

CURRICULUM VITAE del dott. Lucio De Capitani

1. INFORMAZIONI PERSONALI

Nome: LUCIO
Cognome: DE CAPITANI
Cittadinanza: ITALIANA

2. ISTRUZIONE E FORMAZIONE

- a) Diploma di MATURITA' SCIENTIFICA, conseguito presso il Liceo Scientifico Maria Gaetana Agnesi di Merate (LC) con voto 72/100.
- b) Laurea in ECONOMIA E COMMERCIO, curriculum Economico-Finanziario, conseguita il 4 luglio 2005 presso la Facoltà di Economia dell'Università degli Studi di Milano-Bicocca, con voto 110/110 CON LODE. Titolo della tesi: "Copule e Rischio di Credito", relatore Prof. Fabio Bellini, correlatore Prof. Michele Zenga.
- c) Dottorato di Ricerca in STATISTICA METODOLOGICA ED APPLICATA, conseguito il 16 ottobre 2009 presso l'Università degli Studi di Milano-Bicocca. Il dottorato di ricerca è stato conseguito usufruendo di BORSA DI STUDIO. Titolo della tesi: "Stima e verifica d'ipotesi sull'indice di Sharpe", tutor Prof. Michele Zenga.
- d) Dal 5 gennaio 2009 al 4 gennaio 2010 è stato assegnista di ricerca per il settore scientifico-disciplinare SECS-S/01 STATISTICA presso il dipartimento di Scienze Economiche e Metodi Quantitativi (dip. SEMEQ) dell'Università degli Studi del Piemonte Orientale, sede di Novara (responsabile scientifico prof. Daniele De Martini).
- e) Dal 5 gennaio 2010 al 31 dicembre 2013 è assegnista di ricerca per il settore scientifico-disciplinare SECS-S/01 STATISTICA presso il Dipartimento di Statistica e Metodi Quantitativi dell'Università degli Studi di Milano-Bicocca. Programma di ricerca: "Aspetti inferenziali di alcuni indici di performance degli investimenti azionari" (responsabile scientifico Prof. Claudio Borroni).
- e) Dall'1 gennaio 2014 al 31 dicembre 2017 è assegnista di ricerca per il settore scientifico-disciplinare SECS-S/01 STATISTICA presso il Dipartimento di Statistica e Metodi Quantitativi dell'Università degli Studi di Milano-Bicocca. Programma di ricerca: "Stima della Success Probability e della Reproducibility Probability ed applicazioni" (responsabile scientifico Prof. Daniele De Martini).

3. LINGUE STRANIERE CONOSCIUTE

a) INGLESE. Livello di conoscenza:

- capacità di comprensione di un testo scritto in inglese: BUONA;
- capacità di scrittura di un testo in inglese: BUONA;
- comprensione dell'inglese parlato: BUONA;
- capacità di esprimersi in inglese: BUONA.

b) FRANCESE. Livello di conoscenza:

- capacità di comprensione di un testo scritto in francese: SCOLASTICA;
- capacità di scrittura di un testo in francese: SCOLASTICA;
- comprensione del francese parlato: SCOLASTICA;
- capacità di esprimersi in francese: SCOLASTICA.

4. ATTIVITA' DIDATTICA A LIVELLO UNIVERSITARIO

Titolarità di corsi

Negli anni accademici 2013/2014, 2014/2015, 2015/2016, 2016/2017 e 2017/2018 è stato titolare del corso (da 3 cfu) di "Statistica dei Mercati Finanziari" nella Laurea Magistrale in Economia e Finanza presso la Scuola di Economia e Statistica, Università degli Studi di Milano-Bicocca.

Negli anni accademici 2015/2016 e 2017/2018 è stato titolare del corso (da 4 cfu) di "Statistica" nella laurea in Valorizzazione e Tutela dell'Ambiente e del Territorio Montano, Università degli Studi di Milano, sede di Edolo (BS).

Attività di supporto alla didattica (esercitazioni)

Negli anni accademici 2006/2007, 2007/2008, 2008/2009, 2009/2010 ha svolto le esercitazioni di "Analisi dei Dati II" (0.5 cfu) nel corso di Laurea Specialistica in Scienze Economico-Aziendali presso la Facoltà di Economia, Università degli Studi di Milano-Bicocca (Docente del corso: Prof.ssa Marcella Poliscchio).

Negli anni accademici 2006/2007, 2007/2008, 2008/2009, 2009/2010, 2010/2011, 2011/2012 ha svolto le esercitazioni di "Statistica Aziendale" (0.5 cfu) nel corso Laurea in Economia ed Amministrazione delle Imprese presso la Facoltà di Economia, Università degli Studi di Milano-Bicocca (Docente del corso: Prof. Claudio Borroni).

Negli anni accademici 2012/2013, 2013/2014, 2014/2015 e 2017/2018 ha svolto le esercitazioni di "Metodi Statistici per l'amministrazione delle imprese" (0.5 cfu) nel corso Laurea in Economia e Amministrazione delle Imprese presso la Scuola di Economia e Statistica, Università degli Studi di Milano-Bicocca (Docente del corso: Prof. Claudio Borroni).

Negli anni accademici 2013/2014, 2014/2015, 2015/2016, 2016/2017 e 2017/2018 ha svolto il corso di "Software statistici" (1.5 cfu, insegnamento di "Teoria dei campioni e software statistici") nel corso Laurea in Economia e Amministrazione delle Imprese presso la Scuola di Economia e Statistica, Università degli Studi di Milano-Bicocca.

Negli anni accademici 2009/2010, 2010/2011, 2011/2012 ha svolto le esercitazioni di "Teoria dei Campioni" (0.5 cfu) ne corso di Laurea in Economia, Statistica ed Informatica per l' Azienda presso la Facoltà di Economia, Università degli Studi di Milano-Bicocca (Docente del corso: Prof.ssa Angiola Pollastri).

Negli anni accademici 2009/2010, 2010/2011, 2011/2012, 2012/2013, 2013/2014, 2014/2015 ha svolto le esercitazioni di “Campionamento per la Revisione Contabile” (0.5 cfu) nel corso di Laurea Magistrale in Scienze Economico-Aziendali presso la Facoltà di Economia (Scuola di Economia e Statistica per gli anni 2012/2013, 2013/2014 e 2014/2015), Università degli Studi di Milano-Bicocca (Docente del corso: Prof.ssa Angiola Pollastri).

Negli anni accademici 2011/2012, 2012/2013, 2013/2014, 2014/2015, 2015/2016, 2016/2017 e **2017/2018** ha svolto le esercitazioni di “Inferenza Statistica” (0.5 cfu) nel corso di Laurea Magistrale in Economia e Finanza presso la Scuola di Economia e Statistica (Facoltà di economia per l’anno 2011/2012), Università degli Studi di Milano-Bicocca (Docente del corso: Prof.ssa Marcella Poliscchio e Prof. Michele Zenga).

Negli anni accademici 2010/2011, 2011/2012, 2012/2013, 2013/2014, 2014/2015, 2015/2016, 2016/2017 e **2017/2018** ha svolto le esercitazioni di “Rischio di Credito” (0.5 cfu) nel corso di Laurea Magistrale in Economia e Finanza presso la Scuola di Economia e Statistica (Facoltà di economia per l’anno 2011/2012), Università degli Studi di Milano-Bicocca (Docente del corso: Prof. Michele Zenga).

Negli anni accademici 2007/2008, 2009/2010 ha svolto le esercitazioni di “Probabilità, Distribuzioni e Regressione Multipla” (1 cfu) nel corso di Laurea in Economia, Statistica ed Informatica per l’Azienda presso la Facoltà di Economia, Università degli Studi di Milano-Bicocca (Docente del corso: Prof.ssa Anna Maria Fiori e Prof.ssa Angiola Pollastri).

Nell’anno accademico 2008/2009 ha svolto le esercitazioni di “Metodi Quantitativi I (modulo di Statistica Descrittiva)” (1 cfu) nel corso di Laurea in Economia delle Banche, delle Assicurazioni e degli Intermediari Finanziari presso la Facoltà di Economia, Università degli Studi di Milano-Bicocca (Docente del corso: Prof.ssa Anna Maria Fiori).

Negli anni accademici 2013/2014 e 2014/2015 ha svolto le esercitazioni di “Statistica I” (1 cfu) nel corso di Laurea in Economia ed Amministrazione delle Imprese presso la Scuola di Economia e Statistica, Università degli Studi di Milano-Bicocca (Docente del corso: Prof. Claudio Borroni).

Negli anni accademici 2014/2015, 2015/2016, 2016/2017 e **2017/2018** ha svolto le esercitazioni di “Metodi Statistici per il Management” (0.5 cfu) nel corso di Laurea Magistrale in Scienze Economico-Aziendali presso la Scuola di Economia e Statistica, Università degli Studi di Milano-Bicocca (Docente del corso: Prof. Alessandro Zini).

Nell’anno accademico **2017/2018** ha svolto le esercitazioni di “Calcolo delle Probabilità” (2 cfu) nel corso di Laurea in Statistica e Gestione delle Informazioni presso la Scuola di Economia e Statistica, Università degli Studi di Milano-Bicocca (Docente del corso: Prof. Claudio Borroni).

5. ATTIVITA' PROGETTUALE

Lucio De Capitani ha partecipato al progetto PRIN2007: *Metodi Statistici per l’Apprendimento nella Ricerca Clinica* (protocollo 2007AYHZWC).

7. CONGRESSI, CONVEGNI E SEMINARI

Partecipazione a congressi in qualità di relatore

“ISBIS-2008 International Symposium on Business and Industrial Statistics”, Praga, Repubblica Ceca, 1 - 4 luglio 2008 (presentando comunicazione [23]).

“45th Scientific Meeting della Società Italiana di Statistica”, riunione satellite “Statistics for Complex Problems: the Multivariate Permutation Approach and Related Topics”, Padova, 14-15 giugno 2010 (presentando comunicazione [24]).

“45th Scientific Meeting della Società Italiana di Statistica”, Padova, 29 giugno 2010 - 1 luglio 2010 (presentando comunicazione [25]).

“46th Scientific Meeting della Società Italiana di Statistica”, Roma, 20-22 giugno 2012 (presentando comunicazione [26]).

“JOINT MEETING of the International Biometric Society (IBS), Austro-Swiss and Italian Regions”, Milano, 15-19 giugno 2015 (poster session). Titolo del poster: Reproducibility probability estimation for common nonparametric testing (in collaborazione con D. De Martini).

“XVIII workshop on quantitative finance”, Milano, 25-27 gennaio 2017 (poster session). Titolo del poster: Improving Reproducibility Probability Estimation, preserving RP-testing (in collaborazione con D. De Martini)

Seminari

25 ottobre 2011, Dipartimento di Scienze Economiche e Statistiche (DiSES) dell’Università degli studi di Salerno. Titolo del seminario: “Interval estimation for some financial performance measures”.

10 novembre 2011, Dipartimento di Metodi Quantitativi per le Scienze Economiche ed Aziendali dell’Università degli studi di Milano-Bicocca. Titolo del Seminario: “Point and interval estimation for some financial performance measures”.

20 ottobre 2009, Dipartimento di Scienze Economiche e Metodi Quantitativi dell’Università degli Studi del Piemonte Orientale (sede di Novara). Tiene un seminario durante una riunione intermedia per un progetto PRIN2007. Titolo del seminario: “Stima della probabilità di riproducibilità per il test di Wilcoxon”, (con D. De Martini).

7 settembre 2010, Dipartimento di Medicina del Lavoro “Clinica del Lavoro L.Devoto” dell’Università degli Studi di Milano. Tiene un seminario durante una riunione finale per un progetto PRIN2007. Titolo del seminario: “Reproducibility Probability Estimation and Testing for the Wilcoxon Rank-Sum Test”, (con D.De Martini).

6. PUBBLICAZIONI

A. Tesi di dottorato

1. *Stima e Verifica d’Ipotesi sull’Indice di Sharpe*, (2009). Tesi di Dottorato di Ricerca in “Statistica Metodologica ed Applicata”, Dipartimento di Metodi Quantitativi per le Scienze Economiche ed Aziendali, Facoltà di Economia, Università degli Studi di Milano-Bicocca.

B. Articoli su rivista

2. On stochastic orderings of the Wilcoxon Rank Sum test statistic - with applications to reproducibility probability estimation testing. *Statistics & Probability Letters*, vol. 81, pp. 937–946, 2011.
(in collaborazione con De Martini D.)
3. Point and Interval Estimation for some financial performance measures. *Statistica & Applicazioni*, vol. IX, n. 2, pp. 129–158, 2011.
(in collaborazione con Zenga M.)
4. On the Behaviour of the Noncentral t Distribution when the Degrees of Freedom and the Noncentrality Parameter Diverge Together. *Far East Journal of Theoretical Statistics*, vol. 38, n. 1, pp. 1-7, 2012.

5. Interval Estimation for the Sharpe Ratio when returns are not i.i.d. with special emphasis on the GARCH(1,1) process with symmetric innovation. *Statistical Methods and Applications*, vol. 21, n. 4, pp. 517–537, 2012.
6. An Introduction to RP-Testing. *Epidemiology, Biostatistics and Public Health*, DOI 10.2427/8756, 2013.
7. The confluent hypergeometric-mixture of Poliscichio distributions: a generalized Zenga distribution. *Statistica & Applicazioni*, vol. XI, n. 1, pp. 23–48, 2013.
(in collaborazione con Zini A.)
8. A comparison among two generalized Beta-mixtures of Poliscichio distributions and the Zenga model. *Statistica & Applicazioni*, vol. XI, n. 2, pp. 193-230, 2013.
(in collaborazione con Zini A.)
9. Interval estimation for the Sortino Ratio and the Omega Ratio. *Communications in Statistics - Simulation and Computation*, vol. 43, n. 6, pp. 1385-1429, 2014.
10. Testing Serial Independence via Density-Based Measures of Divergence. *Methodology and Computing in Applied Probability*, vol. 16, n. 3, pp. 627-641, 2014.
(in collaborazione con Bagnato L. e Punzo A.)
11. Detecting Serial Dependencies with the Reproducibility Probability Autodependogram. *ASIA: Advances in Statistical Analysis*, vol. 98, n. 1, pp. 35-61, 2014.
(in collaborazione con Bagnato L. e Punzo A.)
12. Inference for performance measures for financial assets. *METRON*, vol. 73, n. 1, pp. 73-98, 2015.
(in collaborazione con Pasquazzi L.)
13. Reproducibility Probability Estimation and Testing for the Wilcoxon Rank-Sum Test. *Journal of Statistical Computation and Simulation*, vol. 85, n. 3, pp. 468-493, 2015.
(in collaborazione con De Martini D.)
14. SDD: An R package for serial dependence diagrams. *Journal of Statistical Software*, vol. 64, Code Snippet 2, pp. 1-19, 2015.
(in collaborazione con Bagnato L., Mazza A., Punzo A.)
15. On the distribution of the sum of cograduated discrete random variables with applications to credit risk analysis. *Statistics & Applications*, vol. XIII (1), pp. 77-105, 2015.
(in collaborazione con Zenga M.)
16. A comparison between nonparametric estimators for finite population distribution functions. *Survey Methodology*, vol. 42 (1), pp. 87-120, 2016.
(in collaborazione con Pasquazzi L.)
17. Reproducibility probability estimation and RP-testing for some nonparametric tests. *Entropy*, vol. 18 (4), Article Number 142, 2016.
(in collaborazione con De Martini D.)
18. The Kullback-Leibler autodependogram. *Journal of Applied Statistics*, vol. 43 (14), pp. 2574-2594, 2016.
(in collaborazione con Bagnato L. e Punzo A.)
19. Testing for serial independence: Beyond the Portmanteau approach. *The American Statistician*, DOI: 10.1080/00031305.2016.1264314, 2016.
(in collaborazione con Bagnato L. e Punzo A.)
20. A diagram to detect serial dependencies: an application to transport time series. *Quality & Quantity*, DOI: 10.1007/s11135-016-0426-y, 2017.
(in collaborazione con Bagnato L. e Punzo A.)
21. Trivariate Burr-III copula with applications to income data. *Metron*, vol. 75 (1), pp. 109-124, 2017.
(in collaborazione con Nicolussi F. e Zini A.)

22. Some remarks on Zenga's approach to kurtosis. *Statistics & Applications*, vol. XIV (1), pp. 159-195, 2016.
(in collaborazione con Poliscchio M.)

C. Proceedings (atti dei congressi)

23. Confidence Intervals and Hypotesis Testing on Sharpe Ratio. In atti della conferenza *ISBIS-2008 International Symposium on Business and Industrial Statistics*, pp. 19–20, 2008. ISBN: 978-80-86742-23-6.
24. Reproducibility Probability Testing for the Wilcoxon Rank-Sum Test. In atti della conferenza satellite "Statistics for Complex Problems: the Multivariate Permutation Approach and Related Topics" del 45th Scientific Meeting della Società Italiana di Statistica, pp. 98–100, 2010. ISBN: 978-88-6129-561-2.
(in collaborazione con De Martini D.)
25. Point and Interval Estimation for some financial performance measures. In: 45th Scientific Meeting of the Italian Statistical Society, Proceedings. ISBN: 978-88-6129-566-7.
26. RP-Estimation and Testing for some common non-parametric tests. In: 46th Scientific Meeting of the Italian Statistical Society, Proceedings. ISBN: 978-88-6129-882-8.
(in collaborazione con De Martini D.)
27. A Finite Population CDF-Estimator for a General Nonparametric Superpopulation Model In atti della conferenza ITACOSM2013. ISBN 978-88-6292-390-3.
(in collaborazione con Pasquazzi L.)
28. Improving the Autodependogram Using the Kullback-Leibler Divergence. In atti del 41st Annual Meeting of the Statistical Society of Canada, 26-29 Maggio 2013, University of Alberta, Edmonton, Alberta.
(in collaborazione con Bagnato L. e Punzo A.)
29. Quantile Estimation with Auxiliary Information: Simulation Results. In: 47th Scientific Meeting of the Italian Statistical Society, Proceedings. ISBN: 978-88-8467-874-4.
(in collaborazione con Pasquazzi L.)
30. The Multivariate Burr III copula with applications to income data. In: *Statistics and Demography: the Legacy of Corrado Gini*. Atti della conferenza SIS 2015 tenutasi in Treviso dal 9 all'11 settembre 2015. ISBN: 978-88-6787-452-1.
(in collaborazione con Zini A. e Nicolussi F.)
31. Optimal Ethical Balance for Phase III Trials Planning. In: 48th Scientific Meeting of the Italian Statistical Society, Proceedings. e-ISBN: 978-88-6453-521-0
(in collaborazione con De Martini D.)

7. ALTRE ATTIVITA'

Abilitazione Scientifica Nazionale

Lucio De Capitani ha conseguito l'Abilitazione Scientifica Nazionale (II fascia) nel luglio 2017.

Attività in qualità di referee

Lucio De Capitani è stato Referee per le riviste: *Journal of Applied Statistics*, *Mathematical Economics*, *Statistics & Applications*, *Entropy*.

Partecipazione a comitati editoriali di riviste specialistiche

Lucio De Capitani fa parte del comitato editoriale della rivista *Statistics & Applications*.

Attività di divulgazione scientifica

Lucio De Capitani ha curato la traduzione dall'italiano all'inglese degli articoli:

- Gaetano Pietra (1915), Delle relazioni tra gli indici di variabilità: Parte I, Atti del reale istituto di scienze, lettere ed arti, Anno Accademico 1914-1915, Tomo LXXIV, Parte Seconda. L'articolo tradotto in inglese è stato pubblicato sulla rivista *Statistica & Applicazioni*, vol. XI (2013), n.1, pp. 7-22.
- Gaetano Pietra (1915), Delle relazioni tra gli indici di variabilità: Parte II, Atti del reale istituto di scienze, lettere ed arti, Anno Accademico 1914-1915, Tomo LXXIV, Parte Seconda. L'articolo tradotto in inglese è stato pubblicato sulla rivista *Statistica & Applicazioni*, vol. XI (2013), n.2, pp. 123-132.

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

MILANO, 18/01/2018

