

PROCEDURA SELETTIVA PER IL RECLUTAMENTO DI N. 1 RICERCATORE A TEMPO DETERMINATO DI TIPOLOGIA A PER IL SETTORE CONCORSALE 13/D4 - SETTORE SCIENTIFICO-DISCIPLINARE SECS-S/06. - PRESSO IL DIPARTIMENTO DI SCIENZE STATISTICHE - DELL'UNIVERSITA' DI ROMA SAPIENZA - BANDITA CON BANDO N. 03/2019 DEL 27.08.2019

VERBALE N. 2 - SEDUTA VALUTAZIONE TITOLI

L'anno 2019, il giorno 5 del mese di dicembre in Roma si è riunita nei locali del Dipartimento di Scienze Statistiche, stanza n.7 v.le Regina Elena 295, 00161 Roma, la Commissione giudicatrice della procedura selettiva per il reclutamento di n. 1 Ricercatore a tempo determinato di tipologia A per il Settore concorsuale 13/D4 – Settore scientifico-disciplinare SECS-S/06 - professore associato presso il Dipartimento di Scienze Statistiche dell'Università degli Studi di Roma “La Sapienza”, nominata con D.D. n. 41 del 07.10.2019 e composta da:

- Prof.ssa Elisabetta Allevi – professore ordinario presso il Dipartimento di Economia e management dell'Università degli Studi di Brescia;
- Prof. Carlo Mari – professore ordinario presso il Dipartimento di Economia dell'Università degli Studi di Chieti e Pescara;
- Prof.ssa Giulia Rotundo – professore associato presso il Dipartimento di Scienze Statistiche dell'Università degli Studi di Roma “La Sapienza”.

I Proff. Elisabetta Allevi e Carlo Mari si collegano via Skype dalle sedi di appartenenza.

La Commissione inizia i propri lavori alle ore 9.00.

Il Presidente informa la Commissione di aver acquisito dal responsabile del procedimento l'elenco dei candidati alla procedura selettiva e la documentazione, in formato elettronico, trasmessa dagli stessi.

La Commissione giudicatrice dichiara sotto la propria responsabilità che tra i componenti della Commissione ed i candidati non sussistono rapporti di coniugio, di parentela o di affinità, fino al quarto grado compreso, né altre situazioni di incompatibilità ai sensi degli artt. 51 e 52 del Codice di Procedura Civile e dell'art. 18, primo comma, lett. b) e c), della legge 30 dicembre 2010, n. 240.

I candidati alla procedura selettiva risultano essere i seguenti:

1. Giacomo Morelli

La Commissione procede quindi alla valutazione preliminare del candidato con motivato giudizio sui titoli, sul curriculum e sulla produzione scientifica, secondo i criteri definiti dal D.M. n. 243/2011 e fissati in dettaglio nell'allegato 1 del verbale della seduta del 20.11.2019.

L'elenco dei titoli e delle pubblicazioni, nonché la valutazione preliminare del candidato vengono riportati in dettaglio nell'allegato 2, che costituisce parte integrante del presente verbale.

Sulla base della valutazione dei titoli, del curriculum e della produzione scientifica del candidato, è ammesso a sostenere il colloquio pubblico il Dott. Giacomo Morelli.

La Commissione prende atto che il candidato ha rinunciato al preavviso di 20 giorni previsti per il colloquio.

Il colloquio si terrà il giorno 18 dicembre 2019, alle ore 11.00 presso il locali del Dipartimento di Scienze Statistiche e, più precisamente, stanza n.7 v.le Regina Elena 295, 00161 Roma.

La Commissione termina i propri lavori alle ore 10.30.

Letto, confermato e sottoscritto.

Firma dei Commissari

F.to Prof. Carlo Mari (Presidente, via Skype)

F.to Prof.ssa Elisabetta Allevi (Componente, via Skype)

F.to Prof.ssa Giulia Rotundo (Segretario)

ALLEGATO N. 2 AL VERBALE N. 2

PROCEDURA SELETTIVA PER IL RECLUTAMENTO DI N. 1 RICERCATORE A TEMPO DETERMINATO DI TIPOLOGIA A PER IL SETTORE CONCORSUALE 13/D4 - SETTORE SCIENTIFICO-DISCIPLINARE SECS-S/06. - PRESSO IL DIPARTIMENTO DI SCIENZE STATISTICHE - DELL'UNIVERSITA' DI ROMA SAPIENZA - BANDITA CON BANDO N. 03/2019 DEL 27.08.2019

L'anno 2019, il giorno 5 del mese di dicembre in Roma si è riunita nei locali del Dipartimento di Scienze Statistiche, stanza n.7, v.le Regina Elena 295, 00161 Roma, la Commissione giudicatrice della procedura selettiva per il reclutamento di n. 1 Ricercatore a tempo determinato di tipologia A per il Settore concorsuale 13/D4 – Settore scientifico-disciplinare SECS-S/06 - presso il Dipartimento di Scienze Statistiche dell'Università degli Studi di Roma "La Sapienza", nominata con D.D. n. 41 del 07.10.2019 e composta da:

- Prof.ssa Elisabetta Allevi – professore ordinario presso il Dipartimento di Economia e management dell'Università degli Studi di Brescia;
- Prof. Carlo Mari – professore ordinario presso il Dipartimento di Economia dell'Università degli Studi di Chieti e Pescara;
- Prof.ssa Giulia Rotundo – professore associato presso il Dipartimento di Scienze Statistiche dell'Università degli Studi di Roma "La Sapienza".

I Proff. Elisabetta Allevi e Carlo Mari si collegano via Skype dalle sedi di appartenenza.

La Commissione inizia i propri lavori alle ore 9.00.

La Commissione, accertato che i criteri generali fissati nella precedente riunione sono stati resi pubblici per più di sette giorni, inizia la verifica dei nomi dei candidati, tenendo conto dell'elenco fornito dal Responsabile del procedimento.

La Commissione, presa visione dell'elenco dei candidati alla procedura selettiva, delle esclusioni e delle rinunce sino ad ora pervenute, prende atto che il candidato da valutare ai fini della procedura selettiva è:

1. Giacomo Morelli

La Commissione, quindi, procede ad esaminare la domanda di partecipazione alla procedura selettiva presentata dal candidato con i titoli allegati e le pubblicazioni.

La Commissione verifica che i titoli allegati alla domanda siano stati certificati conformemente al bando.

Procede poi ad elencare analiticamente i Titoli.

Procede poi ad elencare analiticamente le Pubblicazioni trasmesse dal candidato.

La Commissione elenca i titoli e le pubblicazioni valutabili (allegato 2/A).

1) Vengono esaminati i titoli e le pubblicazioni del candidato Giacomo Morelli

La Commissione inizia la valutazione dei titoli, delle pubblicazioni e della tesi di dottorato del candidato.

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

Candidato: Giacomo Morelli

La Commissione procede all'esame dei titoli e delle pubblicazioni ai fini della formulazione del giudizio collegiale.

La Commissione, dopo aver effettuato una discussione collegiale sul profilo e sulla produzione scientifica del candidato Giacomo Morelli, formula il giudizio collegiale.

Il giudizio collegiale formulato dalla Commissione è allegato al presente verbale quale sua parte integrante (all. 2/B).

La Commissione, sulla base del giudizio formulato, ammette il candidato Giacomo Morelli alla fase successiva della procedura.

Il Presidente invita il Responsabile del procedimento a comunicare al suddetto candidato la data di convocazione per lo svolgimento del colloquio in forma seminariale previsto dal bando.

La Commissione viene sciolta alle ore 10.30 e si riconvoca per il giorno 18 dicembre 2019 alle ore 11.00.

Letto approvato e sottoscritto seduta stante.

La Commissione

Firma dei Commissari

F.to Prof. Carlo Mari (Presidente, via Skype)

F.to Prof. ssa Elisabetta Allevi (Componente, via Skype)

F.to Prof.ssa Giulia Rotundo (Segretario)

ALLEGATO N. 2/A

TITOLI E PUBBLICAZIONI VALUTABILI

PROCEDURA SELETTIVA PER IL RECLUTAMENTO DI N. 1 RICERCATORE A TEMPO DETERMINATO DI TIPOLOGIA A PER IL SETTORE CONCORSUALE 13/D4 - SETTORE SCIENTIFICO-DISCIPLINARE SECS-S/06. - PRESSO IL DIPARTIMENTO DI SCIENZE STATISTICHE - DELL'UNIVERSITA' DI ROMA SAPIENZA - BANDITA CON BANDO N. 03/2019 DEL 27.08.2019

L'anno 2019, il giorno 5 del mese di dicembre in Roma si è riunita nei locali del Dipartimento di Scienze Statistiche, stanza n.7, v.le Regina Elena 295, 00161 Roma, la Commissione giudicatrice della procedura selettiva per il reclutamento di n. 1 Ricercatore a tempo determinato di tipologia A per il Settore concorsuale 13/D4 – Settore scientifico-disciplinare SECS-S/06 - presso il Dipartimento di Scienze Statistiche dell'Università degli Studi di Roma "La Sapienza", nominata con D.D. n. 41 del 07.10.2019 e composta da:

- Prof.ssa Elisabetta Allevi – professore ordinario presso il Dipartimento di Economia e management dell'Università degli Studi di Brescia;
- Prof. Carlo Mari – professore ordinario presso il Dipartimento di Economia dell'Università degli Studi di Chieti e Pescara;
- Prof.ssa Giulia Rotundo – professore associato presso il Dipartimento di Scienze Statistiche dell'Università degli Studi di Roma "La Sapienza".
-

I Proff. Elisabetta Allevi e Carlo Mari si collegano via Skype dalle sedi di appartenenza.

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: Giacomo Morelli

Il candidato Giacomo Morelli presenta per la valutazione 8 pubblicazioni scientifiche (compresa la tesi di dottorato). Le pubblicazioni, allegate alla domanda, sono elencate di seguito:

1. Morelli, G. (2019). Characterizing volatility tail risk under fractionality. *Journal of Banking and Finance*, doi.org/10.1016/j.bankfin.2019.105654, Elsevier (joint with Paolo Santucci de Magistris).
2. Morelli, G. (2019). Liquidity drops. *Annals of Operations Research*, doi.org/10.1007/s10479-019-03285-0, Springer.
3. Morelli, G. (2019). Fair prices under a unified lattice approach for interest rates derivatives. *Annals of Operations Research*, doi.org/10.1007/s10479-019-03209-y, Springer.
4. Morelli, G. (2019). The application of fair division systems in cases involving the judicial division of assets. *Jusletter IT - The Journal for IT and Law*, (joint with F. Corona and M. Dall'Aglio).
5. Morelli, G. (2019). Dynamic asymmetric dependence in financial markets. Working Paper n.161/2019 Dipartimento MEMOTEF, Università di Roma "La Sapienza" (joint with L. Petrella).

6. Morelli, G. (2019). On skewness in interest rates. Working Paper n.162/2019 Dipartimento MEMOTEF, Università di Roma "La Sapienza" (joint with L. Petrella).
7. Morelli, G. (2017). Essays on asymmetric risks in finance and insurance. PhD thesis, Dipartimento Scienze Statistiche, Università di Roma "La Sapienza".
8. Morelli, G. (2018). Conflict resolutions with equitative algorithms I - Report on adaptation of existing results. European Commission Reports, March, 2018. (joint with Marco Dall'Aglio).

Inoltre, il Candidato, presenta i seguenti titoli (di cui alcuni autocertificati):

1. Vincitore assegno di ricerca nel settore scientifico SEC-S/06 con progetto di ricerca "Prezzi della capacità e dell'energia" presso l'Università Luiss "Guido Carli" (2019).
2. Vincitore assegno di ricerca nel settore SECS-S/06 con progetto di ricerca finanziato dalla Commissione Europea in materia di "Risoluzione di conflitti con algoritmi equi" presso l'Università Luiss "Guido Carli" (2018).
3. Dottore di Ricerca in Statistica Metodologica. Università di Roma "La Sapienza" (2017).
4. Varia attività didattica presso l'Università Luiss "Guido Carli".
5. Master in Economics and Finance. Graduate School of Economics, Barcellona (2014).
6. Laurea Magistrale in Finanza e Assicurazioni. Università di Roma "La Sapienza" (2013).
7. Laurea Triennale in Banche, Assicurazioni e Mercati Finanziari. Università di Roma "La Sapienza" (2009).
8. Vincitore di una borsa di studio per meriti presso la Graduate School of Economics di Barcellona.
9. Vincitore di alcune borse di studio per meriti Laziodisu durante la Laurea Triennale e Magistrale.

VERIFICA TITOLI VALUTABILI:

Presenta n. 5 titoli valutabili (i titoli 1-2-3-4-5).

VERIFICA PUBBLICAZIONI VALUTABILI:

Presenta n. 8 pubblicazioni valutabili (di cui una è la tesi di dottorato).

TESI DI DOTTORATO:

"Essays on asymmetric risks in finance and insurance"

La Commissione termina i propri lavori alle ore 10.30.

Letto, approvato e sottoscritto.

La Commissione

F.to Prof. Carlo Mari (Presidente, via Skype)

F.to Prof.ssa Elisabetta Allevi (Componente, via Skype)

F.to Prof.ssa Giulia Rotundo (Segretario)

ALLEGATO N. 2/B

GIUDIZIO COLLEGIALE

PROCEDURA SELETTIVA PER IL RECLUTAMENTO DI N. 1 RICERCATORE A TEMPO DETERMINATO DI TIPOLOGIA A PER IL SETTORE CONCORSUALE 13/D4 - SETTORE SCIENTIFICO-DISCIPLINARE SECS-S/06. - PRESSO IL DIPARTIMENTO DI SCIENZE STATISTICHE - DELL'UNIVERSITA' DI ROMA SAPIENZA - BANDITA CON BANDO N. 03/2019 DEL 27.08.2019

L'anno 2019, il giorno 5 del mese di dicembre in Roma si è riunita nei locali del Dipartimento di Scienze Statistiche, stanza n.7, v.le Regina Elena 295, 00161 Roma, la Commissione giudicatrice della procedura selettiva per il reclutamento di n. 1 Ricercatore a tempo determinato di tipologia A per il Settore concorsuale 13/D4 – Settore scientifico-disciplinare SECS-S/06 – presso il Dipartimento di Scienze Statistiche dell'Università degli Studi di Roma "La Sapienza", nominata con D.D. n. 41 del 07.10.2019 e composta da:

- Prof.ssa Elisabetta Allevi – professore ordinario presso il Dipartimento di Economia e management dell'Università degli Studi di Brescia;
- Prof. Carlo Mari – professore ordinario presso il Dipartimento di Economia dell'Università degli Studi di Chieti e Pescara;
- Prof.ssa Giulia Rotundo – professore associato presso il Dipartimento di Scienze Statistiche dell'Università degli Studi di Roma "La Sapienza".

I Proff. Elisabetta Allevi e Carlo Mari si collegano via Skype dalle sedi di appartenenza.

La Commissione inizia i propri lavori alle ore 9.00 e procede ad elaborare la valutazione collegiale dei titoli e delle pubblicazioni del candidato.

CANDIDATO: Giacomo Morelli

GIUDIZIO COLLEGIALE

Il candidato presenta un buon curriculum sia sotto il profilo dei titoli sia per la consistenza e i contenuti delle pubblicazioni. Buona è la congruenza del curriculum con il settore scientifico disciplinare SECS-S/06, oggetto della valutazione.

TITOLI

Il Candidato possiede una buona qualificazione sia sotto il profilo scientifico sia sotto il profilo didattico. Intensa e continua è l'attività didattica svolta presso l'Università Luiss "Guido Carli".

PUBBLICAZIONI PRESENTATE:

Per ciò che attiene alla valutazione delle pubblicazioni, il candidato ha presentato 8 pubblicazioni scientifiche (tra le quali è compresa la tesi di dottorato), di cui quattro articoli su riviste internazionali ([1], [2], [3], [4]), due working paper dipartimentali ([5], [6]), la tesi di dottorato [7] ed un contributo ad un report della Commissione Europea [8]. Due dei quattro articoli su riviste internazionali sono a firma singola ([2], [3]), gli altri, ad eccezione della tesi di dottorato, sono a più autori. Il contributo del candidato nelle pubblicazioni con coautori è, tuttavia, desumibile dal curriculum. Le pubblicazioni sono coerenti con le tematiche tipiche del settore concorsuale e con quelle interdisciplinari ad esso pertinenti. Hanno ad oggetto lo studio di alcuni processi stocastici caratterizzati da distribuzioni di probabilità asimmetriche di interesse per la finanza, i modelli per il

rischio di tasso di interesse e la valutazione dei titoli interest rate sensitive. La tesi di dottorato è ben organizzata e strutturata, con contenuti di interesse per il settore SECS-S/06 sui rischi asimmetrici in campo finanziario e assicurativo. Complessivamente, la qualità delle pubblicazioni è buona, sia per quanto riguarda l'originalità dei contenuti sia per le metodologie sviluppate. Molto buona è la collocazione editoriale di alcuni lavori ([1], [2], [3]), in riviste di fascia A secondo la classificazione ANVUR.

CONSISTENZA COMPLESSIVA DELLA PRODUZIONE SCIENTIFICA:

La produzione scientifica è intensa e non presenta discontinuità temporali. Nel complesso, il contributo scientifico fornito, in termini di innovatività ed originalità, nell'ambito delle tematiche tipiche del settore scientifico SECS-S/06, è da ritenersi buono. Alla luce di quanto esposto, si ritiene che il candidato possieda i requisiti richiesti per le funzioni di Ricercatore di tipo A nel settore SECS-S/06.

La Commissione termina i propri lavori alle ore 10.30.

Letto, approvato e sottoscritto.

Firma del Commissari

F.to Prof. Carlo Mari (Presidente, via Skype)

F.to Prof.ssa Elisabetta Allevi (Componente, via Skype)

F.to Prof.ssa Giulia Rotundo (Segretario)