

Marco PATACCA

DATI PERSONALI

LUOGO E DATA DI NASCITA: Todi, Italia | 05 Gennaio 1990
TELEFONO: +39 339 7027941
EMAIL: marco.patacca@univr.it
LinkedIn: [linkedin.com/in/marcopatacca](https://www.linkedin.com/in/marcopatacca)

POSIZIONE ATTUALE

MAR 2020 - Presente **Ricercatore**
Università di Verona, Dipartimento di Scienze Economiche, Verona, Italia

POSIZIONI PRECEDENTI

Dic 2019 - Feb 2020 **Funzionario**
Ministero dell'Economia e delle Finanze, Dipartimento delle Finanze, Roma, Italia

Nov 2018 - Dic 2019 **Assegnista di Ricerca**
Léonard de Vinci Pôle Universitaire, Research Center, Parigi, Francia

ISTRUZIONE E FORMAZIONE

NOV 2015 - APR 2019 **Dottorato in ECONOMIA: Metodi Quantitativi per l'Economia**
(S.S.D. SECS-S/06 - XXXI Ciclo)
Dipartimento di Economia, Università degli Studi di Perugia, Perugia, Italia
Tesi: Essays on Bitcoin Price Dynamics
Supervisor: Prof.ssa Gianna FIGÀ TALAMANCA

SET 2013 - LUG 2015 **Laurea Magistrale in FINANZA E METODI QUANTITATIVI PER L'ECONOMIA**
110/110 magna cum Laude
Dipartimento di Economia, Università degli Studi di Perugia, Perugia, Italia
Tesi: "L'Extreme Value Theory nella Modellizzazione dei Rischi Catastrofali"
Relatore: Prof. Mauro PAGLIACCI

SET 2009 - MAG 2013 **Laurea Triennale in ECONOMIA DEI MERCATI E DEGLI INTERMEDIARI FINANZIARI**
voto 107/110
Dipartimento di Economia, Università degli Studi di Perugia, Perugia, Italia
Tesi: "L'Espansione di Cornish-Fisher nell'Analisi dei Rendimenti di un Portafoglio Finanziario" | Relatore: Prof.ssa Gianna FIGÀ TALAMANCA

SET 2004 - GIU 2009 **Diploma di Istruzione Secondaria Superiore ad Indirizzo Scientifico**
Liceo Scientifico "G. Marconi", Foligno, Italia

ESPERIENZE INTERNAZIONALI

GEN 2017 - MAR 2017 **Visiting Scholar** - Department of Statistics, *The London School of Economics and Political Science, London, UK*

Nov 2017 - Dic 2017 **Visiting Scholar** - Department of Finance and Risk Engineering, *New York University, New York, USA*

FORMAZIONE AGGIUNTIVA

- AGO 2016 **ARPM Bootcamp, Advanced Risk and Portfolio Management**
New York University, New York, USA
- LUG 2013 **EF Cambridge English Level Test**
EF International Language Centers, Dublin, Ireland
- OTT 2005 - OTT 2011 **Compimento Superiore di Saxofono**
Conservatorio di Musica di Perugia Istituzione di Alta Cultura, Perugia, Italia

INTERESSI DI RICERCA

Bitcoin, Blockchain Technology, FinTech, Systemic Risk, Extreme Value Theory

PUBBLICAZIONI

- Figà-Talamanca, Gianna and Marco Patacca. "Does Market Attention Affect Bitcoin Returns and Volatility?" *Decisions in Economics and Finance* 2019, Springer International Publishing. ISSN 1129-6569. doi: 10.1007/s10203-019-00258-7. URL <https://doi.org/10.1007/s10203-019-00258-7>.
- Bistarelli, Stefano, Alessandra Cretarola, Gianna Figà-Talamanca and Marco Patacca. "Model-based arbitrage in multi-exchange models for Bitcoin price dynamics." *Digital Finance* 2019, Springer International Publishing. ISSN 2524-6186. doi: 10.1007/s42521-019-00001-2. URL <https://doi.org/10.1007/s42521-019-00001-2>.
- Cretarola, Alessandra, Gianna Figà-Talamanca, and Marco Patacca. "Market attention and Bitcoin price modeling: theory, estimation and option pricing." *Decisions in Economics and Finance* 2019, Springer International Publishing. ISSN 1129-6569. doi: 10.1007/s10203-019-00262-x. URL <https://doi.org/10.1007/s10203-019-00262-x>
- Figà-Talamanca, Gianna and Marco Patacca. "Disentangling the relationship between Bitcoin and market attention measures" *Journal of Industrial and Business Economics* 2019, Springer International Publishing. ISSN 0391-2078. doi: 10.1007/s40812-019-00133-x. URL <https://doi.org/10.1007/s40812-019-00133-x>.
- Bistarelli, Stefano, Alessandra Cretarola, Gianna Figà-Talamanca, Ivan Mercanti, and Marco Patacca. "Is Arbitrage Possible in the Bitcoin Market? (Work-In-Progress Paper)." In: Coppola M., Carlini E., D'Agostino D., Altmann J., Bañares J. (eds) *Economics of Grids, Clouds, Systems, and Services. GECON 2018. Lecture Notes in Computer Science*, vol 11113, pp. 243-251. Springer, Cham. ISBN 978-3-030-13341-2. doi: 10.1007/978-3-030-13342-9_21. URL https://doi.org/10.1007/978-3-030-13342-9_21.
- Cretarola, Alessandra, Gianna Figà-Talamanca, and Marco Patacca. "A Continuous Time Model for Bitcoin Price Dynamics." *Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance. MAF 2018*, Corazza, M., Durbán, M., Grané, A., Perna, C., Sibillo, M. (Eds.), Springer International Publishing AG, part of Springer Nature 2018, pp. 273-277. ISBN 978-3-319-89823-0. doi: 10.1007/978-3-319-89824-7_49. URL https://doi.org/10.1007/978-3-319-89824-7_49.

CONFERENZE, SEMINARI E WORKSHOP

- Settembre 09-11, 2019. **43rd Annual Meeting of the AMASES "Association for Mathematics Applied to Social and Economic Sciences"**, University of Perugia, Perugia, Italy. Oral presentation, "Cointegration analysis of cryptocurrencies".
- Giugno 23-26, 2018. **30th European Conference on Operational Research (EURO 2019)**, University College Dublin, Dublin, Ireland. Oral presentation, "Cointegration analysis of cryptocurrencies".
- Giugno 15-16, 2019. **Cryptocurrency Research Conference 2019**, Southampton Business School, Southampton, United Kingdom. Oral presentation, "Regime switching analysis of cryptocurrencies".
- Novembre 22, 2018. **Université Paris Diderot**, Paris, France. Cryptofinance seminar, "Bitcoin prices and market attention".
- Settembre 13-15, 2018. **42nd Annual Meeting of the AMASES "Association for Mathematics Applied to Social and Economic Sciences"**, University of Naples Parthenope, Napoli, Italy. Oral presentation, "A

Sentiment-Based Model for the Bitcoin: Theory, Estimation and Option Pricing”.

- Luglio 08-11, 2018. **29th European Conference on Operational Research (EURO 2018)**, Valencia, Spain. Oral presentation, “Does market attention affect Bitcoin returns and volatility?”.
- Maggio 11, 2018. **Department of Statistics and Quantitative Methods, Milano Bicocca University**, Milano, Italy. Doctoral seminar, “Bitcoin prices and market attention ”.
- Gennaio 24-26, 2018. **XIX Workshop on Quantitative Finance 2018**, University of Roma Tre, Roma, Italy. Poster presentation, “Does market attention affect Bitcoin returns and volatility?”.
- Gennaio 25-27, 2017. **XVIII Workshop on Quantitative Finance 2017**, University of Milano-Bicocca, Milano, Italy. Poster presentation, “Bitcoins prices and market sentiment indicators”.

PREMI

AMASES 2018 Best Paper Award, Il paper “A Sentiment-Based Model for the Bitcoin: Theory, Estimation and Option Pricing” è stato classificato tra i 4 finalisti per l’AMASES 2018 Best Paper Award.

ESPERIENZE DIDATTICHE

| | |
|---------------------|---|
| GEN 2019 - MAG 2019 | Teaching Assistant di ECONOMETRICS <i>Ecole Supérieure d’Ingénieurs Léonard de Vinci, Paris, France</i> |
| OTT 2018 - DIC 2018 | Teaching Assistant di BASIC CALCULUS <i>Università degli Studi di Perugia, Perugia, Italia</i> |
| SET 2017 - OTT 2017 | Teaching Assistant di BASIC CALCULUS <i>Università degli Studi di Perugia, Perugia, Italia</i> |
| OTT 2016 - FEB 2017 | Teaching Assistant di BASIC CALCULUS <i>Università degli Studi di Perugia, Perugia, Italia</i> |
| OTT 2015 - FEB 2016 | Teaching Assistant di BASIC CALCULUS <i>Università degli Studi di Perugia, Perugia, Italia</i> |
| MAR 2015 - GEN 2015 | Teaching Assistant di FINANCIAL MATHEMATICS <i>Università degli Studi di Perugia, Perugia, Italia</i> |

LINGUE

ITALIANO: Madrelingua
INGLESE: C1

COMPUTER SKILLS

Software: Matlab, Mathematica, R, SAS, L^AT_EX
Office and Altri: Word, Excel, PowerPoint, Windows

Marzo 03, 2020