

Fausto Galli

CONTATTI

E-mail: fgalli@unisa.it

Pagina personale: faustogalli.altervista.org

Ufficio: Dipartimento di Scienze Economiche e Statistiche (DISES), via Ponte don Melillo - 84084 - Fisciano (SA)

Abitazione: Via Maietto 12, 22070 Capiago Intimiano (Co), Italia. +39 031460464

DATI PERSONALI

Nato a Cantù (Co), Italia, 21 Aprile 1969.

Nazionalità italiana.

POSIZIONE ATTUALE

Ricercatore, Università degli Studi di Salerno, Italia.

INTERESSI DI RICERCA

Econometria finanziaria e delle serie storiche, statistica applicata, metodi numerici.

STUDI COMPIUTI

Settembre 2009. **Ph.D. in Economics.** CORE, Université Catholique de Louvain, Belgio. Relatore Luc Bauwens. Predifesa completata, difesa prevista per il 22 settembre 2009.

Giugno 2003. **Dottorato in Economia.** Università degli Studi di Bologna, Bologna. Relatore Sergio Pastorello.

Luglio 1999. **Master in Economics (MEc).** Università Commerciale Luigi Bocconi, Milano.

December 1996. **Laurea** in Discipline Economiche e Sociali (DES). Università Commerciale Luigi Bocconi, Milano. Tesi in Ricerca operativa. Voto finale: 105/110.

ESPERIENZA PROFESSIONALE

Marzo 2011 - . **Ricercatore**, Università degli Studi di Salerno, Italia.

Dicembre 2010 - Febbraio 2011. **Ricercatore post-doc**, Fond National de la Recherche (FNR), Università del Lussemburgo, docente del corso di microstruttura dei mercati finanziari.

Settembre 2009 - Novembre 2010. **Professore invitato**, docente del corso di econometria. Università degli studi di Sassari, Italia.

Settembre 2007 - Giugno 2009. **Professore invitato**, docente dei corsi di statistica e di previsione. Alberta School of Business, Edmonton, Canada.

Aprile 2007 - Giugno 2009. **Docente** del corso di Econometria delle Serie Storiche nel quadro del dottorato di ricerca in finanza. Università della Svizzera Italiana, Lugano, Svizzera.

Settembre 2002 - Maggio 2007 . **Assistente** in vari corsi undergraduate e graduate in Matematica, Statistica ed Econometria, per l'Université Catholique de Louvain, Louvain-la-Neuve e l'Università della Svizzera Italiana, Lugano, Svizzera.

Agosto 1997- Dicembre 2000. **Traduttore** freelance di testi economici. Collaborazioni con SSI gruppo Ambrosetti e Rudiger Dornbusch.

Marzo 1997- Febbraio 2000. **Economista** junior, CFS Economics, Milano.

Febbraio 1992- Marzo 1994. **Assistente di ricerca**. CeSPEL (Università Bocconi), Milano.

ARTICOLI

The moments of Log-ACD models: (con L. Bauwens e P. Giot). *Quantitative and Qualitative Analysis in Social Sciences*, 2, 1, 2008, pp. 1-28.

A nonparametric ACD model (con A. Cosma). CORE DP 2006/67.

Efficient importance sampling for ML estimation of SCD models (con L. Bauwens). *Computational Statistics & Data Analysis*, 53, 6, 2009, pp. 1974-1992.

How vulnerable is India to climatic stress? Measuring vulnerability to drought using the Security Diagram concept (con L. Acosta et al). *Die Erde* 137, 3, 2006.

Crisis Probability Curves (CPCs): A measure of vulnerability thresholds across space and over time (with L. Acosta). Mimeo.

INTERVENTI A SEMINARI E CONFERENZE

Marzo 2010. Seminario presso il DEIR, Università degli Studi di Sassari, Italia.

Gennaio 2010. XI Workshop on Quantitative Finance. Palermo, Italia.

Giugno, 2007. NCCR FINRISK Research Day 2007. Gerzensee, Svizzera.

Aprile, 2007. International Workshop on Computational and Financial Econometrics. Ginevra, Svizzera.

Giugno, 2006. NCCR FINRISK Research Day 2006. Gerzensee, Svizzera.

Febbraio, 2006. Risk Management: from Basel II to Basel III. Ascona, Svizzera.

Ottobre, 2005. University of Lugano Finance Seminar. Lugano, Svizzera.

Settembre, 2005. International Conferente on Finance. Copenhagen, Danimarca.

Marzo, 2005. CORE econometrics seminar. Louvain-la-Neuve, Belgio.

Giugno, 2004. RTN Summer School, Economics and Econometrics of Market Microstructure. Konstanz, Germania.

Febbraio, 2004. Young Financial Researchers Day. Leuven, Belgio.

Gennaio, 2002. Giornata CIDE. Bologna, Italia.

Novembre, 2001. CORE econometrics seminar. Louvain-la-Neuve, Belgio.

ATTIVITA' EDITORIALI

Referee per *Journal of Applied Econometrics*.

Referee per *Computational Statistics & Data Analysis*.

Referee per *Quantitative Finance*.

Referee per *Oxford Bulletin of Economics and Statistics*.

LINGUE

Inglese, Francese: ottimo. **Italiano:** madre lingua.

SOFTWARE

Gauss, Ox, C, R, TSP, EViews, \LaTeX .