



UNIVERSITÀ

LUM

GIUSEPPE
DEGENNARO

Curriculum Vitae Europass

Dott. Riccardo De Blasis
Ricercatore a tempo determinato di Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie
(S.S.D. SECS-S/06; S.C. 13-D4)
Dipartimento di Management, Finanza e Tecnologia
Università LUM Giuseppe Degennaro
S.S. 100 km 18 – 70010, Casamassima (BA)



Contatti

Dipartimento di Management, Finanza e Tecnologia
Università LUM Giuseppe Degennaro
S.S. 100 km 18 – 70010, Casamassima (BA)
Email: deblasis@lum.it

Formazione e carriera

Dicembre 2020 – oggi Ricercatore a tempo determinato di Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie (S.S.D. SECS-S/06), LUM Jean Monnet, Casamassima (BA)

Maggio 2020 – Dicembre 2020 Assegnista di ricerca di Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie (S.S.D. SECS-S/06), Università Politecnica delle Marche, Ancona

Aprile 2019 – Aprile 2020 Lecturer in Finanza, University of Wollongong, Wollongong, Australia
Corsi nell'ambito della laurea magistrale in finanza applicata:
- FIN921 Finanza aziendale (2 sessioni)
- FIN959 Gestione del rischio d'impresa

Agosto 2017 – Aprile 2019 Casual Academic Teacher, University of Wollongong, Wollongong, Australia
Corso nell'ambito della laurea triennale in finanza applicata:
- COMM121 Statistica (5 sessioni)

Gennaio 2016 – Ottobre 2016 Tutor, Università di Chieti-Pescara
Corso nell'ambito della laurea triennale Economia e Management:
- Finanza Aziendale (1 sessione)

Ottobre 2015 – Maggio 2019 Ph.D., Dottorato di Ricerca in Accounting, Management and Finance (in co-tutela con la University of Wollongong, Australia)
Università di Chieti-Pescara "G. d'Annunzio", Chieti

Febbraio 2017 – Dicembre 2019 Ph.D., Dottorato di Ricerca in Finance
(in co-tutela con l'Università di Chieti-Pescara)
University of Wollongong, Australia

Tesi discussa: "Markov Chain Modelling in Finance: Stock Valuation and Price Discovery".

Luglio 2017 Summer School di Econometria c/o London School of Economics, Londra

Luglio 2016 Summer School di Market Microstructure c/o Università degli studi di Chieti-Pescara, nell'ambito del Dottorato di Ricerca in "Economia e Management".

Maggio 2016 Summer School di Econometria c/o Università degli studi di Chieti-Pescara, nell'ambito del Dottorato di Ricerca in "Economia e Management".



UNIVERSITÀ

LUM

GIUSEPPE
DEGENNARO**Esperienza professionale**

2019 – Partecipazione al gruppo di ricerca “Reliability measures for multi-state systems”
Fondi di Ateneo per la Ricerca Università “G. d’Annunzio”
Responsabile scientifico Prof. Guglielmo D’Amico

2018 – Partecipazione al gruppo di ricerca “Mathematical models of poverty”
Fondi di Ateneo per la Ricerca Università “G. d’Annunzio”
Responsabile scientifico Prof. Guglielmo D’Amico

Febbraio 2018 – Aprile 2019 Assistente alla ricerca c/o Rozetta Institute (ex Capital Market Cooperative Research Centre), Sydney
Analisi della microstruttura dei mercati finanziari da un punto di vista quantitativo

Febbraio 2017 – Febbraio 2018 Assistente alla ricerca c/o Derivative Market Research Centre (DMRC), Sydney
Analisi dei mercati derivati da un punto di vista qualitativo e quantitativo. Centro di ricerca finanziato dal Sydney Futures Exchange Fidelity Fund.

2007 – 2015 Collaboratore informatico e coordinatore di progetti EU c/o Regione Abruzzo

2003 – 2007 Addetto alla registrazione dati c/o Provincia di Roma

Istruzione e formazione

Dicembre 2019 Ph.D., Dottorato di Ricerca in Finance
(in co-tutela con l’Università di Chieti-Pescara)
University of Wollongong, Australia

Maggio 2019 Ph.D., Dottorato di Ricerca in Accounting, Management and Finance (in co-tutela con la University of Wollongong, Australia)
Università di Chieti-Pescara “G. d’Annunzio”, Chieti

2015 Laurea magistrale in Economia e Management
Università di Chieti-Pescara “G. d’Annunzio”

2013 Laurea triennale in Economia e Management
Università di Chieti-Pescara “G. d’Annunzio”

Lingue**Italiano**

Madrelingua

Inglese

Comprensione		Parlato		Scritto	
Ascolto	Lettura	Interazione orale	Produzione orale		
C2	C2	C2	C2	C2	C2

Capacità e competenze tecniche

L’attività professionale e di ricerca scientifica è orientata allo studio dei modelli matematici applicati ai problemi di natura economica e finanziaria, con riferimento ai modelli probabilistici e ai processi stocastici. In particolare, lo studio è rivolto ai modelli Markoviani univariati e multivariati. Tra gli altri ambiti di ricerca si evidenzia anche lo studio delle reti complesse con l’applicazione di tecniche di machine learning.

Ulteriori informazioni**Principali pubblicazioni scientifiche**

- De Blasis, R., Masala, G.B., Petroni, F. (2021) ‘A multivariate high-order Markov model for the income estimation of a wind farm’, Energies, MDPI

**Partecipazione a convegni in
qualità di relatore**

2. De Blasis, R. (2020) 'The Price Leadership Share: A new measure of price discovery in financial markets', *Annals of Finance*, 16(3):381-405. DOI: 10.1007/s10436-020- 00371-3
3. D'Amico, G., De Blasis, R., (2020) 'A Review of the Dividend Discount Model: From Deterministic to Stochastic Models', in: 'Statistical Topics and Stochastic Models for Dependent Data with Applications'. John Wiley & Sons, Ltd, pp. 47–67. DOI: 10.1002/9781119779421.ch3
4. D'Amico, G., & De Blasis, R. (2020) 'A multivariate Markov chain stock model', *Scandinavian Actuarial Journal*, 2020(4):272-291, DOI: 10.1080/03461238.2019.1661280
5. Barbu, V.S., D'Amico, G., & De Blasis, R. (2017), 'Novel advancements in the Markov chain stock model: analysis and inference', *Annals of Finance*, 13(2):125–152, DOI: 10.1007/s10436-017-0297-9

Ottobre 2019, FMA Annual Meeting, New Orleans

Titolo presentazione: "A new measure of price discovery in financial markets"

Giugno 2019, INFINITI, Glasgow

Titolo presentazione: "A new measure of price discovery in financial markets"

Aprile 2019, Financial Management and Corporate Governance, Sydney Titolo presentazione: "A new measure of price discovery in financial markets"

Attività di referaggio

The European Journal of Finance, 1 articolo

Financial Innovation, 1 articolo

Journal of Economic and Administrative Science, 1 articolo

Applied Modeling Techniques and Data Analysis (ISTE, Wiley), ed. Dimotilakis, Y.,

Karagrigoriou, A., Parpoula, Ch. and Skiadas, Ch., 1 articolo

SN Business & Economics, 1 articolo

Seminari

CMCRC Finance Seminar Cycle, Sydney

Seminari nell'ambito del corso di dottorato.

- Agosto 2017, "An empirical study into the impact of shareholders voting on the market value of a firm in Australia: the contribution of blockchain"

- Maggio 2018, "The effect of substantial shareholders on firm's value and stock price"

UOW Wednesday Research Lunch Seminars, Wollongong

Seminari su invito presso la Scuola di Accounting, Economics and Finance della University of Wollongong.

- Ottobre 2018, "An empirical study into the impact of shareholders voting on the market value of a firm in Australia: the contribution of blockchain"

- Aprile 2019, "Data Analysis with Python"

- Giugno 2019, "A new measure of price discovery in financial markets"

CMCRC Friday Tech Talk

Seminario su invito presso il CMCRC, Sydney.

- Febbraio 2019, "Introduction to Pandas and Dask for financial applications"

Award & Grants

2017, International Postgraduate Tuition Awards (IPTA) rilasciato da University of Wollongong

2019, Examiners' Commendation for Outstanding Thesis

Riconoscimento per tesi di dottorato eccellente, University of Wollongong

dal 2017 al 2019, Borsa di studio di Dottorato rilasciata dal Rozetta Institute (CMCRC), Sydney, Australia.