

PROCEDURA SELETTIVA DI CHIAMATA PER N. 1 POSTO DI RICERCATORE A TEMPO DETERMINATO DI TIPOLOGIA B PER IL SETTORE CONCORSUALE 13/D4 - SETTORE SCIENTIFICO-DISCIPLINARE SECS-S/06 - PRESSO IL DIPARTIMENTO DI METODI E MODELLI PER IL TERRITORIO, L'ECONOMIA E LA FINANZA DELL'UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI ROMA "LA SAPIENZA" BANDITA CON D.R. N. 1616/2022 DEL 11.05.2022

VERBALE N. 3 – SEDUTA VALUTAZIONE TITOLI

L'anno 2022, il giorno 16 del mese di settembre si è riunita per via telematica tramite la piattaforma Google Meet (link <https://meet.google.com/qdo-hcxf-kvu>) la Commissione giudicatrice della procedura selettiva di chiamata per n. 1 posto di Ricercatore a tempo determinato di tipologia B per il Settore concorsuale 13/D4 – Settore scientifico-disciplinare SECS-S/06 - presso il Dipartimento di Metodi e Modelli per il Territorio, l'Economia e la Finanza dell'Università degli Studi di Roma "La Sapienza", nominata con D.R. n. 2419/2022 del 05/08/2022 e composta da:

- Prof.ssa Sabrina Mulinacci – professore associato presso il Dipartimento di Scienze Statistiche "Paolo Fortunati" dell'Università degli Studi di Alma Mater Studiorum Università di Bologna;
- Prof.ssa Silvia Romagnoli – professore ordinario presso il Dipartimento di Scienze Statistiche "Paolo Fortunati" dell'Università degli Studi di Alma Mater Studiorum Università di Bologna;
- Prof.ssa Barbara Vantaggi– professore ordinario presso il Dipartimento di Metodi e Modelli per il Territorio, l'Economia e la Finanza di "Sapienza" Università di Roma.

La Commissione, presa visione dell'elenco dei candidati e delle rinunce sino ad ora pervenute, prende atto che i candidati da valutare ai fini della procedura sono n. 6, e precisamente:

1. Calvia Alessandro
2. Grassetti Francesca
3. Martire Antonio Luciano
4. Mazzarisi Piero
5. Patacca Marco
6. Pratico Flavio

La Commissione inizia la valutazione dei titoli e delle pubblicazioni dei candidati, seguendo l'ordine alfabetico.

Il Presidente ricorda che le pubblicazioni redatte in collaborazione possono essere valutate sulla base dei criteri individuati nella prima riunione.

Si procede all'esame dei titoli e delle pubblicazioni ai fini della formulazione del giudizio collegiale espresso dalla Commissione (all. D). I giudizi collegiali sono allegati al presente verbale quale sua parte integrante (all. E).

Sulla base della valutazione dei titoli e delle pubblicazioni ed, in particolare, sulla base della valutazione della produzione scientifica dei candidati, sono ammessi a sostenere il colloquio i Dottori:

1. Calvia Alessandro
2. Grassetti Francesca
3. Martire Antonio Luciano
4. Mazzarisi Piero
5. Patacca Marco
6. Pratico Flavio

Il colloquio si terrà il giorno 12.10.2022, alle ore 15:00 presso i locali del Dipartimento di Metodi e Modelli per il Territorio, l'Economia e la Finanza.

La Commissione termina i propri lavori alle ore 16:00 e si riconvoca per i colloqui orali dei candidati, il giorno 12.10.2022, alle ore 15:00.

Letto, confermato e sottoscritto.

Firma del Commissari

.....

.....

.....

ALLEGATO D AL VERBALE N. 3

TITOLI E PUBBLICAZIONI VALUTABILI

PROCEDURA SELETTIVA DI CHIAMATA PER N. 1 POSTO DI RICERCATORE A TEMPO DETERMINATO DI TIPOLOGIA B PER IL SETTORE CONCORSUALE 13/D4 - SETTORE SCIENTIFICO-DISCIPLINARE SECS-S/06 - PRESSO IL DIPARTIMENTO DI METODI E MODELLI PER IL TERRITORIO, L'ECONOMIA E LA FINANZA DELL'UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI ROMA "LA SAPIENZA" BANDITA CON D.R. N. 1616/2022 DEL 11.05.2022

L'anno 2022, il giorno 16 del mese di settembre si è riunita per via telematica tramite la piattaforma Google Meet (link <https://meet.google.com/qdo-hcxf-kvu>) la Commissione giudicatrice della procedura selettiva di chiamata per n. 1 posto di Ricercatore a tempo determinato di tipologia B per il Settore concorsuale 13/D4 – Settore scientifico-disciplinare SECS-S/06 - presso il Dipartimento di Metodi e Modelli per il Territorio, l'Economia e la Finanza dell'Università degli Studi di Roma "La Sapienza", nominata con D.R. n. 2419/2022 del 05/08/2022 e composta da:

- Prof.ssa Sabrina Mulinacci – professore associato presso il Dipartimento di Scienze Statistiche "Paolo Fortunati" dell'Università degli Studi di Alma Mater Studiorum Università di Bologna;
- Prof.ssa Silvia Romagnoli – professore ordinario presso il Dipartimento di Scienze Statistiche "Paolo Fortunati" dell'Università degli Studi di Alma Mater Studiorum Università di Bologna;
- Prof.ssa Barbara Vantaggi – professore ordinario presso il Dipartimento di Metodi e Modelli per il Territorio, l'Economia e la Finanza di "Sapienza" Università di Roma.

La Commissione inizia i propri lavori alle ore 9:00.

La Commissione prende atto dei titoli per i quali sia stata presentata idonea documentazione ai sensi dell'art. 3 del bando.

CANDIDATO: Calvia Alessandro

VERIFICA TITOLI VALUTABILI:

1. PhD in Pure and Applied Mathematics, University Milano-Bicocca 2018. VALUTABILE
2. Postdoctoral Research Fellow, Dep. of Statistics and Quantitative Methods- University Milano-Bicocca dal 1/1/2018 al 14/10/2019. VALUTABILE
3. RTDA Università LUISS Guido Carli dal 15/10/2019 al 14/10/202. VALUTABILE
4. Tutor for the first and second semester courses in Statistics. Politecnico di Milano, Bachelor's Degree in Energy Engineering. 2013/2014
Tutor for the course Mathematical Analysis I. Politecnico di Milano, Bachelor's Degree in Engineering of Computing Systems. 2014/2015
Tutor for the course Statistics. Politecnico di Milano, Bachelor's Degree in Mechanical Engineering. 2014/2015
Tutor for the course Probability. Politecnico di Milano, Bachelor's Degree in Mathematical Engineering. 2014/2015, 2015/2016, 2016/2017
Teaching assistant (esercitatore) for the course Probability Theory. University of Milano-Bicocca, Bachelor's Degree in Mathematics. 2015/2016 2016/2017
Teaching assistant (esercitatore) for the course Measure Theory. University of Milano-Bicocca, Bachelor's Degree in Mathematics. 2015/2016 2016/2017
Teaching assistant (esercitatore) for the course General Mathematics I. University of Milano-Bicocca, Bachelor's Degree in Management Accounting. 2015/2016 2016/2017 2017/2018 2018/2019

- Teaching assistant (esercitatore) for the course Probability. Politecnico di Milano, Bachelor's Degree in Mathematical Engineering. 2017/2018 2018/2019
- Teaching assistant (esercitatore) for the course Mathematics for Finance. University of Milano-Bicocca, Bachelor's Degree in Banking, Finance and Insurance. 2018/2019. VALUTABILE
5. Main teacher (titolare) of the course Quantitative Models for Data Science. 8 CFU. S.S.D.: SECS-S/06. LUISS Guido Carli, Bachelor's Degree in Management and Computer Science. 2019/2020 2020/2021 2021/2022
- Main teacher (titolare) of the course Quantitative Methods for the Enterprise. 8 CFU. S.S.D.: SECS-S/06. LUISS Guido Carli, Master's Degree in Accounting, Finance and Control. 2019/2020 2020/2021 2021/2022
- Main teacher (titolare) of the PhD course (15 hours) Stochastic filtering and applications to finance and economics. Universität Bielefeld, Center for Mathematical Economics (IMW). 2020/2021
- Main teacher (titolare) of the PhD course (15 hours) Stochastic filtering and applications to optimal control problems in finance and economics. Université Paris-Dauphine. 2021/2022. VALUTABILE
6. Supervisor of 8 Master's Degree theses in Accounting, Finance and Control, LUISS Guido Carli (5 of these theses have been discussed in the A.Y. 2020/2021, the remaining 3 are in preparation).
- Reviewer of a PhD Thesis for the University of Cape Town (South Africa), Department of The African Institute of Financial Markets and Risk Management. VALUTABILE
7. Partecipante ai seguenti progetti:
- INdAM-GNAMPA 2015. Investigator. P.I.: Dr. Fulvia Confortola. Applicazioni innovative dei processi di punto marcato. 2015
- INdAM-GNAMPA 2016. Investigator. P.I.: Dr. Fulvia Confortola. Problemi di controllo ottimo stocastico con osservazione parziale e processi di punto marcati. 2016.
- INdAM-GNAMPA 2017. Investigator. P.I.: Prof. Enrico Priola. Sistemi stocastici singolari: buona posizione e problemi di controllo. 2017
- MIUR-PRIN 2015. Investigator. P.I.: Prof. Alessandra Lunardi. Deterministic and stochastic evolution equations. 2017-2020
- INdAM-GNAMPA 2018. Investigator. P.I.: Dr. Elena Bandini. Controllo ottimo stocastico con osservazione parziale: metodo di randomizzazione ed equazioni di Hamilton-Jacobi-Bellman sullo spazio di Wasserstein. 2018
- MIUR-PRIN 2017. Investigator. P.I.: Prof. Fausto Gozzi. The Time-Space Evolution of Economic Activities: Mathematical Models and Empirical Applications. 2020-2023. VALUTABILE
8. Principal Investigator INdAM-GNAMPA 2019 Problemi di controllo ottimo stocastico con osservazione parziale in dimensione infinita. 2019. VALUTABILE
9. Visiting: University of Leeds, UK. Invited by Dr. Katia Colaneri. 12-14/09/2018; University of Milano-Bicocca, Italy. 17-19/01/2022; University of Bologna, Italy. 21/03-08/04/2022; Université Paris-Dauphine-France. 9-13/05/2022; Universitat Bielefeld-Germany 16-20/05/2022. VALUTABILE
10. Relatore:
- Filtering of time-homogeneous pure jump Markov processes with noise-free observation, RTG 1845 Berlin-Potsdam Summer School, Levico Terme, Italy. 29/09/2015
- Conference Control Theory and Related Topics, Politecnico di Milano, Italy. Didactic talk: Stochastic filtering and Marked Point Processes: an introduction and an application to the noise-free model, University of Milano-Bicocca, Italy. 17/11/2015
- Filtering and control of time-homogeneous pure jump Markov processes with noise-free observation, 3rd Barcelona Summer School on Stochastic Analysis: A 2016 EMS Summer School, Centre de Recerca Matemàtica, Universitat Autònoma de Barcelona, Bellaterra, Spain. 30/06/2016

Filtering and control of time-homogeneous pure jump Markov processes with noise-free observation, First Italian Meeting on Probability and Mathematical Statistics, University of Turin & Politecnico di Torino, Italy. 22/06/2017

Filtering and control of time-homogeneous pure jump Markov processes with noise-free observation, International Workshop on BSDEs, SPDEs and their Applications, The University of Edinburgh, UK. 07/07/2017

Optimal control of pure jump Markov processes with noise-free partial observation, BSDEs, Information and McKean-Vlasov equations, University of Leeds, UK. 11/09/2018

Contributer talk: Risk measures and progressive enlargement of filtrations: a BSDE approach, Quantitative Finance Workshop 2019, ETH Zürich, Switzerland. 24/01/2019

Risk measures and progressive enlargement of filtrations: a BSDE approach, 9th General AMAmEF Conference, Paris, France. 13/06/2019

Risk measures and progressive enlargement of filtrations: a BSDE approach, Second Italian Meeting on Probability and Mathematical Statistics, Vietri sul Mare, Italy. 19/06/2019

Risk measures and progressive enlargement of filtrations: a BSDE approach, Vienna Congress on Mathematical Finance, Wien, Austria. 09/09/2019

Economic growth problems in time-space, DEF Internal Seminars, LUISS University, Italy. 12/04/2021

On a class of partially observed systems arising in singular optimal control, 10th General AMAmEF Conference, University of Padova, Italy. 25/06/2021

On a class of partially observed systems arising in singular optimal control, Quantitative Finance Workshop 2022, University of Rome Tor Vergata, Italy. 01/04/2022

VALUTABILE

11. Invited talk: Filtering and optimal control of time-homogeneous pure jump Markov processes with noise-free partial observation. Workshop related to the MIUR-PRIN 2015 project titled "Deterministic and stochastic evolution equations". University of Parma. 05/09/2017

Invited talk: Filtering and optimal control of time-homogeneous pure jump Markov processes with noise-free partial observation, Stochastic control, BSDEs and new developments, Roscoff, France. 14/09/2017

Invited talk: Optimal control of pure jump Markov processes with noise-free partial observation, University of Pisa, Italy. 05/03/2018

Invited talk: Stochastic filtering and optimal control of pure jump Markov processes with noise-free partial observation, 14th Viennese Conference on Optimal Control and Dynamic Games, TU Wien, Austria. 06/07/2018

Invited talk: Optimal control problems with partial observation: an application to the noise-free model, Politecnico di Milano, Italy. 06/02/2019

Invited talk: Risk measures and progressive enlargement of filtrations: a BSDE approach, Politecnico di Milano, Italy. 19/03/2019

Invited talk: Economic growth problems in time-space, University of Insubria, Italy. 10/06/2021

Invited talk: On a class of partially observed systems arising in singular optimal control, AMASES XLV, University of Reggio Calabria, Italy. 16/09/2021

Invited talk: On a class of partially observed systems arising in singular optimal control. Workshop on Mathematical Economics and Financial Mathematics. Universitat Bielefeld-Germany. 03/03/2022

Invited talk: On a class of partially observed systems arising in singular optimal control, University of Bologna, Italy. 06/04/2022

Invited talk: On a class of partially observed systems arising in singular optimal control, 3rd Spring Colloquium on Probability and Finance, University of Padova, Italy. 29/04/2022

Invited talk: On a class of partially observed system arising in singular optimal control. Séminaire Bachelier. Institute Henri Poincaré, Paris- France. 13/05/2022

Invited talk: Economic Growth Models in Time-Space on Networks, Workshop "Taming Uncertainty and Complexity in Economics and Finance", LUISS University, Italy. 27/05/2022

Invited talk: On a class of partially observed systems arising in singular optimal control, Third Italian Meeting on Probability and Mathematical Statistics, University of Bologna, Italy. 13/06/2022

Invited talk: Risk measures and progressive enlargement of filtrations: a BSDE approach, 9th Colloquium on BSDEs, Differential Equations and Mean Field Systems, Université Savoie Mont-Blanc, Annecy, France. 27/06/2022.

VALUTABILE

12. Organizer (with Dr. Elena Bandini) of the Session Methods for Stochastic Filtering and Optimal Control of Processes with Jumps, Second Italian Meeting on Probability and Mathematical Statistics, Vietri sul Mare, Italy.

Organizer (with Prof. Fausto Gozzi, Prof. Francesco Lippi, and Dr. Giovanni Zanco) of the online Workshop Mean Field Games in Economics, LUISS University and the Einaudi Institute for Economics and Finance (EIEF), Rome, Italy. 07-08/09/2020

Organization of the seminar cycle "Insalate di Matematica", promoted by Dept. of Mathematics and Applications, University of Milano-Bicocca. The seminar cycle consisted in a series of informal talks by Ph.D. Students and early researchers in Mathematics. University of Milano-Bicocca, Dept. of Mathematics and its Applications. 2015-2017

In the local organizing committee of the workshop Taming Uncertainty and Complexity in Economics and Finance, LUISS University, Italy. 26-28/05/2022.

VALUTABILE

VERIFICA PUBBLICAZIONI VALUTABILI

1. Calvia, Optimal control of continuous-time Markov chains with noise-free observation, SIAM J. Control Optim., 56 (2018), pp. 2000–2035, <https://doi.org/10.1137/17M1139989>. VALUTABILE
2. A. Calvia, Stochastic filtering and optimal control of pure jump Markov processes with noise-free partial observation, ESAIM: COCV, 26 (2020), 25, VALUTABILE
3. A. Calvia, E. Rosazza Gianin, Risk measures and progressive enlargement of filtration: a BSDE approach, SIAM J. Financial Math., 11 (2020), pp. 815–848, VALUTABILE
4. A. Calvia, S. Federico, F. Gozzi, State constrained control problems in Banach lattices and applications, SIAM J. Control Optim., 59 (2021), pp. 4481–4510, VALUTABILE
5. A. Calvia, G. Ferrari, Nonlinear Filtering of Partially Observed Systems arising in Singular Stochastic Optimal Control, Appl. Math. Optim., 85:12 (2022), VALUTABILE
6. E. Bandini, A. Calvia, K. Colaneri, Stochastic filtering of a pure jump process with predictable jumps and path dependent local characteristics, Stoch. Proc. Appl., 151 (2022), pp. 396-435, VALUTABILE

TESI DI DOTTORATO

Calvia, Optimal control of pure jump Markov processes with noise-free partial observation, PhD Thesis.

CONSISTENZA COMPLESSIVA DELLA PRODUZIONE SCIENTIFICA:

Il candidato presenta una produzione complessiva pari a N. 7 pubblicazioni (compresa la tesi di dottorato).

CANDIDATO: **Grassetti Francesca**

VERIFICA TITOLI VALUTABILI:

1. Dottore di Ricerca (PhD) in Metodi quantitativi per la politica Economica in data 17/04/2018. Università di Macerata. VALUTABILE
2. Abilitazione Scientifica Nazionale alle funzioni di professore universitario di Seconda Fascia nel Settore Concorsuale 13/D4 - METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCIENZE ATTUARIALI E FINANZIARIE, conseguito in data 01/06/2022. VALUTABILE

3. Ricercatore RTD-a per il Settore Scientifico Disciplinare SECS-S/06 presso il Politecnico di Milano, Dipartimento di Matematica dal 05/12/2019. VALUTABILE
4. Relatore:
 - 11th NED, Nonlinear Economic Dynamics Conference, 13 - 15 Settembre, 2021. Milano, IT. Presentazione: *Asset price-GDP cross feedback. The role of dividend policies in a dynamic setting*
 - SIMAI 2020+2021, Congress of the Italian Society of Industrial and Applied Mathematics, 30 Agosto - 3 Settembre, 2021. Parma, IT. Presentazione: *Do financial markets affect real economy? Influences of professional and non-professional beliefs*
 - ICDEA 2021, 26th International Conference on Difference Equations and Applications, 26 - 30 Luglio, 2021. Sarajevo, BA e online. Presentazione: *Nonlinear dynamics in real Economy and financial markets. The role of dividend policies in fluctuations*
 - XLIII A.M.A.S.E.S Conference, 9 - 11 Settembre, 2019. Perugia, IT. Presentazione: *Do financial markets affect real economy? Influences of professional and non-professional beliefs*
 - 12th PODE, Progress On Difference Equations International Conference, 27 - 30 Maggio, 2019. Barganca, PT. Presentazione: *On the relation between employment, capital and financial markets when beliefs are heterogeneous*
 - XLII A.M.A.S.E.S Conference, 13 - 15 Settembre, 2018. Napoli, IT. Presentazione: *Influence of heterogeneous beliefs in a market with $K + 1$ financial assets*
 - MDEF 2018, 10th Workshop Dynamic Models in Economics and Finance, 6 - 8 Settembre, 2018. Urbino, IT. Presentazione: *Market destabilization in a model with $K + 1$ financial assets*
 - XLI A.M.A.S.E.S Conference, 14 - 16 Settembre, 2017. Cagliari, IT. Presentazione: *Complex basins and multistability in a discontinuous growth model*
 - 10th NED, Nonlinear Economic Dynamics Conference, 7 - 9 Settembre, 2017. Pisa, IT Presentazioni: 1) *The dynamics of Cournot duopoly in a monetary economy with overlapping generations of consumers* 2) *On the boundedness of growth*
 - 11th PODE, Progress On Difference Equations International Conference, 29 - 31 Maggio, 2017. Urbino, IT. Presentazione: *Qualitative dynamics of Solow-Swan growth model*
 - BAMC 2017, 59th British Applied Mathematics Colloquium, 10 - 12 Aprile, 2017. Guilford, UK Presentazione: *Local and global dynamics in a discrete time growth model with VES production function*
 - BiGSEM Doctoral Workshop on Economic Theory, 5 - 6 Dicembre, 2016. Bielefeld, DE. Presentazione: *Relation between variable elasticity of substitution between production factors and growth*
 - XL A.M.A.S.E.S Conference, 15 - 17 Settembre, 2016. Catania, IT. Presentazione: *Complex dynamics in a neoclassical growth model with differential savings and Shifted Cobb-Douglas production function*
 - MDEF 2016, 9th Workshop Dynamic Models in Economics and Finance, 23 - 25 Giugno, 2016. Urbino, IT. Presentazione: *Elasticity of substitution between factors and growth: a nonlinear relationship*
 - CHAOS 2016, 9th Chaotic Modelling and Simulation International Conference, 23 - 26, Maggio, 2016. London, UK. Presentazione: *A Diamond growth model with VES production function. The role of the elasticity of substitution*
 - CHAOS 2015, 8th Chaotic Modelling and Simulation International Conference, 26th -28th May, 2015. Paris, FR. Presentazione: *Variable elasticity of substitution in the Diamond model: dynamics and comparisons*
 VALUTABILE
5. Invited talk: Afternoon Math Seminars at DISEI - Piemonte Orientale University Presentazione: *Portfolio Insurers and Constant Weight traders: who will survive?* 24 Novembre, 2021. Novara
 Invited talk: Motivare Coinvolgere Divertire con la Matematica Presentazione: *Connettere la matematica al mondo della finanza* Webinar De Agostini Formazione, 2020, online.
 Invited talk: SAET 2019, Annual Conference of the Society for the Advancement of Economic Theory Presentazione: *Learning to Select Between Multiple Rational Expectations Equilibria with unobservable shocks* 30 Giugno - 6 Luglio, 2019. Ischia, IT

Invited talk: Nonlinear Dynamics in Economics and Finance. Presentazione: *Dynamics of economic growth. Poverty traps and fluctuations at different development levels*. Accademia dei Lincei e Università Politecnica delle Marche 8 Giugno, 2018. Ancona, IT

Invited talk: *Poverty trap, boom and bust periods and growth* Seminario per dottorandi, unica presentatrice Department of Economics, University of Kaiserslautern 4 Maggio, 2018. Kaiserslautern

VALUTABILE

6. Partecipazione a Complex System Winter School, 13-17/01/2020, MIT, USA
Partecipazione alla Summer School Dynamic models in Economics and Finance, 17-21/07/2017, Università degli Studi di Verona e Università degli Studi di Alba di Canazei, IT NON VALUTABILE in quanto la partecipazione a scuole non rientra tra i titoli didattici e scientifici previsti dal bando
7. Partecipazione alla Scuola di Attuariato 2019, Università degli Studi di Firenze (350 ore)
VALUTABILE
8. Visiting per attività di ricerca presso Bielefeld Graduate School of Economics and Management, Bielefeld University, Bielefeld, DE Semestre invernale 2016/2017
Visiting per attività di ricerca presso Department of Business Studies and Economics, Kaiserslautern University Kaiserslautern University, Kaiserslautern, DE 20-26/08/2017, 17-21/01/2018, 25/02-01/03/2018, 18-24/03/2018, 01-05/05/2018
VALUTABILE
9. Membro del gruppo di ricerca MDEF, Modelli Dinamici in Economia e Finanza, dal 2015 (il gruppo riceve finanziamenti dall'Amases per l'organizzazione della conferenza biennale MIDEF)
Membro del gruppo di ricerca QFinLab, Laboratorio di Finanza Quantitativa del Politecnico di Milano, dal 2019
NON VALUTABILE per quanto la partecipazione ad associazioni scientifiche non rientra tra i titoli didattici e scientifici previsti dal bando
10. Membro del gruppo di ricerca composto da (1) gruppo di ricerca QFinLab (di cui la candidata fa parte) del Dipartimento di Matematica del Politecnico di Milano e (2) gruppo di ricerca afferente al Dipartimento di Ingegneria Gestionale del Politecnico di Milano, coordinato dal prof. Tommaso Agasisti: finanziamento di 32000 Euro da Banca d'Italia per la ricerca di metodi didattici per l'insegnamento degli strumenti matematici per l'educazione finanziaria
Membro, dal 2019 al 2021 del gruppo di ricerca composto dall'unione di (1) gruppo di ricerca QFinLab (di cui la candidata fa parte) del dipartimento di Matematica del Politecnico di Milano (2) gruppo di ricerca afferente al Dipartimento di Ingegneria Gestionale del Politecnico di Milano, coordinato dal prof. Tommaso Agasisti e (3) Fondazione Politecnico di Milano. Finanziamento Fondazione Cariplo: 85.000 euro per la realizzazione di un progetto di ricerca sull'utilizzo della matematica per la diffusione dell'educazione finanziaria nelle scuole superiori di secondo grado.
Membro, dal 2020, del gruppo di INdAM-GNAMPA, sezione Equazioni differenziali e sistemi dinamici
Membro, dal 2020 al 2022, del gruppo di ricerca composto dalla candidata oltre a Annamaria Gambaro (Università del Piemonte Orientale), Gianluca Fusai (Università del Piemonte Orientale), Marina Marena (Università degli Studi di Torino) e Patrizia Semeraro (Politecnico di Torino). Il gruppo è in capo ad un qualificato ente di ricerca: Gruppo Nazionale per l'Analisi Matematica, la Probabilità e le loro Applicazioni, gruppo di ricerca dell'Istituto Nazionale di Alta Matematica Francesco Severi. Il gruppo ha ottenuto un finanziamento sulla base di bando competitivo nazionale che prevede la revisione tra pari per il progetto di ricerca "Dynamic optimization for strategic investments" finanziato dall'Istituto Nazionale di Alta Matematica Francesco Severi (INdAM), Gruppo Nazionale per l'Analisi Matematica, la Probabilità e le loro Applicazioni (GNAMPA). Finanziamento: 2250 euro.
Membro, dal 2020 al 2021, del gruppo di ricerca costituito dal gruppo QFinLab (di cui la candidata fa parte) del Dipartimento di Matematica e dal gruppo ReMaps del Dipartimento di Ingegneria Gestionale, entrambi in capo al Politecnico di Milano. Il gruppo ha realizzato un progetto di ricerca finanziato dal Politecnico di Milano (finanziamento: 5.000 euro) in merito allo studio delle metodologie di didattica efficaci per i soggetti adulti, nel settore della finanza e soprattutto finanza matematica.
VALUTABILE

11. Responsabile del progetto di ricerca scientifica per lo sviluppo di un modello matematico per la stima del rate orario di centri di costo internazionali. Incarico affidato da Hyperlean s.r.l., spin-off dell'Università Politecnica delle Marche con la partnership del gruppo Biesse.
VALUTABILE
12. Assegno di ricerca annuale su "Studio e applicazione di strumenti e metodi matematici per la valutazione economica di processi di additive manufacturing nell'ottica della sostenibilità", presso il Dipartimento di Ingegneria Industriale e Scienze Matematiche dell'Università Politecnica delle Marche attraverso il conferimento di assegno di ricerca annuale. VALUTABILE
13. Partecipazione al progetto *IMPACT edufin*. Finanziamento: 32.000 euro, Banca d'Italia
Partecipazione al progetto *EDUFIN@Polimi*. Finanziamento: 85.000 euro, Fondazione Cariplo
Partecipazione, come membro proponente, al progetto *Dynamic optimization for strategic investments*. Finanziamento: 2.250 euro, INdAM-GNAMPA.
Partecipazione al progetto di ricerca *Welfare @PoliMi: Valutare un intervento di educazione finanziaria rivolto al Personale Tecnico Amministrativo del Politecnico*. Finanziamento: 5.000 euro, Politecnico di Milano
Partecipazione come membro proponente al progetto "From Networks to Neural Network in Finance - Summer School". Il progetto è stato finanziato dalla Lake Como School of Advanced Studies, sulla base di un bando competitivo che prevede la revisione tra pari
Partecipazione come membro proponente al progetto European Research Night (European Commission Marie Skłodowska-Curie Actions) con il dipartimento di Economia e Diritto dell'Università degli Studi di Macerata. Il finanziamento è ammesso su base di bando competitivo che prevede revisione tra pari.
VALUTABILE
14. L'articolo "*Portfolio insurers and constant weight traders: who will survive?*" di cui la candidata è co-autrice è stato selezionato come Feature Article per il volume 21(12), 2021 della rivista internazionale Quantitative Finance (fascia A). La scelta è stata fatta dall'editore Prof. Michael Dempster
Conseguimento del NECSI Financial Aid Award erogato dal New England Complex Systems Institute, Cambridge, Massachusetts, USA. Il premio, dell'ammontare di 1.000 dollari per l'iscrizione a corsi del New England Complex Systems Institute, viene erogato sulla base del proprio curriculum accademico
Conseguimento del grant "CMSIM International Participation Grants for CHAOS 2016 Conference". Il grant viene assegnato dal Grant Committee di CMSIM (Chaotic Modelling and Simulation) a giovani ricercatori sulla base di: 1) Curriculum accademico 2) lavoro di ricerca sottoposto a valutazione 3) lettera di referenze
VALUTABILE
15. Organizzazione della Scuola estiva "EduFin Summer School", per gli studenti delle Scuole Superiori di Secondo Grado, che ha approfondito tematiche di finanza e statistica. La scuola si è tenuta online ed è stata organizzata da tutto il gruppo QFinLab, 2022.
Organizzazione della Scuola estiva "From Networks to Neural Network in Finance - Summer School", 2021
Organizzazione del convegno *Esperienze a confronto in tema di educazione finanziaria.*, 2021
Organizzazione della Conferenza internazionale *Big Data and Machine Learning in Finance* presso il Politecnico di Milano, 2021
Organizzazione della Scuola estiva "EduFin Summer School", per gli studenti delle Scuole Superiori di Secondo Grado, 2021
Organizzazione di 8 edizioni del corso Primi passi nella finanza matematica per il progetto Policollege, dal 2020
Organizzazione di una sessione per la 59a Riunione Scientifica Annuale della Società Italiana degli Economisti. Bologna, IT. Organizzazione di una sessione per conto dell'Associazione A.M.A.S.E.S. 2018
Realizzazione del Progetto pro-bono "Educazione finanziaria" realizzato per i soggetti adulti in contesti fragili da QFinLab (gruppo di ricerca a cui appartiene la candidata) in collaborazione con MIP Politecnico di Milano Graduate School of Business. Da settembre 2021 a marzo 2022
Realizzazione del Corso di Finanza Personale per Adulti organizzato in collaborazione con Caritas, Diaconia Valdese e progetto Will. Il corso si è tenuto da marzo a giugno 2021

Realizzazione degli storyboard per i video "informarsi conviene" disponibili su www.informarsiconviene.it. L'incarico è stato affidato dall'Organismo di vigilanza e tenuta dell'albo unico dei Consulenti Finanziari (OCF). Anno 2021.

VALUTABILE

16. Trasferimento tecnologico. Socio fondatore dello spin off dell'Università degli Studi di Macerata "AdvisEU Studio Project- Support and Training Unit Developing Input- Output" società di consulenza per l'Europrogettazione (monitoraggio, selezione, ideazione e realizzazione di progetti da sottoporre a bandi di finanziamento europei)

NON VALUTABILE in quanto non rientra tra i titoli didattici e scientifici previsti dal bando

17. Ricezione di fondi dal Politecnico di Milano nell'ambito dei progetti "Didattica post-covid" dal 21/22 al 23/24

VALUTABILE

18. Delegato dal Consiglio del Corso di Studi in Ingegneria Matematica del Politecnico di Milano per l'ammissione degli studenti internazionali al corso di Laurea Magistrale in Mathematical Engineering, da gennaio 2021 ad oggi

NON VALUTABILE in quanto non rientra tra i titoli didattici e scientifici previsti dal bando

19. Membro dell'A.M.A.S.E.S, Associazione per la Matematica Applicata alle Scienze Economiche e Sociali, dal 2015.

Membro dell'ISDE, International Society of Difference Equations, dal 2018.

NON VALUTABILE perché non rientra tra i gruppi di ricerca ma solamente tra le associazioni scientifiche

20. Co-autore delle schede di approfondimento dedicate alla matematica finanziaria presenti nei testi

i. (2020) Matematica allo specchio, Edizione Verde e Blu, Ghisetti & Corvi, De Agostini (testo per il primo biennio dei licei scientifici)

ii. (2022) Matematica allo specchio, Edizione Blu, Ghisetti & Corvi, De Agostini (testo per il secondo biennio e le classi quinte dei licei scientifici)

VALUTABILE

21. Relatore di 9 tesi di Laurea Magistrale in Mathematical Engineering presso il Politecnico di Milano
VALUTABILE

22. Docenza dei seguenti corsi

Matlab: Instruments, Programming and Economic Applications *Phd Program: Quantitative Methods for Economic Policy* Dipartimento di Economia e Diritto, Università degli Studi di Macerata, IT. Anno accademico: 2019/2020. Ore: 9. Lingua: EN.

Programming for Nonlinear Dynamics in Economics *Phd Program: Quantitative Methods for Economic Policy* Dipartimento di Economia e Diritto, Università degli Studi di Macerata, IT. Anno accademico: 2018/2019. Ore: 4.

Introduction to Matlab *Phd Program: Quantitative Methods for Economic Policy* Dipartimento di Economia e Diritto, Università degli Studi di Macerata, IT. Anno accademico: 2018/2019. Ore: 10. Lingua: EN.

Matlab: Instruments, Programming and Economic Applications *Phd Program: Quantitative Methods for Economic Policy* Dipartimento di Economia e Diritto, Università degli Studi di Macerata, IT. Anno accademico: 2019/2020. Ore: 10. Lingua: EN.

Quantitative Methods and Finance + Business Analytics *International Master in Fintech, Finance and Digital Innovation* MIP Politecnico di Milano Graduate School of Business Anno accademico: 2021/2022. Ore: 5. Lingua: EN (Master di specializzazione)

Assicurazioni (matematica attuariale) *Master Finance, Insurance and New Technologies* Cefiel per Allianz SE Anno accademico: 2020/2021. Ore: 40. Lingua: IT (Master di specializzazione)

Business Analytics and Quantitative Finance *International Master in Fintech, Finance and Digital Innovation* MIP Politecnico di Milano Graduate School of Business Anno accademico: 2020/2021. Ore: 6. Lingua: EN (Master di specializzazione)

Fondamenti di Economia e Finanza *Master Finance, Insurance and New Technologies* Cefiel per Allianz SE. Anno accademico: 2019/2020. Ore: 48. Lingua: IT (Master di specializzazione)

Insurance and Econometrics (SSD SECS-S/06) *Mathematical Engineering (LM-44 Modellistica matematico-fisica per l'ingegneria)* Politecnico di Milano Anno accademico: 2021/2022, CFU:10, Lingua: EN

Laboratorio di Matematica 1 (SSD SECS-S/06) *Economia: Banche, aziende e mercati* (L-18 - Scienze dell'economia e della gestione aziendale) Università degli Studi di Macerata Dall'A.A. 2017/2018 all'A.A. 2020/2021, CFU: 3 (per anno accademico), Lingua: IT

Laboratorio di Matematica 2 (SSD SECS-S/06) *Economia: Banche, aziende e mercati* (L-18 - Scienze dell'economia e della gestione aziendale) Università degli Studi di Macerata Dall'A.A. 2017/2018 all'A.A. 2020/2021, CFU: 3 (per anno accademico) , Lingua: IT

Matematica Generale – VS (SSD SECS-S/06, versione serale, per studenti lavoratori) *Economia: Banche, aziende e mercati* (L-18 - Scienze dell'economia e della gestione aziendale) Università degli Studi di Macerata Anno Accademico 2018/2019, CFU: 12, Lingua: IT

Matematica Generale – modulo 1b (SSD SECS-S/06) *Economia: Banche, aziende e mercati* (L-18 - Scienze dell'economia e della gestione aziendale) Università degli Studi di Macerata o Anno Accademico 2017/2018, CFU: 3, Lingua: IT

Corso di azzeramento di Matematica Generale (Corso senza valutazione finale) *Economia: Banche, aziende e mercati* (L-18 - Scienze dell'economia e della gestione aziendale) Università degli Studi di Macerata Dall'A.A. 2016/2017 all'A.A. 2019/2020, ore: 20 (per anno accademico) , Lingua: IT

Corso di sostegno di Matematica Generale (Corso senza valutazione finale) *Economia: Banche, aziende e mercati* (L-18 - Scienze dell'economia e della gestione aziendale) Università degli Studi di Macerata Dall'A.A. 2017/2018 all'A.A. 2019/2020, ore: 20 (per anno accademico) , Lingua: IT

Didattica Innovativa per il corso Finanza Matematica I (SSD SECS-S/06) *Corso di Laurea Triennale in Ingegneria Matematica* (L-8 e L-9) Politecnico di Milano Anno Accademico 2021/2022, ore: 10, Lingua: IT

VALUTABILE

23. Esercitatore per i corsi:

Finanza Matematica I (SSD SECS-S/06) *Corso di Laurea Triennale in Ingegneria Matematica* (L-8 e L-9) Politecnico di Milano Dall'A.A. 2019/2020 all'A.A. 2021/2022, ore: 20 (per anno accademico), Lingua: IT

Fondamenti di Matematica e Statistica (SSD SECS-S/06) *Corso di Laurea Triennale in Urbanistica* (L-21) Politecnico di Milano Anno Accademico 2019/2020, ore: 20, Lingua: IT

Tutor online per i corsi di Matematica Generale, Matematica Finanziaria, Statistica e Informatica *Corso di Laurea Triennale Economia: Banche, aziende e mercati* (L-18) Università degli Studi di Macerata Dall'A.A. 2015/2016 all'A.A. 2019/2020, Lingua: IT

VALUTABILE

VERIFICA PUBBLICAZIONI VALUTABILI

1. Bischì, G. I., Grassetti, F., Sanchez Carrera, E. J. *On the economic growth equilibria during the Covid-19 pandemic*. Communications in Nonlinear Science & Numerical Simulation, 2022, vol. 112, 106573, ISSN: 1007-5704, doi: 10.1016/j.cnsns.2022.106573. Elsevier, Amsterdam, Paesi Bassi.

VALUTABILE

2. Grassetti, F., Mammana, C., Michetti, E. *Nonlinear dynamics in real economy and financial markets: The role of dividend policies in fluctuations*. Chaos, Solitons and Fractals, 2022, vol. 160, 112191, ISSN: 0960-0779, doi: 10.1016/j.chaos.2022.112191. Elsevier, Amsterdam, Paesi Bassi.

VALUTABILE

3. Grassetti, F., Mammana, C., Michetti, E. *A dynamical model for real economy and finance*. Mathematics and Financial Economics, 2022, vol. 16, p. 345-366, ISSN: 1862-9679, doi: 10.1007/s11579-021-00311-3. Springer, Berlino, Germania.

VALUTABILE

4. Barucci, E. , Dindo, P., Grassetti, F. *Portfolio insurers and constant weight traders: who will survive?*. Quantitative Finance, 2021, vol. 21, p. 1993-2004, ISSN: 1469-7688, doi: 10.1080/14697688.2021.1987506. Taylor & Francis, Milton Park, Regno Unito. VALUTABILE

5. Coppier R., Grassetti F., Michetti E. *Non-compliant behaviour in public procurement: an evolutionary model with endogenous monitoring*. Decisions in Economics and Finance, 2021, vol.

- 44, p. 459-483, ISSN: 1593-8883, doi:10.1007/s10203-021-00317-y. Springer, Berlino, Germania.
VALUTABILE
6. Grassetto, F., Guzowska, M., Michetti, E. *A dynamically consistent discretization method for Goodwin model*. Chaos, Solitons and Fractals, 2020, vol. 130, 109420, ISSN: 0960-0779, doi: 10.1016/j.chaos.2019.109420. Elsevier, Amsterdam, Paesi Bassi. VALUTABILE
 7. Grassetto, F. *On the Influence of Production Technologies and Savings Propensities on Economic Growth. Findings Considering a Solow's Type Growth Model*. Frontiers in Applied Mathematics and Statistics, 2019, vol. 5(1), ISSN: 2297-4687, doi: 10.3389/fams.2019.00001. Frontiers, Losanna, Svizzera.
VALUTABILE
 8. Grassetto, F., Hunanyan, G., Mammana, C., Michetti, E. *A note on the influence of saving behaviors on economic growth*. Metroeconomica, 2019, vol. 70(3), p. 442-457, ISSN: 0026-1386, doi: 10.1111/meca.12210. John Wiley & Sons Inc, New York, Stati Uniti. VALUTABILE
 9. Grassetto, F., Hunanyan, G. *On the economic growth theory with Kadiyala production function*. Communications in Nonlinear Science & Numerical Simulation, 2018, vol. 58, p. 220-232, ISSN: 1007-5704, doi: 10.1016/j.cnsns.2017.06.036. Elsevier, Amsterdam, Paesi Bassi.
VALUTABILE
 10. Grassetto, F., Mammana, C., Michetti, E. *Poverty trap, boom and bust periods and growth. A nonlinear model for non-developed and developing countries*. Decisions in Economics and Finance, 2018, vol. 41, p. 145-162, ISSN: 1593-8883, doi: 10.1007/s10203-018-0211-6. Springer, Berlino, Germania.
VALUTABILE
 11. Grassetto, F., Mammana, C., Michetti, E. *On the Effect of Labour Productivity on Growth: Endogenous Fluctuations and Complex Dynamics*. Discrete Dynamics in Nature and Society, 2018, vol. 2018, 6831508, ISSN: 1026-0226, doi: 10.1155/2018/6831508. Hindawi Publishing Corporation, Londra, Regno Unito.
VALUTABILE
 12. Grassetto, F., Mammana, C., Michetti, E. *Substitutability between production factors and growth. An analysis using VES production functions*. Chaos, Solitons and Fractals, 2018, vol. 113, p. 53-62, ISSN: 0960-0779, doi: 10.1016/j.chaos.2018.04.012. Elsevier, Amsterdam, Paesi Bassi.
VALUTABILE

TESI DI DOTTORATO: Titolo Elaborato finale: "Nonlinear Dynamis and Economic Growth. The Influence of Elasticity of Substitution Between Input Factors and Differential Savings Propensiiies".

CONSISTENZA COMPLESSIVA DELLA PRODUZIONE SCIENTIFICA:

Il candidato presenta una produzione complessiva pari a N. 12 pubblicazioni

CANDIDATO: Martire Antonio Luciano

VERIFICA TITOLI VALUTABILI:

1. Laurea in Matematica presso l'Università degli Studi "Sapienza" di Roma, con voti 101/110
NON VALUTABILE La Commissione ritiene che la formazione universitaria precedente al dottorato non sia rilevante ai fini della procedura.
2. Dottorato di ricerca in Matematica per le applicazioni economico-finanziarie presso l'Università degli Studi "Sapienza" di Roma, conseguito in data 17/02/2012 VALUTABILE
3. Diploma di specializzazione in Econometria applicata VIII edizione in data 16/11/2014, Scuola Nazionale dell'Amministrazione, Master in Econometria Applicata VIII edizione
NON VALUTABILE perché non rientra tra i titoli scientifici e didattici stabiliti dal bando
4. Assegno di ricerca (art.22 settore concorsuale L. 240/2010 13/D4). 01/10/2018-30/09/2019 presso il Dipartimento di Metodi e Modelli per l'Economia, il Territorio e la Finanza presso l'Università "Sapienza" di Roma

Assegno di ricerca (art.22 settore concorsuale L. 240/2010 13/D4). 01/10/2019-30/09/2020 presso il Dipartimento di Metodi e Modelli per l'Economia, il Territorio e la Finanza presso l'Università "Sapienza" di Roma

Assegno di ricerca (art.22 settore concorsuale L. 240/2010 13/D4). 01/12/2020-30/11/2021 presso il Dipartimento di Metodi e Modelli per l'Economia, il Territorio e la Finanza presso l'Università "Sapienza" di Roma

Assegno di ricerca (art.22 settore concorsuale L. 240/2010 13/D4). 01/02/2022- ad oggi (scadenza 31/01/2023) presso il Dipartimento di Economia dell'Università degli Studi di Genova
VALUTABILE

5. Partecipazione al Progetto di Ateneo 2020: "Actuarial and financial risk management solutions in a pandemic mortality framework", Principal Investigator: Immacolata Oliva, Dipartimento di Metodi e Modelli per l'Economia, il Territorio e la Finanza, Università "Sapienza" di Roma

Partecipazione al Progetto di Ateneo 2019: "Life market: a renewal boost for quantitative management of longevity and lapse risk", Principal Investigator: Gabriele Stabile, Dipartimento di Metodi e Modelli per l'Economia, il Territorio e la Finanza, Università "Sapienza" di Roma
VALUTABILE

6. Partecipazione al XXXVI Annual Conference AMASES, Vieste, 2012. Relatore di contributo.

Partecipazione al XXXVII Annual Conference AMASES, Stresa, 2013. Relatore di contributo.

Partecipazione all'International Meeting DYSES 2014, Siviglia (Spagna). Relatore di contributo.

Partecipazione al XIX Workshop on Quantitative Finance, Roma, 2018. Contributo in forma di poster.

Partecipazione al XXI Workshop on Quantitative Finance, Napoli, 2020. Contributo in forma di poster.

Partecipazione all'online International Conference in Actuarial Science, data science and finance. Relatore di contributo.

Virtual 24th International Congress on Insurance: Mathematis and Economics, 2021. Relatore di contributo.

Convegno internazionale (online) Longevity, 2021. Relatore di contributo.

XLV Annual Conference AMASES (online). Relatore di contributo.

VALUTABILE

7. Professore a contratto di supporto alla didattica in Matematica Finanziaria a.a. 2012/13, Facoltà di economia Università degli Studi di Roma Tre

VALUTABILE

8. Docenza del corso:

Finanza Quantitativa (9 cfu) Presso la facoltà di Economia, Università "Sapienza" di Roma, febbraio 2018-gennaio 2019

Finanza Quantitativa (9 cfu) Presso la facoltà di Economia, Università "Sapienza" di Roma, febbraio 2019-gennaio 2020

Neural network for Economists (16 ore) 'European Ph.D. in Socio-Economics and Statistical Studies, Università "Sapienza" di Roma, gennaio 2022

"Matlab application in Finance al Master of Science in Financial Engineering and Risk Management, Metropolitan Tirana University (10 ore), giugno 2022.

VALUTABILE

VERIFICA PUBBLICAZIONI VALUTABILI

1. Paolo De Angelis, Antonio Luciano Martire, Emilio Russo. A bivariate model for evaluating equity linked policies with surrender option. Scandinavian Actuarial, Journal. 2016:3, 246-261, DOI:10.1080/03461238.2014.924433.

VALUTABILE

2. Paolo De Angelis, Roberto De Marchis, Antonio Luciano Martire. A new numerical method for a class of Volterra and Fredholm integral equations. Journal of Computational and Applied Mathematics 379 (2020) 112944.

VALUTABILE

3. Paolo De Angelis, Roberto De Marchis, Antonio Luciano Martire, Immacolata Oliva. A mean-value Approach to solve fractional differential and integral equations. Chaos, Solitons and Fractals 138 (2020) 109895.
VALUTABILE
4. Paolo De Angelis, Roberto De Marchis, Antonio Luciano Martire, Stefano Patri. Non-Standard Volterra Integral Equations: A Mean-Value Theorem Numerical Approach. Applied Mathematical Sciences, Vol. 14, 2020, no. 9,423-432,
VALUTABILE
5. Paolo De Angelis, Roberto De Marchis, Mario Marino, Antonio Luciano Martire, Immacolata Oliva. Betting on bitcoin: a profitable trading between directional and shielding strategies. Decisions in Economics and Finance 44, 883-903 (2021).
VALUTABILE
6. Paolo De Angelis, Roberto De Marchis, Mario Marino, Antonio Luciano Martire, Immacolata Oliva. Evaluating ruin probabilities: a streamlined approach. Applied Mathematics E-Notes 21 (2021), 634-642
VALUTABILE
7. Martire, A.L., Russo, E., Staino, A. (2022). "Surrender and Path-Dependent Guarantees in Variable Annuities: Integral Equation Solutions and Benchmark Methods". In: Corazza, M., Perna, C., Pizzi, C., Sibillo, M. (eds.) Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance. MAF 2022, p.p. 340-346, Springer, Cham.
VALUTABILE
8. Paolo De Angelis, Roberto De Marchis, Antonio Luciano Martire, Emilio Russo. A flexible lattice framework for valuing options on assets paying discrete dividends and variable annuities embedding GMWB riders. Decisions in Economics and Finance 45, 415-446 (2022).
VALUTABILE

TESI DI DOTTORATO: Titolo Elaborato finale: "Embedded surrender option pricing for equity-linked policies comparisons and solutions for bivariate models".

CONSISTENZA COMPLESSIVA DELLA PRODUZIONE SCIENTIFICA:

Il candidato presenta una produzione complessiva pari a N. 9 pubblicazioni (inclusa la tesi di dottorato)

CANDIDATO: Mazzarisi Piero

VERIFICA TITOLI VALUTABILI:

1. Ph.D. in Financial Mathematics 4 Nov. 2014 – 30 Apr. 2018 Organization: Scuola Normale Superiore, Class of Science, Pisa, Italy Doctoral thesis: Dynamic network models with applications to finance.
VALUTABILE
2. Fixed-Term Assistant Professor (RTD-A, SSD: SECS-S/06). 27 Dec. 2021 – present Organization: Scuola Normale Superiore, Class of Science, Pisa, Italy.
VALUTABILE
3. Post-doc Research Fellow 1 Feb. 2020 – 26 Dec. 2021 Organization: Scuola Normale Superiore, Class of Science, Pisa, Italy.
Post-doc Research Fellow 1 May 2018 – 30 Nov. 2019 Organization: University of Bologna, Department of Mathematics, Bologna, Italy.
VALUTABILE
4. Teaching 2022-Scuola Normale Superiore: "Statistical and Machine Learning models for Time Series Analysis" (10h) Ph.D. Course (EN), "Mathematical Models for Quantitative Finance: Market Microstructure, Networks, and Systemic Risk" (6h) Ph.D. Course (EN).

Teaching-2018 University of Bologna: "Crash course in Mathematics" (34h) Undergraduate Course (LC, EN).

VALUTABILE

5. Member of the project "Network analysis of economic and financial resilience" within the Pro3 Italian program (Mar. 2022 - Dec. 2023)

Member of the project "Dynamic models for a fast changing world: An observation-driven approach to time-varying parameters" within the Italian PRIN2020 program (Mar. 2022 - Feb. 2025)

Member of the Italian project "Percorso di formazione su data analysis, network science, artificial intelligence e big data per gli abusi di mercato" founded by the Commissione Nazionale per le Società e la Borsa (CONSOB) (Sep. 2021 - Feb. 2023).

Member of the EU project H2020 SoBigData++: European Integrated Infrastructure for Social Mining and Big Data Analytics (Jan. 2020 – Dec. 2023).

Member of the EU project H2020 DOMINO: Novel tools to evaluate ATM systems coupling under future deployment scenarios (May 2018 – Dec. 2019).

VALUTABILE

6. Research Fellowship at Scuola Normale Superiore co-funded by EU project H2020 SoBigData and Unicredit S.p.a (Feb. 2020–Feb. 2022).

Visiting Researcher at the Queen Mary University of London, School of Mathematical Science (working with Prof. Vito Latora).

Ph.D. scholarship at Scuola Normale Superiore financed by the Ministry of Education, University and Research – MIUR (Nov. 2014 – May 2018).

VALUTABILE

7. 1st edition of the School on Mathematical and Computational aspects of Machine Learning, Pisa, Scuola Normale Superiore (2019).

2nd edition of the Lake Como School of advanced studies in Complex Networks: theory, methods and applications, Como, Villa del Grumello (2016).

8th European summer school in Financial Mathematics, Le Mans (2015).

NON VALUTABILE: non risulta aver partecipato in qualità di relatore e quindi non risulta tra i titoli previsti dal bando

8. Visiting: University College London (forthcoming, one week in October 2022)

NON VALUTABILE la posizione non è ancora stata ricoperta

9. Visiting: Baruch College, New York (June 2022, one week)

Visiting: University of Westminster, London (June 2019, one week)

Visiting: Queen Mary University, London (May 2017 – Jul. 2017, three months)

VALUTABILE

10. Organizzazione:

Second edition of the "School in Machine Learning of Dynamic Processes and Time Series Analysis", November 9-10, 2022, Pisa, Scuola Normale Superiore.

"Networks, Big Data, and Artificial Intelligence in Economics, Finance, and Social Sciences", Sept. 22-24, 2022, parallel session of the annual meeting of A.M.A.S.E.S. XLVI.

"Networks, Big Data, and Artificial Intelligence in Economics, Finance, and Social Sciences", Sept. 13-18, 2021, parallel session of the annual meeting of A.M.A.S.E.S. XLV. Co-organized with Prof. Fabrizio Lillo, Prof. Michele Tumminello.

"School in Machine Learning of Dynamic Processes and Time Series Analysis", Nov. 26-27, 2020 Pisa, Scuola Normale Superiore. Co-organized with Dr. Giulia Livieri, Prof. Fabrizio Lillo, Prof. Stefano Marmi.

SMMNsatellite on "Statistical Mechanics Methods for Networks", satellite conference of NetSci2020, Sep. 17, 2020, Roma (online). Co-organized with Dr. Mateusz Wilinski.

VALUTABILE

11. Supervision of M.Sc. students: 1)Gabriele Poidomani, M.Sc. in Physics at the University of Pisa, Oct. 2021 2) Federico Paltrinieri, M.Sc. in Physics at the University of Bologna, jointly with Prof. Fabrizio Lillo, Jan. 2019 – Sep. 2019. “Modeling temporal networks with dynamic stochastic block models”. 110/110 cum Laude. 3)Elena Stella, M.Sc. in Economics at the University of Pisa and Sant’Anna School of Advanced Studies, jointly with Prof. Giorgio Fagiolo and Prof. Fabrizio Lillo, Apr. 2018 – Dec. 2018. “A discrete autoregressive model for preferential lending, Network analysis of the e-MID interbank market”. 110/110 cum Laude (Then student at the Kellogg School of Management at Northwestern University, Chicago, Illinois). VALUTABILE
12. Supervision of Ph.D. students 1)Valentina Macchiati, Ph.D. in Data Science at Scuola Normale Superiore, jointly with Prof. Diego Garlaschelli, Nov. 2020 – 2)Ioanna-Yvonne Tsaknaki, Ph.D. in Mathematics at Scuola Normale Superiore, jointly with Prof. Fabrizio Lillo, Nov. 2020 – 3) Andrey Shternshis, Ph.D. in Computational Methods and Mathematical Models for Sciences and Finance at Scuola Normale Superiore, jointly with Prof. Stefano Marmi, Nov. 2020 – 4) Daniele Salierno, Ph.D. in Computational Methods and Mathematical Models for Sciences and Finance at Scuola Normale Superiore, jointly with Prof. Fabrizio Lillo, Prof. Vito Latora, May 2021.
Academic Activities. Ph.D. Committees: Dr. Domenico Di Gangi, Ph.D. in Financial Mathematics, Scuola Normale Superiore (2022), Dr. Tonio M’ollmann, Ph.D. in Financial Mathematics, Scuola Normale Superiore (2022), Dr. Danilo Vassallo, Ph.D. in Financial Mathematics, Scuola Normale Superiore (2022)
VALUTABILE
13. Academic Activities. Ms.C. exam committees: Federico Paltrinieri, Ms.C. in Physics, Physics Department of the University of Bologna (Sep. 2019)
Academic Activities. Representative of Post-Doc Researchers at Scuola Normale Superiore (May 2021 - Dec. 2021)
NON VALUTABILE in quanto non rientra tra i titoli didattici e scientifici previsti dal bando
14. Invited speaker at the plenary meeting of “SoBigData++” H2020 research infrastructure, University of Amsterdam, Amsterdam, Netherlands, June 28-29, 2022
Invited speaker at the cycle of “Research Seminars”, IMT School for Advanced Studies, Lucca, 8th Nov. 2021.
Invited speaker at the Summer School of Mathematics for Economic and Social Sciences “An introduction to random dynamical systems and their perturbations”, Centro De Giorgi and Scuola Normale Superiore, Pisa, Sep. 2019.
VALUTABILE
15. Accepted contribution the 28th International Conference on “Computing in Economics and Finance” (CEF2022) by the Society for Computation Economics, Southern Methodist University, Dallas, Texas, USA, June 17-19, 2022.
Accepted contribution to the XXIII Workshop on Quantitative Finance (QFW2022), School of Economics of the University of Rome Tor Vergata, Mar. 2022.
Accepted contribution to the 10th International Conference on Complex Networks and their Applications, INEF-UPM Universidad Polit´ecnica de Madrid, Nov. 2021 (online).
Accepted contribution to the session “Networks, Big Data, and Artificial Intelligence in Economics, Finance, and Social Sciences” of the AMASES Annual Conference 2021, online, Sep. 2021.
Accepted contribution to the Italian satellite of the “Conference on Complex Systems” CSS/Italy, at Fondazione Bruno Kessler, Trento, Jul. 2019.
Accepted contribution to the “Workshop on Economic Science with Heterogeneous Interacting Agents” (WEHIA), at City University of London, Jun. 2019.
Accepted contribution to the 29th annual conference of the European Association for Evolutionary Political Economy (EAEPE), at the Corvinous University, Budapest, Oct. 2017.
Accepted contribution to the 41st Annual Meeting of the Association for Mathematics Applied to Social and Economic Sciences (AMASES), at the University of Cagliari, Sep. 2017.
Accepted contribution to the XVIII Workshop on Quantitative Finance “QFW2017”, at the University of Milano-Bicocca, Milano, Jan. 2017.

Accepted contribution to the satellite meeting of STATPHYS26, “Statistical Physics of Financial and Economic Networks”, at the Paris 1 Panthéon-Sorbonne University, Paris, Jul. 2016.
VALUTABILE

VERIFICA PUBBLICAZIONI VALUTABILI

1. Williams, O.E., Mazzarisi, P., Lillo, F., and Latora, V. (2022). Non-Markovian temporal networks with auto- and cross-correlated link dynamics. *Physical Review E*, 105(3), 034301.
VALUTABILE
2. Delgado, L., Gurtner, G., Mazzarisi, P., Zaoli, S., Valput, D., Cook, A., and Lillo, F. (2021). Networkwide assessment of ATM mechanisms using an agent-based model. *Journal of Air Transport Management*, 95, 102108. DOI: 10.1016/j.jairtraman.2021.102108 ISSN: 0969-6997.
VALUTABILE
3. Campajola, C., Lillo, F., Mazzarisi, P., and Tantari, D. (2021). On the equivalence between the Kinetic Ising Model and discrete autoregressive processes. *Journal of Statistical Mechanics: Theory and Experiment*, 2021(3), 033412. ISSN: 1742-5468.
VALUTABILE
4. Zaoli, S., Mazzarisi, P., and Lillo, F. (2021). Betweenness centrality for temporal multiplexes. *Scientific reports*, 11(1), 4919, 1-9. ISSN: 2045-2322.
VALUTABILE
5. Mazzarisi, P., Zaoli, S., Campajola, C., and Lillo, F. (2020). Tail granger causalities and where to find them: Extreme risk spillovers vs spurious linkages. *Journal of Economic Dynamics and Control*, 121, 104022. ISSN: 0165-1889
VALUTABILE
6. Mazzarisi, P., Barucca, P., Lillo, F., and Tantari, D. (2020). A dynamic network model with persistent links and node-specific latent variables, with an application to the interbank market. *European Journal of Operational Research*, 281(1), 50–65.
VALUTABILE
7. Mazzarisi, P., Zaoli, S., Lillo, F., Delgado, L., and Gurtner, G. (2020). New centrality and causality metrics assessing air traffic network interactions. *Journal of Air Transport Management*, 85, 101801. ISSN: 0969-6997.
VALUTABILE
8. Zaoli, S., Mazzarisi, P., and Lillo, F. (2019). Trip centrality: Walking on a temporal multiplex with non-instantaneous link travel time. *Scientific reports*, 9(1), 10570, 1–11. ISSN: 2045-2322.
VALUTABILE
9. Wilinski, M., Mazzarisi, P., Tantari, D., and Lillo, F. (2019). Detectability of macroscopic structures in directed asymmetric stochastic block model. *Physical Review E*, 99(4), 042310. ISSN: 2470-0053.
VALUTABILE
10. Mazzarisi, P., Lillo, F., and Marmi, S. (2019). When panic makes you blind: A chaotic route to systemic risk. *Journal of Economic Dynamics and Control*, 100, 176–199. ISSN: 0165-1889.
VALUTABILE
11. Barucca, P., Lillo, F., Mazzarisi, P., and Tantari, D. (2018). Disentangling group and link persistence in dynamic stochastic block models. *Journal of Statistical Mechanics: Theory and Experiment*, 2018(12), 123407. DOI: 10.1088/1742-5468/aaeb44 ISSN: 1742-5468
VALUTABILE

TESI DI DOTTORATO

Mazzarisi, P. (2019). Dynamic network models with applications to finance. Supervisors: Prof. Fabrizio Lillo (SNS, Unibo), Prof. Stefano Marmi (SNS).

CONSISTENZA COMPLESSIVA DELLA PRODUZIONE SCIENTIFICA:

Il candidato presenta una produzione complessiva pari a N 12 pubblicazioni (compresa la tesi di dottorato).

CANDIDATO: **Patacca Marco**

VERIFICA TITOLI VALUTABILI:

1. Ph.D. in ECONOMICS: Quantitative Methods for Economics (S.S.D. SECS-S/06 - XXXI Cycle) University of Perugia. Thesis: Essays on Bitcoin Price Dynamics.
VALUTABILE
2. Master's Degree in FINANCE AND QUANTITATIVE METHODS FOR ECONOMICS, 110/110 magna cum Laude. University of Perugia, Perugia.
Bachelor's Degree in ECONOMICS OF MARKETS AND FINANCIAL INTERMEDIARIES, grade 107/110. Department of Economics, University of Perugia,. Thesis: "The Cornish-Fisher Expansion in the Analysis of Financial Portfolio's Performance"
NON VALUTABILE La Commissione ritiene che la formazione universitaria precedente al dottorato non sia rilevante ai fini della procedura.
3. Assistant Professor (RTDa), University of Verona, Department of Economics, Verona, Italy
VALUTABILE
4. Post-Doctoral Researcher in Moneytrack, Léonard de Vinci Pôle Universitaire, Research Center, Paris, France. VALUTABILE
5. Visiting scholar New York University 11-12.2017 e London School of Economics and Political Sciences 1-3.2017. VALUTABILE
6. Interventi a convegni nazionali e internazionali:
May 25-27, 2022. 9th International Conference on Risk Analysis (ICRA9), University of Perugia, Perugia, Italy. Oral presentation, "Investor sentiment as driver of financial stock market".
April 28-30, 2022. Financial Regulation & Technology: Advances since the Financial Crisis (65th Meeting EWG/CFM), HOFSTRA University, New York, United States. Oral presentation, "An explorative analysis of sentiment impact on S&P 500 components returns, volatility and downside risk".
March 31-April 01, 2022. XXIII Workshop on Quantitative Finance (QFW 2022), University of Rome Tor Vergata, Rome, Italy. Oral presentation, "An explorative analysis of sentiment impact on S&P 500 components returns, volatility and downside risk".
November 04-05, 2021. 3rd Crypto Asset Lab Conference (CAL2021), University of Milano-Bicocca, Milano, Italy. Oral presentation, "Common dynamic factors for cryptocurrencies and multiple pair-trading statistical arbitrages".
June 22-25, 2021. 10th General AMAmEF Conference, University of Padova (Virtual Conference), Padova, Italy. Oral presentation, "Regime switches and commonalities of the cryptocurrencies asset class".
January 28-29, 2021. XXII Workshop On Quantitative Finance (QFW 2021), University of Verona (Virtual Conference), Verona, Italy. Member of the organizing committee.
December 19-21, 2020. 14th International Conference on Computational and Financial Econometrics (CFE-CMStatistics 2020), King's College London (Virtual Conference), London, United Kingdom.
Oral presentation, "Common dynamic factors for cryptocurrencies and multiple pair-trading statistical arbitrages".
September 09-11, 2019. 43rd Annual Meeting of the AMASES "Association for Mathematics Applied to Social and Economic Sciences", University of Perugia, Perugia, Italy. Oral presentation, "Cointegration analysis of cryptocurrencies".
June 23-26, 2019. 30th European Conference on Operational Research (EURO 2019), University College Dublin, Dublin, Ireland. Oral presentation, "Cointegration analysis of cryptocurrencies".

June 15-16, 2019. Cryptocurrency Research Conference 2019, Southampton Business School, Southampton, United Kingdom. Oral presentation, "Regime switching analysis of cryptocurrencies".

November 22, 2018. Université Paris Diderot, Paris, France. Cryptofinance seminar, "Bitcoin prices and market attention".

September 13-15, 2018. 42nd Annual Meeting of the AMASES "Association for Mathematics Applied to Social and Economic Sciences", University of Naples Parthenope, Napoli, Italy. Oral presentation, "A Sentiment-Based Model for the Bitcoin: Theory, Estimation and Option Pricing".

July 08-11, 2018. 29th European Conference on Operational Research (EURO 2018), Valencia, Spain. Oral presentation, "Does market attention affect Bitcoin returns and volatility?".

May 11, 2018. Department of Statistics and Quantitative Methods, Milano Bicocca University, Milano, Italy. Doctoral seminar, "Bitcoin prices and market attention".

January 24-26, 2018. XIX Workshop on Quantitative Finance 2018, University of Roma Tre, Roma, Italy. Poster presentation, "Does market attention affect Bitcoin returns and volatility?".

January 25-27, 2017. XVIII Workshop on Quantitative Finance 2017, University of Milano-Bicocca, Milano, Italy. Poster presentation, "Bitcoins prices and market sentiment indicators".

VALUTABILE

7. Best paper award AMASES 2018.

VALUTABILE

8. Teaching assistant Financial mathematics 2014-2015 (Univ. di Perugia),
Teaching assistant Basic calculus dal 2015-2016 al 2018-2019 (Univ. di Perugia),
Lecturer of Econometrics (Paris), Mathematical Finance 2020-2021 (Univ. di Verona),
Lecturer Computational methods for finance 2020-2021 e 2021-2022 (Univ. di Verona)

VALUTABILE

VERIFICA PUBBLICAZIONI VALUTABILI

1. "Regime switches and commonalities of the cryptocurrencies asset class" Figà-Talamanca, Gianna, Focardi, Sergio, Patacca, Marco (2021).THE NORTH AMERICAN JOURNAL OF ECONOMICS AND FINANCE.

VALUTABILE

2. "Common dynamic factors for cryptocurrencies and multiple pair-trading statistical arbitrages" Figà-Talamanca, Gianna, Focardi, Sergio, Patacca, Marco (2021) DECISIONS IN ECONOMICS AND FINANCE.

VALUTABILE

3. "The Quantitative Easing Bursts Bitcoin Price" Patacca, Marco, Focardi, Sergio (2021) ACCOUNTING AND FINANCE RESEARCH.

VALUTABILE

4. "Market attention and Bitcoin price modeling: theory, estimation and option pricing." Cretarola, Alessandra, Figà-Talamanca, Gianna, Patacca, Marco (2020) DECISIONS IN ECONOMICS AND FINANCE.

VALUTABILE

5. "Disentangling the relationship between Bitcoin and market attention measures." Figà-Talamanca, Gianna, Patacca, Marco (2020) ECONOMIA E POLITICA INDUSTRIALE.

VALUTABILE

6. "Does Market Attention Affect Bitcoin Returns and Volatility?" Figà-Talamanca, Gianna, Patacca, Marco (2019) DECISIONS IN ECONOMICS AND FINANCE.

VALUTABILE

7. "Model-based arbitrage in multi-exchange models for Bitcoin price dynamics" Bistarelli, Stefano, Cretarola, Alessandra, Figà-Talamanca, Gianna, Patacca, Marco (2019) DIGITAL FINANCE.

NON VALUTABILE La rivista non risulta tra le riviste scientifiche ai fini del ASN dell'area 13

8. "Is Arbitrage Possible in the Bitcoin Market? (Work-In-Progress Paper)." Bistarelli, Stefano, Cretarola, Alessandra, Figà-Talamanca, Gianna, Mercanti, Ivan, Patacca, Marco (2019) LECTURE NOTES IN ARTIFICIAL INTELLIGENCE.
VALUTABILE
9. "A Continuous Time Model for Bitcoin Price Dynamics." Cretarola, Alessandra, Figà-Talamanca, Gianna, Patacca, Marco (2018) Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance. MAF.
VALUTABILE
10. "Cryptocurrencies as a Driver of Innovation for the Monetary System" Accepted for publication Figà-Talamanca, Gianna, Focardi, Sergio, Mazza, Davide, Patacca, Marco FINTECH RESEARCH AND APPLICATIONS.
NON VALUTABILE La rivista non risulta tra le riviste scientifiche ai fini del ASN dell'area 13

TESI DI DOTTORATO: "Essays on Bitcoin Price Dynamics"

CONSISTENZA COMPLESSIVA DELLA PRODUZIONE SCIENTIFICA:

Il candidato presenta una produzione complessiva pari a N.11, di cui N. 9 ritenute valutabili (compresa la tesi di dottorato).

CANDIDATO: **Prattico Flavio**

VERIFICA TITOLI VALUTABILI:

1. Ph.D. in ingegneria meccanica Università dell'Aquila 10/04/2015. VALUTABILE
2. Laurea in ingegneria meccanica con voto 110/110 presso l'Università dell'Aquila
NON VALUTABILE La Commissione ritiene che la formazione universitaria precedente al dottorato non sia rilevante ai fini della procedura.
3. Research Fellow presso lo Shibaura Institute of Technology dal 10/05/2013 al 09/05/2014
VALUTABILE
4. Assegni di ricerca presso il MEMOTEF, La Sapienza nei periodi dal 01/12/2015 al 30/11/2016 e dal 01/08/2014 - 31/07/2015.
VALUTABILE
5. Visiting research nel 2016 presso Roslin Institute.
VALUTABILE
6. Teaching assistant di Industrial automation (Univ. dell'Aquila) dal 2011 al 2013 Teaching assistant di Industrial automation (Shibaura Institute) 2014, C++ Laboratory (Univ. La Sapienza) nel 2015
VALUTABILE
7. Partecipazioni a convegni come speaker:
 - F. Prattico, F. Petroni, and G. D'Amico, First and second order semi-Markov chains for wind speed modeling, Geophysical Research Abstracts, Vol. 14, EGU2012-318, 2012 EGU General Assembly 2012
 - G. D'Amico, F. Petroni and F. Prattico, A Semi-Markov approach for synthetic data generation of wind speed, SMTDA 2012, Chania, Crete, Greece, 05-08/06/2012.
 - G. D'Amico, F. Petroni and F. Prattico, Wind speed forecasting financial return, ASMDA 2013, Mataro, Spain, 25-27/06/2013.
 - G. D'Amico, F. Petroni and F. Prattico, Is the Weibull distribution really suitable to forecast wind energy production?, SMTDA 2014, Lisboa, Portugal, 11-14/06/2014.
 - T.V. Thuc, F. Prattico, M.A.M. Dzahir, S. Yamamoto, A novel Treadmill Body Weight Support System using Pneumatic Muscle Actuators, EMBC 2014, Chicago, USA 27-30/08/2014.
 - T.V. Thuc, F. Prattico, S. Yamamoto, A novel Treadmill Body Weight Support

system using Pneumatic Artificial Muscle actuators: a comparison between active Body Weight Support system and counter weight system, IU- PESM, Toronto, Canada, 7-12/06/2015.

F. Petroni, F. Prattico, Collaboration network of scientists, Econophysics Colloquium, Prague 14-16/09/2015.

F. Prattico, Tornadoes and Related Damage Costs: Statistical Modeling with a Semi-Markov Approach, IWAP, Toronto, Canada, 20-23/06/2016.

F. Prattico, F. Petroni, G. D'Amico, Volatility Forecasting by Means of a GARCH Model: Accuracy, Entropy and Predictability. SMTDA, Valletta, Malta, 1-4/06/2016.

F. Prattico, F. Petroni. Cryptocurrency hourly volatility and information measures of predictability, ITISE 2022, Gran Canaria, Spain, 27-30/06/2022.

VALUTABILE

8. Associate editor Markets: Emergence, Macroeconomic Factors and Recent Developments, 2013,

Editor Trends in Renewable Energy dal 2015 al 2019,

VALUTABILE

9. Best Paper Award for Young Scientist SMTDA 2012.

VALUTABILE

VERIFICA PUBBLICAZIONI VALUTABILI

1. "First and second order semi-Markov chains for wind speed modeling" G. D'Amico, F. Petroni, F. Prattico (2013) Physica A.

VALUTABILE

2. "Wind speed modeled as an indexed semi-Markov process" G. D'Amico, F. Petroni, F. Prattico (2013) Environmetrics.

VALUTABILE

3. "Reliability measures of second order semi-Markov chain applied to wind energy production" G. D'Amico, F. Petroni, F. Prattico (2013) Journal of Renewable Energy.

NON VALUTABILE La rivista non risulta tra le riviste scientifiche dell'area 13

4. "Performance Analysis of Second Order Semi-Markov Chains: An Application to Wind Energy Production" G. D'Amico, F. Petroni, F. Prattico (2014) Methodology and Computing in Applied Probability.

VALUTABILE

5. "Wind speed and energy forecasting at different time scales: A nonparametric approach" G. D'Amico, F. Petroni, F. Prattico (2014) Physica A.

VALUTABILE

6. "Economic performance indicators of wind energy based on wind speed stochastic modeling" G. D'Amico, F. Petroni, F. Prattico (2015) Applied Energy.

VALUTABILE

7. "Wind speed prediction for wind farm applications by Extreme Value Theory and Copulas" G. D'Amico, F. Petroni, F. Prattico (2015) Journal of Wind Engineering and Industrial Aerodynamics.

NON VALUTABILE La rivista non risulta tra le riviste scientifiche dell'area 13

8. "Reliability measures for indexed semi-Markov chains applied to wind energy production" G. D'Amico, F. Petroni, F. Prattico (2015) Reliability Engineering & System Safety.

VALUTABILE

9. "Tornadoes and related damage costs: statistical modelling with a semi-Markov approach" G. D'Amico, F. Petroni, F. Prattico, R. Manca, C. Corini (2016) Geomatics, Natural Hazards and Risk.

NON VALUTABILE La rivista non risulta tra le riviste scientifiche dell'area 13

10. "On the limit distribution of a second-order semi-Markov chain in state and duration" G. D'Amico, F. Petroni, F. Prattico (2017) Communications in Statistics-Theory and Methods. VALUTABILE

11. "Insuring wind energy production G. D'Amico, F. Petroni, F. Pratico (2017) Physica A: Statistical Mechanics and its Applications.
VALUTABILE
12. "Stock market daily volatility and information measures of predictability" G. D'Amico, F. Gismondi, F. Petroni, F. Pratico (2019) Physica A: Statistical Mechanics and its Applications VALUTABILE

TESI DI DOTTORATO Semi-Markov models applied to wind speed

CONSISTENZA COMPLESSIVA DELLA PRODUZIONE SCIENTIFICA:

Il candidato presenta una produzione complessiva pari a N. 12 pubblicazioni, di cui N. 9 ritenute valutabili.

La Commissione termina i propri lavori alle ore 10:30.

Letto, approvato e sottoscritto.

Firma del Commissari

.....

ALLEGATO E AL VERBALE N. 3
GIUDIZI COLLEGIALI SU TITOLI E PUBBLICAZIONI

PROCEDURA SELETTIVA DI CHIAMATA PER N. 1 POSTO DI RICERCATORE A TEMPO DETERMINATO DI TIPOLOGIA B PER IL SETTORE CONCORSUALE 13/D4 - SETTORE SCIENTIFICO-DISCIPLINARE SECS-S/06 - PRESSO IL DIPARTIMENTO DI METODI E MODELLI PER IL TERRITORIO, L'ECONOMIA E LA FINANZA DELL'UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI ROMA "LA SAPIENZA" BANDITA CON D.R. N. 1616/2022 DEL 11.05.2022

L'anno 2022, il giorno 16 del mese di settembre si è riunita per via telematica tramite la piattaforma Google Meet (link <https://meet.google.com/qdo-hcxf-kvu>) la Commissione giudicatrice della procedura selettiva di chiamata per n. 1 posto di Ricercatore a tempo determinato di tipologia B per il Settore concorsuale 13/D4 – Settore scientifico-disciplinare SECS-S/06 - presso il Dipartimento di Metodi e Modelli per il Territorio, l'Economia e la Finanza dell'Università degli Studi di Roma "La Sapienza", nominata con D.R. n. 2419/2022 del 05/08/2022 e composta da:

- Prof.ssa Sabrina Mulinacci – professore associato presso il Dipartimento di Scienze Statistiche "Paolo Fortunati" dell'Università degli Studi di Alma Mater Studiorum Università di Bologna;
- Prof.ssa Silvia Romagnoli – professore ordinario presso il Dipartimento di Scienze Statistiche "Paolo Fortunati" dell'Università degli Studi di Alma Mater Studiorum Università di Bologna;
- Prof.ssa Barbara Vantaggi – professore ordinario presso il Dipartimento di Metodi e Modelli per il Territorio, l'Economia e la Finanza di "Sapienza" Università di Roma.

La Commissione inizia i propri lavori alle ore 10:45 e procede ad elaborare la valutazione collegiale dei titoli e delle pubblicazioni dei candidati.

CANDIDATO: CALVIA ALESSANDRO

GIUDIZIO COLLEGIALE

TITOLI

Valutazione sui titoli

1. Il percorso dottorale dichiarato ha una buona pertinenza con il settore scientifico disciplinare d'interesse. Punti 7
2. L'attività di tutorato è molto consistente e in linea con il settore disciplinare d'interesse. L'attività di insegnamento è discreta e riporta esperienze anche in ambito dottorale. L'attività didattica di supervisione tesi è molto buona e riporta anche un ruolo in ambito dottorale. Punti 4
3. La posizione di ricerca post-dottorale e la posizione di RTD-A attualmente ricoperta sono pertinenti con il settore scientifico disciplinare. Punti 4
4. La partecipazione a progetti di ricerca è consistente e di ottimo livello. La coordinazione di progetti di ricerca è presente. Punti 7
5. L'attività in qualità di relatore è molto buona, riporta anche una consistente attività di relatore su invito che è valutata di ottimo livello. L'attività di organizzazione di eventi scientifici è buona. Punti 5.5
6. Non sono documentati premi. Punti 0

Totale punti (valutazione titoli) 27.5

PUBBLICAZIONI PRESENTATE:

1 Optimal control of pure jump Markov processes with noise-free partial observation, PhD Thesis

La tesi di dottorato ha una congruenza molto buona con gli interessi del settore scientifico disciplinare. Mostra un livello più che buono di originalità e di rigore. Punti 3.1

2 A. Calvia, Optimal control of continuous-time Markov chains with noise-free observation, SIAM J. Control Optim., 56 (2018), pp. 2000–2035

La pubblicazione a nome singolo, presenta una congruenza molto buona con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è molto buono. La pubblicazione rientra nella fascia A Anvur 22.

Punti 4.6

3 A. Calvia, Stochastic filtering and optimal control of pure jump Markov processes with noise-free partial observation, ESAIM: COCV, 26 (2020), 25

La pubblicazione a nome singolo, presenta una congruenza molto buona con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è molto buono seppur la rilevanza della rivista sia al più di medio livello. Punti 3.3

4. A. Calvia, E. Rosazza Gianin, Risk measures and progressive enlargement of filtration: a BSDE approach, SIAM J. Financial Math., 11 (2020), pp. 815–848

La pubblicazione presenta un ottimo livello di congruenza con il settore scientifico disciplinare. Il livello di originalità e rigore è ottimo così come la rilevanza della rivista (classe A Anvur 22). La pubblicazione è in collaborazione con un co-autore, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 4.5

5. A. Calvia, S. Federico, F. Gozzi, State constrained control problems in Banach lattices and applications, SIAM J. Control Optim., 59 (2021), pp. 4481–4510

La pubblicazione presenta un ottimo livello di congruenza con il settore scientifico disciplinare. Il livello di originalità e rigore è ottimo così come la rilevanza della rivista (classe A Anvur 22). La pubblicazione è in collaborazione con due co-autori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 4.3

6. A. Calvia, G. Ferrari, Nonlinear Filtering of Partially Observed Systems arising in Singular Stochastic Optimal Control, Appl. Math. Optim., 85:12 (2022)

La pubblicazione presenta una congruenza molto buona con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è molto buono seppur la rilevanza della rivista sia di discreto livello. La pubblicazione è in collaborazione con un co-autore, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 3.1

7. E. Bandini, A. Calvia, K. Colaneri, Stochastic filtering of a pure jump process with predictable jumps and path dependent local characteristics, Stoch. Proc. Appl., 151 (2022)

La pubblicazione presenta una congruenza molto buona con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è ottimo così come la rilevanza della rivista (classe A Anvur 22). La pubblicazione è in collaborazione con due co-autori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 4.1

CONSISTENZA COMPLESSIVA DELLA PRODUZIONE SCIENTIFICA:

Valutazione sulla produzione complessiva

Il candidato presenta 7 prodotti, compresa la tesi di dottorato; la consistenza della produzione scientifica è discreta. La congruenza con il settore scientifico disciplinare è mediamente molto buona, così come il livello di originalità e di rigore. La rilevanza delle riviste è mediamente molto buona. Il contributo individuale è mediamente molto buono, considerando che 2 prodotti presentati sono a nome singolo.

Totale punti (valutazione pubblicazioni) 27

CANDIDATO: Grassetti Francesca

GIUDIZIO COLLEGALE

TITOLI

Valutazione sui titoli

1. Il percorso dottorale dichiarato ha una buona pertinenza con il settore scientifico disciplinare d'interesse. Punti 7
2. L'attività di tutorato è molto consistente e in linea con il settore disciplinare d'interesse. L'attività d'insegnamento è molto intensa e riporta esperienze anche in ambito dottorale. L'attività didattica di supervisione tesi è molto consistente. Punti 6.5
3. Ricopre attualmente una posizione di RTD-A nel settore scientifico disciplinare della procedura in oggetto. Sono presenti periodi di ricerca come visiting a dimostrazione di una attività scientifica piuttosto intensa Punti 4
4. La partecipazione a progetti di ricerca è presente. Consistente l'attività divulgativa e terza missione anche come responsabile del progetto. Punti 3
5. L'attività di partecipazione e relazione a convegni è ottima come anche l'attività di relatore su invito. Presente l'attività di organizzazione di sessioni, incontri scientifici e scuole estive. Punti 4
6. La candidata ha ottenuto l'abilitazione scientifica nazionale a professore di seconda fascia. La candidata ha avuto i buoni riconoscimenti scientifici, di particolare rilevanza quello su un articolo su Quantitative finance. Punti 5

Totale punti (valutazione titoli) 29.5

PUBBLICAZIONI PRESENTATE:

1. Bischi, G. I., Grassetti, F., Sanchez Carrera, E. J. *On the economic growth equilibria during the Covid-19 pandemic*. Communications in Nonlinear Science & Numerical Simulation, 2022, vol. 112, 106573, ISSN: 1007-5704, doi: 10.1016/j.cnsns.2022.106573. Elsevier, Amsterdam, Paesi Bassi.

La pubblicazione presenta un'ottima congruenza con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è buono e la rilevanza della rivista (classe A Anvur 22) è ottima. La pubblicazione è in collaborazione con due coautori, da considerarsi aventi pari apporto individuale. Punti 3.9

2. Grassetti, F., Mammana, C., Michetti, E. *Nonlinear dynamics in real economy and financial markets: The role of dividend policies in fluctuations*. Chaos, Solitons and Fractals, 2022, vol. 160, 112191, ISSN: 0960-0779, doi: 10.1016/j.chaos.2022.112191. Elsevier, Amsterdam, Paesi Bassi.

La pubblicazione presenta un'ottima congruenza con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è buono e la rilevanza della rivista (classe A Anvur 22) è ottima. La pubblicazione è in collaborazione con due coautori, da considerarsi aventi pari apporto individuale. Punti 3.8

3. Grassetti, F., Mammana, C., Michetti, E. *A dynamical model for real economy and finance*. Mathematics and Financial Economics, 2022, vol. 16, p. 345-366, ISSN: 1862-9679, doi: 10.1007/s11579-021-00311-3. Springer, Berlino, Germania.

La pubblicazione presenta un'ottima congruenza con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è buono e la rilevanza della rivista (classe A Anvur 22) è ottima. La pubblicazione è in collaborazione con due coautori, da considerarsi aventi pari apporto individuale. Punti 3.9

4. Barucci, E., Dindo, P., Grassetti, F. *Portfolio insurers and constant weight traders: who will survive?*. Quantitative Finance, 2021, vol. 21, p. 1993-2004, ISSN: 1469-7688, doi: 10.1080/14697688.2021.1987506. Taylor & Francis, Milton Park, Regno Unito.

La pubblicazione presenta un'ottima congruenza con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è buono e la rilevanza della rivista (classe A Anvur 22) è ottima. La pubblicazione è in collaborazione con due coautori, da considerarsi aventi pari apporto individuale. Punti 3.9

5. Coppier R., Grassetti F., Michetti E. *Non-compliant behaviour in public procurement: an evolutionary model with endogenous monitoring*. Decisions in Economics and Finance, 2021, vol. 44, p. 459-483, ISSN: 1593-8883, doi:10.1007/s10203-021-00317-y. Springer, Berlino, Germania.

La pubblicazione presenta un'ottima congruenza con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è discreto e la rilevanza della rivista (classe A Anvur 22) è ottima. La pubblicazione è in collaborazione con due coautori, da considerarsi aventi pari apporto individuale. Punti 3.7

6.Grassetti, F., Guzowska, M., Michetti, E. *A dynamically consistent discretization method for Goodwin model*. Chaos, Solitons and Fractals, 2020, vol. 130, 109420, ISSN: 0960-0779, doi: 10.1016/j.chaos.2019.109420. Elsevier, Amsterdam, Paesi Bassi.

La pubblicazione presenta un'ottima congruenza con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è più che buono e la rilevanza della rivista (classe A Anvur 22) è ottima. La pubblicazione è in collaborazione con due coautori, da considerarsi aventi pari apporto individuale. Punti 4

7.Grassetti, F. *On the Influence of Production Technologies and Savings Propensities on Economic Growth. Findings Considering a Solow's Type Growth Model*. Frontiers in Applied Mathematics and Statistics, 2019, vol. 5(1), ISSN: 2297-4687, doi: 10.3389/fams.2019.00001. Frontiers, Losanna, Svizzera.

La pubblicazione a nome singolo, presenta un'ottima congruenza con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è modesto trattandosi di una review e la rilevanza della rivista è anch'essa modesta. Punti 2.4

8.Grassetti, F., Hunanyan, G., Mammana, C., Michetti, E. *A note on the influence of saving behaviors on economic growth*. Metroeconomica, 2019, vol. 70(3), p. 442-457, ISSN: 0026-1386, doi: 10.1111/meca.12210. John Wiley & Sons Inc, New York, Stati Uniti.

La pubblicazione presenta un'ottima congruenza con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è più che buono e la rilevanza della rivista è molto buona. La pubblicazione è in collaborazione con tre coautori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 2.8

9.Grassetti, F., Hunanyan, G. *On the economic growth theory with Kadiyala production function*. Communications in Nonlinear Science & Numerical Simulation, 2018, vol. 58, p. 220-232, ISSN: 1007-5704, doi: 10.1016/j.cnsns.2017.06.036. Elsevier, Amsterdam, Paesi Bassi.

La pubblicazione presenta un'ottima congruenza con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è ottimo così come la rilevanza della rivista (classe A Anvur 22). La pubblicazione è in collaborazione con un coautore, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 4.5

10.Grassetti, F., Mammana, C., Michetti, E. *Poverty trap, boom and bust periods and growth. A nonlinear model for non-developed and developing countries*. Decisions in Economics and Finance, 2018, vol. 41, p. 145-162, ISSN: 1593-8883, doi: 10.1007/s10203-018-0211-6. Springer, Berlino, Germania.

La pubblicazione presenta un'ottima congruenza con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è ottimo così come la rilevanza della rivista (classe A Anvur 22). La pubblicazione è in collaborazione con due coautori, da considerarsi aventi pari apporto individuale. Punti 4.3

11.Grassetti, F., Mammana, C., Michetti, E. *On the Effect of Labour Productivity on Growth: Endogenous Fluctuations and Complex Dynamics*. Discrete Dynamics in Nature and Society, 2018, vol. 2018, 6831508, ISSN: 1026-0226, doi: 10.1155/2018/6831508. Hindawi Publishing Corporation, Londra, Regno Unito.

La pubblicazione presenta un'ottima congruenza con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è discreto e la rilevanza della rivista è limitata. La pubblicazione è in collaborazione con due coautori, da considerarsi aventi pari apporto individuale. Punti 2

12.Grassetti, F., Mammana, C., Michetti, E. *Substitutability between production factors and growth. An analysis using VES production functions*. Chaos, Solitons and Fractals, 2018, vol. 113, p. 53-62, ISSN: 0960-0779, doi: 10.1016/j.chaos.2018.04.012. Elsevier, Amsterdam, Paesi Bassi.

La pubblicazione presenta un'ottima congruenza con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è ottimo così come la rilevanza della rivista (classe A Anvur 22). La pubblicazione è in collaborazione con due coautori, da considerarsi aventi pari apporto individuale. Punti 4.3

CONSISTENZA COMPLESSIVA DELLA PRODUZIONE SCIENTIFICA:

Valutazione sulla produzione complessiva

La candidata presenta 12 prodotti di cui 9 in Classe A: la consistenza della produzione scientifica è ottima. La congruenza con il settore scientifico disciplinare è ottima e il livello di originalità e di rigore sono mediamente più che buoni. La rilevanza delle riviste è mediamente ottima. Solo un lavoro è a nome singolo e di livello discreto.

Totale punti (valutazione pubblicazioni) 43.5

CANDIDATO: Martire Antonio Luciano

GIUDIZIO COLLEGALE

TITOLI

Valutazione sui titoli

- | | |
|---|-----------|
| 1. Il percorso dottorale dichiarato ha una ottima pertinenza con il settore scientifico disciplinare d'interesse. | Punti 8 |
| 2. Presente l'attività di supporto alla didattica anche se limitata. L'attività di docenza sia in corsi universitari che al dottorato è buona e inerente al settore concorsuale di interesse. | Punti 1.5 |
| 3. Ha ricoperto numerose posizioni di ricerca post-dottorale | Punti 2 |
| 4. La partecipazione a progetti di ricerca locali è buona. | Punti 1 |
| 5. L'attività di partecipazione e relazione a convegni è discreta. | Punti 1 |
| 6. Non sono documentati premi | Punti 0 |

Totale punti (valutazione titoli) 13.5

PUBBLICAZIONI PRESENTATE:

1. Paolo De Angelis, Antonio Luciano Martire, Emilio Russo. A bivariate model for evaluating equity linked policies with surrender option. Scandinavian Actuarial, Journal. 2016:3, 246-261, DOI:10.1080/03461238.2014.924433.

La pubblicazione presenta un'ottima congruenza con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è ottimo così come la rilevanza della rivista (classe A Anvur 22). La pubblicazione è in collaborazione con due coautori, da considerarsi aventi pari apporto individuale. Punti 4.3

2. Paolo De Angelis, Roberto De Marchis, Antonio Luciano Martire. A new numerical method for a class of Volterra and Fredholm integral equations. Journal of Computational and Applied Mathematics 379 (2020) 112944.

La congruenza è molto buona. Il livello di originalità e rigore è distinto e la rilevanza della rivista è molto buona. La pubblicazione è in collaborazione con due coautori, da considerarsi aventi pari apporto individuale. Punti 3.3

3. Paolo De Angelis, Roberto De Marchis, Antonio Luciano Martire, Immacolata Oliva. A mean-value Approach to solve fractional differential and integral equations. Chaos, Solitons and Fractals 138 (2020) 109895.

La pubblicazione presenta una congruenza molto buona. Il livello di originalità e rigore è ottimo così come la rilevanza della rivista (classe A Anvur 22). La pubblicazione è in collaborazione con tre coautori, da considerarsi aventi pari apporto individuale. Punti 4.2

4. Paolo De Angelis, Roberto De Marchis, Antonio Luciano Martire, Stefano Patri. Non-Standard Volterra Integral Equations: A Mean-Value Theorem Numerical Approach. Applied Mathematical Sciences, Vol. 14, 2020, no. 9, 423-432,

La pubblicazione presenta una buona congruenza con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è buono e la rilevanza della rivista modesta. La pubblicazione è in collaborazione con tre coautori, da considerarsi aventi pari apporto individuale. Punti 1.7

5. Paolo De Angelis, Roberto De Marchis, Mario Marino, Antonio Luciano Martire, Immacolata Oliva. Betting on bitcoin: a profitable trading between directional and shielding strategies. Decisions in Economics and Finance 44, 883-903 (2021).

La pubblicazione presenta un'ottima congruenza con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è ottimo così come la rilevanza della rivista (classe A Anvur 22). La pubblicazione è in collaborazione con quattro coautori, da considerarsi aventi pari apporto individuale. Punti 4.2

6. Paolo De Angelis, Roberto De Marchis, Mario Marino, Antonio Luciano Martire, Immacolata Oliva. Evaluating ruin probabilities: a streamlined approach. Applied Mathematics E-Notes 21 (2021), 634-642

La pubblicazione presenta un'ottima congruenza con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è buono e la rilevanza della rivista discreta. La pubblicazione è in collaborazione con quattro coautori, da considerarsi aventi pari apporto individuale. Punti 2.1

7. Martire, A.L., Russo, E., Staino, A. (2022). "Surrender and Path-Dependent Guarantees in Variable Annuities: Integral Equation Solutions and Benchmark Methods". In: Corazza, M., Perna, C., Pizzi, C., Sibillo, M. (eds.) Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance. MAF 2022, p.p. 340-346, Springer, Cham.

La pubblicazione è un contributo in un volume. Presenta un'ottima congruenza con il settore disciplinare e un buon livello di originalità. La pubblicazione è in collaborazione con due coautori, da considerarsi aventi pari apporto individuale. Punti 2.4

8. Paolo De Angelis, Roberto De Marchis, Antonio Luciano Martire, Emilio Russo. A flexible lattice framework for valuing options on assets paying discrete dividends and variable annuities embedding GMWB riders. Decisions in Economics and Finance 45, 415-446 (2022).

La pubblicazione presenta un'ottima congruenza con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è ottimo così come la rilevanza della rivista (classe A Anvur 22). La pubblicazione è in collaborazione con tre coautori, da considerarsi aventi pari apporto individuale. Punti 4.3

9. Tesi di PhD: "Embedded surrender option pricing for equity-linked policies comparisons"

La tesi di dottorato ha una ottima congruenza. Mostra un livello più che buono di originalità e di rigore. Punti 3

CONSISTENZA COMPLESSIVA DELLA PRODUZIONE SCIENTIFICA:

Valutazione sulla produzione complessiva

Il candidato presenta 9 prodotti, inclusa la tesi di dottorato, di cui 4 in Classe A: la consistenza della produzione scientifica è buona. La congruenza con il settore scientifico disciplinare è molto buona e il livello di originalità e di rigore sono mediamente più che buoni. La rilevanza delle riviste è mediamente molto buona. Non presenta lavori a nome singolo a parte la tesi di dottorato.

Totale punti (valutazione pubblicazioni) 29.5

CANDIDATO: Mazzarisi Piero

GIUDIZIO COLLEGALE

TITOLI

Valutazione sui titoli

1. Il percorso dottorale dichiarato ha una ottima pertinenza con il settore scientifico disciplinare d'interesse. Punti 8
2. L'attività d'insegnamento è presente e riporta esperienze anche in ambito dottorale, in particolare relativa alla supervisione tesi. Anche la supervisione di tesi di laurea è molto buona. Punti 1.5
3. Ricopre attualmente una posizione di RTD-A nel settore scientifico disciplinare della procedura in oggetto. Le posizioni di ricerca postdottorale, come anche i visiting, sono pertinenti con il settore scientifico disciplinare d'interesse. Punti 5.5
4. La partecipazione a progetti di ricerca è buona. Punti 2
5. E' presente una discreta attività di relatore su invito, mentre l'attività in qualità di relatore è più che buona. L'attività di organizzazione di eventi scientifici è molto buona. Punti 2
6. Non sono documentati la ricezione di premi. Punti 0

Totale punti (valutazione titoli) 19

PUBBLICAZIONI PRESENTATE:

1. Williams, O.E., Mazzarisi, P., Lillo, F., and Latora, V. (2022). Non-Markovian temporal networks with auto- and cross-correlated link dynamics. *Physical Review E*, 105(3), 034301

La pubblicazione presenta una congruenza discreta con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è molto buono così come la rilevanza della rivista. La pubblicazione è in collaborazione con tre co-autori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 3.2

2. Delgado, L., Gurtner, G., Mazzarisi, P., Zaoli, S., Valput, D., Cook, A., and Lillo, F. (2021). Networkwide assessment of ATM mechanisms using an agent-based model. *Journal of Air Transport Management*, 95.

La pubblicazione presenta una buona congruenza con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è più che buono seppur la rilevanza della rivista sia di discreto livello. La pubblicazione è in collaborazione con sei co-autori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 2.5

3. Campajola, C., Lillo, F., Mazzarisi, P., and Tantari, D. (2021). On the equivalence between the Kinetic Ising Model and discrete autoregressive processes. *Journal of Statistical Mechanics: Theory and Experiment*, 2021(3).

La pubblicazione presenta una buona congruenza con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è molto buono così come la rilevanza della rivista. La pubblicazione è in collaborazione con tre co-autori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 3.3

4. Zaoli, S., Mazzarisi, P., and Lillo, F. (2021). Betweenness centrality for temporal multiplexes. *Scientific reports*, 11(1), 4919, 1-9.

La pubblicazione presenta una congruenza discreta con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è molto buono mentre la rilevanza della rivista è ottima (classe A Anvur 22). La pubblicazione è in collaborazione con due co-autori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 3.7

5. Mazzarisi, P., Zaoli, S., Campajola, C., and Lillo, F. (2020). Tail granger causalities and where to find them: Extreme risk spillovers vs spurious linkages. *Journal of Economic Dynamics and Control*, 121.

La pubblicazione presenta un'ottima congruenza con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è quasi ottimo mentre la rilevanza della rivista è ottima (classe A Anvur 22). La pubblicazione è in collaborazione con tre co-autori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 4.2

6. Mazzarisi, P., Barucca, P., Lillo, F., and Tantari, D. (2020). A dynamic network model with persistent links and node-specific latent variables, with an application to the interbank market. *European Journal of Operational Research*, 281(1), 50–65.

La pubblicazione presenta un'ottima congruenza con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è più che buono mentre la rilevanza della rivista è ottima (classe A Anvur 22). La pubblicazione è in collaborazione con tre co-autori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 4

7. Mazzarisi, P., Zaoli, S., Lillo, F., Delgado, L., and Gurtner, G. (2020). New centrality and causality metrics assessing air traffic network interactions. *Journal of Air Transport Management*, 85, 101801.

La pubblicazione presenta una sufficiente congruenza con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è più che buono seppur la rilevanza della rivista sia di discreto livello. La pubblicazione è in collaborazione con quattro co-autori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 2.4

8. Zaoli, S., Mazzarisi, P., and Lillo, F. (2019). Trip centrality: Walking on a temporal multiplex with non-instantaneous link travel time. *Scientific reports*, 9(1), 10570, 1–11.

La pubblicazione presenta una congruenza discreta con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è molto buono mentre la rilevanza della rivista è ottima (classe A Anvur 22). La pubblicazione è in collaborazione con due co-autori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 3.7

9. Wilinski, M., Mazzarisi, P., Tantari, D., and Lillo, F. (2019). Detectability of macroscopic structures in directed asymmetric stochastic block model. *Physical Review E*, 99(4), 042310.

La pubblicazione presenta una congruenza discreta con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è molto buono così come la rilevanza della rivista. La pubblicazione è in collaborazione con tre co-autori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 3.2

10. Mazzarisi, P., Lillo, F., and Marmi, S. (2019). When panic makes you blind: A chaotic route to systemic risk. *Journal of Economic Dynamics and Control*, 100, 176–199.

La pubblicazione presenta un'ottima congruenza con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è quasi ottimo mentre la rilevanza della rivista è ottima (classe A Anvur 22). La pubblicazione è in collaborazione con due co-autori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 4.2

11. Barucca, P., Lillo, F., Mazzarisi, P., and Tantari, D. (2018). Disentangling group and link persistence in dynamic stochastic block models. *Journal of Statistical Mechanics: Theory and Experiment*, 2018(12).

La pubblicazione presenta una buona congruenza con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è più che buono così come la rilevanza della rivista. La pubblicazione è in collaborazione con tre co-autori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 3.2

12. Mazzarisi, P. (2019). Dynamic network models with applications to finance. Supervisors: Prof. Fabrizio Lillo (SNS, Unibo), Prof. Stefano Marmi (SNS).

La tesi di dottorato ha un'ottima congruenza con gli interessi del settore scientifico disciplinare. Mostra un livello molto buono di originalità e di rigore. Punti 3.4

CONSISTENZA COMPLESSIVA DELLA PRODUZIONE SCIENTIFICA:

Valutazione sulla produzione complessiva

Il candidato presenta 12 prodotti compresa la tesi di dottorato; la consistenza della produzione scientifica è ottima. La congruenza con il settore scientifico disciplinare è mediamente molto buona, così come il livello di originalità e di rigore. La rilevanza delle riviste è mediamente molto buona. Il contributo individuale è buono, considerando che i prodotti presentati sono altamente collaborati.

Totale punti (valutazione pubblicazioni) 41

CANDIDATO: Patacca Marco

GIUDIZIO COLLEGIALE

TITOLI

Valutazione sui titoli

1. Il percorso dottorale dichiarato ha una ottima pertinenza con il settore scientifico disciplinare d'interesse. Punti 8
2. L'attività d'insegnamento è discreta. Punti 1
3. La posizione di ricerca post-dottorale e la posizione di RTD-A attualmente ricoperta sono pertinenti con il settore scientifico disciplinare. I periodi di visiting riportati sono vari. Punti 4
4. La partecipazione a progetti di ricerca non è documentata. Punti 0
5. L'attività in qualità di relatore è buona. Punti 1
6. Ha ottenuto un premio come best paper award. Punti 0.5

Totale punti (valutazione titoli) 14.5

PUBBLICAZIONI PRESENTATE:

1. "Regime switches and commonalities of the cryptocurrencies asset class" Figà-Talamanca, Gianna, Focardi, Sergio, Patacca, Marco (2021). THE NORTH AMERICAN JOURNAL OF ECONOMICS AND FINANCE.

La pubblicazione presenta una congruenza più che buona. Il livello di originalità e rigore è discreto così come la rilevanza della rivista. La pubblicazione è in collaborazione con tre co-autori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 2.9

2. "Common dynamic factors for cryptocurrencies and multiple pair-trading statistical arbitrages" Figà-Talamanca, Gianna, Focardi, Sergio, Patacca, Marco (2021) DECISIONS IN ECONOMICS AND FINANCE.

La pubblicazione presenta una congruenza più che buona. Il livello di originalità e rigore è discreto ed è pubblicato in una buona rivista. La pubblicazione è in collaborazione con tre co-autori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 3.7

3. "The Quantitative Easing Bursts Bitcoin Price" Patacca, Marco, Focardi, Sergio (2021) ACCOUNTING AND FINANCE RESEARCH.

La pubblicazione presenta una buona congruenza con il settore disciplinare. Il livello di originalità e rigore è discreto così come la rilevanza della rivista. La pubblicazione è in collaborazione con un co-autore, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 2.7

4. "Market attention and Bitcoin price modeling: theory, estimation and option pricing." Cretarola, Alessandra, Figà-Talamanca, Gianna, Patacca, Marco (2020) DECISIONS IN ECONOMICS AND FINANCE.

La pubblicazione presenta una congruenza più che buona. Il livello di originalità e rigore è buono così come la rilevanza della rivista. La pubblicazione è in collaborazione con tre co-autori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 4.3

5. "Disentangling the relationship between Bitcoin and market attention measures." Figà-Talamanca, Gianna, Patacca, Marco (2020) ECONOMIA E POLITICA INDUSTRIALE.

La pubblicazione presenta una buona congruenza. Il livello di originalità e rigore è discreto così come la rilevanza della rivista. La pubblicazione è in collaborazione con un co-autore, l'apporto individuale è da considerarsi paritario. Punti 1.9

6. "Does Market Attention Affect Bitcoin Returns and Volatility?" Figà-Talamanca, Gianna, Patacca, Marco (2019) DECISIONS IN ECONOMICS AND FINANCE.

La pubblicazione presenta una buona congruenza. Il livello di originalità e rigore è discreto, la collocazione editoriale è buono. La pubblicazione è in collaborazione con due co-autori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 3.8

7. "Is Arbitrage Possible in the Bitcoin Market? (Work-In-Progress Paper)." Bistarelli, Stefano, Cretarola, Alessandra, Figà-Talamanca, Gianna, Mercanti, Ivan, Patacca, Marco (2019) LECTURE NOTES IN ARTIFICIAL INTELLIGENCE.

La pubblicazione presenta una buona congruenza. Il livello di originalità e rigore è discreto. La pubblicazione è in collaborazione con tre co-autori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 1.2

8. "A Continuous Time Model for Bitcoin Price Dynamics." Cretarola, Alessandra, Figà-Talamanca, Gianna, Patacca, Marco (2018) Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance. MAF.

La pubblicazione presenta una congruenza più che buona. Il livello di originalità e rigore è discreto. La pubblicazione è in collaborazione con tre co-autori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 2.3

9. Essays on Bitcoin price dynamics. PhD thesis

La tesi di dottorato ha una congruenza molto buona. Mostra un discreto livello di originalità e di rigore. Punti 3

CONSISTENZA COMPLESSIVA DELLA PRODUZIONE SCIENTIFICA:

Valutazione sulla produzione complessiva

Il candidato presenta 11 prodotti compresa la tesi di dottorato di cui 9 valutabili; la consistenza della produzione scientifica è discreta. La congruenza con il settore scientifico disciplinare è

buona, il livello di originalità e di rigore è discreto e in buono in alcune. La rilevanza delle riviste è varia con tre buone riviste. Il contributo individuale è buono, considerando che i prodotti presentati sono tutti in collaborazione.

Totale punti (valutazione pubblicazioni) 25.9

CANDIDATO: Pratico Flavio

GIUDIZIO COLLEGALE

TITOLI

Valutazione sui titoli

1. Il percorso dottorale dichiarato ha una buona pertinenza con il settore scientifico disciplinare d'interesse, la tesi di dottorato è pertinente. Punti 6.5
2. L'attività d'insegnamento è discreta non risultano esperienze in ambito dottorale Punti 2
3. La posizione di ricerca postdottorale è pertinente con il settore scientifico disciplinare d'interesse, anche all'estero. Punti 1
4. La partecipazione a progetti di ricerca è presente, come l'attività editoriale. Punti 1
5. L'attività in qualità di relatore è buona. Punti 0.5
6. Ha ricevuto due premi. Punti 1

Totale punti (valutazione titoli) 12

PUBBLICAZIONI PRESENTATE:

1. "First and second order semi-Markov chains for wind speed modeling" G. D'Amico, F. Petroni, F. Pratico (2013) Physica A.
La congruenza è buona. Il livello di originalità e rigore è discreto così come la rilevanza della rivista. La pubblicazione è in collaborazione con tre co-autori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 3.7
2. "Wind speed modeled as an indexed semi-Markov process" G. D'Amico, F. Petroni, F. Pratico (2013) Environmetrics.
Discreta la congruenza, come il livello di originalità e rigore e la rilevanza della rivista. La pubblicazione è in collaborazione con tre co-autori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 2.2
3. "Performance Analysis of Second Order Semi-Markov Chains: An Application to Wind Energy Production" G. D'Amico, F. Petroni, F. Pratico (2014) Methodology and Computing in Applied Probability.
La congruenza è buona. Il livello di originalità e rigore è discreto così come la rilevanza della rivista. La pubblicazione è in collaborazione con tre co-autori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 2.2
4. "Wind speed and energy forecasting at different time scales: A nonparametric approach" G. D'Amico, F. Petroni, F. Pratico (2014) Physica A.
La congruenza è buona. Il livello di originalità e rigore è discreto così come la rilevanza della rivista. La pubblicazione è in collaborazione con tre co-autori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 3.9
5. "Economic performance indicators of wind energy based on wind speed stochastic modeling" G. D'Amico, F. Petroni, F. Pratico (2015) Applied Energy.
La congruenza è buona. Il livello di originalità e rigore è discreto così come la rilevanza della rivista. La pubblicazione è in collaborazione con tre co-autori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 2.7

6. "Reliability measures for indexed semi- Markov chains applied to wind energy production" G. D'Amico, F. Petroni, F. Prattico (2015) Reliability Engineering & System Safety.
La congruenza è buona. Il livello di originalità e rigore è buono così come la rilevanza della rivista. La pubblicazione è in collaborazione con tre co-autori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 3.9
7. "On the limit distribution of a second-order semi-Markov chain in state and duration" G. D'Amico, F. Petroni, F. Prattico (2017) Communications in Statistics-Theory and Methods.
La congruenza è buona. Il livello di originalità e rigore è buono così come la rilevanza della rivista. La pubblicazione è in collaborazione con tre co-autori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 2.1
8. "Insuring wind energy production G. D'Amico, F. Petroni, F. Prattico (2017) Physica A: Statistical Mechanics and its Applications.
La congruenza è buona. Il livello di originalità e rigore è buono così come la rilevanza della rivista. La pubblicazione è in collaborazione con tre co-autori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 3.9
9. "Stock market daily volatility and information measures of predictability" G. D'Amico, F. Gismondi, F. Petroni, F. Prattico (2019) Physica A: Statistical Mechanics and its Applications.
La congruenza è buona. Il livello di originalità e rigore è discreto così come la rilevanza della rivista. La pubblicazione è in collaborazione con tre co-autori, da considerarsi avente pari apporto individuale. Punti 3.6

CONSISTENZA COMPLESSIVA DELLA PRODUZIONE SCIENTIFICA:

Il candidato presenta 12 prodotti di cui 9 valutabili; la consistenza della produzione scientifica è buona. La congruenza con il settore scientifico disciplinare è buona, il livello di originalità e di rigore è discreto e buono in vari articoli. La rilevanza delle riviste è varia con quattro riviste di rilievo. Il contributo individuale è buono, considerando che i prodotti presentati sono tutti in collaborazione.

Totale punti (valutazione pubblicazioni) 28.2

La Commissione termina i propri lavori alle ore 16:00

Letto, approvato e sottoscritto.

Firma del Commissari

.....

