



ALLA MAGNIFICA RETTRICE
DELL'UNIVERSITA' DEGLI STUDI DI MILANO

COD. ID: 7068

Il sottoscritto chiede di essere ammesso a partecipare alla selezione pubblica, per titoli ed esami, per il conferimento di un assegno di ricerca presso il Dipartimento di Economia Management e Metodi Quantitativi

Responsabile scientifico: Luca Rossini

Federico Pasquale Cortese

CURRICULUM VITAE

INFORMAZIONI PERSONALI

Cognome	Cortese
Nome	Federico Pasquale

OCCUPAZIONE ATTUALE

Incarico	Struttura
Ricercatore TD III Livello	Consiglio Nazionale delle Ricerche

ISTRUZIONE E FORMAZIONE

Titolo	Corso di studi	Università	anno conseguimento titolo
Laurea Magistrale o equivalente	Finance and Insurance	Università della Calabria	2019
Specializzazione			
Dottorato Di Ricerca	Economia e Statistica curr. Statistica	Università degli Studi di Milano-Bicocca	2024
Master			
Diploma Di Specializzazione Medica			
Diploma Di Specializzazione Europea			
Altro			



LINGUE STRANIERE CONOSCIUTE

lingue	livello di conoscenza
Italiano	Lingua madre
Inglese	C1

PREMI, RICONOSCIMENTI E BORSE DI STUDIO

anno	Descrizione premio
2019	Premio di Laurea UNICAL

ATTIVITÀ DI FORMAZIONE O DI RICERCA

descrizione dell'attività
Sviluppo di modelli statistici avanzati per l'analisi di dati complessi e ad alta dimensionalità, con focus sui modelli a variabili latenti applicati a contesti ambientali e finanziari.

ATTIVITÀ PROGETTUALE

Anno	Progetto
2023-2024	RAISE: Robotics and AI for Socioeconomic Empowerment

CONGRESSI, CONVEGNI E SEMINARI

Data	Titolo	Sede
12-13/09/2024	Emerging Risks in Economics and Finance	Università di Firenze
01-03/08/2023	Ecosta 2023	Waseda University- Tokyo
28-30/06/2023	Statistics@Naples	Università di Napoli Federico II
17-19/12/2022	Computational and Methodological Statistics - CMStatistics2022	King's College, Londra
27-28/10/2022	International FinTech Research Conference	Politecnico di Milano



20-22/04/2022	Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance - MAF2022	Università di Salerno

PUBBLICAZIONI

Articoli su riviste
Maximum likelihood estimation of regime switching Student- t copula model Cortese, Federico P.; Pennoni, Fulvia; Bartolucci, Francesco International Statistical Review, Wiley, 2024 DOI 10.1111/insr.12562
What drives cryptocurrency returns? A sparse statistical jump model approach Cortese, Federico P.; Kolm, Petter N.; Lindström, Erik Digital Finance, Springer, 2023 DOI: 10.1007/s42521-023-00085-x
Tail dependence in financial markets: A dynamic copula approach Cortese, Federico P. Risks, MDPI, 2019 DOI: 10.3390/risks7040116

Atti di convegni
Modelling and forecasting correlated failure counts Cortese, Federico P.; Pievatolo, Antonio ICES 2024 - 2nd Italian Conference on Economic Statistics - Book of Short Papers ISBN 978-88-476-2950-9
Generalized information criteria for sparse statistical jump models Cortese, Federico P.; Kolm, Petter N.; Lindström, Erik Symposium i anvendt statistik - Copenhagen Business School, 2023 ISBN: 978-87-989370-3-6
A regime switching Student-t copula model for the analysis of cryptocurrencies data Cortese, Federico P.; Bartolucci, Francesco; Pennoni, Fulvia Book of Abstracts, Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance, 2022 ISBN: 978-3-030-99638-3
Hidden Markov and regime switching copula models for state allocation in multiple time-series Bartolucci, Francesco; Pennoni, Fulvia; Cortese, Federico P. Book of abstracts and short papers, CLADAG, Firenze University Press, 2021 ISBN: 978-88-5518-340-6



ALTRE INFORMAZIONI

Revisore per Statistical Modelling, Metron, e Scientific Reports journals

Le dichiarazioni rese nel presente curriculum sono da ritenersi rilasciate ai sensi degli artt. 46 e 47 del DPR n. 445/2000.

Il presente curriculum, non contiene dati sensibili e dati giudiziari di cui all'art. 4, comma 1, lettere d) ed e) del D.Lgs. 30.6.2003 n. 196.

RICORDIAMO che i curricula **SARANNO RESI PUBBLICI sul sito di Ateneo** e pertanto si prega di non inserire dati sensibili e personali. Il presente modello è già precostruito per soddisfare la necessità di pubblicazione senza dati sensibili.

Si prega pertanto di **NON FIRMARE** il presente modello.

Luogo e data: Milano, 20/01/2025