



ALLA MAGNIFICA RETTRICE
DELL'UNIVERSITA' DEGLI STUDI DI MILANO

COD. ID: 7068

Il sottoscritto chiede di essere ammesso a partecipare alla selezione pubblica, per titoli ed esami, per il conferimento di un assegno di ricerca presso il Dipartimento di **Economia, Management e Metodi Quantitativi**.

Responsabile scientifico: **Prof. Rossini Luca**

Emilija Dzuverovic

CURRICULUM VITAE

INFORMAZIONI PERSONALI

| | |
|----------------|------------|
| Cognome | Dzuverovic |
| Nome | Emilija |

OCCUPAZIONE ATTUALE

| | |
|---------------------|---|
| Incarico | Struttura |
| Postdoctoral Fellow | Dipartimento di Economia e Management, Università di Pisa |

ISTRUZIONE E FORMAZIONE

| Titolo | Corso di studi | Università | anno conseguimento titolo |
|---------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|----------------------------------|
| Laurea Magistrale o equivalente | Banking and Finance | Università Cattolica del Sacro Cuore | 2019 |
| Dottorato Di Ricerca | Economics, Management and Statistics | Università degli Studi di Messina | 2024 |

PUBBLICAZIONI

| |
|--|
| Bauwens, L., Dzuverovic, E., & Hafner, C. (n.d.). Asymmetric Models for Realized Covariances [submitted to IJF]. |
| Buccheri, G., Corsi, F., & Dzuverovic, E. (n.d.). From Rotational to Scalar Invariance: Enhancing Identifiability in Score-Drive Factor Models [submitted to JAE]. |
| Bauwens, L., Dzuverovic, E., & Hafner, C. (2024). Asymmetric Models for Realized Covariances. LIDAM CORE Discussion Paper 2024/24. |
| Buccheri, G., Corsi, F., & Dzuverovic, E. (2024). From Rotational to Scalar Invariance: Enhancing Identifiability in Score-Drive Factor Models. Available at SSRN: https://ssrn.com/abstract=5040719 . |
| Dzuverovic, E., & Barigozzi, M. (2024). Hierarchical DCC-HEAVY Model for High-Dimensional Covariance Matrices. arXiv: 2305.08488v2 [econ.EM] |
| Dzuverovic, E., & Otranto, E. (2024). Nonlinear HAR Models and Nonlinear Least Squares: Asymptotic Properties. <i>Advanced Methods in Statistics, Data Science and Related Applications</i> , Springer. |
| Dzuverovic, E., & Otranto, E. (2022). Asymptotic Properties of the Nonlinear Least Squares Estimator in HE-HAR Models. In "Book of Short Papers SIS 2022" (Eds. A. Balzanella, M. Bini, C. Cavicchia and R. Verde), Pearson. |



UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI MILANO

INSEGNAMENTO

| Anno | Corso | Programma |
|------------------|---|--|
| 2024/25 | Time Series Econometrics | PhD in Economics, Tuscan Universities (Florence, Siena, and Pisa) |
| 2024/25, 2023/24 | Econometrics for Financial Markets | Master in Risk Management, University of Pisa |
| 2022/23 | TA in Models for Financial Data and Models for Time Series | PhD in Economics, Management and Statistics, University of Messina |
| 2022/23 | TA in Econometrics | MSc in Economics, University of Messina |

CONGRESSI, CONVEGNI E SEMINARI

| Data | Titolo | Sede |
|---------------|--|-----------------------------------|
| 21-22/03/2025 | 32 nd Symposium of the Society for Nonlinear Dynamics & Econometrics (SNDE2025) | San Antonio, Texas, United States |
| 23/01/2025 | Young Economists of Tuscan Institutions Meeting (YETI2025) | Pisa, Italy |
| 18-20/12/2024 | 1 st CAM-Risk Conference | Pavia, Italy |
| 6-7/12/2024 | 35 th (EC)2 Conference: Unravelling Misspecification and Identification in Econometrics | Amsterdam, Netherlands |
| 25-26/01/2024 | 4 th Italian Workshop of Econometrics and Empirical Economics (IWEEE2024) | Bolzano, Italy |
| 15-18/06/2023 | 15 th Annual SoFiE Conference | Seoul, Republic of Korea |
| 8-9/06/2023 | 5 th Quantitative Finance and Financial Econometrics (QFFE) Conference | Marseille, France |
| 9-10/12/2022 | 33 rd (EC)2 Conference: Econometrics of High Frequency Data & Factor Models | Paris, France |
| 22-24/06/2022 | 51 st Scientific Meeting of the Italian Statistical Society (SIS2022) | Caserta, Italy |

LINGUE STRANIERE CONOSCIUTE

| lingue | livello di conoscenza |
|----------|-----------------------|
| Inglese | C1 |
| Italiano | C1 |
| Russo | C1 |
| Serbo | C2 |

PREMI, RICONOSCIMENTI E BORSE DI STUDIO

| anno | Descrizione premio |
|-----------|------------------------|
| 2021-2024 | Borsa di dottorato |
| 2023 | SOFIE borsa di viaggio |

ATTIVITÀ DI RICERCA

| |
|--|
| Financial Economics, Econometrics, High-Dimensional Data, Market Microstructure |
|--|



ISCRIZIONE AD ORDINI PROFESSIONALI

| Anno iscrizione | Ordine | Città |
|-----------------|---------------------------------|-----------|
| 2022 | Società Italiana di Econometria | Bertinoro |
| 2022 | Società Italiana di Statistica | Roma |

ALTRE INFORMAZIONI

| |
|--|
| Coding: Matlab, R, Stata, SAS |
| Banche dati: NYSE TAQ, Bloomberg, Refinitiv Eikon |
| Attività editoriali: Journal of Financial Econometrics, Big Data Research |

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

Il presente curriculum, non contiene dati sensibili e dati giudiziari di cui all'art. 4, comma 1, lettere d) ed e) del D.Lgs. 30.6.2003 n. 196.

RICORDIAMO che i **curricula SARANNO RESI PUBBLICI sul sito di Ateneo** e pertanto si prega di non inserire dati sensibili e personali. Il presente modello è già precostruito per soddisfare la necessità di pubblicazione senza dati sensibili.

Si prega pertanto di **NON FIRMARE** il presente modello.

Luogo e data: Pisa, 23/01/2025