

CAROLINA CASTAGNETTI

Dipartimento di Scienze Economiche e Aziendali
Università di Pavia
Via San Felice 5, 27100 Pavia
Tel: 0382 986217
e-mail: carolina.castagnetti@unipv.it

POSIZIONE ACCADEMICA

Ottobre 2023: Professoressa Ordinaria in Economia Politica, Dipartimento di Scienze Economiche e Aziendali, Università di Pavia.

Ottobre 2021: Professoressa Ordinaria in Econometria, Dipartimento di Scienze Economiche e Aziendali, Università di Pavia.

Giugno 2019: Abilitazione nazionale come professoressa ordinaria in Econometria.

Maggio 2019: Abilitazione nazionale come professoressa ordinaria in Economia Politica.

Maggio 2019: Abilitazione nazionale come professoressa ordinaria in Politica Economica.

Agosto 2015: Professoressa Associata in Economia Politica, Dipartimento di Scienze Economiche e Aziendali, Università di Pavia.

Dal 2011: Componente del Collegio Docenti del Dottorato In Economia LASER, ora Dottorato in Economics Milano-Pavia

Dicembre 2009: Ricercatrice confermata in Econometria, Dipartimento di Economia Politica e Metodi Quantitativi, Università di Pavia.

Dicembre 2004: Ricercatrice non confermata in Econometria, Dipartimento di Economia Politica e Metodi Quantitativi, Università di Pavia. 2003-2004: Docente a Contratto, Dipartimento di Economia Politica e Metodi Quantitativi, Università di Pavia.

1997-2000: Cultrice della Materia e Assistente di Ricerca, Istituto di Economia e Finanza, Università Cattolica di Milano.

INCARICHI ISTITUZIONALI

Da novembre 2019 a novembre 2023, Presidente del Comitato Unico di Garanzia dell'Università di Pavia (CUG)

ATTIVITÀ PROFESSIONALE

Da settembre 2016 a dicembre 2020 *Academic consultant* per CEG (*Competition Economists Group*) Europe. Con CEG attività di consulenza per analisi su presunta attività di cartello e scambio di informazioni su diversi mercati. Analisi su meccanismi d'asta per la fornitura di servizi; definizione di modelli econometrici dinamici per l'analisi di effetti con metodi *time series* su prezzi di beni semilavorati.

Da marzo 2000 a dicembre 2004, analista quantitativo presso Fideuram SGR (Milano). Attività all'interno del gruppo quantitativo, settore obbligazionario, nell'ambito della progettazione di portafogli a minimo tracking error e di strategie attive per la gestione sull'area euro e americana. Responsabile dello sviluppo del modello di rischio per la parte monetaria e per la parte obbligazionaria dell'area Euro. Sviluppo di un modello previsivo per gli optical swap spread. Implementazione di un sistema di performance attribution per i corporate europei. Analisi di carry trade per i crediti. Sviluppo di un modello per il calcolo del SaR di breve periodo per il portafoglio assicurativo di Fideuram Vita.

FORMAZIONE

Dottorato di Ricerca in Economia, Università degli Studi di Pavia, febbraio 2001
Master in Economics, Universitat Pompeu Fabra, Barcellona (Spain), luglio 1997
Master in Applied Economics, CORIPE (Università di Torino), luglio 1996.
Laurea in Economia e Commercio, Università Cattolica di Milano, ottobre 1995.

ATTIVITÀ DIDATTICA

Insegnamenti Dottorato

A.A. 2018-2023. *Topics in panel data models* (20 ore) per il dottorato in Economics dell'Università di Milano-Pavia
A.A. 2017-2018. *Topics in panel data models* (12 ore) per il dottorato Laser dell'Università di Milano-Pavia
A.A. 2015-2016. Panel Data Analysis (15 ore) per il dottorato DREAMT dell'Università di Pavia
A.A. 2013-2015 *Econometrics I* (9 ore) per il dottorato DREAMT dell'Università di Pavia
A.A. 2012-2013. *Econometrics I* (16 ore) per il dottorato DREAMT dell'Università di Pavia
A.A. 2011-2012. *Introductory Statistics and Econometrics* per il Dottorato in Economia Diritto e Istituzioni della scuola superiore IUSS di Pavia

Insegnamenti Laurea Specialistica

A.A. 2022-in corso Titolare del Corso *Microeconometrics* (66 ore), Università degli Studi di Pavia, Dipartimento di Scienze Economiche e Aziendali.
A.A. 2016-2022. Titolare del Corso *Applied Economics and Econometrics* (66 ore), Università degli Studi di Pavia, Dipartimento di Scienze Economiche e Aziendali.
A.A. 2017-2018. Titolare del *Lab in Applied Econometrics* (22 ore), Università degli Studi di Pavia, Dipartimento di Scienze Economiche e Aziendali.
A.A. 2011-2016. Titolare del Corso *Applied Econometrics* (44 ore), Università degli Studi di Pavia, Dipartimento di Scienze Economiche e Aziendali.
A.A. 2013-2015. Co-titolare del Corso *Mathematical Methods for Business* (22 ore), Università degli Studi di Pavia, Dipartimento di Scienze Economiche e Aziendali.
A.A. 2010-2012. Titolare del Corso *Advanced Econometrics* (66 ore) , Università degli Studi di Pavia, Facoltà di Economia
A.A. 2003-2004. *Macroeconometria* (18 ore) , Università degli Studi di Pavia, Facoltà di Economia

Insegnamenti Master

A.A. 2005-2006. 12 ore di lezione all'interno del progetto *Training Course on Economic modelling, analysing and forecasting*. Follow-up afferente al Master in Cooperazione dello IUSS di Pavia.
A.A. 2004-2005. 12 ore di lezione all'interno del progetto *Training Course on Economic modelling, analysing and forecasting* afferente al Master in Cooperazione dello IUSS di Pavia.

Insegnamenti Laurea Triennale

A.A. 2023-in corso. Titolare del Corso di *Economia del Lavoro* (44 ore), Università degli Studi di Pavia, Dipartimento di Scienze Economiche e Aziendali.
A.A. 2022-in corso. Titolare del Corso di Elementi di Psicometria per le scienze umane (36 ore), Università degli Studi di Pavia, Dipartimento di Studi Umanistici.
A.A. 2019-2022. Titolare del Corso di *Economia del Lavoro* (44 ore), Università degli Studi di Pavia, Dipartimento di Scienze Economiche e Aziendali.
A.A. 2018-2019. Titolare del Corso di *Economia del Lavoro* (66 ore), Università degli Studi di Pavia, Dipartimento di Scienze Economiche e Aziendali.
A.A. 2015-2017. Titolare del Corso di *Econometria* (44 ore), Università degli Studi di Pavia, Dipartimento di Scienze Economiche e Aziendali.

A.A. 2004-2009. Titolare del Corso *Econometria dei Mercati Finanziari* (36 ore), Università degli Studi di Pavia, Facoltà di Economia.

A.A. 2004-2009. Titolare del Corso *Economia dei Mercati Monetari e Finanziari* (36 ore), Università degli Studi di Pavia, Facoltà di Economia.

PREMI E BORSE DI STUDIO

Vincitrice della borsa di studio bandita dall'università Cattolica del Sacro Cuore di Milano per il perfezionamento degli studi all'estero per l'anno accademico 1996-97.

Vincitrice della borsa di studio "Ezio Tarantelli" per il perfezionamento degli studi all'estero per l'anno accademico 1996-97 della Fondazione per gli Interventi Sociali della Cassa di Risparmio di Piacenza e Vigevano.

Idoneità della Banca d'Italia (terza classificata) per la borsa di studio "Domenico Menichella" (1996-97).

Vincitrice della Borsa di studio "Giovani Ricercatori" dell'Università di Pavia (1999-2000).

PUBBLICAZIONI

RIVISTE INTERNAZIONALI

1. Changes in the gender pay gap over time: the case of West Germany, *Journal for Labour Market Research*, (con M. Bonaccolto-Toepfer e L. Rosti), N. 57, 2023.
2. Understanding the public-private sector wage gap in Germany: New evidence from a Fixed Effects quantile Approach, *Economic Modelling*, (con M. Bonaccolto-Toepfer e S. Pruemer), N. 116, November 2022.
3. Discriminate me – if you can! The Disappearance of the Gender Pay Gap among Public-Contest Selected Employees in Italy. *Gender, Work & Organization*, (con L. Rosti e M. Töpfer), 27: 1040-1076, 2020
4. The Age Pay Gap between Young and Older Employees in Italy: Perceived or Real Discrimination against the Young?, Polachek, S.W. and Tatsiramos, K. (Ed.) *Change at Home, in the Labor Market, and On the Job (Research in Labor Economics, Vol. 48)*, Emerald Publishing Limited, pp. 195-221, (con L. Rosti e M. Töpfer), 2020.
5. The Public-Private Sector Wage Differential Across Gender in Italy: a New Quantile-Based Decomposition Approach. *Economics Bulletin*, (con L. Rosti e M. Töpfer), 39: 2533-2539, 2019.
6. A two-stage estimator for heterogeneous panel models with common factors. *Econometrics and Statistics*, (con E. Rossi e L. Trapani), 11: 63-82, 2019.
7. Understanding the gender wage-gap differential between the public and private sectors in Italy: A quantile approach, *Economic Modelling*, (con M.L. Giorgetti), 78:240-261, 2019.
8. A novel approach for testing the parity relationship between CDS and credit spread, *Economics Letters*, vol. 172, 115-117, 2018.
9. Overeducation and the Gender Pay Gap in Italy, *International Journal of Manpower*, (con L. Rosti and M. Toepfer), vol. 39, 710-730, 2018.

10. Testing for no factor structures: on the use of average-type and Hausman-type statistics, (con E. Rossi e L. Trapani), *Economics Letters*, vol. 130, 66-68, 2015.
11. Inference on Factor Structures in Heterogeneous Panels (con E. Rossi e L. Trapani), *Journal of Econometrics*, vol. 184, 145-157, 2015.
12. R&D, innovation and knowledge spillovers: an empirical reappraisal based on cross sectional dependence, (con A. Bottasso e M. Conti), *Journal of Applied Econometrics*, vol. 30, 350-352, 2015.
13. Euro Corporate Bonds Risk Factors (con E. Rossi), *Journal of Applied Econometrics*, vol. 28, 372-391, 2013.
14. And Yet they Co-Move! Public Capital and Productivity in OECD (con A. Bottasso e M. Conti), *Journal of Policy Modeling*, vol. 35, 713-729, 2013.
15. Gender stereotyping and wage discrimination among Italian graduates (con L. Rosti), *Gender & Society*, vol. 27, 630-658, 2013.
16. Shortening university career fades the signal away. Evidence from Italy, *Applied Economics Research Bulletin, Berkeley Journal*, forthcoming (con S. Dal Bianco e L. Rosti).
17. Who skims the cream of the Italian graduate crop? Wage-employment versus self-employment (con L. Rosti), *Small Business Economics*, vol. 36, 223-234, 2011.
18. Effort allocation in tournaments: the effect of gender on academic performance in Italian universities (con L. Rosti), *Economics of Education Review*, vol. 28, 357-369, 2009.
19. Educational Performance as Signalling Device: Evidence from Italy (con F. Chelli e L. Rosti), *Economics Bulletin*, vol. 9, 1-7, 2005.
20. Estimating the Risk Premium of Swap Spreads. two Econometric GARCH-based Techniques, *Applied Financial Economics*, vol. 14, 93-104, 2004.

CAPITOLI DI LIBRO

21. A picture of the Italian manufacturing sectors as a first step to design proper industrial policies, in Giorgetti M.L. e Zirulia L. "Digital transition and the European industrial policy" Milano University Press, forthcoming (con C. Cappelli, F. Di Iorio, S. De Santis, M.L. Giorgetti e R. Monducci)
22. The gender gap in academic achievements of Italian graduates, in Davies S. A. (ed.) "Gender Gap: Causes, Experiences and Effects" Nova Science Publishers, Inc., NY, 2010 (con L. Rosti)

ATTI DI CONVEGNO

23. Gender and Innovation (con M.L. Giorgetti e M.L. Mancusi), in Quality Research and Innovation through Equality, Gender Summit Europe 4, Abstract Compendium, 2014

WORKING PAPERS E ALTRE PUBBLICAZIONI

- The COVID-19 pandemic: A threat to higher education? (con M. Bonaccolto-Toepfer), FRIEDRICH-ALEXANDER-UNIVERSITÄT ERLANGEN-NÜRNBERG, Discussion Paper, N. 117, April 2021 (revisione gennaio 2023) **R&R**
- *Differenziali retributivi tra laureati e laureate* (con L. Rosti) (**Ingenere** 2010).

WORK IN PROGRESS

- Learning a Panel Data (con F.Ghezzi, E. Rossi e L. Trapani)
- A Simple Procedure For Decomposing Changes in Wage Distributions Using Quantile Regression (con M.Bonaccolto-Toepfer)
- A multifactor model for credit spread changes.

INCARICHI AMMINISTRATIVI

2023-in corso: Componente della commissione Paritetica di Dipartimento

2021-in corso: Componente del gruppo riesame della Laurea Triennale in Economia.

2013-2024: Componente del Consiglio Scientifico Bibliotecario 5 (Economia, Giurisprudenza e Scienze Politiche e Sociali).

2023-in corso: Componente della Commissione Spazi del Dipartimento

2018-2021: Componente della commissione Paritetica di Dipartimento

2016-2023: Componente della Commissione giudicatrice del premio di laurea Marina Chiola.

2022 e 2023 Presidente Commissione giudicatrice del premio di laurea Marina Chiola.

2016-2019: Componente gruppo riesame del Master Programme in Economics, Finance and International Integration, responsabile dell'indirizzo di Finance.

2016-2018: Co-responsabile del controllo dei Rapporti sui "Soggiorni di studio svolto all'estero" nell'ambito di programmi internazionali del Dipartimento.

2005-2011: Componente della Commissione Stage della Facoltà di Economia di Pavia.

2013- 2016: Componente della Commissione Informatica di Dipartimento

PARTECIPAZIONE A PROGETTI DI RICERCA

2014-2016: Responsabile scientifico dell'assegno di Ricerca Biennale presso l'Autorità AEEGSI sul tema "Sviluppo di modelli previsionali e finanziari per i mercati all'ingrosso dell'energia elettrica e del gas naturale".

Membro del progetto Prin 2011 sul tema "Modelli Statistici multivariati per la valutazione dei rischi".

Membro del progetto Prin 2006 sul tema "L'uso dei dati ad alta frequenza per l'analisi delle interdipendenze tra volatilità, volumi e rendimenti".

Membro del progetto Prin 2004 sul tema "Modelli econometrici per l'analisi dell'integrazione finanziaria ed economica nell'Unione Europea Allargata".

SEMINARI A CONFERENZE INTERNAZIONALI (SELEZIONE)

10th Italian Congress on Econometrics and Empirical Economics, Cagliari, maggio 2023.

Economic Seminar (invited) at University of Erlangen-Nuremberg, Norimberga, gennaio 2019.

86th International Atlantic Economic Conference, New York 2018.

7th ICEEE Italian Congress of Econometrics and Empirical Economics, Messina 2017.

Gender Summit 4- Europe 2014, From Ideas to Markets: Excellence in mainstreaming gender into research, innovation and policy. Brussels 2014.

7th CSDA International Conference on Computational and Financial Econometrics, London 2013

5th ICEEE Italian Congress of Econometrics and Empirical Economics, Genova 2013.

53th SIE Italian Economic Association Conference, Matera 2012.

4th CSDA International Conference on Computational and Financial Econometrics, London 2010.

13-th Conference on Panel data, Cambridge (U.K.), 2006.

47-esima Riunione Annuale Società italiana degli Economisti, Verona 2006.

European Meeting of the Econometric Society, Wien 2006.

Convegno Nazionale delle Ricerche sulle Serie Temporal, Roma Tor Vergata University, 2006.

FFM2001 (Forecasting Financial Markets), London, 2001.

EC(2) (European Conference of the Econometrics Community) (Maximum Likelihood in Econometrics), Dublin, 2000.

EC(2) (European Conference of the Econometrics Community) (Financial Econometrics Conference), Madrid, 1999.

ATTIVITÀ DI REFERAGGIO

Referee per le seguenti riviste:

European Economic Review, The Review of Finance, Oxford Bulletin of Economics and Statistics, Journal of Applied Econometrics, Regional Science and Urban Economics, Small Business Economics (3), Journal of Economic Education, The B.E. Journal of Macroeconomics, Education Economics (3), European Financial Management, Journal of Population Economics, Economics of Education Review (2), Journal of Air Transport Management, Economic Inquiry, Applied Economics, Economics Bulletin (2), Economics Letters, Journal of Asian Economics, International Journal of Manpower (3), Economic Modelling (2), Bulletin of Economic Research, Scientific Reports.

SOFTWARE

Buona conoscenza di Excel, VB, VBA, Gauss, Matlab, SAS, Latex, PL/SQL, STATA.

Conoscenza di base di SQL Server, Oracle, XML, VisualStudio.Net, Bloomberg, Reuter, Datastream, Eviews, PCGive, Rats, R.

LINGUE

Inglese (ottimo), Spagnolo e Tedesco (base)

Pavia, 1 aprile 2024

