

Curriculum



Nome Name:	Enzo
Cognome Surname:	D'INNOCENZO

ORCID:	0000-0002-6040-8783
Scopus Author ID:	57224823258
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:	Ricercatore a t.d. - t.pieno (art. 24 c.3-a L. 240/10)
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:	2024
Anno fine End Year:	n.d.

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

Qualifica Qualification:	Ricercatore a tempo det.
-----------------------------	--------------------------

Ateneo/Ente/Azienda University/Institution/Company	VU University Amsterdam
Posizione Sede Lavorativi (indicare Nazione e Città) Workplace Location (specify Country and City):	Amsterdam, NH, Paesi Bassi
Anno inizio Start Year:	2021
Anno fine End Year:	2023
Descrizione Description:	RESEARCH ASSOCIATE - School of Business and Economics, Department of Econometrics and Data Science

Qualifica Qualification:	Contratto di ricerca (art.22 L.79/2022)
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):	Bologna
Anno inizio Start Year:	2019
Anno fine End Year:	2021
Descrizione Description:	RESEARCH FELLOW - Department of Statistical Sciences

LINGUE / LANGUAGES:

Lingua Language:	Inglese
Scrittura Writing:	B2
Comunicazione Communication:	B2

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:	-Economia politica
Settore scientifico-disciplinare codice Sector scientific-disciplinary code:	-ECON-01/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):**

<p>Descrizione Description:</p>	<p><i>01/03/2023 - Present: Junior Assistant Professor - RTD-A P9 - Progetto di ricerca: Titolo "Crescita resiliente, inclusiva e sostenibile" Copertura finanziaria: Fondi PNRR - Bando PE - Progetto PE9 - GRINS "Growing Resilient, INclusive and Sustainable", Codice PE0000018,CUP: J33C22002910001 Project: PNRR "Growing Resilient, INclusive and Sustainable - GRINS" - Spoke 4 WP3. My research focus on "Quantifying the Effect of Climate Change on Extreme Events", with Prof. Luca Fanelli and Prof. Giuseppe Cavaliere (University of Bologna). Specifically, I am delving into the topic of meteorological droughts. Droughts, with their nonlinear characteristics in space and time, are one of the most challenging and least understood climate phenomena. In our studies, we're developing novel econometric methods to tackle this intricate issue. We're investigating the relationship between climate oscillations and drought through a multivariate heavy-tailed model. To do this, we're harnessing different indices, with the Standardized Precipitation Index (SPI) taking a central role. - On November 3rd, 2023 I have presented our ongoing project at the Spoke 4 Giornata di Studio, Università Ca' Foscari Venezia, for the GRINS - Spoke 4 Kick Off Meeting. - From February 2024, I am also the coordinator of the "Gruppo di Lavoro e Coordinamento ISTAT" for the spoke 4 with the WP4. The main goals, consist in unify and organize all the relevant scientific results obtained by different research groups, before their submission for official publications.</i></p>
-------------------------------------	--

PUBBLICAZIONI / PUBLICATIONS:

<p>Anno della pubblicazione Year of publication:</p>	<p>2024</p>
<p>Citazione Citation:</p>	<p>Enzo D'Innocenzo, Andre Lucas (2024). Dynamic partial correlation models. JOURNAL OF ECONOMETRICS, vol. 241, p. 1-17, ISSN: 0304-4076, doi: 10.1016/j.jeconom.2024.105747</p>

<p>Anno della pubblicazione Year of publication:</p>	<p>2024</p>
<p>Citazione Citation:</p>	<p>Francisco Blasques, Enzo D'Innocenzo, Siem Jan Koopman (2024). Common and idiosyncratic conditional volatility: Theory and empirical evidence from electricity prices. ECONOMETRIC REVIEWS, vol. 43, p. 638-670, ISSN: 1532-4168, doi: 10.1080/07474938.2024.2357430</p>

Anno della pubblicazione Year of publication:	2024
Citazione Citation:	Guizzardi, Andrea, Ballestra, Luca Vincenzo, D'Innocenzo, Enzo (2024). Reverse engineering the last-minute on-line pricing practices: an application to hotels. STATISTICAL METHODS & APPLICATIONS, vol. 33, p. 943-971, ISSN: 1618-2510, doi: 10.1007/s10260-024-00751-3

Anno della pubblicazione Year of publication:	2024
Citazione Citation:	D'Innocenzo, Enzo, Lucas, André, Opschoor, Anne, Zhang, Xingmin (2024). Heterogeneity and dynamics in network models. JOURNAL OF APPLIED ECONOMETRICS, vol. 39, p. 150-173, ISSN: 0883-7252, doi: 10.1002/jae.3013

Anno della pubblicazione Year of publication:	2024
Citazione Citation:	Ballestra, Luca Vincenzo, D'Innocenzo, Enzo, Guizzardi, Andrea (2024). A new bivariate approach for modeling the interaction between stock volatility and interest rate: An application to S&P500 returns and options. EUROPEAN JOURNAL OF OPERATIONAL RESEARCH, vol. 314, p. 1185-1194, ISSN: 0377-2217, doi: 10.1016/j.ejor.2023.11.049

Anno della pubblicazione Year of publication:	2023
Citazione Citation:	Gasperoni, Francesca, Luati, Alessandra, Paci, Lucia, D'Innocenzo, Enzo (2023). Score Driven Modeling of Spatio-temporal Data. JOURNAL OF THE AMERICAN STATISTICAL ASSOCIATION, vol. 118, p. 1066-1077, ISSN: 0162-1459, doi: 10.1080/01621459.2021.1970571

Anno della pubblicazione Year of publication:	2024
Citazione Citation:	Enzo D'Innocenzo, André Lucas, Bernd Schwaab and Xin Zhang (2024). Modeling extreme events: time-varying extreme tail shape*. JOURNAL OF BUSINESS & ECONOMIC STATISTICS, vol. 42, p. 903-917, ISSN: 0735-0015, doi: 10.1080/07350015.2023.2260439

Anno della pubblicazione Year of publication:	2023
Citazione Citation:	Enzo D'Innocenzo, Alessandra Luati, Mario Mazzocchi (2023). A robust score-driven filter for multivariate time series. ECONOMETRIC REVIEWS, vol. 42, p. 441-470, ISSN: 0747-4938, doi: 10.1080/07474938.2023.2198930

Anno della pubblicazione Year of publication:	2024
Citazione	Ballestra, Luca Vincenzo, D'Innocenzo, Enzo, Guizzardi, Andrea (2024). Score-Driven Modeling

Citation:	with Jumps: An Application to S&P500 Returns and Options. JOURNAL OF FINANCIAL ECONOMETRICS, vol. 22, p. 375-406, ISSN: 1479-8409, doi: 10.1093/jjfinec/nbad001
-----------	---

Anno della pubblicazione Year of publication:	2022
Citazione Citation:	Guizzardi, Andrea, Ballestra, Luca Vincenzo, D'Innocenzo, Enzo (2022). Hotel dynamic pricing, stochastic demand and covid-19. ANNALS OF TOURISM RESEARCH, vol. 97, p. 1-15, ISSN: 0160-7383, doi: 10.1016/j.annals.2022.103495

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:	
-----------------------------	--

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:	
-----------------------------	--

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:	
-----------------------------	--

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 16-05-2025

Enzo D'INNOCENZO

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

