

ALLEGATO B

UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI MILANO

selezione pubblica per n. 1 posto/i di Ricercatore a tempo determinato ai sensi dell'art.24, comma 3, lettera b) della Legge 240/2010 per il settore concorsuale 13/B4, settore scientifico-disciplinare SECS-P/11 - Economia degli Intermediari Finanziari presso il Dipartimento di ECONOMIA, MANAGEMENT E METODI QUANTITATIVI, (avviso bando pubblicato sulla G.U. n. 104 del 31/12/2021) Codice concorso 4946

Giulio Anselmi **CURRICULUM VITAE**

(N.B. IL CURRICULUM NON DEVE ECCEDERE LE 30 PAGINE E DEVE CONTENERE GLI ELEMENTI CHE IL CANDIDATO RITIENE UTILI AI FINI DELLA VALUTAZIONE.

LE VOCI INSERITE NEL FACSIMILE SONO A TITOLO PURAMENTE ESEMPLIFICATIVO E POSSONO ESSERE SOSTITUITE, MODIFICATE O INTEGRATE

INFORMAZIONI PERSONALI (NON INSERIRE INDIRIZZO PRIVATO E TELEFONO FISSO O CELLULARE)

COGNOME	ANSELM
NOME	GIULIO
DATA DI NASCITA	04 FEBBRAIO 1986

TITOLI

TITOLO DI STUDIO

(indicare la Laurea conseguita inserendo titolo, Ateneo, data di conseguimento, ecc.)

Laurea Magistrale in Economia dei mercati e degli Intermediari Finanziari, Università Cattolica del Sacro Cuore, Milano, 10 dicembre 2010, Votazione: 110L/110, Titolo della tesi: "Market Microstructure in High Frequency Finance: Evidences from Quote Driven Market", Relatore: Prof. Paolo Gualtieri.

Master of Science in Mathematical Trading & Finance, Bayes/Cass Business School, Londra, Regno Unito, 1 settembre 2014, Votazione: Distinction.

TITOLO DI DOTTORE DI RICERCA O EQUIVALENTI, OVVERO, PER I SETTORI INTERESSATI, DEL DIPLOMA DI SPECIALIZZAZIONE MEDICA O EQUIVALENTE, CONSEGUITO IN ITALIA O ALL'ESTERO

(inserire titolo, ente, data di conseguimento, ecc.)

Dottorato di ricerca in Mercati e Intermediari Finanziari (XXVIII ciclo), Università Cattolica del Sacro Cuore, Milano, 3 marzo 2016, Titolo della tesi: "Essays on Option Implied Volatility Risk Measures for Banks" Coordinatore: Prof. Alberto Banfi.

CONTRATTI DI RICERCA, ASSEGNI DI RICERCA O EQUIVALENTI

(per ciascun contratto stipulato, inserire università/ente, data di inizio e fine, ecc.)

Assegno di ricerca (Legge 240/2010), Università Cattolica del Sacro Cuore, Milano, data di inizio: 1 settembre 2018, data di fine: 31 agosto 2022.

ATTIVITÀ DIDATTICA A LIVELLO UNIVERSITARIO IN ITALIA O ALL'ESTERO

(inserire anno accademico, ateneo, corso laurea, numero ore, ecc.)

2021/2022, Università Cattolica del Sacro Cuore, Milano, Laurea Triennale in Economia dei Mercati e degli Intermediari Finanziari, Corso di Strumenti Derivati, 41 ore, Docente.

2021/2022, 2020/2021, 2019/2020, 2018/2019, 2017/2018, Università Cattolica del Sacro Cuore, Milano, Laurea Magistrale in Banking and Finance, Corso di Derivatives Securities Pricing, 10 ore, Esercitatore.

2021/2022, 2020/2021, 2019/2020, 2018/2019, 2017/2018, Università Cattolica del Sacro Cuore, Milano, Laurea Magistrale in Banking and Finance, Corso di Market Microstructure, 10 ore, Esercitatore.

2021/2022, 2020/2021, 2019/2020, 2018/2019, Università Cattolica del Sacro Cuore, Milano, Laurea Magistrale in Economia dei Mercati e degli Intermediari Finanziari, Corso di Strumenti Derivati (corso avanzato), 10 ore, Esercitatore.

2020/2021, Università Cattolica del Sacro Cuore, Milano, Laurea Triennale in Economia dei Mercati e degli Intermediari Finanziari, Corso di Strumenti Derivati, 26 ore, Docente.

ATTIVITÀ DI RELATORE A CONGRESSI E CONVEGNI NAZIONALI E INTERNAZIONALI

(inserire titolo congresso/convegno, data, ecc.)

1. Future Finance and Economics Association (FFEA) 2022 CryptoAssets and Digital Assets Investment Conference, 7-8 aprile 2022, Rennes School of Business, Rennes, Francia.
2. EFMA 2021 Annual meeting, 30 giugno-3 luglio 2021, Università di Leeds, Leeds, Regno Unito.
3. UCSC-BGU-BIU seminar, 13 gennaio 2021, online.
4. European Securities Market Authority Web-seminar, 27 maggio 2020, online.
5. Securities markets: trends, risks and policies, CONSOB - ESMA, 12 marzo 2020, Università Bocconi, Milano [il paper è stato accettato per la presentazione, il convegno è stato annullato per l'emergenza sanitaria ed è stato sostituito da una presentazione organizzata da CONSOB a dicembre 2020].
6. Convegno estivo ADEIMF 2019, 13-14 settembre 2019, Università degli Studi di Torino, Torino.

PRODUZIONE SCIENTIFICA

PUBBLICAZIONI SCIENTIFICHE

(per ciascuna pubblicazione indicare: nomi degli autori, titolo completo, casa editrice, data e luogo di pubblicazione, codice ISBN, ISSN, DOI o altro equivalente)

1. Anselmi G., M. Nimalendran e G. Petrella, "Order Flow Fragmentation and Flight-To-Transparency During Stressed Market Conditions: Evidence From COVID-19", Finance Research Letters, 44 (2022) 102101, Elsevier Inc., doi: 10.1016/j.frl.2021.102101
2. Anselmi G., "Volatility Risk Measures and Banks' Leverage", in Handbook of Investment Analysis, Portfolio Management, and Financial Derivatives - World Scientific Publishing Ltd., Regno Unito, in corso di pubblicazione
3. Anselmi G. e G. Petrella, "Covid, Volatilità e Rischio di Mercato", in Covid 19 - Conseguenze e Rischi per il Sistema Bancario, Osservatorio Monetario, Associazione per lo Sviluppo degli Studi di Banca e Borsa (ASSB), Milano, 1 (7) ISSN: 1592-5684

4. Anselmi G. e G. Petrella, "Regulation and Stock Market Quality: The Impact of MiFID II Provision on Research Unbundling", *International Review of Financial Analysis*, 76 (2021) 101788, Elsevier Inc., doi: 10.1016/j.irfa.2021.101788
5. Anselmi G., "Illiquid Assets and the Opacity Discount in Banks' Valuation", *Review of Pacific Basin Financial Markets and Policies*, 24 (4) (2021) 2150028, World Scientific Publishing Co., doi: 10.1142/S0219091521500284
6. Anselmi G., "Volatility Measures, Liquidity and Credit Loss Provision during Period of Financial Distress", *Journal of Financial Management, Markets and Institutions*, 6 (2) (2018) 1850006, World Scientific Publishing Co., doi: 10.1142/S2282717X18500068
7. Anselmi G., "Essays on Option Implied Volatility Risk Measures for Banks", *Tesi di Dottorato XXVIII Ciclo*, Università Cattolica del Sacro Cuore, <http://hdl.handle.net/10280/10402>

Data

17/02/2022

Luogo

Milano

TABELLA RIASSUNTIVA - TITOLI

1	Dottorato di ricerca o equipollente conseguito in Italia o all'Estero	Dottorato di ricerca in Mercati e Intermediari Finanziari (XXVIII ciclo), Università Cattolica del Sacro Cuore, Milano, 3 marzo 2016
2	Attività didattica a livello universitario in Italia o all'Estero	Università Cattolica del Sacro Cuore, Milano, Laurea Triennale in Economia dei Mercati e degli Intermediari Finanziari, Corso di Strumenti Derivati, 41 ore (26 ore nell'AA 2020/2021), <u>2 annualità</u> , Docente. Università Cattolica del Sacro Cuore, Milano, Laurea Magistrale in Banking and Finance, Corso di Derivatives Securities Pricing e Corso di Market Microstructure, 20 ore, <u>5 annualità</u> , Esercitatore. Università Cattolica del Sacro Cuore, Milano, Laurea Magistrale in Economia dei Mercati e degli Intermediari Finanziari, Corso di Strumenti Derivati (corso avanzato), 10 ore, <u>4 annualità</u> , Esercitatore.
3	Attività di formazione o di ricerca presso qualificati istituti italiani o stranieri	Assegno di ricerca (Legge 240/2010), Università Cattolica del Sacro Cuore, Milano, data di inizio: 1 settembre 2018, <u>4 annualità</u> , data di fine: 31 agosto 2022.
4	Attività di formazione o di ricerca presso qualificati istituti italiani o stranieri	MSc in Mathematical Trading & Finance, Bayes/Cass Business School, Londra, Regno Unito, 1 settembre 2014, Votazione: Distinction.
4	Attività di relatore a congressi e convegni nazionali e internazionali	1. FFEA 2022 CryptoAssets and Digital Assets Investment Conference, 7-8 aprile 2022, Rennes School of Business, Rennes, Francia. 2. EFMA 2021 Annual meeting, 30 giugno-3 luglio 2021, Università di Leeds, Leeds, Regno Unito. 3. UCSC-BGU-BIU seminar, 13 gennaio 2021, online. 4. ESMA Web-seminar, 27 maggio 2020, online. 5. Securities markets: trends, risks and policies, CONSOB - ESMA, 12 marzo 2020, Università Bocconi, Milano [il paper è stato accettato per la presentazione, il convegno è stato annullato per l'emergenza sanitaria ed è stato sostituito da una presentazione organizzata da CONSOB a dicembre 2020]. 6. Convegno estivo ADEIMF 2019, 13-14 settembre 2019, Università degli Studi di Torino, Torino.

TABELLA RIASSUNTIVA - PRODUZIONE SCIENTIFICA

1	Articolo su libro internazionale (primo autore)	Anselmi G., "Volatility Risk Measures and Banks' Leverage", in Handbook of Investment Analysis, Portfolio Management, and Financial Derivatives - World Scientific Publishing Ltd., Regno Unito, in corso di pubblicazione
2	Articolo in rivista internazionale (primo autore)	1. Anselmi G., M. Nimalendran e G. Petrella, "Order Flow Fragmentation and Flight-To-Transparency During Stressed Market Conditions: Evidence From COVID-19", Finance Research Letters, 44 (2022) 102101, Elsevier Inc., doi: 10.1016/j.frl.2021.102101 2. Anselmi G. e G. Petrella, "Regulation and Stock Market Quality: The Impact of MiFID II Provision on Research Unbundling", International Review of Financial Analysis, 76 (2021) 101788, Elsevier Inc., doi: 10.1016/j.irfa.2021.101788 3. Anselmi G., "Illiquid Assets and the Opacity Discount in Banks' Valuation", Review of Pacific Basin Financial Markets and Policies, 24 (4) (2021) 2150028, World Scientific Publishing Co., doi: 10.1142/S0219091521500284 4. Anselmi G., "Volatility Measures, Liquidity and Credit Loss Provision during Period of Financial Distress", Journal of Financial Management, Markets and Institutions, 6 (2) (2018) 1850006, World Scientific Publishing Co., doi: 10.1142/S2282717X18500068
3	Saggio in opera collettanea a diffusione nazionale (primo autore)	Anselmi G. e G. Petrella, "Covid, Volatilità e Rischio di Mercato", in Covid 19 - Conseguenze e Rischi per il Sistema Bancario, Osservatorio Monetario, Associazione per lo Sviluppo degli Studi di Banca e Borsa (ASSB), Milano, 1 (7) ISSN: 1592-5684
4	Tesi di dottorato	Anselmi G., "Essays on Option Implied Volatility Risk Measures for Banks", Tesi di Dottorato XXVIII Ciclo, Università Cattolica del Sacro Cuore, http://hdl.handle.net/10280/10402