

UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI MILANO

Procedura di selezione per la chiamata a professore di I fascia da ricoprire ai sensi dell'art. 18, comma 1, della Legge n. 240/2010 per il settore concorsuale 01/A3 - Analisi Matematica, Probabilità e Statistica Matematica , (settore scientifico-disciplinare MAT/06 - Probabilità e Statistica Matematica) presso il Dipartimento di Matematica "Federico Enriques", (avviso bando pubblicato sulla G.U. n. 53 del 05/07/2019) - Codice concorso 4104

[Luciano Campi]

CURRICULUM VITAE

INFORMAZIONI PERSONALI (NON INSERIRE INDIRIZZO PRIVATO E TELEFONO FISSO O CELLULARE)

COGNOME	CAMPI
NOME	LUCIANO
DATA DI NASCITA	[06, 05, 1972]

INSERIRE IL PROPRIO CURRICULUM (non eccedente le 30 pagine)

ESPERIENZE PROFESSIONALI

- 09/2013 - oggi : Professore associato, Dipartimento di Statistica, London School of Economics and Political Science.
- 09/2011 - 08/2013 : Professeur, LAGA (Laboratoire Analyse, Géométrie et Applications), Université Paris 13.
- 09/2005 - 08/2011: Maître de Conference (Ricercatore), CEREMADE, Université Paris-Dauphine.
- 02/2004 - 08/2005: Post-Doc nel gruppo di ricerca "Financial and Actuarial Mathematics", Department of Mathematical Methods in Economics, TU Wien, Vienna (Austria).
- 02/2003 - 01/2004: Assegno di ricerca in probabilità e statistica matematica (MAT/06), Università "G. D'Annunzio", Chieti-Pescara.
- 10/2002 - 09/2003: Borsa pre-doc in "Laboratoire de Probabilités et Modèles Aléatoires", Université Paris 6 e 7, sponsorizzato dal progetto EU HCM Dynstoch (IMP, Fifth Framework Programme).

FORMAZIONE

- 04/2017: "Abilitazione scientifica nazionale" per professore I fascia in MAT/06 (Analisi, Probabilità e Statistica Matematica) e SECS-S/06 (Metodi matematici dell'economia e delle scienze attuariali e finanziarie).
- 12/2010: "Habilitation à diriger des recherches" in matematica applicata, Université Paris-Dauphine.
- 12/2003: Dottorato in matematica, Université Paris 6.

- 02/2003: Dottorato in matematica computazionale, Università di Padova.
- 09/1997-09/1999: D.E.A. in probabilità e applicazioni, Università Paris 6 (da 06/1998 a 04/1999, servizio civile agli Archivi di Stato di Pescara).
- 1992-1997: Laurea in Economia Politica, Università “L. Bocconi”, Milano.

VISITING

- 06/2018 (10 gg): Università LUISS, Roma.
- 02/2018 (14 gg): Dipartimento di Matematica, Università di Padova.
- 23/07-04/08/2017: Dipartimento di Matematica, Università di Padova.
- 2-8/11/2015: CIRM, Università di Trento.
- 07/2015 e 09/2015: Dipartimento di Matematica, Università di Padova.
- 06/2014: Dipartimento di Matematica, Università di Padova.
- 10/2004: Dipartimento di Matematica, Università di Carnegie-Mellon, USA.
- 03/2004: Istituto KdV, Università di Amsterdam, Olanda.

ARGOMENTI DI RICERCA

- Calcolo stocastico con applicazioni in economia e finanza,
- controllo ottimo stocastico,
- giochi differenziali stocastici,
- giochi a campo medio.

PUBBLICAZIONI

Articoli pubblicati/accettati per la pubblicazione:

1. “On the support of extremal martingale measures with given marginals: the countable case” (con C. Martini). *Advances in Applied Probability*, in stampa.
2. “Nonzero-sum stochastic differential games with impulse controls: a verification theorem with applications” (con R. Aïd, M. Basei, G. Callegaro e T. Vargiolu). *Mathematics of Operations Research*, in stampa.
3. “ ϵ -Nash equilibrium in stochastic differential games with mean-field interaction and controlled jumps” (con C. Benazzoli e L. Di Persio). *Statistics & Probability Letters*, Vol. 154 (Novembre 2019).
4. “N-player games and mean field games with absorption” (con M. Fischer). *Annals of Applied Probability*, Vol. 28, No. 4 (2018).
5. “A note on the spot-forward no-arbitrage relation in an investment-production model for commodities” (con R. Aïd e D. Lautier). *Handbook of Applied Econometrics: Financial Mathematics, Volatility and Covariance Modelling*, Eds. J. Chevallier, S. Goutte, D. Guerreiro, S. Saglio and B. Sanhaji. Routledge Taylor and Francis. In stampa.

6. "Utility indifference pricing and hedging for structured products in energy markets" (con G. Callegaro, V. Giusto e T. Vargiolu). *Mathematical Methods of Operations Research*, Vol. 85, Issue 2 (2017).
7. "Change of numeraire in the two-marginals martingale transport problem" (con I. Laachir e C. Martini). *Finance and Stochastics*, Vol. 21, Issue 2 (Aprile 2017).
8. "Utility indifference valuation for non-smooth payoffs with an application to power derivatives" (con G. Benedetti). *Applied Mathematics and Optimization*, Vol. 73, Issue 2 (Aprile 2016).
9. "A probabilistic numerical method for optimal multiple switching problem in high dimension" (con R. Aïd, N. Langrené e H. Pham). *SIAM J. on Financial Mathematics*, Vol. 5, No. 1 (2014).
10. "Explicit construction of a dynamic Bessel bridge of dimension 3" (con U. Çetin e A. Danilova). *Electronic Journal of Probability*, Vol. 18 (2013).
11. "On the existence of shadow prices" (con G. Benedetti, J. Kallsen e J. Muhle-Karbe). *Finance and Stochastics*, Vol. 17, No. 4 (Ottobre 2013).
12. "Equilibrium model with default and dynamic insider's information" (con U. Çetin e A. Danilova). *Finance and Stochastics*, Vol. 17, No. 3 (Luglio 2013).
13. "A structural risk-neutral model for pricing and hedging power derivatives" (con R. Aïd e N. Langrené). *Mathematical Finance*, Vol. 23, No. 3 (Luglio 2013).
14. "Efficient portfolios in financial markets with proportional transaction costs" (con E. Jouini e V. Portes). *Mathematics and Financial Economics*, Vol. 7, No. 3 (Giugno 2013).
15. "Multivariate utility maximization with proportional transaction costs and random endowment" (con G. Benedetti). *SIAM J. Control and Optimization*, Vol. 50-3 (2012).
16. "Weak Insider Trading and Behavioral Finance" (con M. Del Vigna). *SIAM J. Financial Mathematics*, Vol. 3 (Marzo 2012).
17. "A note on market completeness with American put options". Pubblicato nel volume: *Inspired by Finance, The Musiela Festschrift*, Eds. Yu. Kabanov, M. Rutkowski, T. Zariphopoulou. Springer (2014).
18. "Dynamic Markov bridges motivated by models of insider trading" (con U. Çetin e A. Danilova). *Stochastic Processes and Their Applications*, Vol. 121, Issue 3 (Marzo 2011).
19. "Multivariate utility maximization under transaction costs" (con M. Owen). *Finance and Stochastics*, Vol. 15, Issue 3 (Settembre 2011).
20. "Structural risk-neutral model of electricity prices" (con R. Aïd, A. Nguyen Huu e N. Touzi). *International Journal of Theoretical and Applied Finance*, Vol. 12, Issue 7 (Novembre 2009).
21. "Super-hedging". *Encyclopedia of Quantitative Finance*, Rama Cont (Ed), Wiley (2010).
22. "Mean-variance hedging for large financial markets". *Stochastic Analysis and Applications*, Vol. 27, Issue 6 (Novembre 2009).
23. "Systematic Equity-Based Credit Risk: A CEV Model with Jump to Default" (con S. Polbennikov e A. Sbuelz). *Journal of Economic Dynamics & Control*, Vol. 33, Issue 1 (Gennaio 2009).
24. "Insider trading in an equilibrium model with default: A passage from reduced form to structural modelling" (con U. Çetin, LSE). *Finance and Stochastics* Vol. 11, No. 4 (Ottobre 2007). Premio per il miglior articolo: Prix Institut Europlace de Finance 2008.
25. "A Super-Replication Theorem in Kabanov's Model of Transaction Costs" (con W. Schachermayer). *Finance and Stochastics* Vol. 10, No. 4 (Dicembre 2006).

26. "Closed-form pricing of Benchmark Equity Default Swaps under the CEV assumption" (con A. Sbuelz). Risk Letters Vol. 1, No. 3 (Settembre 2005).
27. "Some results on quadratic hedging with insider trading". Stochastics and Stochastics Reports Vol. 77, No. 4 (Agosto 2005).
28. "A note on completeness and extremality for financial markets with infinitely many assets". Rendiconti del Seminario Matematico di Padova Vol. 112 (II sem. 2004).
29. "Arbitrage and completeness in financial markets with given N-dimensional distributions", Decisions in Economics and Finance Vol. 27, No. 1, p. 57-80 (Maggio 2004).

Pre-pubblicazioni sottoposte a rivista:

30. "Nonzero-sum stochastic differential games between an impulse controller and a stopper" (con D. De Santis).
31. "N-player games and mean-field games with smooth dependence on past absorptions" (con M. Ghio e G. Livieri).
32. "Optimal market making under partial information with general intensities" (con D. Zabaljauregui).
33. "Mean-field games with controlled jump-diffusion dynamics: existence results and an interbank illiquid market model" (con C. Benazzoli e L. Di Persio).

Altre pubblicazioni:

- Document de synthèse pour l'obtention de l'HDR (Habilitation à diriger les recherches) "Frictions de Marché: coûts de transactions, asymétrie d'information et marchés de l'énergie".
- Tesi di dottorato "Marchés financiers avec une infinité d'actifs, couverture quadratique et délits d'initiés", Université Paris 6, Dicembre 2003.
- Tesi di dottorato "Some Results on Financial Markets with Infinitely Many Assets", Università di Padova, Dicembre 2002.

PROGETTI DI RICERCA E RICONOSCIMENTI

- Partecipazione a: Chaire EDF-CACIB "Finance et développement durable" (2006-2011)
- Partecipazione a: Chaire Groupama "Les particuliers face au risque" (2006-2011).
- Premio dell'Europlace Institute of Finance (EIF) per il miglior articolo in finanza matematica 2009 (vedi la lista delle pubblicazioni).
- Medaglia d'oro dell'Università "L. Bocconi" per i migliori laureati a.a. 1997-1998.

ALTRE ATTIVITÀ SCIENTIFICHE

Supervisione di studenti di dottorato:

- Maddalena Ghio (Scuola Normale Superiore, Pisa), co-supervisione con Giulia Livieri.
- Davide De Santis (LSE), da Settembre 2016.
- Diego Zabaljauregui (LSE), da Settembre 2015.
- Nicolas Langrené (co-supervisione con H. Pham, Université Paris Diderot), titolo: "Méthodes numériques probabilistes en grande dimension pour le contrôle stochastique et problèmes

de valorisation sur les marchés d'électricité", 2014.

- Giuseppe Benedetti (Università Paris Dauphine e CREST), titolo: "Optimal investment and pricing under some market imperfections", 2013.
- Matteo Del Vigna (co-supervisione con M.E. Mancino, Università di Firenze), titolo: "Information Asymmetry and Behavioral Finance", 2012.

Organizzazione di seminari/gruppi di lavoro:

- London Mathematical Finance Seminar Series (2015-2016);
- Seminario Bachelier, Parigi (09/2006 - 06/2013);
- Seminario di probabilità e statistica, Università Paris 13 (01/2012 - 06/2013);
- Gruppo di lavoro "Quantitative methods" del FiME, Laboratorio Dauphine-CREST-EDF su Finanza e Mercati Energetici, (09/2006 - 07/2008).

Organizzazione di workshop/conferenze:

- Due sessioni su "Stochastic Games" al "Second Italian Meeting on Probability and Mathematical Statistics", Salerno, 06/2019;
- Workshop "Mean-field games, energy systems, and other applications", Edimburgo, 04/2019;
- 16th, 15th e 14th Paris December Finance Meeting by EUROFIDAI (membro del comitato scientifico);
- MMF 2017: Conference on Mathematical Modelling in Finance, Londra, 08/2017;
- Risk and Stochastics Conference 2017, LSE, Londra;
- 3rd London-Paris Bachelier Workshop, Parigi, 09/2016;
- 2nd London-Paris Bachelier Workshop, Londra, 09/2015;
- Settimana sui modelli Kyle-Back, 04/2015, Parigi (parte del Semestre su Informazione in Finanza e Assicurazioni);
- 1st London-Paris Bachelier Workshop, Parigi, 09/2014;
- Risk and Stochastics Conference 2014, LSE, Londra;
- Minisymposium "Méthodes stochastiques en gestion des risques", Conferenza annuale della SMAI 2013, Seignosse, Francia.
- Workshop "Paris Dauphine: Markets with frictions", Parigi, 14-17/09/2010.

Editore associato per "IMA Journal of Applied Mathematics" e "Decisions in Economics and Finance".

Referaggio articoli scientifici: Mathematical Finance, Finance and Stochastics, Journal of Theoretical and Applied Finance, Applied Mathematical Finance, Annals of Applied Probability, Stochastic Processes and Its Applications, Journal of Economic Dynamics and Control, Applied Mathematics and Optimization, Journal of Credit Risk, Journal of Banking and Finance, Stochastics and Stochastics Reports, Decisions in Economics and Finance, Journal of Mathematical Economics, Mathematics and Financial Economics, Economic Theory, SIAM Journal on Financial Mathematics, Annals of Finance, SIAM Journal of Optimization and Control, Electronic Journal of Probability, Electronic Communications in Probability, Operations Research Letters, Quantitative Finance, Mathematics of Operations Research.

Attività di reviewer: Mathematical Reviews.

Referaggio libri scientifici: Springer Finance Textbooks.

Referaggio progetti di ricerca: WWTF (Vienna Science and Technology Fund), SFI (Science Foundation Ireland), Università LUISS.

AMMINISTRAZIONE E DIDATTICA

Amministrazione:

- 2018-oggi: Responsabile EDI (Equity, Diversity, Inclusion) per il dipartimento, membro del comitato Athena SWAN, LSE.
- 2016-2018: Direzione del BSc in scienze attuariali, membro del collegio docenti. Contatto del dipartimento con l'Istituto degli Attuari (Gran Bretagna).
- 2015-2016: Selezione studenti per il Master "Risk and Stochastics", organizzazione del "London Mathematical Finance Seminar".
- 2014-2015: Selezione studenti per il Master "Financial Statistics".
- 2012-2013 : Co-direzione del Master AMI "Algorithmique, Modélisation, Images", Università Paris 13.
- 2012-2013 : Co-direzione del comitato scientifico del LabEx ("Laboratoire d'Excellence") MME-DII Modelli Matematici ed Economici per Dinamica, Incertezza e Interazioni. Web: <http://labex-mme-dii.u-cergy.fr/>
- 2006-2011: Co-direzione del Master ISF "Ingénierie Statistique et Financière", Università Paris-Dauphine.

Didattica:

- 2018-2019: Corsi di "Matematica attuariale: non vita" (30h, BSc Actuarial Science) e "Metodi stocastici per la valutazione dei derivati" (30h, Master "Quantitative Methods for Risk Management"). Corso intensivo "Controllo stocastico e giochi a campo medio" (9h), Università di Verona.
- 2017-2018: Corsi di "Matematica attuariale: non vita" (30h, BSc Actuarial Science) e "Teoria avanzata delle probabilità" (30h, Master "Quantitative Methods for Risk Management"). Corso intensivo "Un'introduzione al controllo stocastico e all'ottimizzazione di portafoglio" (9h), Università di Verona.
- 2016-2017: Corsi di "Matematica attuariale: vita" (30h, BSc Actuarial Science), "Teoria avanzata delle probabilità" (30h) e "Metodi stocastici per la valutazione dei derivati" (15h, Master "Risk and Stochastics" e Master "Statistics"), LSE. Corso intensivo di "Arresto ottimo e applicazioni in finanza" (9h), Università di Verona.
- 2015-2016: Corsi di "Matematica attuariale: vita" (30h, BSc Actuarial Science), "Teoria avanzata delle probabilità" (30h, Master "Risk and Stochastics" e Master "Statistics"), helping sessions di "Processi stocastici" (10h, Master Risk and Stochastic e Master Statistics), LSE. Corso intensivo di "Controllo stocastico e ottimizzazione di portafoglio" (9h), Università di Verona.
- 2014-2015: Corsi di "Matematica attuariale: vita" (30h, BSc Actuarial Science) e "Teoria avanzata delle probabilità" (30h, Master "Risk and Stochastics" e Master "Statistics"), LSE. Corso intensivo di "Controllo stocastico e ottimizzazione di portafoglio" (9h), Università di Verona.
- 2013-2014: Corso di "Matematica attuariale: vita" (60h) per il BSc Actuarial Science, LSE. Corso intensivo di "Controllo stocastico e ottimizzazione di portafoglio" (9h), Università di Verona.

- 2012-2013: Corsi di “Probabilità e statistica”, “Controllo stocastico e ottimizzazione di portafoglio”, “Calcolo stocastico”, “Modelli di rischio” e “Statistica matematica”, Università Paris 13.
- 2011-2012: Corsi di “Modelli di rischio”, “Modelli di tassi d’interesse e volatilità”, “Calcolo stocastico” and “Statistica”, Università Paris 13.
- 2010-2011: Corso “Asset Pricing I” (in inglese), “Processi stocastici e EDP” e “Modelli di tasso d’interesse e rischio di credito”, Università Paris-Dauphine. Corso di “Misure di rischio” (in inglese), Università del Lussemburgo.
- 2009-2010: Corsi di “Processi stocastici e EDP” e di “Modelli di tasso d’interesse e rischio di credito”, Università Paris-Dauphine.
- 2007-2008 e 2008-2009: Corso “Modelli di tassi d’interesse e rischio di credito” e “Processi con salti e rischio di credito”, Università Paris-Dauphine. Esercitazioni di “Asset pricing”, Master QEF Ecole Polytechnique e HEC (lezioni in inglese).
- 2006-2007: Esercitazioni di “Matematica attuariale I” e di “Valutazione di prodotti derivati”, corso “Processi con salto e rischio di credito”, Università Paris-Dauphine. Esercitazioni di “Asset pricing” per il Master QEF, Ecole Polytechnique e HEC (lezioni in inglese).
- 2005-2006: Esercitazioni di “Analisi I”, “Matematica attuariale I”, “Processi stocastici a tempo continuo”, corso “Valutazione di prodotti derivati”, Università Paris-Dauphine.
- 12/2004: Corso intensivo “Calcolo stocastico con applicazioni finanziarie”, dottorato di Scienze, Università “G. D’Annunzio”, Chieti-Pescara.
- 2003-2004: Pre-corso di Analisi (con M. Parton), esercitazioni di Matematica Finanziaria, Università “G. D’Annunzio”, Chieti-Pescara.

CONFERENZE, WORKSHOPS & SCUOLE

Presentazioni su invito:

- 07/2019: Summer school e workshop su “Equilibria in Financial Markets: the General Equilibrium and the Game Theoretic Perspectives”, Bielefeld, Germania.
- 05/2019: Workshop “New Frontiers in Stochastics for Economics and Finance”, Siena.
- 04/2019: 2nd Leeds Meeting on Stochastic Control and Games under Ambiguity, Leeds (Gran Bretagna).
- 04/2019: Workshop “Mean-field games, energy systems, and other applications”, Edinburgh.
- 09/2018: Conference in honour of Yuri Kabanov, Luminy, Francia.
- 07/2018: 14th Viennese Conference on Optimal Control and Dynamic Games, Vienna.
- 05/2018: Byrne Workshop on Stochastic Analysis in Finance and Insurance, University of Michigan.
- 06/2017: First Italian Meeting on Probability and Mathematical Statistics, Torino.
- 06/2017: Workshop “Convex stochastic optimization”, King’s College, Londra.
- 03/2017: Workshop “Mean-field games”, Nizza, Francia.
- 06/2016: Conference “Risks, uncertainty and models for Economy and Finance”, University of Maine, Le Mans, Francia.

- 05/2016: Workshop “Stochastic Analysis and Mathematical Finance - A Fruitful Partnership”, CMO, Oaxaca, Messico.
- 02/2016: Frontiers in Stochastic Modelling for Finance, Padova.
- 09/2015: 7th General AMAmEF and Swissquote Conference, Losanna.
- 02/2015: Paris - SEA Conference in Mathematical Finance, Siem Reap, Cambogia.
- 09/2014: Advances in stochastic analysis for risk modeling, CIRM, Luminy, Francia.
- 05/2014: Mathematical Finance: Arbitrage and Portfolio Optimization, Banff Center, Canada.
- 08/2013: Workshop on Electricity, Energy and Commodities Risk Management, Fields Institute, Toronto.
- 06/2013: Workshop on “stochastic portfolio, arbitrage theory, role of information and credit risk”, Beijing international center for mathematical research, Universit`a di Pechino, Cina.
- 01/2013: Conference “Non-stationarity in Statistics and Risk Management”, CIRM, Luminy, Francia.
- 01/2013: 7th Bachelier Colloquium on Mathematical Finance and Stochastic Calculus, Metabief, Francia.
- 08/2012: Joint Conference SMF-VMS, Hue University, Hue (Vietnam).
- 08/2012: Lezioni su “Pricing and hedging in energy markets” alla “Vietnamese-French Summer School on Mathematical Methods in Finance and Economics”, University of Economics and Law and John Von Neumann Institute, Ho Chi Minh City, Vietnam.
- 07/2012: SIAM Conference on Financial Mathematics and Engineering, Minneapolis (USA).
- 10/2011: International Conference on Stochastic Analysis and Applications, Hammamet (Tunisia).
- 08/2011: 58th World Statistics Congress of the International Statistical Institute (ISI), Dublino, Irlanda.
- 04/2011: JAROS Workshop and Young Researchers Workshop on Finance 2011, Tokyo Metropoli- tan University, Giappone.
- 01/2011: Workshop “Stochastic Analysis in Finance and Insurance”, Oberwolfach, Germany.
- 09/2010: Workshop on Advanced Mathematical Methods for Finance, Berlino.
- 07/2010: Analysis, Stochastics, and Applications - A Conference in Honour of Walter Schachermayer, Università di Vienna (Austria).
- 01/2010: Workshop on Foundations of Mathematical Finance, Fields Institute, Toronto (Canada).
- 06/2009: Conference in honour of Marc Yor, H. Poincaré Institut, Parigi.
- 05/2009: Istanbul Workshop on Mathematical Finance.
- 10/2008: Journées MAS de la SMAI, Rennes (Francia).
- 07/2008: Summer School in Perceiving, measuring and managing risk: Illiquidity, long-term risk, natural resources, University of British Columbia (Vancouver).
- 06/2008: 14th International Conference on Computing in Economics and Finance, Università della Sorbona (Parigi).
- 06/2008: International Workshop: CREDIT RISK, Evry (Francia).

- 05/2008: Workshop “New Directions in Quantitative Finance”, Parigi.
- 10/2007: 14th Workshop in Mathematics and Economics: Insider and Asymmetric Information in Financial Trading. Università di Oslo.
- 01/2007: Workshop on “Information in Pricing Models”, Università di Tolosa “P. Sabatier”.
- 04/2005: Second Purdue Minisymposium on Financial Mathematics, Purdue University (USA).

Altre presentazioni:

- 06/2019: Second Italian Meeting on Probability and Mathematical Statistics, Vietri sul Mare, Salerno, Italy.
- 06/2011: The 4th Western Conference on Mathematical Finance, USC, Los Angeles.
- 07/2009: The 33rd Conference on Stochastic Processes and Their Applications, Berlino (Germania).
- 09/2007: Mid-Term Conference on Advanced Mathematical Methods for Finance, TU Wien, Vienna (Austria).
- 09/2005: PRIN Workshop on “Stochastic Methods in Mathematical Finance”, Università di Roma “La Sapienza”.
- 07/2004: Third World Congress of the Bachelier Finance Society, Chicago.
- 04/2004: Finance Job Market, Università Paris-Dauphine.
- 01/2004: V Workshop of Quantitative Finance, Siena.
- 01/2004: Berlin Workshop on Mathematical finance for Young Researchers, Università Humboldt, Berlino.
- 09/2003: Conferenza finale del progetto nazionale “Stochastic Processes and Applications to Filtering, Simulation and Mathematical Finance”, Università di Bologna.
- 05/2003: Workshop on Statistical Inference for Stochastic Processes DYNSTOCH, Helsinki (Finlandia).
- 01/2003: IV Workshop of Quantitative Finance, Torino.
- 09/2002: Probability Workshop on Random Processes and Fields and Financial Applications, Università di Bologna.
- 05/2002: Workshop on Statistical Inference for Stochastic Processes DYNSTOCH, La Manga, Cartagena (Spagna).
- 01/2002: III Workshop of Quantitative Finance, Verona. Poster.

SEMINARI

- 03/2003: LPMA, Università Paris 6 e 7.
- 04/2003: Dipartimento di Scienze, Università “G. D’Annunzio”, Chieti-Pescara.
- 06/2003: Dipartimento di Statistica and Matematica Applicata alle Scienze Umane “D. De Castro”, Università di Torino.
- 10/2003: Dipartimento di Matematica, Università di Pavia.
- 02/2004: Laboratoire de Mathématiques Appliquées, Università Aix-Marseille (Francia).
- 03/2004: KdV Institut, Università di Amsterdam (Olanda).

- 04/2004: Financial and Actuarial Mathematics Department, TU Wien, Vienna.
- 11/2004: Dipartimento of Matematica, Università Paris 13.
- 02/2005: Seminario Bachelier, Istituto H. Poincaré, Parigi.
- 04/2005: Newton Institute, Cambridge (Gran Bretagna).
- 10/2005: LPMA, Università Paris 6 e 7.
- 12/2005: Dipartimento di Matematica, Università di Evry, Francia.
- 02/2006: Risk and Stochastics Seminar, LSE, Londra.
- 10/2006: Dipartimento di Matematica Attuariale e Statistica, Università Heriot-Watt, Edimburgo (Gran Bretagna).
- 10/2006: Seminario Bachelier, Istituto H. Poincaré, Parigi.
- 05/2007: IMQ, Università Bocconi, Milano.
- 10/2007: Finance and Stochastics Seminar, Università di Boston (USA).
- 11/2007: Mathematical Finance Seminar, Università di Oxford.
- 11/2007: Oberseminar Finanz- und Versicherungsmathematik, LMU & TU Munich, Monaco di Baviera.
- 02/2008: Finance and Stochastics Seminar, Imperial College, Londra.
- 06/2008: Séminaire de probabilités et statistiques, Università Paris 13.
- 06/2008: Séminaire Analyse-Probabilités, CEREMADE, Università Paris-Dauphine.
- 10/2008: Probability and Mathematical Finance Seminar, Carnegie-Mellon University (USA).
- 10/2008: Finance and Stochastics Seminar, Università di Boston.
- 12/2008: Talks in Financial and Insurance Mathematics, ETH Zurich.
- 12/2009: Colloquium on Economic Theory, Università di Bielefeld, Germania.
- 02/2010: Dipartimento di Economia, Università di Pisa, Italy.
- 02/2010: Finance and Stochastics Seminar, Imperial College, Londra.
- 03/2010: Mathematical Finance Seminar, Università di Austin, Texas.
- 10/2010: Séminaire de probabilités et statistiques, Università Paris 13.
- 01/2011: Seminar Finanzmathematik, Università di Vienna, Austria.
- 02/2011: Séminaire de probabilités, statistiques et contrôle, ENSTA, Parigi.
- 05/2011: Séminaire de probabilités, LPMA Paris 6 & 7, Parigi.
- 07/2011: Stochastics Seminar, Christian-Albrechts-Universität zu Kiel, Germania.
- 10/2011: Mathematical Finance Nomura Seminar, Università di Oxford.
- 12/2011: Seminar Finanzmathematik, Università di Vienna, Austria.
- 02/2012: Università Paris-Est, Marne-la- Vallée, Francia.
- 04/2012: Risk and Stochastics Seminar, LSE, Londra.
- 05/2012: Probability Seminar, Toulouse Mathematical Institute, Tolosa.

- 09/2012: Seminar Finanzmathematik, Università di Vienna, Austria.
- 04/2013: Decision Mathematics Seminar, Toulouse School of Economics, Tolosa.
- 11/2013: Mathematical Finance Seminar, Università di Warwick (Gran Bretagna).
- 12/2013: Mathematical Finance Seminar, Imperial College, Londra.
- 03/2014: Mathematics Department, Università di Evry, Francia.
- 07/2014: Dipartimento di Informatica, Università di Verona.
- 08/2015: Dipartimento di Matematica, Università dell'Aquila.
- 10/2015: Statistics Laboratory, Università di Cambridge.
- 11/2015: Dipartimento di Matematica, Università di Trento.
- 12/2015: Università Paris-Est, Marne-la-Vallée, Francia.
- 12/2015: Università Paris Diderot - Paris 7.
- 01/2016: London Mathematical Finance Seminar, Londra.
- 04/2016: Università LUISS, Roma.
- 06/2016: Università di Bielefeld, Germania.
- 11/2016: Seminario FiME, Parigi.
- 11/2016: Probability Seminar, Università di Bath, Gran Bretagna.
- 12/2016: London Probability Seminar, King's College, Londra.
- 01/2017: North British Probability Seminar, Edimburgo.
- 05/2017: Stochastic Finance @ Warwick Seminar, Università di Warwick.
- 09/2017: Dipartimento di Matematica, Università di Bologna.
- 12/2017: Dipartimento di Matematica, Università dell'Aquila.
- 01/2018: Dipartimento di Matematica, Università di Pavia.
- 02/2018: Finance and Stochastics Seminar, Imperial College, Londra.
- 02/2018: Scuola Normale di Pisa.
- 03/2018: Toulouse School of Economics, Tolosa, Francia.
- 06/2018: Università LUISS, Roma.
- 10/2018: Columbia University, New York, USA.
- 04/2019: Dipartimento di Scienze Economiche, Università di Verona.
- 05/2019: TU and Università Humboldt, Berlino.

LINGUE Italiano (madrelingua), Inglese (fluente), Francese (fluente).

Data

22/07/2019

Luogo

Londra (Gran Bretagna)