

**PROCEDURA SELETTIVA DI CHIAMATA PER IL RECLUTAMENTO DI N.1 RICERCATORE A TEMPO DETERMINATO IN TENURE TRACK (RTT) PER IL SETTORE CONCORSUALE/GRUPPO SCIENTIFICO-DISCIPLINARE 13/D4 SETTORE SCIENTIFICO-DISCIPLINARE SECS-S/06 PRESSO IL DIPARTIMENTO DI METODI E MODELLI PER L'ECONOMIA, IL TERRITORIO E LA FINANZA INDETTA CON D.R. N.7/2024 DEL 5.1.2024 (AVVISO DI INDIZIONE PUBBLICATO SU G.U. – IV SERIE SPECIALE N. 5 DEL 16-01-2024)**

**Codice concorso 2023RTTE022**

**VERBALE QUARTA SEDUTA**

L'anno 2024, il giorno 19 del mese di luglio si è riunita presso il Dipartimento di Metodi e Modelli per l'Economia, il Territorio e la Finanza (MEMOTEF) la Commissione giudicatrice della procedura selettiva di chiamata, indetta con D.R. n.7 del 05-01-2024, per n.1 posto di Ricercatore a tempo determinato in tenure track (RTT) per il Settore concorsuale/Gruppo scientifico-disciplinare 13/D4 – Settore scientifico-disciplinare SECS-S/06 - presso il Dipartimento di Metodi e Modelli per l'Economia, il Territorio e la Finanza dell'Università degli Studi di Roma "La Sapienza", nominata con D.R. n.888 del 12-04-2024 e D.R. n. 1412/2024 del 19.06.2024 e composta da:

- Prof. Marcellino GAUDENZI – Ordinario presso l'Università degli Studi di Udine;
- Prof.ssa Claudia CECI – Ordinario presso l'Università degli Studi di Roma "La Sapienza";
- Prof. Pierpaolo UBERTI - Associato presso l'Università degli Studi di Milano Bicocca

La Commissione inizia i propri lavori alle ore 9.30.

I candidati ammessi al colloquio, riportati in ordine alfabetico, sono:

1. DE BLASIS Riccardo
2. FREZZA Massimiliano
3. KHORRAMI CHOKAMI Amir
4. MASTRANDREA Rossana
5. SALUZZI Luca
6. VIDOTTO Anna.

Verificata la regolarità della convocazione per il colloquio, la Commissione procede all'appello nominale dei candidati. Risultano presenti i seguenti candidati:

1. DE BLASIS Riccardo
2. FREZZA Massimiliano
3. MASTRANDREA Rossana
4. SALUZZI Luca
5. VIDOTTO Anna.

Risultano assenti i seguenti candidati:

1. KHORRAMI CHOKAMI Amir.

La Commissione procede all'identificazione dei candidati, mediante esibizione di un documento d'identità in corso di validità, i cui estremi vengono riportati nel foglio presenze, allegato 1 del presente verbale. Dopo aver illustrato le modalità di svolgimento del colloquio in forma seminariale e dell'accertamento delle competenze linguistiche scientifiche, alle ore 10:10 la Commissione dà inizio alla discussione pubblica dei titoli e della produzione scientifica e all'accertamento dell'adeguata conoscenza di una lingua straniera ed, eventualmente, dell'adeguata conoscenza della lingua italiana da parte dei candidati stranieri chiamando in ordine alfabetico i candidati.

La Commissione chiama quindi il candidato **DE BLASIS Riccardo**.

Il candidato illustra pubblicamente alla Commissione il suo percorso formativo e di ricerca. In particolare vengono approfonditi i seguenti argomenti:

- Modelli markoviani e semi-markoviani univariati e multivariati
- Modelli multivariati per la volatilità
- Discussione delle pubblicazioni sulle applicazioni finanziarie (*stock valuation*) ed economiche (*market microstructures* e misure dinamiche di povertà)
- Discussione di alcuni articoli sulle applicazioni ai mercati energetici
- Modelli markoviani per la valutazione di opzioni reali.

La Commissione chiama quindi il candidato **FREZZA Massimiliano**.

Il candidato illustra pubblicamente alla Commissione il suo percorso formativo e di ricerca. In particolare vengono approfonditi i seguenti argomenti:

- Moto browniano frazionario ed estensione al caso multifrazionario con esponente aleatorio
- Applicazioni del calcolo frazionario in ambito finanziario: regolarità del processo dei prezzi delle azioni ed efficienza
- Il problema della liquidità dei mercati: i parametri di autosimilarità
- Discussione dei risultati relativi alla *rough volatility* (tramite la trasformata di Lamperti)
- Discussione sulla correlazione tra volatilità e volumi.

La Commissione chiama quindi la candidata **MASTRANDREA Rossana**.

La candidata illustra pubblicamente alla Commissione il suo percorso formativo e di ricerca. In particolare vengono approfonditi i seguenti argomenti:

- Teoria dei grafi e delle reti in ambito economico
- *Evolutionary game theory*
- Applicazioni in economia ambientale e sanitaria comprendendo anche lo specifico campo dei vaccini COVID.

La Commissione chiama quindi il candidato **SALUZZI Luca**.

Il candidato illustra pubblicamente alla Commissione il suo percorso formativo e di ricerca. In particolare vengono approfonditi i seguenti argomenti:

- Problemi di controllo ottimo deterministici in alta dimensione
- Metodi numerici basati su algoritmi con struttura ad albero e programmazione dinamica per la determinazione della funzione valore
- Risultati nell'ambito della decomposizione tensoriale ai fini della riduzione dei costi computazionali dovuti alla alta dimensione del problema.

La Commissione chiama quindi la candidata **VIDOTTO Anna**.

La candidata illustra pubblicamente alla Commissione il suo percorso formativo e di ricerca. In particolare vengono approfonditi i seguenti argomenti:

- Approssimazione gaussiana
- Statistica per processi geometrici
- Serie storiche funzionali sulla sfera: applicazioni alle temperature della terra
- Modelli autoregressivi sulla sfera e risultati asintotici.

Al termine della discussione pubblica dei titoli e delle pubblicazioni di ciascun candidato, la Commissione procede ad accertare l'adeguata conoscenza della lingua inglese:

Dott. **DE BLASIS Riccardo**, lettura e traduzione di un brano tratto dal libro *Arbitrage Theory in Continuous Time*, Tomas Bjork, Oxford University Press.

Dott. **FREZZA Massimiliano**, lettura e traduzione di un brano del libro *Arbitrage Theory in Continuous Time*, Tomas Bjork, Oxford University Press.

Dott.ssa **MASTRANDREA Rossana**, lettura e traduzione di un brano del libro *Arbitrage Theory in Continuous Time*, Tomas Bjork, Oxford University Press.

Dott. **SALUZZI Luca**, lettura e traduzione di un brano del libro *Arbitrage Theory in Continuous Time*, Tomas Bjork, Oxford University Press.

Dott.ssa **VIDOTTO Anna**, lettura e traduzione di un brano del libro *Arbitrage Theory in Continuous Time*, Tomas Bjork, Oxford University Press.

Terminata alle ore 12.40 la discussione pubblica dei titoli e delle pubblicazioni e l'accertamento delle competenze linguistiche, la Commissione sospende la seduta pubblica e, sulla base dei criteri selettivi definiti nella seduta preliminare, procede ad effettuare la valutazione collegiale del seminario e la valutazione della prova diretta ad accertare l'adeguata conoscenza della lingua inglese, che vengono riportate nell'allegato 2 del presente verbale e ad attribuire un punteggio ai titoli e a ciascuna delle pubblicazioni selezionate dal candidato [per i candidati stranieri l'adeguata conoscenza della lingua italiana] che viene riportato nell'allegato 3 del presente verbale.

La Commissione termina i propri lavori alle ore 13:30 e si riconvoca, il medesimo giorno 19.07.2024 alle ore 14:30 per formulare il giudizio collegiale comparativo complessivo dei candidati che hanno sostenuto il colloquio in forma seminariale e la prova diretta ad accertare le competenze linguistico scientifiche, in relazione al *curriculum*, al punteggio attribuito ai titoli e alle pubblicazioni e ad eventuali altri requisiti stabiliti dal bando, formulare la graduatoria di merito, individuare il/i vincitore/i della procedura selettiva, in numero pari a quello dei posti messi a concorso e redigere la relazione finale.

Letto, confermato e sottoscritto

Prof. Marcellino GAUDENZI

Prof.ssa Claudia CECI

Prof. Pierpaolo UBERTI