

CURRICULUM VITAE
FORMATO EUROPEO



INFORMAZIONI PERSONALI

Nome **VITALE Cosimo Damiano**

ESPERIENZA LAVORATIVA

- (dal 1972) **Istruttore Senior** di Statistica Matematica ed Econometria presso il Centro di Specializzazione e Ricerche/Centro per la Formazione in Economia e Politica dello Sviluppo Rurale (Portici), dell'Università degli studi di Napoli Federico II.
- (da luglio 1976 a giugno 1977) **Associate Researcher** presso il Department of Statistics of Berkeley, University of California (USA), con borsa di studio CNR.
- (dal luglio al settembre 1984) **Visiting Professor** presso il Department of Statistics, School of Business Administration, Temple University, Philadelphia (USA)
- (aa 1979/80-1982/83) **Docente** di Analisi Statistica presso la scuola di Perfezionamento in Ricerca Operativa della Facoltà di Scienze Statistiche Demografiche ed Attuariali dell'Università degli Studi di Roma.
- (aa. 1981/82-1983/84) **Incaricato** stabilizzato di Econometria Applicata alla Gestione delle Imprese per l'anno accademico 1979/80, di Statistica Metodologica per gli, presso la Facoltà di Scienze Economiche e Sociali dell'Università della Calabria (CS)
- (aa 1984/85 - 1987/88) **Associato** di Statistica Metodologica presso la Facoltà di Scienze Economiche e Sociali dell'Università della Calabria.
- (aa 1988/89 -1989/90) **Associato** di Probabilità e Statistica presso la Facoltà di Ingegneria dell'Università degli Studi di Napoli Federico II.
- (dal 1990/91) **Ordinario** di Statistica presso la Facoltà di Economia dell'Università di Salerno.
- Nome e indirizzo del datore di lavoro Dipartimento di Scienze Economiche e Statistiche – Università degli Studi di Salerno - Italy
 - Tipo di azienda o settore Ente Pubblico
 - Tipo di impiego Docente e ricercatore

ISTRUZIONE E FORMAZIONE

- Date (da – a) 1966/1970
- Nome e tipo di istituto di istruzione o formazione Università degli Studi di Roma "La Sapienza"
- Principali materie / abilità professionali oggetto dello studio Statistica Finanziaria ed Attuariale
- Qualifica conseguita Laurea in Scienze Statistiche ed Attuariali
- Date (da – a) 1976/1977
- Nome e tipo di istituto di istruzione o formazione University of Berkely, California (USA)

- Principali materie / abilità professionali oggetto dello studio
- Qualifica conseguita

Probabilità and Statistics

Master

CAPACITÀ E COMPETENZE PERSONALI

PRIMA LINGUA

Italiano

ALTRE LINGUE

Inglese

- Capacità di lettura
- Capacità di scrittura
- Capacità di espressione orale

Buono

Buono

Buono

CAPACITÀ E COMPETENZE ORGANIZZATIVE

1991-1995

Direttore dell'Istituto di Statistica della Facoltà di Economia e Commercio dell'Università degli Studi di Salerno

1991-1995

Coordinatore del dottorato di Statistica, VIII ciclo, sede amministrativa di Bari

2000-2003

Direttore del Dipartimento di Scienze Economiche dell'Università di Salerno

1999-2003

Componente del Comitato scientifico del Centro per la Formazione in Economia e Politica dello Sviluppo Rurale (Portici)

2000-2002

Componente del comitato scientifico del FORMSTAT (Roma)

2000-2003

Componente del Nucleo di Valutazione dell'Università di Salerno

2004-2007

Presidente del Comitato Tecnico del Centro per la Formazione in Economia e Politica dello Sviluppo Rurale (Portici)

2004-2009

Coordinatore del Dottorato di Ricerca in Ingegneria ed Economia dell'Innovazione, dell'Università di Salerno

dal 2007

Componente del CIT (Communication Information and Tecnology) dell'Università degli Studi di Salerno

dal 2007

Componente del Comitato Catalogo di Ateneo per le pubblicazioni scientifiche dell'Università di Salerno

dal 2009

Componente del Comitato Spin-Off dell'Università di Salerno

CAPACITÀ E COMPETENZE IN CAMPO DIDATTICO

1991-1995

- Insegnamento di **Probabilità e Statistica** presso il Centro di Specializzazione e Ricerche, Portici (NA)
- Insegnamento di **Probabilità e Statistica** presso l'Università di Napoli Federico II
- Insegnamento di **Statistica Matematica** presso l'Università del Sannio (BN)
- Insegnamento di **Econometria** presso il Centro di Specializzazione e Ricerche, Portici (NA)
- Insegnamento di **Econometria** presso l'Università della Calabria

- Insegnamento di **Statistica Metodologica** presso l'Università della Calabria
- Insegnamento di **Metodologia Statistica in Agricoltura** presso la Facoltà di Agraria dell'Università di Napoli Federico II 1989/1990-1994/1995
- Insegnamento di **Statistica I** presso l'Università degli Studi di Salerno
- Insegnamento di **Statistica II** presso l'Università degli Studi di Salerno
- Insegnamento di **Statistica** presso l'Università degli Studi di Salerno
- Insegnamento di **Statistica Esplorativa** presso il Centro per la Formazione in Economia e Politica per lo Sviluppo Rurale, Portici (NA)
- Insegnamento di **Statistica Economica** presso l'Università della Calabria
- Insegnamento di **Analisi Statistica** presso la Scuola di Perfezionamento in Ricerca Operativa dell'Università degli Studi di Roma
- Insegnamento di **Analisi delle Serie Storiche** presso il Centro di Specializzazione e Ricerche, Portici (NA)
- Insegnamento di **Analisi delle Serie Storiche** presso l'Università di Napoli Federico II
- Insegnamento di **Statistica** presso l'Università di Salerno dal 1990/1991 ad oggi,
- Insegnamento di **Analisi Statistica dei Mercati Monetari e Finanziari** presso l'Università di Salerno dal 2003,
- Insegnamento di **Statistica Medica** presso l'Università degli Studi di Salerno dal 2006.
- Insegnamento di **Statistica in e-learning** nell'anno accademico 2007/2008 presso l'Università di Salerno
- Insegnamento di **Processi Stocastici ed Inferenza Statistica** presso l'Università degli Studi di Salerno dal 2010.

CAPACITÀ E COMPETENZE IN CAMPO
SCIENTIFICO

Analisi delle Serie Storiche

- nel campo spettrale,
- nel campo temporale,
- modellistica ARIMA,
- modelli multivariati
- decomposizioni in componenti correlate
- previsioni ottimali,
- modellistica non lineare nei livelli,
- modelli per la volatilità
- modelli dinamici e dinamiche caotiche
- serie storiche sistematicamente ricampionate
- serie storiche sistematicamente sottocampionate
- modellistica non lineare nei livelli e nella variabilità
- proprietà probabilistiche e statistiche dei modelli non lineari a soglia.

Analisi Multivariata

- studio della struttura degli autovalori di una matrice di correlazione e misura del grado di "collinearità";
- generalizzazione al caso multivariato della variabile T di Student doppiamente non centrale;
- analisi ed inferenza sui dati dipendenti e studio delle loro relazioni con i processi temporali e la "intervention analysis"
- Modellistica lineare VARMA e non lineare TVARMA

Ricampionamento ed inferenza non parametrica

- la procedura Jackknife per la stima della varianza e la costruzione di intervalli di confidenza in dati non iid;
- la procedura Jackknife per la stima della varianza e la costruzione di intervalli di confidenza in popolazioni finite e campioni complessi;
- la procedura Bootstrap nell'inferenza di stime complesse;
- la procedura Bootstrap per l'inferenza in dati non iid ed in particolare per serie temporali;
- verosimiglianza empirica e procedura bootstrap nell'inferenza statistica.

Publicazioni scientifiche 2001-2013

- 2001 • Rappresentazione di alcune proprietà idrauliche del suolo mediante la geometria dei frattali (con V. Comegna, A. Sommella), in *Metodi Statistici e Matematici per L'Analisi delle Serie Idrologiche*, (a cura di D. Piccolo e L. Umbertini), 2001, pp. 57-71
- 2002 • Sub-series length in MBB procedure for α -mixing processes (con M. La Rocca), in *Advances in Classification and Data Analysis*, Springer, 2001, pp. 291-299.
Modelling leverage effects in financial time series by GARCH-BL models (G. Storti), in *Modelli Complessi e Metodi Computazionali Intensivi per la Stima e la Previsione* (a cura di C. Provasi), ed. CLEUP, 325-330, 2001.
• Parametric Bootstrap Inference in Bilinear Time Series Models (con M. La Rocca), *Metron*, 2001 vol.59, pp. 101-116.
- CLS asymptotic variance for a particular relevant bilinear time series model (con G. Giordano), inviato per la pubblicazione a *Statistical Methods & Applications*, 2002.
- 2003 • Processi stocastici e dinamiche complesse nelle analisi di serie temporali, in *Studi in Onore di Angelo Zanella* (editors: Frosini, Magagnoli, Boari), Vita e Pensiero, Milano 2002, pp. 691-708.
• INTRODUZIONE ALLA STATISTICA PER LE APPLICAZIONI ECONOMICHE. VOL. I: STATISTICA DESCRITTIVA, ESI edizioni (NA), 2002.
• INTRODUZIONE ALLA STATISTICA PER LE APPLICAZIONI ECONOMICHE. VOL. II: PROBABILITÀ E STATISTICA, ESI edizioni (NA), 2002.
• PROCESSI STOCASTICI, CAOS E CASO NEI FENOMENI DINAMICI, CUSL edizioni (SA), 2002.
• BL-GARCH models and asymmetries in volatility (con G. Storti) in *Statistical Methods & Applications*, 2003,
• Likelihood inference in BL-GARCH models (with: G. Storti), *Computational Statistics*, 2003, vol 18, pp. 387-400.
• Bootstrap inference in multivariate local polynomial regression for time series (con L. Parrella), *Atti del Convegno SIS*, Napoli, 2003.
• On non-linear threshold autoregressive predictors (con A. Amendola, M. Niglio), *Atti Convegno: Modelli Statistici e Metodi di Simulazione per l'Analisi di Dati Dipendenti*, Campobasso, 28-29 aprile, 2003.
• The exact multi-step ahead predictor of threshold autoregressive moving average (con A. Amendola, M. Niglio) *SCO2003: Modelli Complessi e Metodi di Computazione Intensivi per la Stima e la Previsione*. Treviso, 4-6 settembre 2003, pp. 21-26.
- 2004 • The Threshold ARMA Model And Its Autocorrelation Function (con A. Amendola, M. Niglio) *Compstat04*, Praga 21-27 agosto 2004, sezione poster. Book of Abstract.
• Regime Switching and Asymmetries in Financial Time Series (con A. Amendola, M. Niglio). In *Atti del Convegno: Metodi Matematici e Statistici per l'Analisi dei Dati Assicurativi e Finanziari*, Edizioni CUSL, 2004, pp. 27- 32.
• Proprietà Statistiche in Serie Storiche Sottocampionate (con F. Giordano). In *Atti del Convegno: Metodi Matematici e Statistici per l'Analisi dei Dati Assicurativi e Finanziari*, Edizioni CUSL, 2004, pp. 151-156.
• Bootstrap inference in multivariate local polynomial regression for time series (con Parrella), 2004, *Statistical Methods and Applications* (in corso di pubblicazione)
• ANALISI STATISTICA DELLE PROPRIETÀ IDRAULICHE ED IDRODISPERSIVE DEI SUOLI, (con V. Comegna e C. Perna), Edizioni ESI Italia, 2004.
- 2005 • Multi-step SETAR predictors in the analysis of hydrological time series (con Niglio M., Amendola A.), *atti convegno European Geosciences Union*, vol. 7. Vienna 24-29 aprile 2005. ISSN: 1029-7006
• INTRODUZIONE ALLA STATISTICA PER LE APPLICAZIONI ECONOMICHE. VOL. II: PROBABILITÀ E STATISTICA, ESI (NA), seconda edizione, 2005.
- 2006 • The exact multi-step predictor in Threshold Autoregressive Moving Average Models (con Niglio e Amendola), *Statistics and Probability Letters*, 2006, vol. 76, pp. 625-633.
• The moments of SETARMA models (con Amendola A., Niglio M.), *Journal of Statistics & Probability Letters*, 2006, v. 76, pp. 625-633.
• Multi-steps SETARMA predictors in the analysis of hydrological time series (con Amendola A., Niglio M.), *Journal of Physics And Chemistry Of The Earth*, 2006, v. 31, pp. 1118-1126.

Pubblicazioni scientifiche 2001-2013

- 2007
- Bootstrap inference in local polynomial regression of time series (con Parrella L.M.), *Journal Of Statistical Methods & Applications*, 2007, v. 16, pp. 117-139.
 - Temporal aggregation and closure of VARMA models. Some new results (con Amendola A., Niglio M.), *Convegno Cladag su: Classification and Data Analysis*, 2007, Grafica Editrice Romana s.r.l., Macerata, pp. 409-412.
 - Forecast density combination for threshold models (con Amendola A., Niglio M.), *Convegno S.Co, Venezia 2007*, Cleup Editrice, pp. 33-38.
 - Theshold models for Value at Risk estimation (con La Rocca M., Storti G.), *Convegno Società Italiana di Statistica, su: Risk and Prediction, Venezia 2007*, CLEUP EDITRICE, pp. 329-340.
 - A Fast Procedure for Calibrating VaR Models (con La Rocca M., Storti G.), *Convegno General Meeting of the International Statistical Institute, Lisbona 2007*, pp. 11-22.
 - A The autocorrelation function in SETARMA models (con Amendola A., Niglio M.), in: In E. KONTOGHIORGHES; C. GATU (editors): *Optimisation, Econometric and Financial Analysis*. pp. 127-141. Springer-Verlag, 2007.
- 2008
- Least squares predictors for threshold models: properties and forecast evaluation (con Amendola A., Niglio M.). In C. PERNA AND M. SIBILLO (editors). *Mathematical and Statistical Methods for Insurance and Finance*. pp. 20-28. Springer-Verlag, 2008.
 - Estimation of Threshold Models with ARMA Regims (con Amendola A., Niglio M.), *Atti Convegno Società Italiana di Statistica (CD)*, 2008, Università della Calabria (CS).
- 2009
- Statistical Properties of Threshold Models (con Amendola A., Niglio M.). *Communications In Statistics. Theory And Methods*, 2009, vol. 38; p. 1-19.
 - Temporal aggregation and closure of VARMA models. Some new results (con Amendola A., Niglio M.). In: GREENACRE M., LAURO N.C., PALUMBO F.. *Data Analysis and Classification: From Exploration to Confirmation*, 2009, p. 435-444, BERLIN: Springer-Verlag Berlin and Heidelberg GmbH & Co. K
 - Global stationarity and existence of Threshold ARMA models (con Amendola A., Niglio M.). In: *Applied stochastic models and data analysis*. Vilnius, 30/06/2009-03/07/2009, VILNIUS: Technika, 2009, p. 427-431
- 2010
- Comegna, A. Coppola, V. Comegna, G. Severino, A. Sommella, C.D. Vitale (2010). State-space approach to evaluate spatial variability of field measured soil water status along a line transect in a volcanic-vesuvian soil.. *HYDROLOGY AND EARTH SYSTEM SCIENCES*, p. 2455-2463, ISSN: 1027-5606
 - Marcella Niglio, Giuseppe Storti, Cosimo Damiano Vitale (2011). Classification of Financial Assets on the Basis of their Risk Profile . In: AA.VV.. *Book of Short Papers, CLADAG 2011 - Meeting of the Classification and Data Analysis Group of the Italian Statistical Society - USB pen*. p. 1-4, Pavia university press, ISBN: 9788896764220
 - Marcella Niglio, Cosimo Damiano Vitale (2010). Quasi-maximum likelihood estimators for Threshold ARMA models: theoretical results and computational issues. In: Y. Lechevallier and G. Saporta. *Proceedings in Computational Statistics 2010*. p. 1461-1468, Springer-Verlag, ISBN: 9783790826036
 - AMENDOLA A., NIGLIO M, VITALE C (2010). Temporal aggregation and closure of VARMA models. Some new results. In: GREENACRE M.; LAURO N.C.; PALUMBO F.. *Data Analysis and Classification: From Exploration to Confirmation*. p. 435-444, BERLIN:Springer-Verlag Berlin and Heidelberg GmbH & Co. K, ISBN: 9783642037382
 - Alessandra Amendola, Marcella Niglio, Cosimo Damiano Vitale (2010). Threshold Moving Average Models Invertibility. In: Nicola Torelli. *Proceedings of the 45th Scientific Meeting of the Italian Statistical Society (USB stick)*. p. 1-8, Cleup, Padova, ISBN: 9788861295667
 - Amendola A., Niglio M., Vitale C.D. (2010). A note on the invertibility of the threshold moving average model. Fisciano (SA):CUSL, Fisciano (SA), ISBN: 9788861970441

Pubblicazioni scientifiche 2001-2013

- 2011
- Cosimo Damiano Vitale, Giuseppe Storti (2011). *Analisi Statistica dei Mercati Monetari e Finanziari*. p. 1-400, ESI - Napoli, ISBN: 9788849521511
 - Marcella Niglio, Giuseppe Storti, Cosimo Damiano Vitale (2011). *Classification of Financial Assets on the Basis of their Risk Profile*. In: AA.VV.. *Book of Short Papers, CLADAG 2011 - Meeting of the Classification and Data Analysis Group of the Italian Statistical Society* - USB pen. p. 1-4, Pavia university press, ISBN: 9788896764220
 - Antonio Cioffi, Fabio Gaetano Santeramo, Cosimo Damiano Vitale (2011). *The price stabilization effects of the EU entry price scheme for fruit and vegetables*. *AGRICULTURAL ECONOMICS*, p. 1-14, ISSN: 0169-5150, doi: 10.1111/j.1574-0862.2010.00526
- 2012
- Francesco Giordano, Cira Perna, Cosimo Damiano Vitale (2012). *A comment on "An analysis of global warming in the Alpine Region based on nonlinear nonstationary time series models" by F. Battaglia and M.K. Protopapas*. *STATISTICAL METHODS & APPLICATIONS*, p. 355-361, ISSN: 1618-2510, doi: 10.1007/s10260-012-0204-5
 - Ruggiero C., Ascione S., Punzo A., Vitale C. (2012). *Estimation of relative growth rate of ten field-grown herbaceous species: the effects of LAR and NAR depend on time scale and type of analysis*. *JOURNAL OF CROP SCIENCE*, vol. 3, p. 57-63, ISSN: 0976-8920
 - Marcella Niglio, Cosimo Damiano Vitale (2012). *Local Unit Roots and Global Stationarity of TARMA Models*. *METHODOLOGY AND COMPUTING IN APPLIED PROBABILITY*, p. 17-34, ISSN: 1387-5841
 - Marcella Niglio, Cosimo Damiano Vitale (2012). *On the Stationarity of Threshold Models with Multiple Variables*. *QUADERNI DI STATISTICA*, vol. 14, p. 177-180, ISSN: 1594-3739
 - Marcella Niglio, Cosimo Damiano Vitale (2012). *Generalization of some linear time series property to non linear domain*. In: Cira Perna, Marilena Sibillo. *Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance*. p. 323-332, SPRINGER, ISBN: 9788847023413
 - Giordano Francesco, Marcella Niglio, Cosimo Damiano Vitale (2012). *On the stationarity of the Threshold Autoregressive process: the two regimes case*. In: Giommi A.. *SIS2012 - Proceeding of the XLVI Scientific Meeting*. p. 1-4, Cleup, Padova, ISBN: 9788861298828
- 2013
- Ascione S, Ruggiero C, Vitale CD (2013). *Contribution of growth components on relative, plant, crop and tuber growth rate of nine potato cultivars in southern Italy*. *THE INTERNATIONAL JOURNAL OF SCIENCES*, vol. 2, p. 1-11, ISSN: 2305-3925
 - Comegna A., Coppola A., Comegna V., Sommella A., Vitale C.D. (2013). *Use of fractional Bronian motion model to mimic spatial horizontal variation of soil physical hydraulic properties displaying a power-law variogram*. *PROCEDIA ENVIRONMENTAL SCIENCES*, vol. 17, p. 1-10, ISSN: 1878-0296

Il sottoscritto è a conoscenza che, ai sensi dell'art. 26 della legge 15/68, le dichiarazioni mendaci, la falsità negli atti e l'uso di atti falsi sono puniti ai sensi del codice penale e delle leggi speciali. Inoltre, il sottoscritto autorizza al trattamento dei dati personali, secondo quanto previsto dalla Legge 675/96 del 31 dicembre 1996.

Portici, 08/07/2013

FIRMA
