

Informazioni personali

Nome / Cognome

Indirizzo

Email

Nazionalità

Data di nascita

Frattarolo Lorenzo

Via Perugia 40 c 30020 Marcon (VE), Italia

lorenzo.frattarolo@gmail.com

Italiana

10/08/1981

Ambiti di Ricerca

Reti Finanziarie, Analisi di Serie Temporal Multivariate, Statistica non Parametrica, Misure di Rischio Sistemico, Metodi di Riduzione della Varianza

Esperienze Lavorative

Dates

Occupazione

Principali Attività

Nome ed Indirizzo del Datore di Lavoro

1 Ottobre 2023 - Today

Ricercatore a Tempo Determinato (B) in Econometria

Insegnamento e Ricerca

Dipartimento di Scienze Economiche, Università degli Studi di Verona, via Cantarane, 24 - 37129 Verona

Date

Occupazione

Principali Attività

Nome ed Indirizzo del Datore di Lavoro

16 Settembre 2018 - 24 Settembre 2023

Agente Contrattuale

Ricercatore

European Commission – Joint Research Center, Directorate B Fair and Sustainable Economy, Unit B.1 Economic and Financial Resilience, Via Enrico Fermi, 2749 21027 Ispra (VA), Italy

Date

Occupazione

Principali Attività

Nome ed Indirizzo del Datore di Lavoro

1 Gennaio 2016 - 15 Settembre 2018

Assegnista per il progetto "Modelli Statistici per la valutazione del rischio". Supervisor: Monica Billio

Ricercatore

Dipartimento di Economia, Università Ca Foscari, Cannaregio, 873 S. Giobbe - 30121 Venezia

Date

Occupazione

Principali Attività

Nome ed Indirizzo del Datore di Lavoro

1 Luglio 2014 - 31 Dicembre 2015

Ricercatore Post Dottorale per il progetto SAFE project "Sovereign, bank and insurance credit spread: connectedness and system networks" Principal Investigator: Lorian Pelizzon, Director of the SAFE Systemic Risk Lab. Joint project with Monica Billio: Università Ca' Foscari di Venezia, Mila Getmansky: University of Massachusetts, US, Dale Gray: International Monetary Fund and MF Risk, Andrew Lo: MIT Sloan, Robert Merton: MIT Sloan

Researcher

Research Center SAFE, House of Finance, Grünerburgplatz 1, 60323 Frankfurt am Main

Date

Occupazione

Principali Attività

1 Luglio 2013 - 30 Giugno 2014

Assegno di Ricerca: "Syrtto (Systemic Risk Tomography) EU FP7 project SSH-2012-320270"

Ricercatore

Nome ed Indirizzo del Datore di Lavoro	UMR8174-CNRS Centre d'Economie de la Sorbonne (CES) , La Maison des Sciences Economiques Université Paris 1 Panthéon-Sorbonne 106/112, Boulevard de l'Hopital 75647 - Paris cedex 13
Date	1 Giugno 2012 - 30 Maggio 2013
Occupazione	Assegno di Ricerca: <i>"Equity returns, dependencies structures and systemic events in financial system"</i>
Principali Attività	Ricercatore
Nome ed Indirizzo del Datore di Lavoro	International Center of Economics and Finance (ICEF), Dipartimento di Economia, Università Ca Foscari of Venice, Cannaregio, 873 S. Giobbe - 30121 Venezia
Date	20 Giugno 2011 - 20 Maggio 2012
Occupazione	Assegno di Ricerca: <i>"Simulation Based Econometrics Methods for Discrete Time Option Pricing Models with Switching Volatility"</i>
Principali Attività	Ricercatore
Nome ed Indirizzo del Datore di Lavoro	International Center of Economics and Finance (ICEF), Dipartimento di Economia ,Università Ca Foscari, Cannaregio, 873 S. Giobbe - 30121 Venezia
Date	21 Settembre 2009 - 21 Maggio 2011
Occupazione	Assegno di Ricerca: <i>"Hedge funds: tail event behavior and absolute alphas"</i>
Principali Attività	Ricercatore
Nome ed Indirizzo del Datore di Lavoro	International Center of Economics and Finance (ICEF), Dipartimento di Scienze Economiche, Università Ca Foscari di Venezia, Cannaregio, 873 S. Giobbe - 30121 Venezia

Pubblicazioni

Articoli su Rivista

Casarin, R., Craiu, R. V., Frattarolo, L., Robert, C. P.,	Living on the Edge: An Unified Approach to Antithetic Sampling (2023), Forthcoming in Statistical Science
Barbaglia, L., Frattarolo, L., Onorante, L., Tiozzo Pezzoli, L., Pericoli, F. M., Ratto, M.	Testing Big Data in a Big Crisis: Nowcasting under COVID-19. (2022), International Journal of Forecasting
Billio, M., Frattarolo, L., Guegan, D.	High-Dimensional Radial Symmetry of Copula Functions: Multiplier Bootstrap vs. Randomization. Symmetry, 14(1), 97.(2022)
Billio, M., Frattarolo, L., Guegan, D.	Multivariate radial symmetry of copula functions: Finite sample comparison in the iid case. Dependence Modeling, 9(1), 43-61.(2021)
Billio, M., Caporin, M., Frattarolo, L., Pelizzon L.	Networks in risk spillovers: A multivariate GARCH perspective. Econometrics and Statistics, (2021)
Frattarolo, L., Parpinel, F., Pizzi, C.	Combining permutation tests to rank systemically important banks. Statistical Methods & Applications, 29(3), 581-596.(2020)
Billio, M., Casarin, R., Costola, M., & Frattarolo, L.	Opinion Dynamics and Disagreements on Financial Networks. Advances in Decision Sciences, 23(4), 1-27,(2019).
Frattarolo, L., Parpinel, F., Pizzi, C.	Systemically Important Banks: A Permutation Test Approach. pp.41-52. In Rivista Italiana di Economia, Demografia e Statistica - ISSN:0035-6832 vol. LXX (3)(2016)

Billio, M., Frattarolo, L., Pelizzon L.

Billio, M., Frattarolo, L., Pelizzon L.

Capitoli di Libro e Atti di Convegno

Billio, M., Casarin, R., Costola, M., & Frattarolo, L.

Billio, M., Casarin, R., Costola, M., & Frattarolo, L.

Frattarolo, L., Guegan, D.

Billio, M., Caporin, M., Frattarolo, L., Pelizzon L.

Working Papers

Di Dio, F., Frattarolo, L.

D'Auria, F., Di Dio, F., Frattarolo, L., Hohberger, S., Ratto, M., Vogel, L.

Frattarolo, L.

Articoli Istituzionali

M. Bellia, L. Cales, L. Frattarolo, D. Monteiro, M. Petracco Giudici

M. Bellia, L. Cales, L. Frattarolo, A. Maerean, D. Monteiro, M. Petracco Giudici, L. Vogel

Contributi di Policy

Pfeiffer, P., Ratto, M., Cardani, R., Croitorov, O., Frattarolo, L., Pataracchia, B., Teresinski, J., Ifrim A., and Roman, J.

Pfeiffer, P., Ratto, M., Cardani, R., Croitorov, O., Frattarolo, L., Pataracchia, B. and Teresinski, J.

Cardani, R., Frattarolo, L., Pataracchia, B., Ratto, M. and Teresinski, J.

Hedge Fund Tail Risk: An Investigation in Stressed Markets. *The Journal of Alternative Investments*, 18(4), 109.(2016)

A Time Varying Performance Evaluation of Hedge Fund Strategies Through Aggregation *Bankers, Markets & Investors* n° 129 (2014)

Contagion dynamics on financial networks. *International Financial Markets: Volume 1* Routledge Advances in Applied Financial Econometrics, 63 (2019).

Disagreement in signed financial networks. In *Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance* (pp. 139-142). Springer, Cham. (2018)

Orthogonal Polynomials Derivative for Empirical Copula *Contributions in infinite-dimensional statistics and related topics*, E.G.Bongiorno, E.Salinelli, A.Goia, P.Vieu, Società Editrice Esculapio, (2014) pg. 119

Proximity-structured multivariate volatility models for systemic risk, e-Book "Advances in Latent Variables" Eds. Brentari E., Carpita M., Vita e Pensiero, Milan, Italy (2013)

Business Cycle and Environmental Policy in a Heterogeneous-Firm Macroeconomic Model (2022), mimeo

The effectiveness of automatic stabilisers in the euro area (2022) mimeo

Modal Grids in MIDAS estimation with large number of regressors (2022), mimeo

COVID-19: the stabilising impact of EU bond issuance on sovereigns and banks. *Quarterly Report on the Euro Area (QREA)*, 20(3), 17-28. (2021)

The sovereign-bank nexus in the euro area: financial and real channel. *Quarterly Report on the Euro Area (QREA)*, 19(1), 45-65.(2020)

Contribution to Spring Economic Forecast 2023: Which Factors Shape Growth and Inflation Going Forward? Model-Based Insights into the Spring Forecast(thematic Box I.2.4), 2023

Contribution to Spring Economic Forecast 2022: ALTERNATIVE SCENARIOS ON THE ECONOMIC OUTLOOK (Special Issue 4), 2022

Contribution to European Economic Forecast Autumn 2021. Special topic 4.2 "ENERGY PRICES", 2021

Cardani, R., Croitorov, O., Di Dio, F., Frattarolo, L., Giovannini, M., Hohberger, S., Pfeiffer, P., Ratto, M. and Vogel, L.

Cardani, R., Croitorov, O., Frattarolo, L., Giovannini, M., Hoffmann, S., Leal, J., Pfeiffer, P., Ratto, M., Vogel, L. and Vyskrabka, M.

Ratto, M., Pfeiffer, P., Vogel, L., Calès, L., Cardani, R., Croitorov, O., Di Dio, F., Frattarolo, L., Giovannini, M., Hohberger, S., Leal, J. and Vyskrabka, M.

Croitorov, O., Frattarolo, L., Pataracchia, B. and Ratto, M.

Cales, L., Cardani, R., Croitorov, O., Di Dio, F., Frattarolo, L., Giovannini, M., Hohberger, S., Pataracchia, B. and Ratto, M.

Calès, L., Cardani, R., Croitorov, O., Di Dio, F., Frattarolo, L., Giovannini, M., Hohberger, S., Pataracchia, B. and Ratto, M.

Educazione

Date
Titolo della Qualifica
Materie Principali
Nome e tipo di Organizzazione che fornisce l'educazione

Date
Titolo della Qualifica
Materie Principali
Nome e tipo di Organizzazione che fornisce l'educazione
Livello di classificazione

Date
Titolo della Qualifica
Materie Principali
Nome e tipo di Organizzazione che fornisce l'educazione
Livello di classificazione

The euro area's COVID-19 recession through the lens of an estimated structural macro model, Vox EU, 2021

Contribution to European Economic Forecast. Spring 2021. Special Issue 4.1. THE ROLE OF SAVINGS IN DETERMINING THE RECOVERY PATH, 2021

Contribution to European Economic Forecasts, Autumn 2020, Special Issue 3.1. The road out of the crisis remains bumpy and uncertain, 2020

Contribution to European Economic Forecasts - Spring 2020, Chapter 3 "Special issues", Special issue 1 "How the pandemic shaped the Forecast". (pp.65-72), 2020

Contribution to European Economic Forecasts - Autumn 2019, special issue 3.2 "What is behind the slowdown A model-based analysis of growth drivers" (pp.65-67)., 2019

Contribution to European Economic Forecast - Spring 2019. Chapter 1 "Putting the forecast into perspective: the weakness in manufacturing in the euro area - Fading external drivers of euro area growth" and Box I.1 "Looking at euro area GDP growth in 2019 through the lens of an estimated model"., 2019

Gennaio 2011 - Dicembre 2014
Ph.D in cotutela in Matematica Applicata/Economia
Empirical Copula Processes, Systemic Risk
Université Paris 1 Pantheon-Sorbonne/Università Ca' Foscari Venezia

Settembre 2008 - Agosto 2009
International Master in Economics and Finance
Economia, Finanza, Econometria, Risk Management
Università Ca' Foscari, Venezia

Master di secondo livello
Settembre 1999 - Marzo 2007

Laura V.O. in Fisica Teorica
Fisica, Matematica, Teoria Quantistica dei Campi, Transizione di Fase, Modello Standard della fisica delle particelle
Università La Sapienza, Roma

Bachelor + Master Degree

Periodi di Visita

Agosto 2018

Dipartimento di Statistica, Università di Toronto

Partecipazione a Progetti di Ricerca Nazionali ed Internazionali

2018

European Commission H2020-EE-2017-CSA-PPI, "EeDaPP Energy efficiency Data Protocol and Portal"

2017-2018

European Commission H2020-EE-2016-CSA-PPI, "EeMAP Energy efficient Mortgages Action Plan"

2017-2018

EUROSTAT, Euro-indicators, "Monthly production of coincident indicators for growth cycle and business cycle"

2016-2017

EUROSTAT, Methodological Support, "Financial cycles"

2016

SAFE research project :Network Banks Exposures and Variance Spillovers in the Euro Area

2013-2016

European Commission FP7-SSH-2012-2, "SYRTO Systemic risk tomography: signals, measurement, transmission channels, and policy interventions", (grant agreement n° 320270)

2011 – 2014

Progetto MIUR "Modelli statistici multivariati per la valutazione del rischio", (PRIN – cod. 2010RHAHPL)

Teaching

Date

a.a. 2016/2017-2017/2018

Università

Università Ca' Foscari, Dipartimento di Economia, Venezia

Course

Economics and Econometrics of international Finance

Date

a.a. 2017/2018

Università

Università Ca' Foscari, Dipartimento di Economia, Venezia

Course

Statistica 1-2, :Esercitazioni

Date

a.a. 2017/2018

Università

Università Ca' Foscari, Dipartimento di Economia, Venezia

Course

Master IMEF Mathematics

Date

a.a. 2017/2018

Università

Università Ca' Foscari, Dipartimento di Economia, Venezia

Course

Master IMEF Econometrics

Date

a.a. 2017/2018

Università

Università Ca' Foscari, Dipartimento di Economia, Venezia

Course

Master IMEF Foundation of Corporate Finance & Banking

Università

Università Ca' Foscari, Dipartimento di Economia, Venezia

Course

Master IMEF MatLab

Date

a.a. 2016/2017

Universita Course	Università Ca' Foscari, Dipartimento di Economia, Venezia Master IMEF Econometrics
Date Universita Course	a.a. 2016/2017 Università Ca' Foscari, Dipartimento di Economia, Venezia master IMEF Foundation of Corporate Finance & Banking
Date Universita Course	a.a. 2013/2014 Università Ca' Foscari, Dipartimento di Economia, Venezia Tutor for Non linear models and Financial Econometrics
Date Universita Course	a.a. 2011/2012 2013/2014 2014/2015 2015/2016 Università Ca' Foscari, Dipartimento di Economia, Venezia Econometrics: Practical Exercise Sessions
Date Universita Course	a.a. 2010/2011 Università Ca' Foscari, Dipartimento di Economia, Venezia Introduzione all'Econometria: Esercitazioni
Partecipazioni a Conferenze	
Conferenza Ruolo	CFE-CMStatistics 2022,17-19 December 2022, London Invited Speaker
Conferenza Ruolo	COMPSTAT 2022, 23-26 August 2022, Bologna Invited Speaker
Conferenza Ruolo	SSC2022, 49th Annual Meeting of the Statistical Society of Canada, May 30 - June 3, 2022, Virtual Speaker
Conferenza Ruolo	European Meeting of Statisticians (EMS 2019),July 22, 2019 - July 26, 2019 Palermo, Italy Speaker
Conferenza Ruolo	1st International Conference on Econometrics and Statistics (EcoSta 2017), Hong Kong University of Science and Technology 15 – 17 June 2017 Speaker
Conference Role	9th Financial Risks International Forum, Paris 21 & 22 March, 2016 Speaker
Conferenza Ruolo	IWFOS2014 International Workshop on Functional and Operatorial Statistic, Stresa(Italy), June 19-21,2014 Speaker
Conferenza Ruolo	Computational and Financial Econometrics (CFE 2012) 1-3 December 2012, Conference Centre, Oviedo, Spain Chair and Speaker Session CS07: Measuring systemic risk
Conferenza Ruolo	New Tools for Financial Regulation,Paris, November 15-16, 2012,Banque de France Discussant

Consulenze

2011-2013

Valutazione Derivati Creditizi per Studio CDR & Associati.

2014

Pacchetto R di Simulazione da Modelli di Copula per KnowShape s.r.l.

Lingue

Madrelingua

Italiano

Other language(s)

*Autovalutazione
Livello europeo^(*)*

Inglese, Francese

Inglese

Francese

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

^(*) Quadro comune europeo di riferimento per le lingue (ERL)

Io sottoscritto Lorenzo Frattarolo nato a Latina il 10/08/1981 dichiaro ai sensi del D.P.R. 445/2000 e successive modifiche ed integrazioni, che quanto sopra dichiarato corrisponde a verità e autorizzo al trattamento dei dati personali per le finalità legate alla presente procedura di selezione resa ai sensi del D.lgs. 196/2003.

Marcon
24/05/2023