

Matteo Maria Pelagatti

Curriculum Vitae

Posizione accademica

- dal 01/01/19 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

- dal 2016 Membro del Gruppo di Lavoro che ha progettato il Corso di Laurea Magistrale in Data Science attivo a partire dall'anno accademico 2017/18.
- dal 2015 Membro del Gruppo di Lavoro che ha riprogettato il Web d'Ateneo.
- dal 2013 Membro del Gruppo di Lavoro per la Ricerca coordinato dal Prorettore G. Pacchioni
- dal 2013 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.

Ufficio U7-2092a – Università degli Studi di Milano-Bicocca
Via Bicocca degli arcimboldi, 8 – 20126 Milano



• +39 02 64485834

✉ matteo.pelagatti@unimib.it

Esperienze lavorative non accademiche

- 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, Etnoteam, H3G, INAIL, Nielsen, Publitalia '80, Software Company, ...).
- dal 1998 Trainer per SAS Institute.
- 1998-2015 Trainer per SPSS Italia.
- 1995-1996 Ecomar S.r.l., elaborazione dei dati oceanografici per il progetto Mose, su commissione del Magistrato alle Acque di Venezia.

Lingue

- 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 Insegnamenti di *Data Science Lab* (3CFU, magistrale), *Statistica dei Mercati Monetari e Finanziari* (6CFU, magistrale), *Statistica Economica M* (6CFU, magistrale). Per il Dottorato in Statistica e Finanza Matematica insegnamento di *Asymptotic Statistics* (12 ore).
- 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 specialistica/magistrale: *Laboratorio di Serie Storiche*, *Laboratorio di Introduzione alle Serie Storiche*, *Statistica dei Mercati Monetari e Finanziari*.
- 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*.

Ufficio U7-2092a – Università degli Studi di Milano-Bicocca
Via Bicocca degli arcimboldi, 8 – 20126 Milano



• +39 02 64485834

✉ matteo.pelagatti@unimib.it

Ricerca

Principali temi di ricerca

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

Collaborazioni internazionali in atto

- U.S.A. Dal 2008 collaboro con il prof. Pranab K. Sen della University of North Carolina at Chapel Hill. Il prof. Sen è considerato dalla American Statistical Association uno dei 30 statistici più influenti al mondo ed ha vinto nell'anno 2010 il Samuel Wilks Award per la statistica. Il primo frutto della collaborazione è un articolo sul *Journal of Econometrics*.
- Svezia Con il gruppo di ricerca formato dal sottoscritto, Paolo Cherubini (Psicologia, Università di Milano-Bicocca), Mauro Schiavella (Psicologia, Dalarna University) e Jerker Westin (Informatica per la salute, Dalarna University) abbiamo vinto un grant Svenska Spel, ente di Stato svedese che gestisce i giochi, che finanzia la prima parte di una ricerca finalizzata allo sviluppo di una metodologia per la realizzazione di un software per limitare il gioco problematico nell'ambito del poker on-line.
- Internazionale Per proseguire ed arricchire la ricerca sul gioco patologico provando ad accedere ai fondi H2020, che prevedono grossi gruppi di ricercatori di molti paesi diversi, si è costituito un gruppo di ricerca che include 14 istituti di ricerca e aziende situati in 7 paesi europei ed extra-europei. La prima domanda di finanziamento H2020 non è stata accolta, ma sicuramente proveremo a partecipare ad altri bandi.
- Altre Dal 2016 collaboro con Giacomo Sbrana (NEOMA, Business School, Mont-Saint-Aignan, Francia) su temi di modellistica state space, con Allin Cottrell (Wake Forest University, USA) e Riccardo (Jack) Lucchetti (Università Politecnica delle Marche) su temi di modellistica state space e con Grzegorz Dudek (Czestochowa University of Technology, Polonia) e Francesco Lisi (Università di Padova) su temi di previsione di domanda e prezzi elettrici.

Progetti di ricerca finanziati

- 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.

Ufficio U7-2092a – Università degli Studi di Milano-Bicocca
Via Bicocca degli arcimboldi, 8 – 20126 Milano



+39 02 64485834

✉ matteo.pelagatti@unimib.it

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.

——— Pubblicazioni

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

- 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.

Ufficio U7-2092a – Università degli Studi di Milano-Bicocca
Via Bicocca degli arcimboldi, 8 – 20126 Milano



+39 02 64485834

✉ matteo.pelagatti@unimib.it

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

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 Parisio L., Pelagatti M. "Market coupling between electricity markets: theory and empirical evidence for the Italian–Slovenian interconnection". *Economia Politica* forthcoming.

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*, in stampa. DOI: 10.1007/s10899-017-9741-z

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.

Ufficio U7-2092a – Università degli Studi di Milano-Bicocca
Via Bicocca degli arcimboldi, 8 – 20126 Milano



+39 02 64485834

✉ matteo.pelagatti@unimib.it

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*. Giuffr .

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 *Dinamicit  e Sicurezza. I Dati del Lavoro che Cambia* edited by Mario Mezzanzanica, 152–174. Guerini e Associati.
- 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.

Ufficio U7-2092a – Universit  degli Studi di Milano-Bicocca
Via Bicocca degli arcimboldi, 8 – 20126 Milano



+39 02 64485834

✉ matteo.pelagatti@unimib.it

- 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 Zavarella 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 come referee

- Referee per Advances in Data Analysis and Classification · Applied Economics · Computational Statistics and Data Analysis · Chapman & Hall/CRC Press · Econometric Reviews · Economic Modelling · Economics e-journal · Electronic Journal of Applied Statistical Analysis · Empirical Economics · Energy Economics · Energy Journal · Environmetrics · 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 Statistical Computation and Simulation · Journal of the American Statistical Association · Mathematics and Computers in Simulation · Metron · Review of Derivative Research · South African Journal of Economics · Statistical Methods and Applications.
- Reviewer per Mathematical Reviews (American Mathematical Society) · Frontiers in Energy Systems and Policy · Czech Science Foundation.

Milano, 4 gennaio 2019

*Ufficio U7-2092a – Università degli Studi di Milano-Bicocca
Via Bicocca degli arcimboldi, 8 – 20126 Milano*



+39 02 64485834

✉ matteo.pelagatti@unimib.it