

**ALLEGATO B**

UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI MILANO  
selezione pubblica per n.1 posto/i di Ricercatore a tempo determinato in tenure track (RTT)  
per il settore concorsuale 13/D1 - Statistica,  
settore scientifico-disciplinare SECS-S/01  
presso il Dipartimento di ECONOMIA, MANAGEMENT E METODI QUANTITATIVI,  
(avviso bando pubblicato sulla G.U. n. 49 del 18-06-2024). Codice concorso 5576

**Federico Pasquale Cortese**  
**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 INTEGRATE)

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

COGNOME	CORTESE
NOME	FEDERICO PASQUALE

**TITOLI**

**TITOLO DI STUDIO**

*(indicare la Laurea conseguita inserendo tipologia e relativo punteggio, Ateneo, titolo della tesi, data di conseguimento, ecc.)*

Laurea Triennale in Matematica (L-35); VOTO 100/110; Università della Calabria; titolo tesi “Equazioni differenziali stocastiche e applicazioni finanziarie”, conseguita in data 20-09-2017

Laurea Magistrale in Finance and Insurance (LM-16); voto finale 110/110 e lode; Università della Calabria; titolo tesi “Tail dependence in financial markets: A dynamic copula approach”, conseguita in data 19-09-2019

**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 tipologia del titolo e relativo punteggio, Ateneo, titolo della tesi, data di conseguimento, ecc.)*

Dottorato di ricerca in Economia e Statistica, curriculum Statistica, Università degli Studi di Milano-Bicocca, conseguito in data 16-02-2024; titolo tesi “Statistical modeling and temporal clustering of multivariate time series with application to financial data”.

## CONTRATTI DI RICERCA, ASSEGNI DI RICERCA O EQUIVALENTI

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

Contratto da ricercatore III livello a tempo determinato presso il Consiglio Nazionale delle Ricerche - Istituto di Matematica Applicata e Tecnologie Informatiche "E.Magenes", sede di Milano.  
Data Inizio: 02-10-2023. Data Fine: 30-09-2024

## ATTIVITÀ DIDATTICA A LIVELLO UNIVERSITARIO IN ITALIA O ALL'ESTERO

(inserire tipologia dell'attività, periodo [gg/mm/aa inizio e fine], anno accademico, ateneo, denominazione del corso, numero ore/CFU, ecc.)

### Anno Accademico 2022-2023

- Tutor per il corso *Probabilità e Statistica per l'Informatica* (8 CFU)  
dal 01-03-2023 al 01-09-2023  
Corso di laurea in Informatica, Università degli Studi di Milano-Bicocca
- Docente a contratto per il corso *Calcolo delle Probabilità e Statistica* (10 CFU)  
dal 01-10-2022 al 28-02-23  
Corso di laurea in Ingegneria dell'Automazione, Politecnico di Milano
- Docente a contratto per il corso *Fondamenti di Statistica e Segnali Biomedici* (5 CFU)  
dal 02-02-2023 al 30-04-2023  
Corso di laurea in Ingegneria Biomedica, Politecnico di Milano.
- Docente a contratto per il corso *Inferenza Bayesiana* (6 CFU)  
dal 01-12-2022 al 30-03-2023  
Corso di laurea in Biostatistica, Università degli Studi di Milano-Bicocca.

### Anno Accademico 2021-2022

- Docente a contratto per il corso *Fondamenti di Statistica e Segnali Biomedici* (5 CFU)  
dal 02-02-2022 al 30-04-2022  
Corso di laurea in Ingegneria Biomedica, Politecnico di Milano.
- Docente a contratto per il corso *Inferenza Bayesiana* (6 CFU)  
dal 01-12-2021 al 30-03-2022  
Corso di laurea in Biostatistica, Università degli Studi di Milano-Bicocca.

### Anno Accademico 2018-2019

- Tutor per il corso *Financial Econometrics* (9 CFU)  
dal 01-09-2018 al 02-02-2019  
Corso di laurea magistrale in Finance and Insurance, Università della Calabria.

## DOCUMENTATA ATTIVITÀ DI FORMAZIONE O DI RICERCA PRESSO QUALIFICATI ISTITUTI ITALIANI O STRANIERI

*(inserire tipologia dell'attività, anno/anno accademico, ente, periodo, impegno in termini orari, ecc.)*

Partecipante al workshop on "Advanced Time Series Methods" - Università di Perugia, Perugia, Italia. 19-20 giugno 2023

Partecipante al workshop on "Bayesian Nonparametrics for Complex Data" - Università di Padova, Padova, Italia. 24 gennaio 2020

## ATTIVITÀ DI RELATORE A CONGRESSI E CONVEGNI NAZIONALI E INTERNAZIONALI

*(inserire titolo congresso/convegno, data, durata in giorni/ore, ente organizzatore, ecc.)*

- Ecosta 2023 - Waseda University, Tokyo, Giappone - Relatore, 1-3 agosto 2023

- Statistics@Naples - Università di Napoli Federico II, Napoli, Italia - Relatore, 28-30 giugno 2023

- Computational and Methodological Statistics - CMStatistics2022 - King's College London, Londra, Regno Unito - Relatore invitato, 17-19 dicembre 2022

- International FinTech Research Conference - Politecnico di Milano, Milano, Italia - Relatore, 27-28 ottobre 2022

- Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance - MAF2022 - Università di Salerno, Fisciano (SA), Italia - Relatore, 20-22 aprile 2022

## 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) Cortese, Federico P.; Pievatolo, Antonio (2024).  
Modelling and forecasting correlated failure counts  
<https://www.disia.unifi.it/vp-453-2nd-italian-conference-on-economic-statistics.html>  
ICES 2024 - 2nd Italian Conference on Economic Statistics - Book of Short Papers.  
ISBN 978-88-476-2950-9.

2) Cortese, Federico P.; Pennoni, Fulvia; Bartolucci, Francesco (2024).  
Maximum likelihood estimation of regime switching Student-t copula model  
<https://onlinelibrary.wiley.com/doi/10.1111/insr.12562>  
International Statistical Review.  
DOI 10.1111/insr.12562.

- 3) Cortese, Federico P.; Kolm, Petter N.; Lindström, Erik (2023).  
What drives cryptocurrency returns? A sparse statistical jump model approach  
<https://link.springer.com/article/10.1007/s42521-023-00085-x>  
Digital Finance.  
DOI: 10.1007/s42521-023-00085-x.
- 4) Cortese, Federico P.; Kolm, Petter N.; Lindström, Erik (2023).  
Generalized information criteria for sparse statistical jump models  
[http://www.statistiksymposium.dk/Symposium%20i%20anvendt%20statistik%202023\\_Web.pdf](http://www.statistiksymposium.dk/Symposium%20i%20anvendt%20statistik%202023_Web.pdf)  
Symposium i anvendt statistik - Copenhagen Business School.  
ISBN: 978-87-989370-3-6.
- 5) Cortese, Federico P.; Bartolucci, Francesco; Pennoni, Fulvia (2022).  
A regime switching Student-t copula model for the analysis of cryptocurrencies data  
<https://link.springer.com/book/10.1007/978-3-030-99638-3>  
Book of Abstracts, Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance.
- 6) Bartolucci, Francesco; Pennoni, Fulvia; Cortese, Federico P. (2021).  
Hidden Markov and regime switching copula models for state allocation in multiple time-series  
<https://media.fupress.com/files/pdf/24/7254/19407>  
Book of abstracts and short papers, CLADAG, Firenze University Press.  
ISBN: 978-88-5518-340-6.
- 7) Cortese, Federico P. (2019).  
Tail dependence in financial markets: A dynamic copula approach  
<https://www.mdpi.com/2227-9091/7/4/116/htm>  
Risks.  
DOI: 10.3390/risks7040116.

Data

17-07-2024

Luogo

Milano