

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 SCIENZE STATISTICHE DELL'UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI ROMA "LA SAPIENZA" BANDITA CON D.R. N. 2267/2021 DEL 09.08.2021

VERBALE N. 2 – SEDUTA VERIFICA TITOLI

L'anno 2021, il giorno 16 del mese di dicembre si è riunita in modalità telematica (via Meet) 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 Scienze statistiche dell'Università degli Studi di Roma "La Sapienza", nominata con D.R. n. 2987/2021 del 16.11.2021 e composta da:

- Prof. Paolo Falbo – professore associato presso il Dipartimento di Metodi quantitativi dell'Università degli Studi di Brescia (componente);
- Prof.ssa Rosella Giacometti – professore ordinario presso il Dipartimento di Economia dell'Università degli Studi di Bergamo (segretario);
- Prof.ssa Giulia Rotundo – professore ordinario presso il Dipartimento di Scienze Statistiche dell'Università degli Studi di Roma "La Sapienza" (presidente).

La Commissione inizia i propri lavori alle ore 09:00.

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

I candidati alla procedura selettiva risultano essere i seguenti:

1. Riccardo De Blasis
2. Giacomo Morelli

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.

La Commissione, quindi, procede ad esaminare le domande di partecipazione alla procedura presentate da parte dei candidati, con i titoli allegati e le pubblicazioni.

Per ogni candidato, la Commissione verifica che i titoli allegati alla domanda siano stati certificati conformemente al bando.

Procede poi ad elencare analiticamente i titoli e le pubblicazioni trasmesse dal candidato.

Successivamente elenca, per ogni candidato, i titoli e le pubblicazioni valutabili (allegato B).

- 1) Vengono esaminati i titoli e le pubblicazioni del candidato Riccardo De Blasis
- 2) Vengono esaminati i titoli e le pubblicazioni del candidato Giacomo Morelli

La Commissione termina i propri lavori alle ore 12:00 e si riconvoca per la verifica dei titoli e delle pubblicazioni dei candidati, il giorno 12 gennaio 2022 alle ore 9:00.

Letto, confermato e sottoscritto.

Firma del Commissari

Prof. Paolo Falbo

Prof.ssa Rosella Giacometti

Prof.ssa Giulia Rotundo

ALLEGATO B AL VERBALE N. 2

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 SCIENZE STATISTICHE DELL'UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI ROMA "LA SAPIENZA" BANDITA CON D.R. N. 2267/2021 DEL 09.08.2021

TITOLI E PUBBLICAZIONI VALUTABILI

CANDIDATO: RICCARDO DE BLASI

VERIFICA TITOLI

TITOLI VALUTABILI:

- a. dottorato di ricerca o titolo equivalente: titolo di dottorato in Accounting management and finance in cotutela con University of Wollongong: Tesi di Dottorato (2019) Markov Chain Modelling in Finance: Stock Valuation and Price Discovery (punti 1 e 2 elenco titoli)
- b. attività didattica a livello universitario in Italia e/o all'estero
 - o Certificato di insegnamento presso la University of Wollongong (Australia) (punto 4 elenco titoli)
 - o Ulteriore attività didattica in lauree triennali, Magistrali e Dottorato evinta da CV
- c. documentata attività di formazione o di ricerca presso qualificati istituti italiani o stranieri
 - o Titolare di contratti e RTD-A (posizione attuale)
 - o Certificato di ricerca presso il Rozetta Institute Sydney (Australia) (punto 3 elenco titoli)
 - o Attestato della London School of Economics (punto 8 elenco titoli)
 - o Summer school Università di Chieti e Pescara: market microstructure evinto da CV
 - o Attestato lingua inglese PTE (punto 9 elenco titoli)
- d. Organizzazione, direzione e coordinamento di gruppi di ricerca nazionali e internazionali, o partecipazione agli stessi (evinto da CV)
- e. Relatore a congressi e convegni nazionali e internazionali (punto 5 elenco titoli e CV)
- f. Premi e riconoscimenti nazionali e internazionali per attività di ricerca
 - o Borsa di Studio IPTA (punto 7 elenco titoli)

ATTIVITA' NON VALUTABILI

Attività di referaggio (punto 6) in quanto non prevista nei criteri specificati nel primo verbale.

VERIFICA PUBBLICAZIONI

PUBBLICAZIONI VALUTABILI:

1. D'Amico, G. & De Blasi, R. (2021) 'Confidence sets for dynamic poverty indexes', *Journal of Applied Statistics*, DOI: 10.1080/02664763.2021.1967893
2. De Blasi, R., Masala, G.B. & Petroni, F. (2021) 'A Multivariate High-Order Markov Model for the Income Estimation of a Wind Farm', *Energies*, DOI: 10.3390/en14020388
3. De Blasi, R. & Petroni, F. (2021) 'Price Leadership and Volatility Linkages between Oil and Renewable Energy Firms during the COVID-19 Pandemic', *Energies*, DOI: 10.3390/en14092608
4. De Blasi, R. (2020) 'The Price Leadership Share: A new measure of price discovery in financial markets', *Annals of Finance*, DOI: 10.1007/s10436-020-00371-3
5. D'Amico, G. & De Blasi, R. (2020) 'A review of the Dividend Discount Model: from deterministic to stochastic models', in Barbu, V.S. & Vergne, N. (Eds.), 'Statistical Topics and Stochastic Models for Dependant Data with Applications', ISTE, Wiley. arxiv.org/abs/2001.00465. (Accettato il 19/03/2020)
6. D'Amico, G. & De Blasi, R. (2020) 'A multivariate Markov chain stock model', *Scandinavian Actuarial Journal*, 2020(4):272-291, DOI:10.1080/03461238.2019.1661280

7. Barbu, V.S., D'Amico, G. & De Blasis, R. (2017), 'Novel advancements in the Markov chain stock model: analysis and inference', *Annals of Finance*, 13(2):125–152, DOI: 10.1007/s10436-017-02979

TESI DI DOTTORATO:

(2019) Markov Chain Modelling in Finance: Stock Valuation and Price Discovery: VALUTABILE.

CONSISTENZA COMPLESSIVA DELLA PRODUZIONE SCIENTIFICA:

Il candidato presenta una produzione complessiva pari a N. 7 pubblicazioni. In particolare presenta 6 articoli e 1 capitolo di libro (il numero 5). Le pubblicazioni 4, 6 e 7 sono di fascia A.

CANDIDATO: GIACOMO MORELLI

VERIFICA TITOLI

TITOLI VALUTABILI:

- a. dottorato di ricerca o titolo equivalente: Titolo di studio Dottorato di Ricerca in Statistica, Curriculum Statistica Metodologica, con tesi "Asymmetric Risks in Finance and Insurance" conseguito il 25.09.2017 presso il Dipartimento di Scienze Statistiche di Sapienza Università di Roma (quarto punto elenco titoli)
- b. Attività didattica a livello universitario in Italia e/o all'estero; attività didattica in lauree triennali, Magistrali e Dottorato (evinta da CV)
- c. Documentata attività di formazione o di ricerca presso qualificati istituti italiani o stranieri;
 - o Ricercatore a tempo determinato di tipo A (RTD-A) dal 20.03.2020, contratto con scadenza 19.03.2023, presso il Dipartimento di Scienze Statistiche, Sapienza Università di Roma: (primo punto elenco titoli)
 - o Assegnista di Ricerca sul progetto "Prezzi e capacità dell'energia" presso Luiss Guido Carli dal 01.09.2019 a 19.03.2020 (secondo punto elenco titoli)
 - o Assegnista di Ricerca sul progetto "Risoluzione di conflitti con algoritmi equi" finanziato dal Dipartimento di Giustizia dell'Unione Europea tramite CREA Project, presso Luiss Guido Carli dal 01.04.2018 a 31.03.2019 (terzo punto elenco titoli)
 - o Titolo di studio Master Degree in Economics and Finance conseguito il 10.07.2014 presso Universitat Pompeu Fabra e Barcelona Graduate School of Economics: (quinto punto elenco titoli)
- d. Organizzazione, direzione e coordinamento di gruppi di ricerca nazionali e internazionali, o partecipazione agli stessi (evinto da CV)
- e. Relatore a congressi e convegni nazionali e internazionali (evinto da CV)
- f. Premi e riconoscimenti nazionali e internazionali per attività di ricerca
 - o Borsa di studio Barcelona Graduate School of Economics per studente meritevole, anno 2013-2014 (ottavo punto elenco titoli)
 - o Borsa di studio Laziodisu Sapienza Università di Roma per studente meritevole, anno 2007-2008 (nono punto elenco titoli)
 - o Borsa di studio Laziodisu Sapienza Università di Roma per studente meritevole, anno 2006-2007 (decimo punto elenco titoli)

VERIFICA PUBBLICAZIONI

PUBBLICAZIONI VALUTABILI:

1. Maccarrone, G., Morelli, G., and Spadaccini, S. (2021) GDP Forecasting: Machine Learning, Linear or Autoregression? *Artificial Intelligence in Finance*, *Frontiers* accepted for publication
2. Morelli, G., and D'Ecclesia R. L. (2021). Responsible Investments Reduce Market Risks. *Decisions in Economics and Finance* accepted for publication (Fascia A, I.F. 0.74)

3. Andreani, M., Candila, V., Morelli, G., and Petrella, L. (2021). Multivariate Analysis of Energy Commodities during the COVID-19 Pandemic: Evidence form a Mixed-Frequency Approach. *Risks*, 9:144
4. Morelli, G., and Petrella, L. (2021). Option Pricing, Zero Lower Bound, and COVID--19. *Risks*, 9:167
5. Foroni, B, Mazza, S. Morelli, G, and Petrella, L. (2020). GLASSO Estimation of Commodity Risks, *Book of Short Papers, Proceedings of the Italian Statistical Society* p.957-962
6. Corona, F., Dall'Aglio, M., and Morelli, G.(2019). The application of fair division systems in cases involving the judicial division of assets. *Jusletter-IT*, p.1-8
7. Morelli, G.(2019). A unified approach for interest rates derivatives pricing. *Annals of Operations Research*, 299 (Fascia A, I.F. 4.854)
8. Morelli, G.(2019). Liquidity drops. *Annals of Operations Research*, 299:711-719 (Fascia A, I.F. 4.854)
9. Morelli, G., and Santucci de Magistris, P. (2019). Volatility tail risk under fractionality. *Journal of Banking and Finance*, 108: 105654 (Fascia A, I.F. 3.07)
12. Dall'Aglio, M., and Morelli, G. (2018). Conflict Resolutions with Equitative Algorithms (CREA) - Report on Adaptation of Existing Results. *European Commission Reports, Justice Department*

PUBBLICAZIONI NON VALUTABILI

10. Morelli, G., and Petrella, L. (2019). Dynamic asymmetric dependence in financial markets. Working Paper n.161/2019 Dipartimento MEMOTEF, Sapienza Università degli Studi di Roma
11. Morelli, G., and Petrella, L. (2019). On skewness in interest rates. Working Paper n.62/2019 Dipartimento MEMOTEF, Sapienza Università degli Studi di Roma

TESI DI DOTTORATO

(2017) Dottorato di Ricerca in Statistica con tesi "Asymmetric Risks in Finance and Insurance": VALUTABILE.

CONSISTENZA COMPLESSIVA DELLA PRODUZIONE SCIENTIFICA:

Il candidato presenta una produzione complessiva pari a N. 12 pubblicazioni. Le pubblicazioni 10,11 non valutabili come previsto nel verbale 1 in quanto in quanto rapporti dipartimentali. Delle 10 pubblicazioni valutabili 1 è un proceeding (pubblicazione numero 5) e le pubblicazioni 2,7,8,9 sono in fascia A.

Letto, confermato e sottoscritto.

Firma del Commissari
 Prof. Paolo Falbo
 Prof.ssa Rosella Giacometti
 Prof.ssa Giulia Rotundo

PROCEDURA SELETTIVA DI CHIAMATA A N. 1 POSTO DI RICERCATORE A TEMPO DETERMINATO TIPOLOGIA B INDETTA CON D.R N. 2267/2021 DEL 09.08.2021 PER IL SSD 13/D4 – SC SECS-S/06 – PRESSO IL DIPARTIMENTO DI SCIENZE STATISTICHE DELL' UNIVERSITA' DI ROMA LA SAPIENZA.

La Commissione giudicatrice della procedura selettiva indicata in oggetto segnala che, all'atto della valutazione dei lavori scientifici presentati dai candidati, ha verificato che i nessun candidato ha inviato un numero di lavori inferiore al numero minimo di lavori indicato nell'articolo 1 del bando

Roma, 16/12/2021

La Commissione
Prof. Paolo Falbo
Prof.ssa Rosella Giacometti
Prof.ssa Giulia Rotundo