discussant to a paper by J.Li at the Financial Econometrics Conference, <b>Toulouse</b> (declined)
12-13/12/2014	conference on Realized volatility, <b>Montreal</b> : declined for teaching duties
20-21/11/2014	workshop on statistics of high-frequency data, <b>Humboldt University, Berlin</b> , declined for teaching duties
13-15/11/2014	<b>SIAM</b> conference on Financial mathematics and engineering, parallel session, <b>Chicago</b>
22-25/9/2014	workshop on Statistical Inference for Lévy Processes, Lorentz Center, <b>Leiden</b> , The Netherlands
24/1/2014	Discussant at XV Workshop on Quantitative Finance, <b>Firenze</b>
18-19/12/2013	convegno Statistics for Stochastic Processes and Analysis of High Frequency Data, Univ. <b>Paris 6</b>
14-16/12/2013	7 <sup>th</sup> International Conference on Computational and Financial Econometrics (CFE), Univ. <b>London</b>
27-29/6/2013	conference Measuring and modeling financial risk with high frequency data, EUInstitute, <b>Fiesole</b>
18-19/3/2013	JAFEE-Columbia-Institute of Statistical Mathematics (ISM) International Conference on mathematical/quantitative finance, financial engineering and related fields, <b>Tokyo</b>
12-13/3/2012	workshop Statistics for Stochastic Processes: Inference, Limit Theorems, Finance and Data Analysis, Institut L. Bachelier, Palais Brongniart, <b>Paris</b>
7-8/10/2011	conference: Measuring risk, Bendheim center for Finance, <b>Princeton</b> University. Invitation completely funded by the Bendheim center
23-24/5/2011	Seventh Seminar on Stochastic Analysis, Random Fields and Applications, <b>Ascona</b>
21-22/5/2010	<b>Toulouse School of Economics</b> , 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	<b>Field Institute Toronto</b> , 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 <b>Business School, Baltimore</b> , Maryland, Workshop on Econometrics, missed out travel because of Iceland volcano dust cloud
12-3-2010	<b>Ritsumeikan</b> University, Workshop on Stochastic Processes and Applications to Mathematical Finance, 11-12/3/2010
15-16/5/2009	<b>Toulouse School of Economics</b> , France, invited talk, funded by Toulouse School of Economics and Firenze University grants
12-13/6/2008	<b>Munich University of Technology</b> , invited talk, conference Risk modelling and high-frequency data, invitation funded by the Insitute for advanced study of TUM
28/5/2008	<b>London, UCL</b> , invited talk at the workshop Continuous-time financial econometrics, invitation funded by UCL
26/5/2008	<b>Parigi, Hec</b> campus, invited talk, Methematical finance conference, invtation funded by HEC
19-23/5/2008	<b>Ascona</b> : Invited talk (declined), Sixth Seminar on Stochastic Analysis, Random Fields and Applications, Centro Stefano Franscini, Switzerland
16-17/5/2008	<b>London, Imperial College</b> , 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	<b>Zurich</b> : 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	<b>Montreal</b> : 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	<b>Tolouse</b> : miniworkshop organizzato da Monique Pontier, Università di Tolosa III, funded by the University Tolouse III
30/10-1/11/06	<b>IMPA</b> , Rio de Janeiro: Convegno Mathematics and finance: from theory to practice, invited speaker, funded by IMPA
6-8/9/2006	<b>Ecole Polytechnique</b> , Palaiseau (France), Workshop on Financial Modelling with Jump Processes, funded by AMAMEF-ESF
29/8-2/9/2006	<b>Rimini</b> : 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	<b>Politecnico di Torino</b> : 22-esimo convegno IFIP, funded by MIUR project directed by Sergio Vessella
19/11/2004	<b>Perugia</b> , II giornata di studio "Dati ad alta frequenza: modelli e Applicazioni", invited speaker
9-15/5/1999	<b>Cortona</b> : convegno "Evolution equations and applications", invited speaker, partecipazione finanziata dall'organizzazione del convegno

## COMUNICAZIONI A CONVEGNI E CONGRESSI

2019	XX Quantitative Finance Workshop, 23-25 gennaio, <b>ETH, Zurich</b>
2018	Frontiers in High-Frequency Financial Econometrics, 28-29 settembre, Scuola Normale Superiore <b>Pisa</b> , I also was <b>Chairperson</b>
2018	<b>SoFiE</b> conference, Lugano 12-14 June
2017	Accepted paper at <b>SoFiE</b> conference, New York 21-23 June
2017	XVIII Workshop on Quantitative Finance, <b>Milano</b> Bicocca, 25-27/1, I also was <b>Chairperson</b>
2016	9 <sup>th</sup> SoFiE conference 15/17-6-2016, <b>Hong Kong</b>
2016	accepted for presentation at ICASQF conference 6/2016, <b>Colombia</b> , 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, <b>Parigi</b> 30/3-1/4
2016	XVII Workshop on quantitative finance, <b>SNS Pisa</b> , 28-29/1
2015	DynStoch conference, <b>Lund</b> , 27-29/5/2015
2013	XIV Workshop on quantitative finance <b>Rimini</b> , 24-25 of January
2011	Workshop Statistical inference and numerical analysis of stochastic processes: probabilistic tools and application to financial econometrics, 17-18 Marzo, <b>Firenze</b>
2011	<b>Padova</b> 27,28 gennaio, XII Workshop on quantitative finance
2011	convegno Modeling and managing financial risks, <b>Paris</b> 10-13 gennaio
2010	XI Workshop on quantitative finance, <b>Palermo</b> 28-29 Gennaio
2009	Research week in <b>Florence</b> <i>Stochastic processes and financial econometrics</i> , DiMaD, 9-11 settembre
2009	Eurandom, Statistical inference for Lévy processes with applications to finance, <b>Eindhoven</b> , 15/7
2009	Firenze-Ritsumeikan workshop, <b>Firenze</b> , 12-13 marzo
2009	X Workshop in Quantitative Finance, <b>Politecnico di Milano</b> , 29-30 gennaio
2007	conference Multivariate Volatility models, <b>Faro</b> (Portugal), 27-28/10
2007	Workshop on Quantitative Finance, <b>Venezia</b> , 25-26 Gennaio
2005	<b>Palermo</b> , XXIX Convegno AMASES 12-15 Settembre
2005	Econometric Society IX World Congress, <b>Londra</b> , 19/24 Agosto
2005	Summer School Risk management and control, <b>Roma</b> , 9-17 Giugno
2004	XXVIII Convegno AMASES, <b>Modena</b> , 8-12 Settembre
2004	3rd World Congress of the <b>Bachelier Finance Society, Chicago</b> , 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 A FIRENZE

### Minicorsi (organizzazione)

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

### Convegni (organizzazione in capo)

- 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 presso il DiMaD, 9-11 settembre

### Convegni (co-organizzazione)

- 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. Buhlmann
- 2003 **meeting** *Mathematical Finance Seminars*, organizzato da M.Frittelli, al DiMaD, 18/3, in occasione delle visite di M.Schweizer and P.Embrechts

### Seminari (organizzazione)

- 23/4/2018 Simone Scotti, Univeristà 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 Borinetti, 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**  
Gianna Figà-Talamanca, Università di Perugia  
Peter Tankov, Polytechnique di Palaiseau  
Alvaro 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**  
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**  
Christian T. Brownlees, Univ. di Firenze  
Roberto Renò, Univ. di Siena, Volatility forecasting: the jumps do matter

31/5/2007 Alvaro 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

**Seminari (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 Markowitz 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

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

## PRESSO L'UNIVERSITÀ DI FIRENZE

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 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)

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

Co-docente del precorso di Matematica per i corsi di laurea di Ec. e Comm. e di Ec. Az.

2011/2012 Esercitazioni al corso Matematica - Applicazioni Economiche, per 3 CFU, CdL Economia Aziendale

Co-Docente del corso Matematica finanziaria e teoria dei mercati per 3 CFU, CdL Economia e Commercio, curriculum "Analisi economica", terzo anno

2010/2011 Esercitazioni al corso Metodi Matematici per le Applicazioni Economiche (3 CFU), CdL Economia Aziendale (anno di sciopero)

2009/2010 Metodi Matematici 1 (6 CFU), CdL Management Internazionalizzazione e Qualità, affidamento nella sede di Prato

Metodi Matematici 2 e Matematica Finanziaria (3 CFU), CdL Management Internazionalizzazione e Qualità, affidamento nella sede di Prato

Probabilità e Statistica Matematica, tutoraggio (corso da 6CFU), CdL Economia Aziendale a distanza (Nettuno)

2008/09 Metodi Matematici 1 (6 CFU), CdL Management Internazionalizzazione e Qualità, affidamento nella sede di Prato

- Metodi Matematici 2 e Matematica Finanziaria (3 CFU), CdL Management Internazionalizzazione e Qualità, affidamento nella sede di Prato
- Probabilità e Statistica Matematica, tutoraggio (corso da 6CFU), CdL Economia Aziendale a distanza (Nettuno)
- 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
- 2007/08      Calcolo 1, CdL Statistica (3 CFU), esercitazioni
- Metodi Matematici per la Gestione aziendale (6 CFU), CdL Marketing ed Internazionalizzazione, affidamento nella sede di Prato
- 2006/07      Metodi Matematici (6 CFU), CdL Marketing ed Internazionalizzazione, affidamento nella sede di Prato
- Metodi Matematici (Polo Penitenziario Prato), CdL Economia Aziendale
- 2005/06      Metodi Matematici (6 CFU), CdL Marketing ed Internazionalizzazione, affidamento nella sede di Prato
- Metodi matematici, CdL Economia Aziendale, Polo universitario penitenziario di Prato
- Calcolo delle probabilità e statistica, tutoraggio (corso da 6CFU), CdL Economia Aziendale a distanza (Nettuno)
- 2004/05      precorsi di matematica (uno di 4 moduli) per le matricole della Facoltà di Economia di Firenze
- corso ed esercitazioni di METODI MATEMATICI (6 CFU), CdL Marketing del Tessile e Abbigliamento, affidamento nella sede di Prato
- 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
- corso di MATEMATICA GENERALE (CdL Economia Aziendale), Polo Universitario Penitenziario, Prato
- 2003/04      precorsi di matematica (8 ore, uno di 4 moduli) per le matricole della facoltà di Economia di Firenze
- corso ed esercitazioni di METODI MATEMATICI (6 CFU), CdL Marketing del Tessile e Abbigliamento, affidamento nella sede di Prato
- 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
- esercitazioni al corso di MATEMATICA FINANZIARIA (2.5 CFU), CdL Economia Aziendale
- 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 PROBABILITÀ, 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

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  
2005- **Tutor universitario** per lo stage aziendale di: Laura Pieragnoli; Giulio Lorenzini (presso Società Generale, da marzo a settembre 2013); Salassa Angelica (presso Valentino SpA, da ottobre 2018 a gennaio 2018)

## MEMBRO DI COMMISSIONI PER L'ASSEGNAZIONE DEL TITOLO DI DOTTORATO

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 DI RICERCATORI

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**: 2004(resp. Frittelli), 2006(Mancini), 2016(Mancini), 2017(Mancini), 2018(Mancino)

## ALTRE COMMISSIONI

2019 **Gruppo di Riesame**, CdLM Accounting e Libera Professione, Università di Firenze  
2017 commissione di concorso per **assegnazione di contratto di insegnamento** per Matematica per le Applicazioni Economiche, 3 CFU, per l'a.a. 2017-2018, giugno  
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)  
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)  
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)  
2000-2010 **Giunta** dei CdL MTA-MIQ dal 2000-2001 al 2009-2010  
2005 **Giunta** dei DiMaD  
2001- commissione di dipartimento per la **ripartizione dei fondi** ex 60%: 2001, 2004, 2005, 2012, 2018  
2003-2008 commissioni **elettorali** (Presidente di CdL FIRM, 2012; Direttore di Dipartimento, 2008; Preside di Facoltà, 2003, 2006)

## TESI DI LAUREA triennale

2013 **Relatrice** della tesi di laurea triennale in Economia e Commercio di Elvin Biba, *Modeling the effects and propagation of business financial distress on financial markets*, laureato il 17/10/13  
2000, 2002 Ho **seguito le tesi** di laurea, presso la Facoltà di Economia di Firenze, di: F.Fazzi, *tesi Metodologie di calcolo del Value at Risk. Stime del VAR per alcuni prodotti derivati*, laureato il 19 settembre 2002, relatore Prof. M. Galeotti; I. Zei, *tesi Il Capital Asset Pricing Model a tre momenti*, 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** 21/4 e 24/9 1998; 23/6 e 2/7 1999; 11/2, 28/6, 25/9, 30/9, 10/12 2002; 25/9, 18/10, 28/10 2003; 16/2, 1/7, 2/7, 12/7, 20/9 2004  
2013- **commissioni di laurea** (10/10/13 CdLM BAMF; 17/10/2013 CdS Economia e Commercio, laureando Biba; 12/12/13 laurea triennale di Innocenti Francesco; 17/2/14 CdLM BAMF; 15/7/2014 CdLM BAMF; 15/12/2016 CdLM FIRM), 26/2/2018 (EA), 19/4/2018 (EA), 14/12/2018 (LM ALP)