

Matteo Maria Pelagatti

Curriculum Vitae

Posizione accademica

- dal 01/10/23 al 30/09/26 Vice Direttore del Dipartimento di Economica, Metodi Quantitativi e Strategie di Impresa, Università degli Studi di Milano-Bicocca.
- dal 01/01/19 al 30/09/22 Direttore del Dipartimento di Economica, Metodi Quantitativi e Strategie di Impresa, Università degli Studi di Milano-Bicocca.
- dal 01/11/17 Professore ordinario di Statistica Economica presso il Dipartimento di Economica, Metodi Quantitativi e Strategie di Impresa, Università degli Studi di Milano-Bicocca.
- 2014-2017 Professore associato di Statistica Economica presso il Dipartimento di Economica, Metodi Quantitativi e Strategie di Impresa, Università degli Studi di Milano-Bicocca.
- 2002-2014 Ricercatore di Statistica Economica presso il Dipartimento di Statistica, Università degli Studi di Milano-Bicocca.

Istruzione

- 1998-2002 Dottorato in Statistica, Università degli Studi di Milano (supervisore Prof. Marco Martini).
- 2000-2001 Guest doctoral student, Humboldt Universität zu Berlin (supervisore Prof. Helmut Lütkepohl).
- 1997 Laurea in Scienze Politiche indirizzo economico-statistico, Università degli Studi di Milano, voto 110/110.
- 1991 Diploma di Maturità Scientifica, Liceo A. Volta, Milano.
- 1990 Diploma di High School, Box Elder High, Brigham City, Utah, USA, conseguito frequentando il 4° anno da *exchange student*.

Incarichi accademici istituzionali in Bicocca

- 2023-2027 Presidente della Commissione Paritetica del Dipartimento di Economia, Metodi Quantitativi e Strategie di Impresa, Università degli Studi di Milano-Bicocca
- 2023-2027 Membro del Comitato Direttivo del Progetto Dipartimento di Eccellenza del Dipartimento di Economia, Metodi Quantitativi e Strategie di Impresa, Università degli Studi di Milano-Bicocca

Ufficio U7-2103 – Università degli Studi di Milano-Bicocca

Via Bicocca degli arcimboldi, 8 – 20126 Milano

☎ +39 339 2641480 • 📞 +39 02 64485834

✉ matteo.pelagatti@unimib.it

- 2023-2026 Vice Direttore del Dipartimento di Economia, Metodi Quantitativi e Strategie di Impresa, Università degli Studi di Milano-Bicocca
- 2023-oggi Membro della Commissione Ricerca di Ateneo
- 2019-2022 Referente del Progetto Dipartimento di Eccellenza del Dipartimento di Economia, Metodi Quantitativi e Strategie di Impresa, Università degli Studi di Milano-Bicocca
- 2019-2023 Direttore del Dipartimento di Economia, Metodi Quantitativi e Strategie di Impresa, Università degli Studi di Milano-Bicocca
- 2020-oggi Membro del gruppo di lavoro d'Ateneo sui ranking internazionali
- 2018-2019 Responsabile internazionalizzazione del CdLM in Data Science, Università degli Studi di Milano-Bicocca
- 2016-2017 Membro del Gruppo di Lavoro che ha progettato il Corso di Laurea Magistrale in Data Science attivo a partire dall'anno accademico 2017/18.
- 2015-2018 Membro del Gruppo di Lavoro che ha riprogettato il Web d'Ateneo.
- 2013-2019 Membro del Gruppo di Lavoro per la Ricerca coordinato dal Prorettore G. Pacchioni
- 2013-2019 Membro del Gruppo di Lavoro per la Valorizzazione della Ricerca coordinato dal Prorettore D. Porro.
- 2003-2009 Consigliere d'Amministrazione dell'Università degli Studi di Milano-Bicocca.

Esperienze lavorative non accademiche

- 2023-2024 Conto terzi per Unieuro per l'ottimizzazione del budget degli investimenti pubblicitari.
- 2012-2023 Conto terzi per Pirelli per la costruzione e implementazione di un sistema di manutenzione predittiva per le presse.
- 2020-2021 Conto terzi per il Consorzio di Tutela del Credito per costruire modelli di credit scoring basati su dati transazionali bancari.
- dal 2018 Socio fondatore della start-up innovativa SeaFrog S.r.l. nata dai risultati della ricerca Pokermapper.
- dal 2000 Consulenza e formazione presso numerose aziende ed enti (Aeroporti di Roma, Assolombarda, Astrazeneca, Audible.de, Banca d'Italia, Ceccarelli, Enel, Engie, E.On, Enoteam, H3G, INAIL, Nielsen, Publitalia '80, Software Company, ...).
- 1998-2018 Trainer per SAS Institute.
- 1998-2015 Trainer per SPSS Italia.
- 2000 Esercitazioni di metodi MCMC per applicazioni biomediche presso Pfizer, Berlino per un corso di aggiornamento tenuto dal Prof. Mauro Gasparini.
- 1995-1996 Ecomar S.r.l., elaborazione dei dati oceanografici per il progetto Mose, su commissione del Magistrato alle Acque di Venezia.

Lingue

Ufficio U7-2103 – Università degli Studi di Milano-Bicocca

Via Bicocca degli arcimboldi, 8 – 20126 Milano

☎ +39 339 2641480 • ☎ +39 02 64485834

✉ matteo.pelagatti@unimib.it

Italiano madrelingua.
Inglese ottimo orale e scritto.
Tedesco buono orale e discreto scritto.

Didattica accademica

Presso Università degli Studi di Milano-Bicocca

A.A. in corso *Streaming Data Management and Time Series Analysis* (6 CFU, magistrale), *Computational Finance and Financial Econometrics* (6 CFU, magistrale), *Statistica Economica M* (6 CFU, magistrale).

A.A. passati Laurea triennale: *Serie Storiche Economiche I e II*, *Serie Storiche Economiche*, *Metodi di Simulazione*, *Esercitazioni di Statistica Multivariata*, *Statistica dei Mercati Monetari e Finanziari*.

Laurea magistrale: *Laboratorio di Serie Storiche*, *Laboratorio di Introduzione alle Serie Storiche*, *Statistica dei Mercati Monetari e Finanziari*, *Data Science Lab*, *Streaming Data Management and Time Series Analysis*, *Lab Data Challenge*.

Dottorato in Statistica e Finanza Matematica: *Asymptotic Statistics*.

Dottorato in Economia: *State Space Methods in Time Series*.

Dottorato in Statistica: *Time Series Analysis*.

Presso altre università

Università Cattolica del Sacro Cuore, sede di Piacenza: *Research Methods* (magistrale).

Università degli Studi di Bergamo: *Statistica dei Mercati Monetari e Finanziari* (triennale).

Università Bocconi di Milano – Master MEc: *Esercitazioni di Econometria III*.

Ricerca

Principali temi di ricerca

Analisi delle serie storiche, statistica robusta, mercati elettrici, finanza quantitativa, ciclo economico, statistica e finanza computazionale, metodi non parametrici, statistica per la sanità.

Progetti di ricerca finanziati

2023-2027 Sono stato il principale redattore e faccio parte del comitato esecutivo del progetto *Dipartimento di Eccellenza 2023-2027 DEMS*.

2023-oggi Dirigo il Data Science Lab del DEMS (<https://datalab.unimib.it/>).

2023-2025 Responsabile del task 6.4 *Derived Forecasts: households, care needs, labour force participation* dello WP *A novel data analytics system on ageing in Italy (Age-it)*, Spoke 1 del progetto PNRR Partenariato Esteso 8 *Age-it*.

2022-2023 Membro del progetto di ricerca *Data Mart Recidiva* (CINI/Ministero della Giustizia).

Ufficio U7-2103 – Università degli Studi di Milano-Bicocca

Via Bicocca degli arcimboldi, 8 – 20126 Milano

☎ +39 339 2641480 • 📞 +39 02 64485834

✉ matteo.pelagatti@unimib.it

- 2022-2023 Membro del progetto Agrimonia finanziato dalla Fondazione Cariplo (<https://agrimonia.net/>).
- 2019-2022 Ho coordinato il progetto *Dipartimento di Eccellenza 2018-2022* DEMS e, al suo interno, ho costituito il Data Science Lab.
- 2014-2015 Grant di Svenska Spell Research Council per il progetto *PokerMap*. Durata: 1 anno. Finanziamento: 500.000 SEK (circa 55.000 EUR).
- 2008-2010 PRIN 2007: *L'architettura dei mercati elettrici europei: efficienza, integrazione e stime del mark-up*. Durata: 2 anni. Coordinatore: B. Bosco.
- 2006-2008 PRIN 2005: *I numeri indice per il confronto nello spazio: aspetti teorici e applicazioni ad alcune città italiane*. Durata: 2 anni. Coordinatore nazionale: G. Ferrari. Coordinatore locale: M. Pelagatti.
- 2007-2008 Progetto *Indicatore sintetico dell'attività economica nella Provincia di Milano* in collaborazione con e finanziato da il Centro Studi Assolombarda.
- 2003-2005 PRIN 2003: *Metodologie e strumenti per l'analisi dell'evoluzione territoriale e per uno sviluppo territoriale del modello di dinamica strutturale*. Coordinatore nazionale: C. Filippucci. Coordinatore locale: B. Zavanella.

Publicazioni

Riviste in fascia A (lista ASN per il settore 13/D2)

- 2024 Pelagatti, M., Sbrana, G. "Estimating correlations among elliptically distributed random variables under any form of heteroskedasticity" *Quantitative Finance*, DOI: 10.1080/14697688.2023.2278502.
- 2023 Gianfreda, A., Maranzano P., Parisio L., Pelagatti, M. "Testing for integration and cointegration when time series are observed with noise " *Economic Modelling* 125, 106352, DOI: 10.1016/j.econmod.2023.106352
- 2023 Sbrana G., Pelagatti M. "Optimal hierarchical EWMA forecasting" *International Journal of Forecasting* online first, DOI: 10.1016/j.ijforecast.2022.12.008.
- 2022 Golia S., Grossi L., Pelagatti M. "Machine Learning Models and Intra-Daily Market Information for the Prediction of Italian Electricity Prices" 5, 81-101.
- 2022 Bonini M., Monti G.S., Pelagatti M.M., Ceriotti V., Re E.E., Bramè B., Bottero P., Tosi A., Vaghi A., Martelli A., Traina G.M., Rivolta L., Rivolta F., Ortolani C.M. "Ragweed pollen concentration predicts seasonal rhino-conjunctivitis and asthma severity in patients allergic to ragweed" *Scientific Reports* 12, 15921.
- 2021 Pelagatti M., Maranzano P. "Assessing the effectiveness of the Italian risk-zones policy during the second wave of COVID-19" *Health Policy* 125(9), 1188–1199. DOI:10.1016/j.healthpol.2021.07.011
- 2020 Colombo E., Pelagatti M. "Statistical learning and exchange rate forecasting" *International Journal of Forecasting* 36(4), 1260-1289. DOI:10.1016/j.ijforecast.2019.12.007

Ufficio U7-2103 – Università degli Studi di Milano-Bicocca

Via Bicocca degli arcimboldi, 8 – 20126 Milano

☎ +39 339 2641480 • 📞 +39 02 64485834

✉ matteo.pelagatti@unimib.it

- 2019 Gianfreda A., Parisio L., Pelagatti M. "The RES-Induced Switching Effect Across Fossil Fuels: An Analysis of Day-Ahead and Balancing Prices", *The Energy Journal* 40 (S.I. The New Era of Energy Transition).
- 2018 Lisi F., Pelagatti M. "Component estimation for electricity market data: Deterministic or stochastic?", *Energy Economics* 74, 13–37.
- 2018 Fattore M., Pelagatti M., Vittadini G. "A least squares approach to latent variables extraction in formative–reflective models", *Computational Statistics and Data Analysis* 120, 84–97.
- 2016 Gianfreda A., Parisio L., Pelagatti M. "The impact of RES in the Italian day-ahead and balancing markets", *The Energy Journal* 37(SI2), 161–184.
- 2016 Gianfreda A., Parisio L., Pelagatti M. "Revisiting long-run relations in power markets with high RES penetration", *Energy Policy* 94, 432–445.
- 2016 Bosco B., Parisio L., Pelagatti M. "Price coordination in vertically integrated electricity markets: Theory and empirical evidence", *The Energy Journal*, 37(1), 181–194.
- 2015 Pelagatti M., Colombo E. "On the empirical failure of purchasing power tests". *Journal of Applied Econometrics*, 30(6), 904–923.
- 2015 Della Torre E., Pelagatti M., Solari L. "Internal and external equity in compensation systems and firm-level absenteeism: the role of explained inequalities". *Human Relations* 68(3), 409–440.
- 2014 Bongini P., Nieri L., Pelagatti M. "The importance of being systemically important financial institutions". *Journal of Banking & Finance* 50, 562–574.
- 2013 Pelagatti M., Sen P.K. "Rank tests for short memory stationarity". *Journal of Econometrics* 172(1), 90–105.
- 2013 Bosco B., Parisio L., Pelagatti M. "Price-capping in partially monopolistic electricity markets with an application to Italy". *Energy Policy* 54, 257–266.
- 2012 Bosco B., Parisio L., Pelagatti M. "Strategic bidding in vertically integrated power markets with an application to the Italian electricity auctions. *Energy Economics* 34(6), 2046–2057.
- 2011 Pelagatti M. "State space methods in Ox/SsfPack ". *Journal of Statistical Software* 41(3), 1–25.
- 2010 Bosco B., Parisio L., Pelagatti M. "Long-run relations in European electricity prices". *Journal of Applied Econometrics* 25(5), 805–832.
- 2007 con molti altri autori. "ASSET (Age/Sex Standardised Estimates of Treatment): a research model to improve the governance of prescribing funds in Italy". *PLoS ONE* 2(7).

[Altri articoli su riviste internazionali con referee](#)

- 2023 Maranzano P., Pelagatti M. "Spatiotemporal Event Studies for Environmental Data Under Cross-Sectional Dependence : An Application to Air Quality Assessment in Lombardy" *Journal of Agricultural, Biological and Environmental Statistics*, DOI: 10.1007/s13253-023-00564-z

Ufficio U7-2103 – Università degli Studi di Milano-Bicocca

Via Bicocca degli arcimboldi, 8 – 20126 Milano

☎ +39 339 2641480 • 📠 +39 02 64485834

✉ matteo.pelagatti@unimib.it

- 2022 Golia S., Grossi L., Pelagatti M. "Machine Learning Models and Intra-Daily Market Information for the Prediction of Italian Electricity Prices" *Forecasting*, 5, 81–101
- 2021 Pelagatti M., Maranzano P. "Nonparametric tests for event studies under cross-sectional dependence" *Quarterly Journal of Finance and Accounting*, 59(1&2).
- 2020 Maranzano P., Fassò A., Pelagatti M., Mudelsee M. "Statistical Modeling of the Early-Stage Impact of a New Traffic Policy in Milan, Italy" *International Journal of Environmental Research Public Health* 17(3).
- 2019 Gianfreda A., Parisio L., Pelagatti M. "The RES-Induced Switching Effect Across Fossil Fuels: An Analysis of Day-Ahead and Balancing Prices" *Energy Journal* 40(S11).
- 2019 Parisio L., Pelagatti M. "Market coupling between electricity markets: theory and empirical evidence for the Italian–Slovenian interconnection". *Economia Politica* 36, 527-548.
- 2018 Gianfreda A., Parisio L., Pelagatti M. "A Review of Balancing Costs in Italy before and after RES introduction". *Renewable & Sustainable Energy Reviews* 91, 549–563.
- 2018 Schiavella M., Pelagatti M., Westin J., Lepore G., Cherubini P. "Profiling Online Poker Players: Are Executive Functions Correlated with Poker Ability and Problem Gambling?" *Journal of Gambling Studies* 34(3), pp 823–851.
- 2017 Bongini P., Patarnello A., Pelagatti M., Rossolini M. "Keeping Funding Costs under Control: Evidence from Bank Bond Issues", *International Journal of Business and Social Science* 8(5), 135–146.
- 2017 Bongini P., Nieri L., Pelagatti M., Piccini A. (2017) "Curbing systemic risk in the insurance sector: A mission impossible?", *The British Accounting Review* 49(2), 256–273.
- 2012 Fattore M., Pelagatti M., Vittadini G. "Inconsistencies of the PLS-PM approach to structural equation models with formative-reflective schemes". *Electronic Journal of Applied Statistical Analysis* 5(3), 333–338.
- 2010 Pelagatti M., Negri V. "The Industrial Cycle of Milan as an Accurate Leading Indicator for the Italian Business Cycle". *Journal of Business Cycle Measurement and Analysis* 2010(2), article 2.
- 2009 Pelagatti M. "Modelling good and bad volatility". *Studies in Nonlinear Dynamics and Econometrics* 13(1), article 2.
- 2008 Mariani P., Pelagatti M., Hahn A., Alpini D. "Epidemiology of paroxysmal positioning vertigo: correlation with seasons, climate, and pollution". *International Tinnitus Journal* 14(2), 168–174.
- 2008 con molti altri autori. "Effect of age and sex related therapeutic needs on general practices' prescribing cost. The ASSET (Age/Sex Standardised Estimates of Treatment) research model". *PharmacoEconomics - Italian Research Articles* 10(2), 89–98.

- 2007 con B. Bosco e L. Parisio. "Deregulated Wholesale Electricity Prices in Italy". *International Advances in Economic Research* 13(4), 415–432.
- 2006 Pelagatti M., Fuà D., Galliani G., Brugnoli A., Condemi V. "Statistical investigation on the relation between car accidents and warm katabatic winds". *Il Nuovo Cimento C* 29(2), 229–235.

Monografie e curatele

- 2015 Pelagatti M. *Time Series Modelling with Unobserved Components*, Chapman & Hall/CRC.
- 2006 Mariani P., Pelagatti M. (curatori) *Metodologie e strumenti per l'analisi dell'evoluzione economica territoriale*. CUSL.
- 2004 Pelagatti M. (curatore) *Studi in ricordo di Marco Martini*. Giuffrè.

Altre pubblicazioni

- 2016 Lisi F., Pelagatti M. "Component estimation for electricity market data: Deterministic or stochastic?" in *Proceedings - International Conference on Modern Electric Power Systems, MEPS 2015*.
- 2016 Gianfreda A., Parisio L., Pelagatti M. "Italian Wholesale Electricity Market: RES Effects Across Day-ahead and Balancing Markets" in *Proceedings - International Conference on Modern Electric Power Systems, MEPS 2015*.
- 2015 Bongini P., Paternello A., Pelagatti M., Rossolini M. "How difficult is it to raise money in turbulent times?" in *Lending, Investments and the Financial Crisis*, edited by E. Beccalli, F. Poli, 1–21, Palgrave MacMillan.
- 2014 Parisio L., Pelagatti M. "Market coupling between electricity markets: Theory and empirical evidence for the Italian-Slovenian interconnection" in *Proceedings of the 11th International Conference on the European Energy Market*.
- 2014 Pelagatti M., Parisio L. "First results on the Italian-Slovenian electricity market coupling" in *47th Scientific Meeting of the Italian Statistical Society Proceedings*.
- 2013 Bosco B., Parisio B., Pelagatti M. "Optimal pricing behavior of vertically integrated utilities: Theory and evidence from the Italian electricity wholesale market" in *Proceedings of the 10th International Conference on the European Energy Market*.
- 2012 Pelagatti M. "Supply Function Prediction in Electricity Auctions" in *Complex Models and Computational Methods in Statistics* edited by M. Grigoletto, F. Lisi, S. Petrone, 203–213. Springer-Verlag.
- 2012 Bosco B., Parisio L., Pelagatti M. "Price capping in partially monopolistic electricity markets" in *Proceedings of the 9th International Conference on the European Energy Market*.
- 2012 Fattore M., Pelagatti M., Vittadini G. "Globally-optimized latent variable extraction in formative-reflective models" *Quaderni di Statistica* 14, 101–104.
- 2010 Pelagatti M. "Previsioni delle dinamiche dei contratti di lavoro in Lombardia" in *Dinamicità e Sicurezza. I Dati del Lavoro che Cambia* edited by Mario Mezzanzanica, 152–174. Guerini e Associati.

Ufficio U7-2103 – Università degli Studi di Milano-Bicocca

Via Bicocca degli arcimboldi, 8 – 20126 Milano

☎ +39 339 2641480 • 📞 +39 02 64485834

✉ matteo.pelagatti@unimib.it

- 2010 Pelagatti M. "Price indexes across space and time and the stochastic properties of prices" in *Price Index Numbers in Time and Space* edited by G. Ferrari, L. Biggeri, 97–114. Springer-Verlag.
- 2010 Bosco B., Parisio L., Pelagatti M. "Estimating marginal costs and market power in the Italian electricity auctions" in *Proceedings of the 7th International Conference on the European Energy Market*.
- 2010 Pelagatti M., Sen P.K. "A robust version of the KPSS test based on ranks" in *Società Italiana di Statistica: Atti della XLV Riunione Scientifica*.
- 2009 Pelagatti M., Lisi F. "Variance initialisation in GARCH estimation." in *Complex Data Modeling and Computationally Intensive Statistica Methods for Estimation and Prediction* edited by Paganoni, Sangalli, Secchi, Vantini. Maggioli Editore.
- 2008 Zavanella B., Mezzanzanica M., Pelagatti M., Minotti S., Martini M. "A two-step approach for regional medium-term skill needs forecasting" in *Regional Forecasting on Labour Markets* edited by C. Knobel, B. Kriechel, A. Schmid. Rainer Hampp Verlag.
- 2007 Pelagatti M. "Duration dependent Markov-switching vector autoregression: Properties, Bayesian inference, software and application" in *Business Fluctuations and Cycles* edited by T. Nagakawa, 43–66. Nova Science Publishers, Hauppauge NY.
- 2006 Pelagatti M. "Forecasting good volatility and bad volatility" in *Società Italiana di Statistica: Atti della riunione intermedia 2007 su Rischio e Previsione*.
- 2006 Pelagatti M., Perricone C., Fattore M. "La misura dell'inflazione spaziale in Italia usando dati raccolti per altri fini" in *Metodologie e Strumenti per l'Analisi dell'Evoluzione Economica Territoriale* edited by P. Mariani, M. Pelagatti, 133–154. CUSL, Milano.
- 2006 Pelagatti M. "Estimation and Optimal Filtering for a Common Stochastic Cycle Shifted in Continuous Time" in *Società Italiana di Statistica: Atti della XLIII Riunione Scientifica*.
- 2004 Pelagatti M. "Ciclo macroeconomico e cicli economici settoriali" in *Studi in Ricordo di Marco Martini* edited by M. Pelagatti, 83–104. Giuffré, Milano.
- 2002 Pelagatti M. "Duration-Dependent Markov-Switching VAR Models with Applications to the Business Cycle Analysis" in *Società Italiana di Statistica: Atti della XLI Riunione Scientifica*.

Attività editoriali

Associate Statistical Methods & Applications (2019-2023).
 editor per

Referee per Advances in Data Analysis and Classification · Applied Economics · Computational Statistics and Data Analysis · Chapman & Hall/CRC Press · Econometrics Journal · Econometric Reviews · Economic Modelling · Economics e-journal · Economic Notes · Electronic Journal of Applied Statistical Analysis · Empirical Economics · Energy Economics · Energy Journal · Energy Strategy Reviews · Entropy · Environmetrics · Forecasting · Health Policy · Heliyon · IEEE Transactions on Power Systems · International Journal of Forecasting · International Journal of Theoretical and Applied Finance · International Review of Economics and Finance · Journal of Business and Economic Statistics · Journal of Business Cycle Measurement and Analysis · Journal of Gambling Studies · Journal of Risk and Financial Management · Journal of Statistical Computation and Simulation · Journal of the American Statistical Association · Macroeconomic Dynamics · Mathematics and Computers in Simulation · Macroeconomic Dynamics · Metron · Renewable and Sustainable Energy Reviews · Review of Derivative Research · Social Indicators Research · South African Journal of Economics · Statistical Analysis and Data Mining · Statistical Methods & Applications · Utilities Policy.

Milano, 5 marzo 2024