

# Curriculum



Nome Name:	Giuseppe
Cognome Surname:	CAVALIERE

ORCID:	n.d.
Scopus Author ID:	n.d.
WOS Author ID:	n.d.
Sito WEB WEB site:	n.d.

## **POSIZIONE PROFESSIONALE ATTUALE / CURRENT PROFESSIONAL POSITION:**

Posizione attuale Current position:	In servizio
Qualifica Qualification:	Professore Ordinario
Ateneo/Ente/Azienda University/Institution/Company:	Alma Mater Studiorum - Università di BOLOGNA
Nazione Ateneo/Ente/Azienda University/Institution/Company Country:	ITA
Anno inizio Start Year:	2006
Anno fine End Year:	n.d.

## **PRECEDENTI ESPERIENZE LAVORATIVE (ULTIMI 10 ANNI) / PREVIOUS WORK EXPERIENCE ( LAST 10 YEARS):**

Qualifica Qualification:	Professore Ordinario
-----------------------------	----------------------

Ateneo/Ente/Azienda University/Institution/Company	Alma Mater Studiorum - Università di BOLOGNA
Posizione Sede Lavorativi (indicare Nazione e Città) Workplace Location (specify Country and City):	n.d.
Anno inizio Start Year:	2006
Anno fine End Year:	n.d.
Descrizione Description:	Ordinario di Econometria dal 1.10.2006

### LINGUE / LANGUAGES:

Lingua Language:	Inglese
Scrittura Writing:	C2
Comunicazione Communication:	C2

### AREA/SETTORE SCIENTIFICO-DISCIPLINARE / AREA/SECTOR SCIENTIFIC-DISCIPLINARY

Area scientifico-disciplinare Area scientific-disciplinary:	Scienze economiche e statistiche
Area scientifico-disciplinare codice Area scientific-disciplinary code:	13
Settore scientifico-disciplinare codice Sector scientific-disciplinary code:	-Econometria
Settore scientifico-disciplinare codice Sector scientific-disciplinary code:	-ECON-05/A

### DESCRIZIONE DEI PRINCIPALI RISULTATI SCIENTIFICI CONSEGUITI NEGLI ULTIMI 10 ANNI (CON ANNESSO ELENCO DI MASSIMO 10 PUBBLICAZIONI) / DESCRIPTION OF THE MAIN SCIENTIFIC RESULTS ACHIEVED IN THE LAST 10 YEARS (WITH ATTACHED LIST OF MAXIMUM 10 PUBLICATIONS):

Descrizione Description:	<i>The contributions over the past decade have enriched the fields of econometrics and statistical analysis, particularly in the areas of bootstrap methods, time-series analysis, co-integration, and the handling of complex data characteristics like heteroskedasticity and non-stationarity. The work not only advances theoretical understanding but also provides practical tools for empirical researchers in economics and finance. 1. Advancements in Bootstrap Methods: significant</i>
-----------------------------	--

	<p><i>contributions to bootstrap inference, particularly in the context of econometrics and time series analysis. This includes developing techniques for bootstrap inference in the presence of bias, under random limit bootstrap measures, and on the boundary of the parameter space. 2. Co-integration Analysis in Econometrics: extensive exploration of co-integration analysis in vector autoregression (VAR) models, especially under conditions of heteroskedasticity. This includes methods for determining the co-integration rank in these models and testing hypotheses on co-integration relations. 3. Time-Series Econometrics: Advances in the understanding of time-series econometrics, especially in dealing with non-stationary and heavy-tailed processes. This encompasses research on non-stationary stochastic volatility, fractional time series models, and methods for handling infinite variance in time series data. 4. Methodological Contributions to Econometric Theory: developing new econometric methods or enhancing existing ones. This includes work on Proxy-SVARs, GARCH processes, and ACD models, as well as various applications of bootstrap methods in econometrics. 5. Application of Econometric Methods in Financial and Macroeconomic Analysis: Some of the research also involves applying these advanced econometric methods to practical problems in finance and macroeconomics, like modeling corporate defaults, evaluating the accuracy of tail risk forecasts, and analyzing price dynamics in commodity markets.</i></p>
--	--

## **PUBBLICAZIONI / PUBLICATIONS:**

Anno della pubblicazione Year of publication:	2021
Citazione Citation:	Boswijk, H. Peter, Cavaliere, Giuseppe, Georgiev, Iliyan, Rahbek, Anders (2021). Bootstrapping non-stationary stochastic volatility. JOURNAL OF ECONOMETRICS, vol. 224, p. 161-180, ISSN: 0304-4076, doi: 10.1016/j.jeconom.2021.01.005

Anno della pubblicazione Year of publication:	2024
Citazione Citation:	Barigozzi, Matteo, Cavaliere, Giuseppe, Trapani, Lorenzo (2024). Inference in heavy-tailed non-stationary multivariate time series. JOURNAL OF THE AMERICAN STATISTICAL ASSOCIATION, vol. 119, p. 565-581, ISSN: 0162-1459, doi: 10.1080/01621459.2022.2128807

Anno della pubblicazione Year of publication:	2015
Citazione Citation:	CAVALIERE, GIUSEPPE, Heino Bohn Nielsen, Anders Rahbek (2015). Bootstrap testing of hypotheses on co-integration relations in VAR models. ECONOMETRICA, vol. 83, p. 813-831, ISSN: 0012-9682, doi: 10.3982/ECTA11952

Anno della pubblicazione Year of publication:	2020
Citazione Citation:	Giuseppe Cavaliere, Iliyan Georgiev (2020). Inference under random limit bootstrap measures. <i>ECONOMETRICA</i> , vol. 88, p. 2547-2574, ISSN: 0012-9682, doi: 10.3982/ECTA16557

Anno della pubblicazione Year of publication:	2020
Citazione Citation:	Cavaliere, Giuseppe, Nielsen, Heino Bohn, Rahbek, Anders (2020). Bootstrapping Noncausal Autoregressions: With Applications to Explosive Bubble Modeling. <i>JOURNAL OF BUSINESS &amp; ECONOMIC STATISTICS</i> , vol. 38, p. 55-67, ISSN: 0735-0015, doi: 10.1080/07350015.2018.1448830

Anno della pubblicazione Year of publication:	2023
Citazione Citation:	Cavaliere G., Lu Y., Rahbek A., Staerk-Ostergaard J. (2023). Bootstrap inference for Hawkes and general point processes. <i>JOURNAL OF ECONOMETRICS</i> , vol. 235, p. 133-165, ISSN: 0304-4076, doi: 10.1016/j.jeconom.2022.02.006

Anno della pubblicazione Year of publication:	2022
Citazione Citation:	Cavaliere, Giuseppe, Nielsen, Heino Bohn, Pedersen, Rasmus Søndergaard, Rahbek, Anders (2022). Bootstrap inference on the boundary of the parameter space, with application to conditional volatility models. <i>JOURNAL OF ECONOMETRICS</i> , vol. 227, p. 241-263, ISSN: 0304-4076, doi: 10.1016/j.jeconom.2020.05.006

Anno della pubblicazione Year of publication:	2024
Citazione Citation:	Angelini, G, Cavaliere, G, Fanelli, L (2024). An identification and testing strategy for proxy-SVARs with weak proxies. <i>JOURNAL OF ECONOMETRICS</i> , vol. 238, p. 1-18, ISSN: 0304-4076, doi: 10.1016/j.jeconom.2023.105604

Anno della pubblicazione Year of publication:	2024
Citazione Citation:	Cavaliere, Giuseppe, Gonçalves, Sílvia, Nielsen, Morten Ørregaard, Zanelli, Edoardo (2024). Bootstrap Inference in the Presence of Bias. <i>JOURNAL OF THE AMERICAN STATISTICAL ASSOCIATION</i> , vol. 119, p. 1-12, ISSN: 0162-1459, doi: 10.1080/01621459.2023.2284980

Anno della pubblicazione Year of publication:	2024
Citazione Citation:	Cavaliere, Giuseppe, Mikosch, Thomas, Rahbek, Anders, Vilandt, Frederik (2024). Tail behavior of ACD models and consequences for likelihood-based estimation. <i>JOURNAL OF ECONOMETRICS</i> ,

**DESCRIZIONE DEI PRINCIPALI PROGETTI DI RICERCA E PREMI CONSEGUITI NEGLI ULTIMI 10 ANNI (CON ANNESSO ELENCO DI MASSIMO 10 RISULTATI, INCLUDENDO, A TITOLO DI ESEMPIO, PRINCIPAL INVESTIGATOR O COORDINATORE LOCALE DI PROGETTI DI RICERCA COMPETITIVI NAZIONALI O INTERNAZIONALI, SIGNIFICATIVI PREMI CONSEGUITI PER LA PROPRIA ATTIVITÀ DI RICERCA)/ DESCRIPTION OF THE MAIN RESEARCH PROJECTS AND AWARDS AWARDED IN THE LAST 10 YEARS (WITH ATTACHED LIST OF MAXIMUM 10 ACHIEVEMENTS, INCLUDING, FOR EXAMPLE, PRINCIPAL INVESTIGATOR OR LOCAL COORDINATOR OF NATIONAL OR INTERNATIONAL COMPETITIVE RESEARCH PROJECTS, SIGNIFICANT AWARDS AWARDED FOR YOUR RESEARCH ACTIVITY):**

Descrizione Description:	<i>Proponent/Co-proponent of several projects, including the PRIN initiatives and international grants. These have been central to advancing research in econometrics and finance, from exploring bootstrap methods in complex econometric models to analyzing risks in sustainable investing and dissecting high-dimensional network structures in macroeconomics and finance.</i>
-----------------------------	---

Descrizione Description:	Prin 2020 2020B2AKFW
-----------------------------	----------------------

Descrizione Description:	Prin 2017 2017TA7TYC
-----------------------------	----------------------

**DESCRIZIONE DEI PRINCIPALI RISULTATI CONSEGUITI NEGLI ULTIMI 10 ANNI IN TERMINI DI SVILUPPO DI RETI E RELAZIONI SCIENTIFICHE NAZIONALI E INTERNAZIONALI (CON ANNESSO ELENCO DI MASSIMO 5 RISULTATI, INCLUDENDO, A TITOLO DI ESEMPIO, PARTECIPAZIONE O ORGANIZZAZIONE DI CONVEGNI NAZIONALI E INTERNAZIONALI; CONTRIBUTI A CONSORZI DI RICERCA) / DESCRIPTION OF THE MAIN RESULTS ACHIEVED IN THE LAST 10 YEARS IN TERMS OF DEVELOPMENT OF NATIONAL AND INTERNATIONAL SCIENTIFIC NETWORKS AND RELATIONS (WITH ATTACHED LIST OF MAXIMUM 5 RESULTS, INCLUDING, FOR EXAMPLE, PARTICIPATION OR ORGANIZATION OF**

**NATIONAL AND INTERNATIONAL CONFERENCES;  
CONTRIBUTIONS TO RESEARCH CONSORTIA):**

Descrizione Description:	<i>Giuseppe Cavaliere has contributed to the development of national and international scientific networks and relationships in the field of econometrics and empirical economics. This has been achieved through active participation and organization of numerous prestigious conferences and workshops, as well as through delivering invited talks at various esteemed institutions worldwide.</i>
-----------------------------	--

Descrizione Description:	European Meeting of the Econometrics Society 2024, member of the program committee as lead for Econometrics
-----------------------------	---

**DESCRIZIONE DEI PRINCIPALI RISULTATI CONSEGUITI NEGLI  
ULTIMI 10 ANNI IN TERMINI DI SUPPORTO ALLA COMUNITÀ  
SCIENTIFICA (CON ANNESSO ELENCO DI MASSIMO 5 RISULTATI,  
INCLUDENDO, A TITOLO DI ESEMPIO, RESPONSABILITÀ DI  
DIREZIONE DI COMITATI EDITORIALI; INCARICHI DI  
VALUTAZIONE DELLA RICERCA PRESSO ISTITUZIONI  
NAZIONALI O INTERNAZIONALI; RESPONSABILITÀ  
ISTITUZIONALI ALL'INTERNO DELL'ISTITUZIONE DI  
APPARTENENZA O DI ALTRE ISTITUZIONI) / DESCRIPTION OF  
THE MAIN RESULTS ACHIEVED IN THE LAST 10 YEARS IN TERMS  
OF SUPPORT TO THE SCIENTIFIC COMMUNITY (WITH  
ATTACHED LIST OF MAXIMUM 5 RESULTS, INCLUDING, FOR  
EXAMPLE, MANAGEMENT RESPONSIBILITIES OF EDITORIAL  
COMMITTEES; RESEARCH EVALUATION ROLES AT NATIONAL  
OR INTERNATIONAL INSTITUTIONS; INSTITUTIONAL  
RESPONSIBILITIES WITHIN THE INSTITUTION OF AFFILIATION  
OR OTHER INSTITUTIONS):**

Descrizione Description:	<i>Participation in editorial boards of leading econometrics journals and extensive referee work for a broad range of publications.</i>
-----------------------------	---

Descrizione Description:	Journal of Econometrics, Associate Editor since 2020
-----------------------------	--

Descrizione Description:	Econometric Theory, Co-Editor 2009
-----------------------------	------------------------------------

Descrizione	Econometrics Journal, Associate Editor 2012-
-------------	--

Description:	2023
--------------	------

Descrizione Description:	Journal of Econometrics, Co-Editor (2024-2027)
-----------------------------	--

**DESCRIZIONE DEI PRINCIPALI RISULTATI CONSEGUITI NEGLI ULTIMI 10 ANNI IN TERMINI VALORIZZAZIONE DELLE CONOSCENZE (CON ANNESSO ELENCO DI MASSIMO 3 RISULTATI, RELATIVI ALLA PARTECIPAZIONE DEL CANDIDATO ALLE ATTIVITÀ DI VALORIZZAZIONE DELLE CONOSCENZE) / DESCRIPTION OF THE MAIN RESULTS ACHIEVED IN THE LAST 10 YEARS IN TERMS OF KNOWLEDGE VALORIZATION (WITH ATTACHED LIST OF MAXIMUM 3 RESULTS, RELATING TO THE CANDIDATE'S PARTICIPATION IN KNOWLEDGE VALORIZATION ACTIVITIES):**

Descrizione Description:	
-----------------------------	--

**Informazioni aggiornate alla data di candidatura 30-04-2025**

**Giuseppe CAVALIERE**

*Il presente curriculum costituisce allegato e parte integrante dell'incarico sottoscritto*