

GAMBARELLI LUCA

Curriculum Vitae

Marzo 2021

INFORMAZIONI PERSONALI:

Data di nascita: 28/03/1990
Luogo di nascita: Reggio Emilia, Italia
Nazionalità: Italiana
Pagine e siti web: <http://personale.unimore.it/AddressBook/Home/luca.gambarelli>
<https://www.linkedin.com/in/gambarelli-luca/>
<https://www.researchgate.net/profile/Luca-Gambarelli>

CONTATTI:

Dipartimento di Economia “Marco Biagi”
Università di Modena e Reggio Emilia
Viale Berengario, 51
I-41121 Modena, Italia
phone 39-059-2056779
e-mail: luca.gambarelli@unimore.it, luca.gambarelli@gmail.com

POSIZIONE ATTUALE:

Novembre 2018 - Dottorato di Ricerca in “Lavoro, Sviluppo e Innovazione” presso Fondazione Marco Biagi, Università di Modena e Reggio Emilia. Tutor: Prof. S. Muzzioli
Febbraio 2018 - Docente a contratto presso Dipartimento di Economia “Marco Biagi” - Università di Modena e Reggio Emilia.

ESPERIENZE DI VISITING:

Settembre 2020 –
Dicembre 2020 Visitor presso Department of Data Analysis and Mathematical Modelling, Ghent University, Gent, Belgium, nell’ambito del Progetto di ricerca “Machine learning methods for measuring financial risk”

ASSEGNI DI RICERCA:

Gennaio 2016 - Gennaio 2018 “I MOMenti impliciti: misure, previsioni e indici (IMOM)”, *Dipartimento di Economia “Marco Biagi”, Università di Modena e Reggio Emilia*, Tutor: Prof. S. Muzzioli

CORSO DI STUDI:

Aprile 2015 Laurea Magistrale in Analisi, Consulenza e Gestione finanziaria (110/110 cum laude)
Dipartimento di Economia “Marco Biagi” - Università di Modena e Reggio Emilia
Tesi: "La skewness implicita nel mercato italiano", Relatore: Prof. S. Muzzioli

Settembre 2012 Laurea Triennale in Economia e Finanza
Dipartimento di Economia “Marco Biagi” - Università di Modena e Reggio Emilia

ATTIVITA' DIDATTICA:

Anno Accademico

2017-2018
2018-2019
2019-2020
2020-2021

Didattica integrativa nel corso: Metodi quantitativi per la finanza (ACGF), *Dipartimento di Economia “Marco Biagi”, Università di Modena e Reggio Emilia* (24 ore)

Anno Accademico

2015-2016
2016-2017
2017-2018
2018-2019
2019-2020
2020-2021

Didattica integrativa nel corso: Matematica e matematica finanziaria (CLEMI),
Dipartimento di Economia “Marco Biagi”, Università di Modena e Reggio Emilia (20 ore)

Anno Accademico
2017-2018

Didattica integrativa (esercitazioni) nel corso: Matematica e matematica finanziaria (CLEMI), *Dipartimento di Economia “Marco Biagi”, Università di Modena e Reggio Emilia* (72 ore)

ALTRE ATTIVITA':

Anno Accademico

2018-2019

2019-2020

Organizzatore del ciclo di Seminari del Corso di Dottorato in Lavoro, Sviluppo e Innovazione, *Fondazione "Marco Biagi", Università di Modena e Reggio Emilia*

Anno Accademico

2017-2018

Organizzatore del ciclo di Seminari di Economia Politica, *Dipartimento di Economia "Marco Biagi", Università di Modena e Reggio Emilia*

Rappresentante dei titolari di assegno di ricerca presso il Consiglio di *Dipartimento di Economia "Marco Biagi", Università di Modena e Reggio Emilia*

PARTECIPAZIONE A PROGETTI DI RICERCA:

- Progetto di ricerca interdisciplinare FAR 2019 "Risk assessment in the EU: new indices based on machine learning methods, Coordinatore: Prof. S. Muzzioli
- Progetto di ricerca interdisciplinare FAR2017 "The role of Asymmetry and Kolmogorov equations in financial Risk Modelling (ARM)", Coordinatore: Prof. S. Muzzioli
- Progetto di ricerca internazionale 2015-2017: "Implied Volatility and higher order moments: new measures and indexes of financial connectedness", Coordinatore: Prof. S. Muzzioli
- Progetto di ricerca nazionale FAR2015 "A Skewness index for Europe (EU-SKEW)" Coordinatore: Prof. S. Muzzioli

SEMINARI SU INVITO:

- 15 Maggio 2020, "Gender Wage Gap Evidence from Italy", *Fondazione "Marco Biagi" - Università di Modena e Reggio Emilia*.
- 11 Giugno 2019, "Applicazioni della logica Fuzzy: valutazione di politiche pubbliche e decisioni di investimento", *Fondazione "Marco Biagi" - Università di Modena e Reggio Emilia*.
- 12 Dicembre 2017, "Indices for financial market volatility obtained through fuzzy regression", *Dipartimento di Economia "Marco Biagi" - Università di Modena e Reggio Emilia*.
- 21 Febbraio 2017, "The R software for econometric applications on historical financial series", *Centro Studi Banca e Finanza (CEFIS), Modena*.
- 30 Novembre 2016, 7 Dicembre 2016, 14 Dicembre 2016, Ciclo di seminari sul tema "The R software for Finance applications", *Centro Studi Banca e Finanza (CEFIS), Modena*.
- 22 Novembre 2016, "Moments Risk and the Cross-section of Stock Returns", *Dipartimento di Economia "Marco Biagi" - Università di Modena e Reggio Emilia*.

PARTECIPAZIONE A CONFERENZE E WORKSHOP:

- 29-31 Gennaio 2020, *XXI Workshop on Quantitative Finance, Napoli (presentazione poster)*;
- 29 Novembre 2019, *Digital workshop on fuzzy methods, Fondazione Marco Biagi, Modena (relatore)*;

- 9-11 Settembre 2019, *43rd Annual Meeting of the Association for Mathematics Applied to Social and Economic Sciences (AMASES), Perugia (relatore)*;
- 12-14 Giugno 2019, *2019 FMA European Conference, Glasgow – Scotland (relatore)*;
- 24-26 Gennaio 2018, *XIX Workshop on Quantitative Finance, Roma (presentazione poster)*;
- 14-16 Settembre 2017, *41st Annual Meeting of the Association for Mathematics Applied to Social and Economic Sciences (AMASES), Cagliari (relatore)*;
- 9-12 Luglio 2017, *IEEE INTERNATIONAL CONFERENCE ON FUZZY SYSTEMS (FUZZ-IEEE 2017), Napoli*;
- 25-27 Gennaio 2017, *XVIII Workshop on Quantitative Finance, Milano (presentazione poster)*;
- 30 Settembre 2016, *Siena Finance Workshop, Siena (discussant)*.

ESPERIENZE LAVORATIVE:

<p>1 Ottobre 2012 – 26 Ottobre 2012</p>	<p>Creazione di un programma economico-finanziario su formato Excel per valutare la convenienza finanziaria di un costruendo investimento immobiliare con ricorso all'indebitamento bancario – <i>presso</i> Dott. Loris Lusetti (Consulente e sviluppatore di progetti immobiliari)</p>
<p>16 Aprile 2012 – 30 Giugno 2012</p>	<p>Compilazione e aggiornamento dei libri contabili obbligatori per le società di persone e di capitali – <i>presso</i> Dott. Massimiliano Folloni – Piazza Mazzini, 8 Novellara (RE) (Studio commercialista)</p>

CAPACITÀ E COMPETENZE INFORMATICHE:

Ottime conoscenze e competenze in ambito informatico, sia per quanto riguarda il pacchetto Office, sia per quanto riguarda i principali software econometrici (EViews, Matlab, R/RStudio, Stata).

CAPACITÀ E COMPETENZE SCIENTIFICHE:

Attitudine alla ricerca maturata nel corso della redazione della tesi di laurea, e successivamente mediante l'attività di ricerca svolta presso il Dipartimento di Economia Marco Biagi e le collaborazioni con Professori Bernard De Baets (Ghent University), Elyas Elyasiani (Temple University) e Silvia Muzzioli (Università degli studi di Modena e Reggio Emilia). L'attività di ricerca ha prevalentemente riguardato i seguenti temi:

- analisi del mercato azionario Italiano ed Europeo con riferimento alla stima dei momenti fisici ed impliciti, dei premi al rischio dei momenti e dei principali fattori di rischio, e all'implementazione di strategie di portafoglio;
- calcolo di indici di volatilità e misure di rischio per il mercato azionario italiano ed europeo attraverso la metodologia classica (CBOE), l'utilizzo di misure di volatilità "corridor" e di metodi di regressione fuzzy.

CAPACITÀ E COMPETENZE RELAZIONALI:

Ottime capacità relazionali; capacità di ascoltare, interagire, e lavorare in gruppo, acquisite sia in ambito lavorativo (in particolare nel corso dei progetti di ricerca condivisi con i colleghi, durante l'attività didattica e di supporto ai tesisti) che ludico-ricreativo (oratorio, campi estivi) e sportivo (Pallacanestro Novellara)

CAPACITÀ E COMPETENZE ORGANIZZATIVE:

Capacità di organizzazione, programmazione, gestione e autonomia nel proprio lavoro maturate sia nel corso delle esperienze lavorative (con particolare riferimento alla pianificazione dell'attività di ricerca e alla preparazione delle attività didattiche e seminari), sia attraverso la realizzazione di eventi e manifestazioni sportive e culturali in collaborazione con: Comune di Novellara, Oratorio Cristo Re, Pallacanestro Novellara.

PUBBLICAZIONI:

- (1) Elyasiani, E., Gambarelli, L., Muzzioli, S. (2021). "The skewness index: uncovering the relation with volatility and market returns". *Applied Economics*, DOI: 10.1080/00036846.2021.1884837
- (2) Elyasiani, E., Gambarelli, L., Muzzioli, S. (2020). "The use of option prices to assess the skewness risk premium". *Applied Economics*, 52(55), 6057-6074.
- (3) Muzzioli, S., Gambarelli, L., De Baets, B. (2020). "Option implied moments obtained through fuzzy regression". *Fuzzy Optimization and Decision Making*, 19, 211–238.
- (4) Elyasiani, E., Gambarelli, L., Muzzioli, S. (2020). "Moment risk premia and the cross-section of stock returns in the European stock market". *Journal of Banking & Finance*, 111, 105732.
- (5) Gambarelli, L., Muzzioli, S. (2019). "Risk-asymmetry indices in Europe". *DEMB Working Paper n. 157*.
- (6) Muzzioli, S., Gambarelli, L., De Baets, B. (2019). "Towards a fuzzy index of skewness". In: Fullér, R., Giove, S. and Masulli, F. (Eds.), *Fuzzy Logic and Applications*, Berlin: Springer, 164-175.
- (7) Elyasiani, E., Gambarelli, L., Muzzioli, S. (2018). "The Risk-Asymmetry Index as a New Measure of Risk". *Multinational Finance Journal*, 22(3/4), 173-210.
- (8) Muzzioli, S., Gambarelli, L., De Baets, B. (2018). "Indices for financial market volatility obtained through fuzzy regression". *International Journal of Information Technology & Decision Making*, 17(6), 1659-1691.

- (9) Elyasiani, E., Gambarelli, L., Muzzioli, S. (2018). “The properties of a skewness index and its relation with volatility and returns”. *DEMB Working Paper n. 133*.
http://merlino.unimo.it/campusone/web_dep/wpdemb/0133.pdf
- (10) Elyasiani, E., Gambarelli, L., Muzzioli, S. (2018). “The use of option prices in order to evaluate the skewness risk premium”. *DEMB Working Paper n. 132*.
http://merlino.unimo.it/campusone/web_dep/wpdemb/0132.pdf
- (11) Elyasiani, E., Gambarelli, L., Muzzioli, S. (2017). “The Information Content of Corridor Volatility Measures During Calm and Turmoil Periods”. *Quantitative Finance and Economics*, 2017, 1(4): 454-473. doi: 10.3934/QFE.2017.4.454.
- (12) Muzzioli S., Gambarelli L. De Baets B. (2017). “Towards a Fuzzy Volatility Index for the Italian Market”. *Proceedings of the IEEE INTERNATIONAL CONFERENCE ON FUZZY SYSTEMS (FUZZ-IEEE 2017)* DOI: 10.1109/FUZZ-IEEE.2017.8015446.
- (13) Elyasiani, E., Gambarelli, L., Muzzioli, S. (2016). “Moment Risk Premia and the Cross-Section of Stock Returns”. *DEMB Working Paper n. 103*. http://merlino.unimo.it/campusone/web_dep/wpdemb/0103.pdf
- (14) Elyasiani, E., Gambarelli, L., Muzzioli, S. (2016). “Fear or greed? What does a skewness index measure?”. *DEMB Working Paper n. 102*.
http://merlino.unimo.it/campusone/web_dep/wpdemb/0102.pdf
- (15) Elyasiani, E., Gambarelli, L., Muzzioli, S. (2016). “The Risk-Asymmetry index”. *CEFIN Working Paper n. 61*. http://www.cefin.unimore.it/new/wp-content/uploads/2016/12/Cefin_WP_61.pdf
- (16) Elyasiani, E., Gambarelli, L., Muzzioli, S. (2015). “Towards a skewness index for the Italian stock market”. *DEMB Working Paper n. 64*. http://merlino.unimo.it/campusone/web_dep/wpdemb/0064.pdf

INTERESSI DI RICERCA:

Stima di volatilità e momenti di ordine superiore, misure di rischio implicite nei prezzi delle opzioni, metodi di regressione fuzzy, costruzione di indici aggregati di rischio e di connessione finanziaria, machine learning e big data.

Autorizzo il trattamento dei miei dati personali ai sensi del Decreto Legislativo 30 giugno 2003, n. 196 “Codice in materia di protezione dei dati personali”.

Dichiaro che quanto indicato nel C.V. corrisponde al vero ai sensi del DPR 445/2000.