



Curriculum Vitae Europass

Informazioni personali

Cognome/Nome **De Sanctis Nunzio**

Indirizzo

Telefono(i)

E-mail

Cittadinanza

Data di nascita

Sesso

Occupazione desiderata/Settore professionale

Economista quantitativo

Esperienza professionale

Date	20/5/2012 – Oggi
Lavoro o posizione ricoperti	Trader quantitativo indipendente
Principali attività e responsabilità	Sviluppo di sistemi automatici di trading
Nome e indirizzo del datore di lavoro	Tradingquant.it
Tipo di attività o settore	Servizi finanziari
Date	1/2/2017 – Oggi
Lavoro o posizione ricoperti	Trader quantitativo indipendente
Principali attività e responsabilità	Servizi di consulenza aziendale
Nome e indirizzo del datore di lavoro	Integrated Services For Sme – I.S.SME
Tipo di attività o settore	Servizi alle imprese
Date	03/11/2014 – 19/12/2016
Lavoro o posizione ricoperti	Consulente esterno
Principali attività e responsabilità	Analisi econometrico-statistiche
Nome e indirizzo del datore di lavoro	John Street Capita
Tipo di attività o settore	Servizi finanziari
Date	03/11/2014 – 19/12/2016
Lavoro o posizione ricoperti	Consulente esterno
Principali attività e responsabilità	Analista economico mercati delle Commodities
Nome e indirizzo del datore di lavoro	TeleTrade
Tipo di attività o settore	Ricerca Applicata
Date	12/09/2013 – 23/01/2015
Lavoro o posizione ricoperti	Consulente esterno
Principali attività e responsabilità	Analista finanziario mercati valutari
Nome e indirizzo del datore di lavoro	Alphari UK
Tipo di attività o settore	Servizi finanziari

Date	15/10/2010 – 30/11/2011
Lavoro o posizione ricoperti	Collaboratore didattico
Principali attività e responsabilità	Assistente in Docenza alla Cattedra di Macroeconomia
Nome e indirizzo del datore di lavoro	Università Luiss Guido Carli – Facoltà di Scienze Politiche
Tipo di attività o settore	Insegnamento e ricerca
Date	01/10/2009 – 30/09/2011
Lavoro o posizione ricoperti	Collaboratore didattico
Principali attività e responsabilità	Assistente in Docenza alla Cattedra di Microeconomia Avanzata – Economia dell'incertezza e dell'informazione
Nome e indirizzo del datore di lavoro	Università di Roma Tor Vergata – Facoltà di Economia
Tipo di attività o settore	Insegnamento e ricerca
Date	01/12/2009 – 01/03/2011
Lavoro o posizione ricoperti	Consulente economico
Principali attività e responsabilità	Coordinamento ricerca su "Strumenti finanziari per lo sviluppo cooperativo"
Nome e indirizzo del datore di lavoro	Fondazione "Ivano Barberini" – LegaCoop Bologna
Tipo di attività o settore	Ricerca applicata
Date	01/08/2006 – 31/05/2007
Lavoro o posizione ricoperti	Funzionario
Principali attività e responsabilità	Economista: microsimulazioni, modelli macroeconomici, gestione database
Nome e indirizzo del datore di lavoro	Centro Studi Confindustria - Roma
Tipo di attività o settore	Ricerca applicata
Date	01/02/2006 – 30/06/2006
Lavoro o posizione ricoperti	Borsista
Principali attività e responsabilità	Collaborazione con il Prof. Marcello Messori alla realizzazione di una indagine sulla <i>Governance</i> delle Banche Popolari Italiane
Nome e indirizzo del datore di lavoro	Assonime – Associazione fra le società per azioni
Tipo di attività o settore	Ricerca applicata
Date	19/01/2006 – 31/07/2006
Lavoro o posizione ricoperti	Professore a Contratto
Principali attività e responsabilità	Assistente in Docenza alla Cattedra di Economia Politica
Nome e indirizzo del datore di lavoro	Università di Napoli Federico II – Facoltà di Giurisprudenza
Tipo di attività o settore	Insegnamento e ricerca
Istruzione e formazione	
Date	2002 – 2005
Titolo della qualifica rilasciata	Dottorato di Ricerca in Scienze Economiche
Principali tematiche/competenza professionali possedute	Macroeconomia Finanziaria, Microeconomia Bancaria, Economia Computazionale, Modelli dinamici stocastici calibrati e simulazioni con MATLAB
Nome e tipo d'organizzazione erogatrice dell'istruzione e formazione	Università di Napoli Federico II – Dipartimento di Teoria e Storia dell'Economia Pubblica
Livello nella classificazione nazionale o internazionale	Dottorato di Ricerca (PhD)
Date	2003
Titolo della qualifica rilasciata	Scuola Estiva di Ottimizzazione Matematica
Principali tematiche/competenza professionali possedute	Ottimizzazione non lineare, Ottimizzazione vettoriale
Nome e tipo d'organizzazione erogatrice dell'istruzione e formazione	Università di Varese Insubria – Facoltà di Economia

Livello nella classificazione nazionale o internazionale	ISCED 6
Date	2002 - 2003
Titolo della qualifica rilasciata	Master in Economia e Istituzioni (MEI)
Principali tematiche/competenza professionali possedute	Macroeconomia, Microeconomia, Econometria, Economia Monetaria, Economia Internazionale, Economia Applicata
Nome e tipo d'organizzazione erogatrice dell'istruzione e formazione	Università di Roma Tor Vergata – Facoltà di Economia CEIS
Livello nella classificazione nazionale o internazionale	Master Universitario di II Livello
Date	2002
Titolo della qualifica rilasciata	Corso Residenziale di Econometria CIdE – Bertinoro
Principali tematiche/competenza professionali possedute	Econometria Applicata, Modelli dinamici (Econometria delle Serie Storiche), Modelli Multiequazionali
Nome e tipo d'organizzazione erogatrice dell'istruzione e formazione	Centro Interuniversitario di Econometria
Livello nella classificazione nazionale o internazionale	ISCED 6
Date	1995 – 2001
Titolo della qualifica rilasciata	Laurea con Lode in Scienze Politiche – Indirizzo Politico Economico
Principali tematiche/competenza professionali possedute	Discipline economiche, statistiche, storiche, sociologiche e giuridiche come da Piano di Studio caratterizzante il Corso di Laurea
Nome e tipo d'organizzazione erogatrice dell'istruzione e formazione	Università degli Studi di Napoli Federico II – Facoltà di Scienze Politiche
Livello nella classificazione nazionale o internazionale	Laurea Specialistica
Date	1989 - 1994
Titolo della qualifica rilasciata	Diploma di Ragioniere e Perito Commerciale
Principali tematiche/competenza professionali possedute	Discipline contabili, tecniche e giuridiche come da Piano di Studio caratterizzante il Diploma statale
Nome e tipo d'organizzazione erogatrice dell'istruzione e formazione	Istituto Tecnico Commerciale Statale VII* - Napoli
Livello nella classificazione nazionale o internazionale	Diploma di Scuola Secondaria Superiore

Capacità e competenze personali

Madrelingua(e) **Italiano**

Altra(e) lingua(e)

Autovalutazione

Livello europeo (*)

Inglese

Francese

Comprensione				Parlato				Scritto	
Ascolto		Lettura		Interazione orale		Produzione orale			
B2	Livello intermedio	C1	Livello avanzato	B1	Livello intermedio	B1	Livello intermedio	B2	Livello intermedio
A2	Livello elementare	A2	Livello elementare	A1	Livello elementare	A1	Livello elementare	A2	Livello elementare

(*) Quadro comune europeo di riferimento per le lingue

Capacità e competenze sociali

Buona capacità di lavorare in gruppo e di adeguamento ad ambienti multiculturali maturata nel contesto accademico e di partecipazione alle attività del Dipartimento di appartenenza. Ottima capacità di comunicazione, specie di insegnamento, maturata nell'attività di assistenza alla docenza in ambito accademico.

Capacità e competenze organizzative

Buone capacità organizzative e attitudine alla gestione di progetti e di gruppi maturata in ambito accademico, nella vita associativa e in genere nella sfera privata. Ottime capacità di *problem solving*.

Capacità e competenze tecniche	Costruzione e impiego attraverso l'ausilio dell'elaboratore elettronico di modelli matematici simulativi per l'economia. Questa capacità è maturata in ambito accademico e professionale nonché ad un'innata passione per la modellistica e la simulazione coltivata anche nel tempo libero.
Capacità e competenze informatiche	<p>Ottima conoscenza del Personal Computer in ambiente Windows. Discreta conoscenza del PC in ambiente Macintosh e Linux. Buone capacità di interventi hardware. Buone conoscenze teoriche di informatica generale.</p> <p><i>Office Automation:</i> Word (Avanzato), Excel(Avanzato), Access(Ottimo), Visual Basic for Application (Buono), Latex (Buono), SQL(Buono).</p> <p><i>Calcolo Scientifico:</i> MATLAB (Avanzato), SIMULINK (Intermedio), Control System Toolbox (Base), Mathematica (Buono), Maple (Buono), Stata (Ottimo), Sas-Stat (Base), SPSS (Buono), E-Views (Ottimo).</p> <p><i>Financial Analysis:</i> Multicharts (Ottimo), Metatrader (Ottimo), Linguaggio EasyLanguage (Buono), Linguaggio Mql4 (Buono), ProRealTime (Buono).</p> <p>In generale, ottima capacità di intuizione e di comprensione del funzionamento di software applicativo di qualsiasi natura maturata nel corso degli studi, in ambito lavorativo e nel tempo libero. Ottima capacità di navigare in Internet.</p>
Hobby e tempo libero	Lettura, Internet, Scacchi, Giochi di strategia e di simulazione al PC.
Patente	Automobilistica (Patente B)
Referenze	<p>Marcello Messori Professore ordinario di Economia Libera Università Internazionale degli Studi Sociali "Guido Carli" – Dipartimento di Scienza Politiche Via Columbia 2, 00133, Roma mmessori@luiss.it</p> <p>Anna Ruocco Dirigente generale Ministero dell'Economia e delle Finanze - Dipartimento delle Finanze Via Pastrengo 22, 00185 Roma anna.ruocco@finanze.it</p>
Allegati	Elenco dettagli esami universitari, corsi Master e altri corsi. Dettaglio delle attività svolte in ambito lavorativo. Abstract Tesi di Laurea e Tesi di Dottorato

13 giugno 2018

Tutti i Marchi sono proprietà dei legittimi proprietari.

Autorizzo il trattamento dei miei dati personali ai sensi del Dlgs 196 del 30 giugno 2003 e dell'art. 13 GDPR (Regolamento UE 2016/679) ai fini della ricerca e selezione del personale.

Allegato 1

Dettaglio delle attività svolte in ambito lavorativo

Principali Analisi svolte presso il Centro Studi Confindustria con l'impiego di Stata e Matlab:

- ❖ Il carico fiscale sulle imprese manifatturiere italiane: Indagine su aliquota media e aliquota marginale.
- ❖ Redditività imprese manifatturiere: analisi sull'indice margine operativo netto su fatturato.
- ❖ Analisi della composizione delle passività delle imprese italiane.
- ❖ Impatto su Irap della manovra finanziaria e riduzione del cuneo fiscale per le imprese manifatturiere italiane (Finanziaria 2006).
- ❖ Analisi degli effetti della variazione normativa sulla destinazione del Tfr (Finanziaria 2006) sulle imprese italiane e sul gettito fiscale.
- ❖ Indagine sulle forze di lavoro: laureati e mercato del lavoro.
- ❖ Analisi della sostenibilità del debito pubblico italiano.
- ❖ Indagine sulle ragioni della bassa crescita della produttività italiana.

Altre mansioni svolte presso il Csc:

- ❖ Gestione e aggiornamento Modello macroeconomico annuale Csc 2 in ambiente Aremos.
- ❖ Costruzione e gestione Modello macroeconomico trimestrale in ambiente EViews.
- ❖ Gestione e aggiornamento Database Csc in ambiente Sql-Access.

Analisi svolte presso la Fondazione "Ivano Barberini":

- ❖ Modelli teorici di finanziamento delle imprese cooperative.
- ❖ Analisi dei bilanci civilistici e consolidati delle imprese cooperative su dataset CRM-AIDA.
- ❖ Analisi di settore e territoriale con Stata 11

Analisi svolte presso John Street Capital

- ❖ Implementazione di modelli simulazione prodotti derivati in ambiente Matlab
- ❖ Backtesting di strategie di trading con prodotti derivati in ambiente Matlab e Multicharts
- ❖ Analisi Montecarlo e Walk Forward Analysis in ambiente Matlab e Stata

Principali database utilizzati:

- ❖ Indagine sui bilanci delle famiglie italiane - Banca d'Italia
- ❖ Indagine sulle imprese industriali e dei servizi - Banca d'Italia
- ❖ Aida - Bureau Van Dijk
- ❖ Bankscope - Bureau Van Dijk
- ❖ Datastream - Thomson Financial
- ❖ ConIstat - Istat
- ❖ CoeWeb - Istat
- ❖ Annual macro-economic database (Ameco) - European Commission
- ❖ Base informativa pubblica - Banca di Italia
- ❖ Economic and Social Statistics - Eurostat
- ❖ Statistical Data Warehouse - European Central Bank
- ❖ SourceOECD - OECD's Online Statistical Databases
- ❖ Rilevazione sulle forze di lavoro - Istat
- ❖ Dati cumulativi di società italiane - MedioBanca
- ❖ Movimprese - UnionCamere
- ❖ Historical Us Stock Options Data

Allegato 2

Abstract Tesi di Laurea e Tesi di Dottorato

Tesi di Laurea: "Incoerenza temporale e indipendenza della Banca centrale: aspetti teorici e problemi di misurazione"

La tesi esamina le argomentazioni a sostegno della proposta di indipendenza della banca centrale quale rimedio ai problemi di incoerenza temporale a cui la banca centrale può incorrere nella gestione della politica monetaria. La prima parte contiene una rassegna dei principali contributi, da Kidland e Prescott (1977) e Barro e Gordon (1983), che muovono la loro celebre critica alla Teoria del controllo ottimo e propongono di sostituire alla regola cogente un criterio informale di comportamento delle autorità monetarie sorretto dalla loro reputazione, a Rogoff (1985) che dimostra come in presenza di distorsioni nel mercato del lavoro un banchiere centrale "conservatore" garantisce un più alto livello di benessere sociale rispetto al banchiere "discrezionale". Ed infine Lohmann (1992) che riconosce all'Autorità politica la possibilità di intervenire qualora gli shock fossero particolarmente forti e tali quindi da rendere necessario il contenimento dell'atteggiamento "conservatore" del banchiere centrale. Nella seconda parte, la tesi descrive e costruisce due dei principali indici di indipendenza della banca centrale, Grilli, Masciandaro e Tabellini (1991) e Cukierman, Webb e Neyapti (1992), applicati all'Italia dal 1950 al 1998 ed utilizzando i testi di legge che regolamentano l'organizzazione e il funzionamento del nostro Istituto di emissione. Il punto centrale che emerge è che, come sostiene una parte della letteratura, l'indipendenza della banca centrale è intimamente legata alla possibilità di perseguire un basso tasso di inflazione, anche a scapito della crescita del prodotto interno lordo.

Tesi di Dottorato: "Accelerazione finanziario e capitale bancario: una valutazione comparativa"

La tesi sviluppa un modello di equilibrio economico generale di tipo New Keynesian, adattato per includere una versione dinamica del contratto finanziario di Holmstrom e Tirole (1997), e di cui indaga il funzionamento. Il modello stocastico di equilibrio dinamico, opportunamente calibrato, può essere impiegato per valutare quantitativamente gli effetti macroeconomici delle rigidità presenti nei mercati finanziari sotto forma di costi di agenzia e del diverso grado di capitalizzazione del settore bancario. Inoltre, attraverso simulazioni numeriche è possibile analizzare gli effetti macroeconomici, in un'ottica di breve periodo, degli shock esogeni, tecnologici e di politica economica, in un contesto di vischiosità dei prezzi e frizioni nei mercati finanziari. In dettaglio, la tesi esplora il ruolo delle banche nelle fluttuazioni cicliche, così come descritto dal cosiddetto filone del Bank lending channel, e compara i risultati ottenuti con la tradizionale teoria dell'acceleratore finanziario. La principale novità rispetto ai modelli di accelerazione finanziaria standard è nella presenza del capitale bancario, che insieme al net worth degli imprenditori, determina il livello aggregato della spesa per investimento. Dato il modello, il capitale bancario riduce i problemi di azzardo morale derivanti dalle asimmetrie informative esistenti e le conseguenti inefficienze allocative nei mercati finanziari. Viene quindi confermato uno dei capisaldi del Bank lending channel che vede nella sottocapitalizzazione del sistema bancario una delle cause di maggiore amplificazione degli shock macroeconomici.

Allegato 3

Elenco dettagli esami universitari

Insegnamento Corso di Laurea Scienze Politiche	Data	Docente
Lingua Francese	14/05/1996	Prof. Gabriella Fabbicino
Statistica	17/05/1996	Prof. Domenico Piccolo
Economia Politica	24/06/1996	Prof. Carlo Panico
Storia Moderna	07/11/1996	Prof. Silvio Zotta
Istituzioni di Diritto Pubblico	06/03/1997	Prof. Eugenio de Marco
Politica Economica e Finanziaria	13/06/1997	Prof. Roberto Cagliozzi
Sociologia	09/07/1997	Prof. Orazio Mazzoni
Storia delle Dottrine Politiche	18/11/1997	Prof.ssa Marinelli Fedeli de Cecco
Economia e Politica Agraria	11/05/1998	Prof. Arnaldo Cervo
Demografia	21/05/1998	Prof.ssa Annunziata Nobile
Economia e Politica Monetaria	25/05/1998	Prof. Carlo Panico
Economia Aziendale	16/07/1998	Prof. Arnaldo Cervo
Pianificazione e Organizzazione Territoriale	05/11/1998	Prof. Tullio d'Aponte
Economia Internazionale	10/06/1999	Prof.ssa Franca Meloni
Economia e Politica Industriale	12/07/1999	Prof. Roberto Cagliozzi
Economia dei Paesi in Via di Sviluppo	26/05/2000	Prof. Alfredo Testi
Econometria	29/06/2000	Prof. Erasmo Papagni
Storia Economica dell'Europa	10/10/2000	Prof. Giuseppe di Taranto
Scienza delle Finanze	08/11/2000	Prof. Francesca Stroffolini
Lingua Inglese	08/03/2001	Prof. Gabriella di Martino
Istituzioni di Diritto Privato	30/03/2001	Prof. Domenico Sinesio
Insegnamento Master MEI	Ore	Docente
Matematica	40	Dott.ssa Elisabetta Tessitore
Probabilità	40	Dott. Roberto Monte
Macroeconomia Modulo I	16	Prof. Giancarlo Marini
Macroeconomia Modulo II	16	Prof. Pasquale Scaramozzino
Macroeconomia Modulo III	16	Prof. Alberto Dalmazzo
Microeconomia Modulo I	16	Prof. Pietro Riechlin
Microeconomia Modulo II	16	Prof. Robert Waldmann
Microeconomia Modulo III	16	Prof. Emilio Barucci
Statistica Modulo I	16	Prof. Giuseppe Arbia
Statistica Modulo II	16	Prof. Simone Borra
Statistica Modulo III	16	Prof. Gianpaolo Scalia Tomba
Corso Specialistico Matlab	16	Dott. Massimo Regoli
Corso Specialistico Stata	16	Dott. Giovanni Vecchi
Economia della crescita	12	Prof. Antonio Ciccone
Ottimizzazione e metodi stocastici	12	Prof. Pasquale Scaramozzino
Teoria dei Sistemi Monetari Internazionali	12	Prof.ssa Annalisa Rosselli
I Sistemi Monetari Internazionali	12	Prof. Gianni Toniolo
Moneta, Politica Monetaria e Crescita Economica	12	Prof. Fabrizio Mattesini
Attività Bancaria	12	Prof. Marcello Messori
Crisi valutarie: Modelli teorici e applicazioni empiriche	12	Prof. Riccardo Faini
Risparmio, investimento e bilancia dei pagamenti	12	Prof. Giancarlo Corsetti
L'equilibrio macroeconomico e la determinazione dei tassi di cambio	12	Prof. Alberto Petrucci
Oltre i Minimi Quadrati Ordinari	12	Prof. Franco Peracchi
Serie Storiche Multivariate	12	Prof. Marco Lippi
Non stazionarietà	12	Prof. Domenico Marinucci

Insegnamenti Corso dottorato di Ricerca**CFU****Docente**

Analisi dei Sistemi (Facoltà di Ingegneria)

6

Prof. Mario di Bernardo

Automazione Industriale (Facoltà di Ingegneria)

3

Prof. Mario di Bernardo