



Matteo BONATO
Chercheur affilié à l'IPAG Business School

Biographie

Matteo Bonato est chercheur affilié à l'IPAG Business School, en France. Il occupe actuellement le poste de directeur principal des investissements chez SwissBorg, une plateforme suisse de trading de cryptomonnaies et de gestion de patrimoine. Auparavant, il a occupé des fonctions au sein du département de validation et de développement des modèles de risque chez Credit Suisse et UBS. Il est titulaire d'un doctorat en finance de l'université de Zurich et est également chercheur associé principal à l'université de Johannesburg (Afrique du Sud). Il a publié des articles sur la modélisation et la prévision de la volatilité, avec des applications aux actions et aux matières premières, dans des revues internationales de premier plan évaluées par des pairs, telles que : Journal of Empirical Finance, Journal of Financial Markets, Journal of Forecasting, Energy Economics et Resources Policies.

Éducation

2009: PhD in Finance, University of Zurich and Swiss Finance Institute (Switzerland)

Teaching Areas

- Volatility modelling and forecasting
 - Business Data Analytics
 - Story telling with data
-

Research Areas

- Volatility modelling and forecasting
 - High frequency finance
 - Climate risk
-

Professional experiences

- Depuis 2022 : Gestionnaire d'investissement senior, SwissBorg (Suisse)
 - Depuis 2018 : Chercheur affilié, IPAG
 - Depuis 2015 : Chercheur affilié, Université de Johannesburg (Afrique du Sud)
 - 2015 – 2022 : Analyste quantitatif, UBS (Suisse)
 - 2015 : Chercheur invité, Université de Harare (Zimbabwe)
 - 2014 : Chercheur invité, Université de Pretoria (Afrique du Sud)
 - 2011 – 2014 : Analyste quantitatif, UBS (Suisse)
 - 2010 : Analyste quantitatif, Credit Suisse (Suisse)
-

Selected publications

- Bonato, Cepni, Gupta et Pierdzioch (2024), Applications commerciales et volatilité réalisée des marchés boursiers au niveau des États : une expérience de prévision Journal of Forecasting 43(2)
 - Bonato, Cepni, Gupta et Pierdzioch (2023) Risques climatiques et volatilité réalisée des marchés boursiers au niveau des États Journal of Financial Markets
 - Bonato, Cepni, Gupta et Pierdzioch (2023) Risques climatiques et volatilité réalisée des taux de change des principales devises liées aux matières premières Journal of Financial Markets
 - Bonato, Cepni, Gupta et Pierdzioch (2021) Les chocs pétroliers permettent-ils de prédire la variance réalisée des REIT américains ? Energy Economics
 - Bonato, Gupta, Lau et Wang (2020) Contagion basée sur les moments entre les marchés de l'or et du pétrole Économie de l'énergie 89, juin 2020,
 - Matteo Bonato (2019) Corrélations réalisées, bêtas et contagion de la volatilité sur le marché des matières premières agricoles : qu'est-ce qui a changé ? Journal of International Financial Markets, Institutions and Money 62, 184-202
 - Bonato, Caporin et Rinaldo (2013) Contagion des risques dans les portefeuilles d'actions internationaux Journal of Empirical Finance 24, 121-137
-