

CURRICULUM VITAE



*Dichiarazione sostitutiva di certificazione e
dichiarazione sostitutiva dell'atto di notorietà ai sensi del
D.P.R. 445/28.12.2000*

**(allegare copia non autenticata di documento di identità del
sottoscrittore in corso di validità)**

Il/La sottoscritto/a Francesco Campigli

consapevole delle responsabilità penali cui può andare incontro, in caso di dichiarazioni mendaci, ai sensi e per gli effetti di cui all'art. 76 del D.P.R. 445/2000 e consapevole che, ai sensi dell'art. 13, del Regolamento UE 2016/679 (GDPR), la presente dichiarazione sarà pubblicata sul sito web dell'amministrazione in apposita sezione di Amministrazione Trasparente, sotto la propria responsabilità

**dichiara
ai sensi degli artt. 46 e 47 del DPR 445/2000**

INFORMAZIONI PERSONALI

Nome

Campigli, Francesco

è attualmente uno studente di dottorato del corso "Computational Methods and Mathematical Models for Sciences and Finance" presso la Scuola Normale Superiore (Pisa, Italia). Precedentemente, si è laureato in Finance and Risk Management presso l'Università degli Studi di Firenze. Durante il suo corso master, ha partecipato ad uno scambio all'estero presso Universitat de Castelló Juame I (Spagna). Si interessa di temi inerenti la finanza quantitativa, econometria finanziaria ad alta frequenza e microstruttura di mercato. Recentemente, ha esplorato modelli per il price impact con parametri time-varying al fine di applicarli all'esecuzione ottimale e l'analisi dei costi di transazione.

Indirizzo

Telefono

Fax

E-mail

Da Ottobre 2019 ad Oggi

Nazionalità

Dottorato di Ricerca in Metodi Computazionali e Modelli Matematici per le Scienze e la Finanza presso la Scuola Normale Superiore di Pisa (Italia). Titolo della tesi: The time-varying nature of the market impact: modeling, estimation, and applications.

Data di nascita

Supervisor: Prof. Fabrizio Lillo e Giacomo Bormetti.

ESPERIENZA LAVORATIVA

- Date (da – a)
- Posizione e attività

Da Marzo 2023 a Luglio 2023

Attività didattica integrativa di 16 ore del Corso "Computational Economics" coordinato dal Prof. Giorgio Ricchiuti per il CdS B203 - FINANCE AND RISK MANAGEMENT - FINANZA E GESTIONE DEL RISCHIO, a.a.2022/2023 2° Semestre, Scuola di Economia e Management (SECS-P02) presso Università degli Studi di Firenze, diretta dalla Prof. Maria Elvira Mancino.

- Date (da – a)
- Posizione e attività

- Date (da – a)
 - Posizione e attività
- Tenuto seminario di 2 ore all'interno dell'attività didattica integrativa del Corso "Computational Economics" coordinato dal Prof. Giorgio Ricchiuti per il CdS B203 - FINANCE AND RISK MANAGEMENT - FINANZA E GESTIONE DEL RISCHIO, a.a.2022/2023 dal titolo: "Networks: an introduction" presso Università degli Studi di Firenze.

- Date (da – a)
 - Posizione e attività
- Ottobre 2018 – Settembre 2019
Attività di tutoraggio didattico di 150 ore del corso "Matematica Finanziaria" (SECS_S/06) per il corso di laurea di Economia Aziendale (L-18) presso Università degli Studi di Firenze.

ISTRUZIONE E FORMAZIONE

- Date (da – a)
 - Nome e tipo di istituto di istruzione o formazione
- Ottobre 2016 a Aprile 2019
Laurea Magistrale in Finance and Risk Management (LM-16) presso Università degli Studi di Firenze (Italia). Titolo della tesi: A generalized hybrid Heston model for stochastic interest rates. Supervisor: Prof. Maria Elvira Mancino e Prof. Gabriele Tedeschi. Voto finale: 110/110 cum laude.
- Date (da – a)
 - Nome e tipo di istituto di istruzione o formazione
- Ottobre 2013 a Ottobre 2016
Laurea Triennale in Economia Aziendale (L-18) presso Università degli Studi di Firenze (Italia). Titolo della tesi: Le variazioni dell'inflazione a seguito del quantitative easing: il caso Europa. Supervisor: Prof. Laura Grassini. Voto finale: 103/110.

MADRELINGUA **ITALIANO**

ALTRE LINGUA

- Capacità di lettura
 - Capacità di scrittura
 - Capacità di espressione orale
- INGLESE**
Eccellente
Eccellente
Eccellente

CAPACITÀ E COMPETENZE

Ho seguito i seguenti corsi presso la Scuola Normale Superiore e l'Università degli Studi di Firenze: High-Frequency Financial Econometrics, Mathematical Models for Quantitative Finance, Stochastic PDEs and applications, Computational Finance, Econometrics of Financial Markets, Quantitative Finance, Scientific programming – Python and Fortran 95, Introduction to Machine Learning, Numerical Analysis and Optimization, Statistical and Machine Learning Models for Time Series Analysis, Quantitative Risk Management, Probability and Mathematical Statistics, Micro and Macroeconometrics.

CAPACITÀ E COMPETENZE TECNICHE

Conoscenze dei seguenti linguaggi di programmazione Matlab, R-Studio, Python, Fortran 95, Julia, C/C++, Eviews, Gretl, Microsoft Office, Bloomberg.

ESPERIENZE DI RICERCA E STUDIO A LIVELLO INTERNAZIONALE

Partecipazione ad uno scambio universitario presso l'Universitat Jaume I (Castellon del La Plana, Spain), al fine di redigere la tesi magistrale dal 01/2019 al 04/2019.

PARTECIPAZIONE ALLE ATTIVITÀ
DI GRUPPO DI RICERCA
CARATTERIZZATO DA
COLLABORAZIONI A LIVELLO
NAZIONALE O INTERNAZIONALE

Inserimento del progetto di ricerca che svolgo presso la Scuola Normale Superiore all'interno del progetto vincitore del PRIN 2020 "Dynamic models for a fast changing world: An observation-driven approach to time-varying parameters".

ELENCO DELLE PUBBLICAZIONI E
DEI WORKING PAPER

1. Campigli, F., Bormetti, G., & Lillo, F. (2022). Measuring price impact and information content of trades in a time-varying setting. arXiv preprint arXiv:2212.12687.

2. Campigli, F., Tedeschi, G., & Recchioni, M. C. (2021). The talkative variables of the hybrid Heston model: Yields' maturity and economic (in) stability (No. 2021/03).

PRESENTAZIONE,
PARTECIPAZIONE E
ORGANIZZAZIONE A CONVEGNI DI
CARATTERE SCIENTIFICO IN ITALIA
O ALL'ESTERO

Invited speaker alla Society of Financial Econometrics (Sung Kyun Kwan University, Seoul, South Korea). Presentazione del lavoro: Measuring price impact and information content of trades in a time-varying setting. Dal 15/06/2023 al 19/06/2023.

Invited speaker alla Conference of Financial Econometrics (King's College, London, UK). Presentazione del lavoro: Measuring price impact and information content of trades in a time-varying setting. Dal 17/12/2022 al 19/12/2022.

Invited speaker al Workshop in Quantitative Finance (Università di Cassino, Gaeta, Italia). Presentazione del lavoro: Measuring price impact and information content of trades in a time-varying setting. Dal 20/04/2022 al 22/04/2022.

Invited speaker al Machine learning of dynamic processes and time series analysis Prima Edizione (Scuola Normale Superiore, Italia). Presentazione del lavoro: Measuring price impact and information content of trades in a time-varying setting. In data 26/10/2020.

Organizzazione e partecipazione al Florence-Paris workshop on Statistics of Random Processes and Its Applications to Financial Econometrics (Università degli studi di Firenze, Italia). Dal 10/07/2023 al 11/07/2023.

Partecipazione al Workshop in Quantitative Finance (AMASES, Palermo, Italia). Dal 22/09/2022 al 24/09/2022.

Partecipazione all'Italian Congress of Econometrics and Empirical Economics (Società Italiana di Econometria, Online). Dal 21/01/2021 al 23/01/2021.

Partecipazione al Programming and Machine Learning in Python (GARR, Online). Dal 5/05/2020 al 19/05/2020.

Partecipazione al First santander financial engineering school (Santander, Online). Scholarship winner. Dal/03/2021 02 al 18/03/2021.

PATENTI

Patente A2 e Patente B

Data e Luogo

Firma

20/12/2023, Firenze

