



Luca Scaffidi Domianello

Data di nascita: 24/05/1994 | **Nazionalità:** Italiana | **Numero di telefono:**
(+39) 3889378669 (Cellulare) | **Indirizzo e-mail:** luca.scaffidi@unict.it | **Sito web:**
<https://www.linkedin.com/in/lscaffd/> | **Indirizzo:** , , Italia (Abitazione)

ESPERIENZA LAVORATIVA

UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI CATANIA, DIPARTIMENTO DI ECONOMIA E IMPRESA – CATANIA
RICERCATORE A TEMPO DETERMINATO (RTD-A) – 01/02/2024 – ATTUALE

UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI FIRENZE, DIPARTIMENTO DI STATISTICA, INFORMATICA, APPLICAZIONI – FIRENZE, ITALIA
ASSEGNISTA DI RICERCA – 01/07/2023 – 31/01/2024

Metodi di apprendimento statistico per l'acquisizione di conoscenza da dati ad elevata dimensionalità provenienti da sensori (SSD: SECS-S/03)

UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI FIRENZE, DIPARTIMENTO DI STATISTICA, INFORMATICA, APPLICAZIONI – FIRENZE, ITALIA
ASSEGNISTA DI RICERCA – 01/06/2022 – 31/05/2023

Indicatori di monitoraggio per l'innovazione ed efficienza negli uffici giudiziari (SSD: SECS-S/01)

UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI MESSINA, DIPARTIMENTO DI ECONOMIA – MESSINA, ITALIA
CULTORE DELLA MATERIA – 09/2021 – 09/2024

Cultore della Materia in Statistica II (ssd SECS-S/01) nel corso di laurea Economia, Banca e Finanza (L-33).

ISTRUZIONE E FORMAZIONE

09/2018 – 12/2021 Messina, Italia
DOTTORATO DI RICERCA IN ECONOMICS, MANAGEMENT AND STATISTICS CURRICULUM STATISTICS, XXXIV CICLO Università degli studi di Messina, Dipartimento di Economia

Interessi di ricerca:

- time series;
- financial volatility;
- markov switching models;
- midas regressions;
- multivariate volatility models.

Voto finale Ottimo | **Tesi** Component Volatility Models: A MIDAS Approach (ssd SES-S/01). Relatore: Prof. Edoardo Otranto

08/2016 – 06/2018 Messina, Italia
LAUREA MAGISTRALE IN SCIENZE ECONOMICHE E FINANZIARIE CURRICULUM METODI QUANTITATIVI Università degli studi di Messina, Dipartimento di Economia

Voto finale: 110 e lode/110

Tesi: Efficienza e rendimento azionario delle banche. Risultati di un'analisi empirica nell'area EU-15

Relatore: Prof. Antonio Fabio Forgione

Disciplina: Risk Management

- Tecniche statistiche avanzate
- Matematica finanziaria
- Metodi statistici per la finanza
- Econometria avanzata
- Diritto bancario e finanziario
- Risk management

- Modelli demografici
- Economia monetaria e finanziaria

10/2016 – 11/2017

MASTER IN GLOBAL MARKETING, COMUNICAZIONE & MADE IN ITALY Fondazione Italia – USA, Centro Studi Comunicare l'Impresa

- Export credit risk management
- Circolazione internazionale delle merci
- Principi di marketing
- Contrattualistica internazionale
- Internazionalizzazione e Marketing

08/2013 – 06/2016 Messina, Italia

LAUREA IN ECONOMIA AZIENDALE CURRICULUM BANCA E INTERMEDIARI FINANZIARI Università degli studi di Messina, Dipartimento di Economia

Voto finale: 110 e lode/110

Tesi: I sistemi di garanzia dei depositi. Profili giuridici e innovazioni apportate dell'Unione Bancaria Europea

Relatore: Prof.ssa Brunella Russo

Disciplina: Diritto Bancario

- Economia aziendale
- Contabilità e bilancio
- Matematica generale e finanziaria
- Diritto privato, pubblico, commerciale e bancario
- Economia degli intermediari finanziari
- Economia e gestione delle aziende di credito
- Statistica

● **RETI E AFFILIAZIONI**

2022 – ATTUALE

Società Italiana di Statistica

2019 – 2021

The Society for Financial Econometrics (SoFiE)

2018 – 2024

Società Italiana di Econometria (SIeE)

● **PUBBLICAZIONI**

2025

[On using fuzzy clustering for detecting the number of states in Markov switching models](#)

Con E. Otranto

Annals of operation research.

2025

[Common Features in Volatilities: a New Multiplicative Error Model](#)

con E. Otranto

Nome della pubblicazione: 3rd italian conference on economic statistics

2025

[On Parameter Estimation of Distributions for Toroidal Data via Contrastive Learning: A Simulation Study](#)

con C. Di Nuzzo e S. Ingrassia

Nome della pubblicazione: Statistics for Innovation IV (SIS 2025)

2024

[Smooth and Abrupt Dynamics in Financial Volatility: The MS-MEM-MIDAS](#)

con G.M Gallo e E. Otranto

Oxford Bulletin of Economics and Statistics

2024

[HAR-based realized volatility clustering](#)

con P. D'Urso, R. Mattera e E. Otranto

Nome della pubblicazione: ICES 2024 - 2nd Italian Conference on Economic Statistics

2024

[A Fuzzy Clustering Approach to Detect the Number of States in Markov Switching Models](#)

con E. Otranto

Nome della pubblicazione: Methodological and Applied Statistics and Demography IV (SIS 2024)

2023

[Long and Short-Run Dynamics in Realized Covariance Matrices: A Robust MIDAS Approach](#)

con E. Otranto

Springer Proceedings in Mathematics & Statistics

2023

[STUDENT MOBILITY IN HIGHER EDUCATION: A DESTINATION-SPECIFIC LOCAL ANALYSIS](#)

Nome della pubblicazione: CLADAG 2023 BOOK OF ABSTRACTS AND SHORT PAPERS

2022

[Smooth and abrupt dynamics in financial volatility: the MS-MEM-MIDAS](#)

con G.M. Gallo e E. Otranto

Nome della pubblicazione: 51st Scientific Meeting of the Italian Statistical Society

2022

[Component Volatility Models: A MIDAS Approach](#)

Ph.D. Dissertation

2021

[The Incidence of Spillover Effects During the Unconventional Monetary Policies Era](#)

con D. Lacava

● **CONFERENZE E SEMINARI**

13/02/2025 – 14/02/2025 Napoli

Common features in volatilities: a new Multiplicative Error Model

3rd Italian Conference on Economic Statistics. Contributed Session: Advances in Time Series Forecasting for Socio-Economic Dynamics

14/12/2024 – 16/12/2024 Londra

Contrastive learning: A statistical approach

CFE-CMStatistics 2024. Organized Session: Advances in statistical learning and clustering (Invitato)

28/08/2024 – 30/08/2024 Catania

On assessing the properties of noise contrastive estimation: a simulation approach

8th Workshop on Models and Learning in Clustering and Classification (MBC2). Lightning talk session.

17/07/2024 – 20/07/2024 Genova

On the relationship between Markov switching models and fuzzy clustering: a nonparametric method to detect the number of states

The 52nd Scientific Meeting of the Italian Statistical Society. Contributed Session: Advances in clustering and classification

23/03/2024 – 24/03/2024 Online

Clustering of Italian higher education institutions based on a destination: Specific approach

HiTEc & CoDES 2024. Organized Session: Statistical Model and methods for education evaluation (Invitato)

11/09/2023 – 13/09/2023 Salerno

STUDENT MOBILITY IN HIGHER EDUCATION: A DESTINATION-SPECIFIC LOCAL ANALYSIS

14th Scientific Meeting of the Classification and Data Analysis Group. Contributed Session: GLM and Survival Models.

22/06/2022 – 24/06/2022 Caserta

Smooth and Abrupt Dynamics in Financial Volatility: the MS-MEM-MIDAS

51ST SCIENTIFIC MEETING OF THE ITALIAN STATISTICAL SOCIETY, Solicited Session: Statistics for finance: new models, new data.

25/05/2022 – 27/05/2022 Online

Long and Short run dynamics in Realized Covariance Matrices: a Robust MIDAS Approach

9th International Conference on Risk Analysis (ICRA9), Organized Session: High-frequency data in economics and finance (Invitato)

23/08/2020 – 23/08/2020 Online

Stock Market Volatility, Macroeconomic Fundamentals and Regime Switching

Presentation Session, SoFiE Financial Econometrics Summer School 2020

● **INTERESSI DI RICERCA**

Financial Econometrics, Conditional Volatility Models, MIDAS regressions, Markov Switching Models, Multivariate Volatility models, Financial Clustering, Spatial Interaction models, Non-normalized models

● **CORSI**

24/07/2023 – 29/07/2023

Methods in Time Series Econometrics

Summer School organizzata dalla SIdE (Società Italiana di Econometria) Topics: Markov Switching VAR, DSGE, Impulse Response functions

16/03/2023 – 17/03/2023

Short course on Financial time series and tail risk forecasting with Python

Corso organizzato dall'Università degli studi di Salerno, tenuto dal visiting professor Richard Gerlach. Topic: garch models, realized volatility measures, parametric e semi-parametric Value at Risk (VaR) e Expected Shortfall (ES).

07/2020 – 07/2020

The Econometrics of Mixed Frequency (Big) Data

Corso per Ph.D. students organizzato da SoFiE (The Society for Financial Econometrics) . Topic: Mixed Data Sampling Regressions, Nowcasting, Vector Autoregressive Models with Mixed Frequency Data, Quantile Regressions, Empirical Risk Minimization.

03/2020 – 04/2020

Introduzione all'ingegneria finanziaria

Corso professionalizzante organizzato dal Dipartimento di Economia e Impresa dell'Università di Catania, tenuto dal Ph.D. Vincenzo Corallo. Topic: fondamenti teorici di matematica per la finanza, linguaggio di programmazione Python, QuantLib.

07/07/2019 – 12/07/2019

Financial Time Series

Postgraduate Course organizzato dalla SIde (Società Italiana di Econometria). Topic: ARMA models, GARCH models, Multivariate GARCH models, Ex-post estimation of volatility, Risk measure, Backtesting.

● ALTRO

2022 – 2023

Guest Editor, Special Issue "Price Volatility in Financial and Commodity Markets", Journal of Risk and Financial Management

Link https://www.mdpi.com/journal/jrfm/special_issues/7ZCH7M1068

● INSEGNAMENTI ED ESERCITAZIONI

2024 – 2025

ANALYSIS OF MULTIDIMENSIONAL AND TIME SERIES DATA

A.A. 2024 - 2025. Docente di "Analysis of multidimensional and time series data" (63 ore, 9 CFU) per il corso di Laurea Magistrale in Economia e Politiche Pubbliche (LM-56), Dipartimento di Economia e Impresa, Università degli Studi di Catania

2023 – 2024

Statistica Applicata ed Econometria

A.A. 2023 - 2024. Esercitatore di Statistica Applicata ed Econometria - canale B (10 ore) per il corso di Laurea di Economia e Management (L-18), Dipartimento di Impresa e Management, LUISS Guido Carli, Roma.

2023 – 2024

Statistica Applicata ed Econometria

A.A. 2023 - 2024. Esercitatore di Statistica Applicata ed Econometria - canale E (10 ore) per il corso di Laurea di Economia e Management (L-18), Dipartimento di Impresa e Management, LUISS Guido Carli, Roma.

● PARTECIPAZIONE A COMITATI ORGANIZZATORI DI CONVEGNI SCIENTIFICI

13/02/2024 – 14/02/2024

2nd ITALIAN CONFERENCE ON ECONOMIC STATISTICS, 13-14 February, 2024, Firenze

7th Workshop on Models and Learning in Clustering and Classification 28-30 August 2024, Catania

● ATTIVITÀ DI REFERAGGIO

Attività di Reviewer per le seguenti riviste

International Journal of Forecasting, Advances in Data Analysis and Classification, Statistical Methods & Applications

● COMPETENZE

Padronanza del Pacchetto Office (Word Excel PowerPoint ecc) | R, Stata, Gretl, MatLab, Python, LaTeX

● COMPETENZE LINGUISTICHE

Lingua madre: **ITALIANO**

Altre lingue:

	COMPRENSIONE		ESPRESSIONE ORALE		SCRITTURA
	Ascolto	Lettura	Produzione orale	Interazione orale	
INGLESE	B2	B2	B2	B2	B2

Livelli: A1 e A2: Livello elementare B1 e B2: Livello intermedio C1 e C2: Livello avanzato

● **TRATTAMENTO DEI DATI PERSONALI**

Trattamento dei dati personali

Autorizzo il trattamento dei dati personali contenuti nel mio curriculum vitae in base all'art. 13 del D. Lgs. 196/2003 e all'art. 13 del [Regolamento UE 2016/679 relativo alla protezione delle persone fisiche con riguardo al trattamento dei dati personali](#).

Autorizzo il trattamento dei miei dati personali presenti nel CV ai sensi dell'art. 13 d. lgs. 30 giugno 2003 n. 196 - "Codice in materia di protezione dei dati personali" e dell'art. 13 GDPR 679/16 - "Regolamento europeo sulla protezione dei dati personali".