

UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI MILANO

Procedura di selezione per la chiamata a professore II fascia da ricoprire ai sensi dell'art. 18, commi 1 e 4, della Legge n. 240/2010 per il settore concorsuale 13/D1 - STATISTICA ,
(settore scientifico-disciplinare SECS-S/01 - STATISTICA)
presso il Dipartimento di DIPARTIMENTO DI ECONOMIA, MANAGEMENT E METODI QUANTITATIVI,
(avviso bando pubblicato sulla G.U. n. 42 del 29.5.2018 - SCADENZA: 29 giugno 2018) - Codice concorso 3766

Samantha LEORATO CURRICULUM VITAE

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

COGNOME	LEORATO
NOME	SAMANTHA
DATA DI NASCITA	09/07/1974

AFFILIAZIONE

Dipartimento di Economia e Finanza (DEF)
Università di Roma Tor Vergata
Via Columbia, 2
00133 Roma
Phone: +39 0672596108
Mobile: +39 3494696386
samantha.leorato@uniroma2.it
<https://sites.google.com/site/samanthaleorato/home>
https://www.researchgate.net/profile/Samantha_Leorato

FORMAZIONE

Dottorato in Statistica Metodologica: Università di Roma La Sapienza, aprile 2002.

Tesi: Uno stimatore per la distanza χ^2 con applicazioni alla verifica di ipotesi.

Supervisore: Prof. Michel Broniatowsky, Università di Parigi VI - Jussieu.

Laurea in Statistica, Università di Roma La Sapienza, settembre 1998. Votazione: 110/110 e Lode.

Tesi: Distribuzione e stima del massimo di processi aleatori.

Relatore: Prof. Enzo Orsingher.

ABILITAZIONE SCIENTIFICA NAZIONALE (ASN 2012):

13/A5: Econometria. Validità: 11 Dic. 2013 - 11 Dic. 2019

13/D1: Statistica. Validità: 10 Feb. 2014 - 10 Feb. 2020

POSIZIONE ATTUALE E PRECEDENTI:

2006-presente: Ricercatore confermato in Econometric (SECS-P/05) presso il Dipartimento di economia e Finanza dell'University di Roma Tor Vergata.

Novembre 2016 – Ottobre 2017: Visiting fellow presso il Bocconi Institute for Data Science and Analytics (BIDSA).

Maggio 2003 – Ottobre 2005: Assegno di ricerca in Probabilità e Statistica Matematica (MAT/06). Supervisore: Enzo Orsingher.

PUBBLICAZIONI:

1. S. Leorato (2017). A note on Hölder's inequality for matrix-valued measures. *Mathematical Inequalities & Applications*, **20**, 1183-1188.
 2. M. Mezzetti, M. Strauss, S. Leorato (2017). Is a matrix exponential specification suitable for the modeling of spatial correlation structures? *Spatial Statistics*, vol. **20**, Pages 221-243.
 3. S. Leorato e M. Mezzetti. (2016). Spatial Panel Data Model with Error Dependence: A Bayesian Separable Covariance Approach. *Bayesian Analysis*, vol. **11** Number 4, 1035-1069., ISSN: 1931-6690, doi: 10.1214/15-BA979
 4. S. Leorato, F. Peracchi, A.V. Tanase (2012). Asymptotically efficient estimation of the conditional expected shortfall. *Computational Statistics & Data Analysis*, Elsevier, vol. **56**(4), pages 768-784.
 5. S. Leorato e E. Orsingher (2009). Branching on a Sierpinski graph. *Statistics & Probability Letters* **79**, Issue 2, 145-154.
 6. S. Leorato (2009). A refined Jensen inequality for functionals of a Hilbert space and asymptotic approximations. *Journal of Multivariate Analysis* **100**, Issue 5, May 2009, Pages 1044-1060.
 7. S. Leorato and E. Orsingher (2007). A grain of dust falling through a Sierpinski gasket. *Acta Math. Sinica* **23**, n.6, 1095--1108.
 8. A. Lachal, S. Leorato, E. Orsingher (2006). Minimal cyclic motion in R^n and hyper-Bessel functions. *Annales I.H. Poincaré - PR* **42**, 753-772
 9. S. Leorato (2006). A chi-square type test for covariances. *J. Nonpar. Statistics*, **18**, 159-180.
 10. M. Broniatowski e S. Leorato (2006). An estimation method for the Neyman chi-square divergence with application to test of hypotheses. *Journal of Multivariate Analysis*, **97**, 1409-1436.
 11. S. Leorato e E. Orsingher (2004). Bose-Einstein-type statistics, order statistics and planar random motions with three directions. *Advances in Applied Probability*, **36**(2004), n. 3, 937-970.
 12. S. Leorato, E. Orsingher, M. Scavino (2003). An alternating motion with stops and the related planar cyclic motion with four directions. *Advances in applied Probability*, **35**, 1153-1168.
-

WORKING PAPERS

A.G. Bille e S. Leorato (2017). Quasi-ML estimation, marginal effects and asymptotics for spatial autoregressive nonlinear models. BEMPS Bozen Economics & Management Paper Series N. 44/2017 (sottomesso).

S. Leorato e F. Peracchi (2015). Comparing distribution and quantile regressions. EIEF Working Paper Series vol. 15/11.

S. Leorato e F. Peracchi (2015). Shape regressions. In: EIEF Working Paper Series. vol. 06/15

S. Leorato e M. Mezzetti (2015). Spatial panel data model with error dependence: a Bayesian separable covariance approach. In: CEIS Research Paper, Tor Vergata, CEIS, . vol. 13, Issue 3, No. 338

R. Koenker, S. Leorato e F. Peracchi (2013). Distributional vs. Quantile Regression . In: CEIS Working Paper. vol. 11, Issue 15, No. 300

S. Leorato, F. Peracchi e A.V. Tanase (2010). Asymptotically efficient estimation of the conditional expected shortfall, EIEF Working paper 10/13.

S. Leorato (2008). A refined Jensen's inequality in Hilbert spaces and empirical approximations, CEIS Research Paper, 134, November 2008.

PROGETTI IN CORSO

1. A spatial model specification based on matrix functions, *con A. Martinelli*.
 2. Random probability measures via sequential quantiles barycenters, *con A. Fabretti*.
 3. Bayesian spatio-temporal factor models, *con M. Mezzetti*.
 4. Convexity and monotonicity of some matrix valued functions of the Gaussian distribution
-

PRESENTAZIONI A SEMINARI E CONFERENZE

Su invito:

University of Milan, Febbraio 2017.
University of Insubria DiSAT, Febbraio 2017.
Bocconi University, Novembre 2016.
Zurich University, Ottobre 2016.
La Sapienza University, Rome, IT, Maggio 2011

Workshop e Conferenze (2015-oggi)

IWEEE, Milano Bicocca, Gennaio 2018.
9th Jean Paelink Seminar, Cartagena, Ottobre 2017.
ICEEE 7th, Messina, Gennaio 2017.
EEA/ESEM, Mannheim Agosto 2015.
ICEEE, Salerno, Gennaio 2015.

ATTIVITÀ DI REVISIONE

CSDA, Quantitative Finance, Journal of Multivariate Analysis, Communications in Statistics—Theory and Methods, SMA, JSS, JOEI, J. Appl. Stat.

ATTIVITÀ DIDATTICA

Triennio

Introduction to Econometrics per il corso di laurea triennale in Business Administration & Economics (6 crediti), 2018-19.

Introduzione all'Econometria per il corso di laurea triennale in Scienze Economiche (CLESE) (6 crediti), 2014-2015, 2015-16, 2017-18.

Laurea Magistrale

Econometria applicata per il corso di laurea Magistrate in Economia e Finanza (CLEMIF) (6 credits), 2012-13, 2013-14.

Econometria per il corso di laurea Magistrate in Economia e Finanza (CLEMIF) (5 credits), 2008-09, 2009-10, 2010-11, 2011-12.

Static regression and IV/GMM (6 crediti) per il Master of Science in Economics e Master of Science in Finance and Banking.

PhD e Master di II livello

Bootstrap (10-20 ore, 2010-2015): Ph.D. in Econometrics and Empirical Economics, EIEF graduate program.

Weak convergence and empirical processes (10-16 ore, 2006-2009): Ph.D. in Econometrics and Emp. Econ. Probability, Master in Economics (MEI), Tor Vergata, 2007

Probability and Statistics: Master in Development Economics and International Cooperation, 2007; Master in European Economy and International Finance, 2006-2007.

Regression, M. in European Economy and International Finance, 2006-2007; Master in Economics, 2006.

Tesi

Supervisione di tesi di laurea (livello undergraduate) nei seguenti argomenti: alfabetizzazione finanziaria; regressione quantile; econometria spaziale; modelli fattoriali dinamici; stima semiparametrica del *l'expected shortfall* condizionato (dottorato).

COMMISSIONE DI DOTTORATO DI RICERCA

P. Ferrante, A. Maruotti: Statistica Metodologica XX ciclo, Università di Roma La Sapienza.
A. Mammone: Statistica Metodologica XXI ciclo, Università di Roma La Sapienza.
V. Cammarota, A. Di Salvatore: Statistica Metodologica XXII ciclo, Università di Roma La Sapienza.
A. Tanase: Econometrics and Empirical Economics, Università di Roma Tor Vergata.

PROGETTI FINANZIATI

Grant “Mission: Sustainability”, finanziato dall’Università di Roma Tor Vergata, per il progetto “Climate18 - Statistical Detection and Attribution of Climate Change”. PI: Prof. T. Proietti.

PRIN research project (2010-2011): ”La previsione economica e finanziaria: il ruolo dell’informazione e la capacità di modellare il cambiamento”. PI: Prof. T. Proietti.

Progetto di Ateneo Università di Roma Tor Vergata: “Generalized risk measures and portfolio allocation strategies”. (2008) - Coordinatore: S. Leorato.

Progetto di Ateneo Università di Roma Tor Vergata: : “Compensating wage differentials and job injury risks “(2007) - Coordinatore: Daniela Vuri.

Progetto di Ateneo Università di Roma La Sapienza: “Moti aleatori a velocità finita in spazi iperbolici” (2006). Coordinatore: Prof. E. Orsingher.

Collaborative Linkage Grant NATO (No. PST.CLG.980408): “Fractional Calculus and related stochastic processes and equations”. Coordinatore: Prof. E. Orsingher, University di Roma La Sapienza. In collaborazione con Prof. Yuriy Kozachenko, Kyiv National Taras Shevchenko University (Ukraine).

Progetto di Ateneo Università di Roma La Sapienza: “Sull’interazione tra equazioni differenziali frazionarie e processi diffusivi” (2002), Cod. C26F025192. Coordinatore: Prof. E. Orsingher.

Progetto CNR (CNR - Agenzia2000. Cod. CNR004890 002): “Ottimizzazione in ambito probabilistico e statistico con applicazioni alla terapia medica (oncologia) e alla salute pubblica”. Coordinatore: Prof. G. Celant, Università di Padova.

ALTRE ATTIVITÀ ISTITUZIONALI

Membro del Collegio dei docenti del dottorato di Economics and Finance (precedentemente Econometria ed Economia Empirica)

Membro del Collegio dei docenti del Master of Science in Economics e del Master of Science in Finance and Banking (2012-2015)

LINGUE PARLATE

Italiano (madrelingua), inglese (C1), francese (B1).

ALTRO

Collaborazione alla stesura di alcuni lemmi del ”Dizionario Economia e Finanza Treccani”, pubblicato dall’Istituto dell’Enciclopedia Italiana (<http://www.treccani.it>).

1997-2003: Istat (Roma). Collaboratore tecnico ente di ricerca – VI livello.

Data

26/06/2018

Luogo

Como

