

Giovanni De Luca

Curriculum vitae

1. Informazioni generali

Dati personali

Indirizzo: Dipartimento di Statistica e Matematica per la Ricerca Economica, Via Medina, 40 - 80133 Napoli
Telefono: +39 081 5474915
Fax: +39 081 5474904
E-mail: giovanni.deluca@uniparthenope.it
Pagina Web: http://www.economia.uniparthenope.it/Siti_docenti/deluca/home.html

Formazione

1991: Laurea in Economia e Commercio, Università degli Studi di Salerno. Tesi di laurea in econometria: *Distribuzione dei redditi e disoccupazione, una verifica time-series per l'Italia*, relatore prof.ssa Francesca Bettio, votazione 110/110.

1992: Third graduate summer course on efficiency analysis, Center for Operations Research and Econometrics, Université Catholique de Louvain, July 19-30.

1993: IV Master in Economia del Settore Pubblico, Foromez (Napoli, 11 gennaio 1993 - 10 gennaio 1994)

1994: Visiting Student presso il Department of Probability and Statistics della Faculty of Pure Science, University of Sheffield (UK). Frequenta i corsi del I semestre del Master in Statistics. Corsi frequentati: Practical Statistics (Dr. Fieller), Probability Modelling (Prof. Biggins), Linear Models (Prof. Loynes), Generalized Linear Models (Prof. Loynes), Multivariate Statistics (Prof. Fieller), Statistical Inference (Dr. Blackwell).

1995: Sesto corso residenziale di econometria, CIDE (Bertinoro, 11-22 settembre).

1994-1997: Dottorato di Ricerca in Metodi Statistici e Matematici per la Ricerca Economica e Sociale, Dipartimento di Scienze Statistiche, Università di Perugia. Tesi di dottorato: *Un approccio alternativo per il test di integrazione stagionale*, relatore prof. Pierluigi Daddi.

1998: Borsa di studio del Dipartimento di Scienze Statistiche, Università di Perugia, per attività di ricerca su modelli di tipo ARCH e modelli di volatilità stocastica per la previsione della volatilità in ambito finanziario

1999: Master in Economics and Finance 1999, Venice International University, Venezia, gennaio giugno.

Carriera Accademica

1999 (dicembre): Ricercatore di Statistica Economica, Università degli Studi di Verona

2002 (dicembre): Ricercatore di Statistica Economica, Università degli Studi di Napoli *Parthenope*

2006 (novembre): Professore Associato di Statistica Economica, Università degli Studi di Napoli *Parthenope*

2. Attività di ricerca

Interessi di ricerca

Funzioni copula per i rendimenti finanziari

Test di integrazione stagionale: metodi per individuare la non stazionarietà di una serie storica stagionale.

Modelli per le serie storiche finanziarie: modelli ad eteroschedasticità condizionata, modelli di volatilità stocastica e annessi problemi di stima.

Analisi dei dati finanziari tick-by-tick.

Metodi statistici per il rischio operativo.

Indici dei Prezzi al Consumo: procedure di campionamento sotto un vincolo di bilancio.

Pubblicazioni

1. De Luca G. (1998), An alternative approach for the seasonal integration test, *Statistica*, n. 3.
2. Cecconi C., De Luca G. (2000), Un disegno di campionamento sperimentale per la rilevazione dei prezzi

al consumo nei comuni umbri, in Filippucci C. (a cura di) *Tecnologie informatiche e fonti amministrative nella produzione di dati*, Franco Angeli.

3. Bartolucci F., De Luca G., Loperfido N. (2000), A generalization for skewness of the basic stochastic volatility model, *Proceedings of the 15th International Workshop on Statistical Modelling*, Bilbao, July 2000.
4. Bartolucci F., De Luca G. (2000), Exact maximum likelihood estimation for the asymmetric stochastic volatility model, *Proceedings of Computational Statistics*, Utrecht, August 2000.
5. Bartolucci F., De Luca G. (2001), Maximum likelihood estimation for a latent variable time series model, *Applied Stochastic Models in Business and Industry*, Volume 17, Issue 1.
6. De Luca G., Guerriero M. (2001), La tecnica di bootstrap per gli intervalli di previsione nei modelli AR(p)-ARCH(q), *Quaderni di Statistica del DESI*, Università di Verona, Volume 2.
7. De Luca G. (2001), La direzione dei prezzi di titoli azionari e i modelli ACD, *Quaderni di Statistica del DESI*, Università di Verona, Volume 2.
8. De Luca G., Golia S. (2001), The prediction of a price change and the persistence in intradaily durations, *Proceedings of Modelli complessi e metodi computazionali per la stima e la previsione*, Bressanone, September 2001.
9. Bartolucci F., De Luca G. (2002), Estimation of stochastic volatility models, in Kontoghiorghes *et al.* (edited by) *Computational methods in decision-making, economics and finance*, Kluwer Applied Optimization Series.
10. Bartolucci F., De Luca G. (2002), A general framework for fitting stochastic volatility models, *Atti della riunione SIS 2002*.
11. Bartolucci F., De Luca G. (2002), Maximum likelihood estimation of a CAPM with time-varying beta, *Proceedings of the Conference CompStat 2002*, Short Communications and Posters, Berlino, August 2002.
12. Bartolucci F., De Luca G. (2003), Likelihood-based inference in asymmetric stochastic volatility models, *Computational Statistics and Data Analysis*, Volume 42, Issue 3.
13. De Luca G. (2003), The distributional assumptions for ACD models, *Proceedings of Quantitative Methods in Economy*, Bratislava, Slovacchia.
14. Olivieri D., De Luca G. (2003), *L'impatto economico del Festival Lirico Veronese*, Fondazione Arena di Verona.
15. De Luca G., Zuccolotto P. (2003), Finite and infinite mixtures for financial durations, *Metron*, vol. LXI, n. 3.
16. De Luca G. (2004), Estimating the instantaneous volatility of the price process, in Bee Dagum E. *et al.* (edited by) *Linear and Non Linear Dynamics in Time Series*.
17. De Luca G., Zuccolotto P. (2004), Empirical evidence for different financial durations, *Proceedings of the Conference Metodi matematici e statistici per l'analisi dei dati assicurativi e finanziari*, Salerno, Italy.
18. De Luca G., Loperfido N. (2004), A Skew-in-Mean GARCH Model, in Genton M. (edited by) *Skew-Elliptical Distributions and Their Applications: A Journey Beyond Normality*, Ed. Chapman & Hall / CRC, Boca Raton, FL, pp. 205-222.
19. De Luca G., Gallo G.M. (2004), Mixture processes for financial intradaily durations, *Studies in Nonlinearity and Dynamics in Econometrics*, vol. 8.2.
20. De Luca G., Gallo G.M. (2004), Modelling financial durations between price movements, *Proceedings of the 19th International Workshop on Statistical Modelling*, Firenze, Italy.

21. De Luca G., Zuccolotto P. (2004), Detecting features of different financial durations through the Pareto distributions, *Quaderni di Statistica*, vol. 6.
22. De Luca G., Genton M., Loperfido N. (2006), The Multivariate Skew GARCH model, *Advances in Econometrics: Econometric Analysis of Financial and Economic Time Series (volume 20 Part A)*, Elsevier.
23. De Luca G., Loperfido N. (2006), The Skew- t GARCH model, *Proceedings of the Conference SER2006*, Monte Porzio Catone, Italy.
24. De Luca G., Zuccolotto P. (2006), Diagnostics for regime-switching distributed PACD models, *Proceedings of the Conference SER2006*, Monte Porzio Catone, Italy.
25. De Luca G., Zuccolotto P. (2006), Regime-switching Pareto distributions for ACD models, *Computational Statistics and Data Analysis*, Volume 51, Issue 4.
26. De Luca G., Riviuccio G. (2006), I modelli di tipo ARCH: la teoria consolidata e i nuovi sviluppi, *Newsletter AIFIRM*, n. 2.
27. De Luca G. (2006), Forecasting volatility using high-frequency data, *Statistica Applicata*, vol. 18 n. 2.
28. De Luca G., Riviuccio G. (2006), Modelling financial durations via a parametric and a semiparametric approach, in Bee Dagum E. *et al.* (edited by), *Statistical Inference on the Deterministic and Stochastic Dynamics of Observed Time Series*, Proceedings of the Final Workshop PRIN/COFIN 2002, Pitagora Editrice Bologna.
29. De Luca G., Loperfido N. (2007), Asymmetries for multivariate returns: an empirical approach, *Atti della riunione intermedia SIS 2007*.
30. De Luca G., Riviuccio G. (2007), Modeling the conditional dependence between stock market returns with a Copula-GARCH approach, *Atti della riunione intermedia SIS 2007*.
31. De Luca G., Gallo G.M. (2007), Time-varying mixture MEM for realized volatility, *S.Co 2007, Book of Short Papers*.
32. De Luca G., Golia S. (2007), The autocorrelation function for squared white noises, *S.Co 2007, Book of Short Papers*.
33. De Luca G., Riviuccio G., Zuccolotto P. (2008), Exploring the copula approach for the analysis of financial durations, in Perna C., Sibillo M. (edited by), *Mathematical and Statistical Methods in Insurance and Finance*, Springer Milan.
34. De Luca G., Riviuccio G. (2008), Asymmetric multivariate tail dependence, *Atti della riunione SIS 2008*.
35. De Luca G., Gallo G.M. (2009), Time-varying mixing weights in mixture Autoregressive Conditional Duration models, *Econometric Reviews*, Volume 28 (1-3).
36. De Luca G., Riviuccio G. (2009), Archimedean copulae for risk measurement, *Journal of Applied Statistics*, Volume 36, Issue 8.
37. De Luca G., Riviuccio G., Zuccolotto P. (2009), Joint tail dependence in multivariate copulae, *Book of Abstract, EURISBIS'09*.
38. De Luca G., Riviuccio G., Zuccolotto P. (2009), Archimedean copulas and market risk in a financial crisis perspective, *S.Co. 2009, Proceedings*.

Presentazioni a convegni

- Un approccio alternativo per il test di integrazione stagionale, Contributi Statistici all'Econometria, Roma, febbraio 1997

- Exact maximum likelihood estimation for a latent variable time-series model, Inference and Prediction in Financial Risk Management, Tirano, settembre 1999 (con Bartolucci F.)
- Un disegno di campionamento sperimentale per la rilevazione dei prezzi al consumo nei comuni umbri, Tecnologie informatiche e fonti amministrative nella formazione dei dati economici”, Bologna, febbraio 2000 (con Cecconi C.)
- Maximum likelihood estimation of a stochastic volatility models, Computational Methods in Decision Making and Finance, Neuchatel (CH), agosto 2000 (con Bartolucci F.)
- The prediction of a price change and the persistence in intradaily durations, Modelli complessi e metodi computazionali per la stima e la previsione, Bressanone, settembre 2001 (con Golia S.)
- A general framework for fitting stochastic volatility models, XLI Riunione Scientifica Società Italiana di Statistica, Milano, giugno 2002 (con Bartolucci F.)
- Maximum likelihood estimation of a CAPM with time-varying beta, CompStat, Berlino, agosto 2002 (con Bartolucci F.)
- Estimating the instantaneous volatility of the price process, Linear and Nonlinear Dynamics in Time Series, Bressanone, giugno 2003
- Modelling the fractions of informed and uninformed traders in financial markets, International Conference in Methodology and Statistics, Ljubljana (Slovenia), settembre 2003
- The distributional assumptions for ACD models, Quantitative Methods in Economy, Bratislava (Slovacchia), novembre 2003
- A Multivariate Skew-in-mean GARCH model, Joint Statistical Meeting, Toronto, agosto 2004 (con Genton M. e Loperfido N.)
- A Multivariate Skew GARCH model, Advances in Econometrics, Baton Rouge (Louisiana), novembre 2004 (con Genton M. e Loperfido N.)
- Time-varying Mixing Weights in Mixture Autoregressive Conditional Duration Models, Statistical Inference on Linear and Non-Linear Dynamics in Time Series, Bressanone, giugno 2005 (con Gallo G.)
- The Pareto ACD model, 3rd World Conference Computational Statistics and Data Analysis, Limassol (Cipro) ottobre 2005 (con Zuccolotto P.)
- A Skew-t GARCH model, II Workshop Modelli e metodi per serie storiche finanziarie, Padova, gennaio 2006 (con Loperfido N.)
- The Skew-t GARCH model, Convegno Nazionale delle Ricerche sulle Serie Temporali, Monte Porzio Catone, aprile 2006 (con Loperfido N.)
- Forecasting volatility using high-frequency data, SIS 2006, Riunione Satellite *La statistica per le Imprese*, Torino, giugno 2006 (relazione invitata)
- A time-varying mixture MEM for realized volatility, S.Co. 2007, Venezia, settembre 2007 (relazione invitata, con Gallo G.M.)
- Modelling multivariate returns via asymmetric Archimedean copulae, CFE 2008, Neuchatel (CH), giugno 2008 (con Riveccio G. e Zuccolotto P.)
- Asymmetric multivariate tail dependence, SIS 2008, Cosenza, giugno 2008 (con Riveccio G.)
- Joint tail dependence in multivariate copulae, EURISBIS'09, Cagliari, giugno 2009 (relazione invitata, con Riveccio G. e Zuccolotto P.)
- Archimedean copulas and market risk in a financial crisis perspective, S.Co. 2009, Milano, settembre 2009 (relazione invitata, con Riveccio G. e Zuccolotto P.)

Seminari

The Skew-Normal distribution for financial returns, Università di Urbino (10 maggio 2001).

A Skew-in-mean Garch model for small capitalized markets, Università di Padova (20 settembre 2001).

A Multivariate Skew GARCH model, Università di Padova (dicembre 2004).

Time-varying mixing weights in Mixture Autoregressive Conditional Durations, Università di Salerno (17 maggio 2005).

Partecipazioni a Programmi di Ricerca di Interesse Nazionale (PRIN)

2000: Linearità e non linearità in modelli state space: problemi di specificazione, stima, verifica di ipotesi e previsione. Area 13: Scienze Economiche e Statistiche, Coordinatore nazionale programma di ricerca: Bee Dagum Estela, Responsabile scientifico unità di ricerca: Proietti Tommaso.

2002: Modelli state space lineari e non lineari: inferenza e applicazioni all'economia e alla finanza. Area 13: Scienze Economiche e Statistiche, Coordinatore nazionale programma di ricerca: Bee Dagum Estela, Responsabile scientifico unità di ricerca: Proietti Tommaso.

2003: L'evoluzione dei sistemi produttivi localizzati e la crescita economica del territorio. Area 13: Scienze Economiche e Statistiche, Coordinatore nazionale programma di ricerca: Filippucci Carlo, Responsabile scientifico unità di ricerca: Quintano Claudio.

2004: Stima parametrica e non parametrica delle dinamiche di momenti condizionali di serie storiche. Area 13: Scienze Economiche e Statistiche, Coordinatore nazionale programma di ricerca: Bee Dagum Estela, Responsabile scientifico unità di ricerca: Proietti Tommaso.

2006: Misure di volatilità e interdipendenze fra mercati finanziari: analisi e stabilità degli spillover. Area 13: Scienze Economiche e Statistiche, Coordinatore nazionale programma di ricerca: Paruolo Paolo, Responsabile scientifico unità di ricerca: Gallo Giampiero Maria.

Collaborazioni

Relazione sullo stato dell'ambiente in Umbria, a cura della Regione Umbria (1997).

Osservatorio Generale dei Prezzi, a cura della Regione Umbria (1998).

Indicatori bibliometrici (fonte: Harzing's Publish or Perish)

h-index: 4

g-index: 5

hc-index: 4

3. Attività didattica

Corsi

A.A. 2000/01

Controllo Statistico della Qualità, Facoltà di Economia, Università di Verona.

Statistica dei mercati monetari e finanziari, Facoltà di Economia, Università di Verona.

A.A. 2001/02

Controllo Statistico della Qualità, Facoltà di Economia, Università di Verona.

Statistica dei mercati finanziari I, Facoltà di Economia, Università di Verona.

Statistica dei mercati finanziari II, Facoltà di Economia, Università di Verona.

A.A. 2002/03

Controllo Statistico della Qualità, Facoltà di Economia, Università di Verona.

Statistica dei mercati finanziari I, Facoltà di Economia, Università di Verona.

Statistica dei mercati finanziari II, Facoltà di Economia, Università di Verona.

Statistica dei mercati monetari e finanziari, Facoltà di Economia, Università di Napoli Parthenope.

A.A. 2003/04

Statistica dei mercati monetari e finanziari, Facoltà di Economia (I livello), Università di Napoli Parthenope.

Serie Storiche Economiche, Facoltà di Economia (II livello), Università di Napoli Parthenope.

A.A. 2004/05

Statistica dei mercati monetari e finanziari, Facoltà di Economia (I livello), Università di Napoli Parthenope.

Analisi delle serie storiche e tecniche di previsione nel breve-medio periodo, Facoltà di Economia (II livello), Università di Napoli Parthenope.

A.A. 2005/06

Analisi delle serie storiche e tecniche di previsione nel breve-medio periodo, Facoltà di Economia (II livello), Università di Napoli Parthenope

Statistica dei mercati monetari e finanziari, Facoltà di Economia (I livello), Università di Napoli Parthenope.

Statistica, Facoltà di Economia (I livello), Università di Napoli Parthenope.

Statistica, Facoltà di Giurisprudenza (I livello), Università di Napoli Parthenope.

A.A. 2006/07

Analisi delle serie storiche e tecniche di previsione nel breve-medio periodo, Facoltà di Economia (II livello), Università di Napoli Parthenope

Statistica dei mercati monetari e finanziari, Facoltà di Economia (I livello), Università di Napoli Parthenope.

Statistica, Facoltà di Economia (I livello), Università di Napoli Parthenope

Statistica, Facoltà di Giurisprudenza (I livello), Università di Napoli Parthenope.

A.A. 2007/08

Analisi delle serie storiche e tecniche di previsione nel breve-medio periodo, Facoltà di Economia (II livello), Università di Napoli Parthenope

Statistica dei mercati monetari e finanziari, Facoltà di Economia (I livello), Università di Napoli Parthenope.

Statistica, Facoltà di Economia (I livello), Università di Napoli Parthenope

Statistica, Facoltà di Giurisprudenza (I livello), Università di Napoli Parthenope.

A.A. 2008/09

Statistica dei mercati monetari e finanziari, Facoltà di Economia (I livello), Università di Napoli Parthenope.

Statistica, Facoltà di Economia, (I livello), Università di Napoli Parthenope

Statistica, Facoltà di Giurisprudenza (I livello), Università di Napoli Parthenope.

Altri corsi

Ciclo di lezioni (5 giorni) *Stima della volatilità delle serie storiche finanziarie*, Corso per Esperti Finanziari, organizzato da Nemetria s.r.l., Foligno, PG, 1999.

Corso di *Statistica* (4 crediti) per il Master di I livello in Programmazione e Gestione delle Politiche e dei Servizi Sociali, Istituto Universitario Suor Orsola Benincasa, 2003

Ciclo di lezioni (8 ore) in *Statistica per i mercati finanziari*, Master di I livello in Economia e Gestione dell'Internazionalizzazione, Università di Urbino, 2003.

Corso di *Statistica* (4 crediti) per il Master di I livello in Programmazione e Gestione delle Politiche e dei Servizi Sociali, Istituto Universitario Suor Orsola Benincasa, 2004.

Corso di *Statistica* (20 ore) per I.F.T.S. Esperto di Marketing Turistico, Pompei (NA), 2004.

Corso di *Statistica* (50 ore) per I.F.T.S. Tecnico Superiore per le Produzioni Vegetali, Capaccio (SA), 2004.

Lezioni su *Il Conto Satellite del Turismo* (24 ore) per Master Internazionale per il Turismo, SDOA, Vietri sul Mare (SA), 2005.

Docenza del corso e-learning *Elementi di Statistica* (modulo 3), Università degli Studi di Napoli Parthenope, Progetto Mo.D.eM., a.a. 2007/08.

4. Altre informazioni

Membro della Società Italiana di Statistica.

Membro del collegio dei docenti del dottorato *Statistica Applicata al Territorio*, Università di Napoli Parthenope (coordinatore Prof. Quintano).

Attività di referaggio per *Computational Statistics and Data Analysis*, *Journal of Economic Dynamics and Control*, *Journal of Applied Statistics*, *Statistical Methods & Application*, *Statistica e Applicazioni* e *Metron*.

Componente della Commissione per il titolo di Dottore di ricerca in *Metodi Statistici e Matematici per la Ricerca Economica e Sociale*, Università di Perugia, 2004.

Componente della Commissione per il titolo di Dottore di ricerca in *Statistica Applicata*, Università di Firenze, 2007.

Organizzatore della sessione *High-frequency data in finance*, Conferenza *Computational and Financial Econometrics*, Ginevra, Aprile 2007.

Discussant nella sessione di contributi spontanei *Statistica per la Finanza*, SIS 2004, Bari, giugno 2004.

Discussant nella sessione organizzata *Models for the analysis of volatility in financial markets*, CLADAG 2009, Catania, settembre 2009.

Valutatore per lo *Standard Research Grants Program of the Social Sciences and Humanities Research Council of Canada (SSHRC)*.

Napoli, 18 gennaio 2010