

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. 3 – SEDUTA VALUTAZIONE TITOLI

L'anno 2022, il giorno 12 del mese di gennaio 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.

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. 1, e precisamente:

- Giacomo Morelli.

In data 28/12/2021 con pec prot.n. 109889 e successiva comunicazione alla commissione in data 3/01/2022 è pervenuta la rinuncia a partecipare alla procedura selettiva del candidato:

- Riccardo De Blasis.

La Commissione inizia la valutazione dei titoli e delle pubblicazioni del candidato.

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 individuale da parte di ciascun commissario e di quello collegiale espresso dalla Commissione (all. D). I giudizi dei singoli commissari e quello collegiale 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, è ammesso a sostenere il colloquio il Dottore:

1. Giacomo Morelli

Essendo pervenuta, da parte del candidato, in data odierna, la rinuncia al preavviso dei termini di 20 giorni per la convocazione al colloquio, questo viene fissato il giorno 19/01/2022, alle ore 10:30 in modalità telematica.

La Commissione termina i propri lavori alle ore 12:00 e si riconvoca per la verifica dei titoli e delle pubblicazioni del candidato, il giorno 19/01/2022 alle ore 10:30 via google meet al link <https://meet.google.com/dhe-egeu-upt>.

Letto, confermato e sottoscritto.

Firma del Commissari

Prof. Paolo Falbo

Prof.ssa Rosella Giacometti

Prof.ssa Giulia Rotundo

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

L'anno 2022, il giorno 12 del mese di gennaio 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.

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

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 (evinto 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)

- 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.

La Commissione termina i propri lavori alle ore 12:00

Letto, approvato e sottoscritto.

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

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

L'anno 2022, il giorno 12 del mese di gennaio 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 e procede ad elaborare la valutazione individuale e collegiale dei titoli e delle pubblicazioni del candidato.

CANDIDATO: Giacomo Morelli

COMMISSARIO 1: Prof. Paolo Falbo

TITOLI

Valutazione sui titoli

Il candidato mostra un significativo percorso di formazione in linea con il settore SECS-S/06 e denota inoltre una vivace attività scientifica, avendo partecipato a progetti di ricerca di Ateneo ed è relatore a numerosi convegni e seminari.

PUBBLICAZIONI PRESENTATE

1. Maccarrone, G., Morelli, G., and Spadaccini, S. (2021) GDP Forecasting: Machine Learning, Linear or Autoregression? Artificial Intelligence in Finance, Frontiers accepted for publication	Buona pubblicazione attinente al settore.
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)	Ottima collocazione editoriale su tema pienamente attinente al settore
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	Buona pubblicazione attinente al settore e su temi di rilevante attualità.
4. Morelli, G., and Petrella, L. (2021). Option Pricing, Zero Lower Bound, and COVID--19. Risks, 9:167	Buona pubblicazione attinente al settore e su temi di rilevante attualità.

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	Pubblicazione attinente al settore, ma di limitata rilevanza editoriale.
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	Buona pubblicazione parzialmente attinente al settore.
7. Morelli, G. (2019). A unified approach for interest rates derivatives pricing. Annals of Operations Research, 299 (Fascia A, I.F. 4.854)	Ottima collocazione editoriale su tema pienamente attinente al settore
8. Morelli, G. (2019). Liquidity drops. Annals of Operations Research, 299:711-719 (Fascia A, I.F. 4.854)	Ottima collocazione editoriale su tema pienamente attinente al settore
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)	Ottima collocazione editoriale su tema pienamente attinente al settore
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	Pubblicazione attinente al settore, ma di limitata rilevanza editoriale.

CONSISTENZA COMPLESSIVA DELLA PRODUZIONE SCIENTIFICA

Il candidato mostra una buona produzione scientifica, su tematiche attinenti al settore, con continuità temporale, dimostrando una sensibilità anche su tematiche di attualità.

Valutazione sulla produzione complessiva

Il giudizio complessivo sulla produzione scientifica del candidato è pienamente soddisfacente, sia con riferimento all'attinenza al settore che alla continuità ed all'intensità.

COMMISSARIO 2: Prof.ssa Rosella Giacometti

TITOLI

Valutazione sui titoli

Il candidato ha un percorso formativo orientato su tematiche rilevanti ed attinenti al settore concorsuale. Ha sviluppato una buona esperienza didattica in lingua italiana ed inglese, anche se limitata alle Università italiane.

PUBBLICAZIONI PRESENTATE

1. Maccarrone, G., Morelli, G., and Spadaccini, S. (2021) GDP Forecasting: Machine Learning, Linear or Autoregression? Artificial Intelligence in Finance, Frontiers accepted for publication	Buona pubblicazione attinente al settore.
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)	Ottima collocazione editoriale su tema pienamente attinente al settore
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	Buona pubblicazione attinente al settore e su temi di rilevante attualità.

4. Morelli, G., and Petrella, L. (2021). Option Pricing, Zero Lower Bound, and COVID--19. Risks, 9:167	Buona pubblicazione attinente al settore e su temi di rilevante attualità.
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	Pubblicazione attinente al settore, ma di limitata rilevanza editoriale.
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	Buona pubblicazione parzialmente attinente al settore.
7. Morelli, G. (2019). A unified approach for interest rates derivatives pricing. Annals of Operations Research, 299 (Fascia A, I.F. 4.854)	Ottima collocazione editoriale su tema pienamente attinente al settore
8. Morelli, G. (2019). Liquidity drops. Annals of Operations Research, 299:711-719 (Fascia A, I.F. 4.854)	Ottima collocazione editoriale su tema pienamente attinente al settore
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)	Ottima collocazione editoriale su tema pienamente attinente al settore
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	Pubblicazione attinente al settore, ma di limitata rilevanza editoriale.

CONSISTENZA COMPLESSIVA DELLA PRODUZIONE SCIENTIFICA

Il candidato presenta una consistenza complessiva molto buona rapportata alla anzianità accademica

Valutazione sulla produzione complessiva

Il candidato presenta pubblicazioni congruenti con le tematiche del settore scientifico SECS-S/06. La consistenza e la continuità temporale sono ottime.

COMMISSARIO 3: Prof.ssa Giulia Rotundo

TITOLI

Valutazione sui titoli

Il candidato ha sviluppato significative esperienze di collaborazione e di ricerca scientifica in Italia ed all'Estero. Ha inoltre ottenuto una formazione pienamente in linea con il settore SECS-S/06, consolidata con la formazione post laurea.

PUBBLICAZIONI PRESENTATE

1. Maccarrone, G., Morelli, G., and Spadaccini, S. (2021) GDP Forecasting: Machine Learning, Linear or Autoregression? Artificial Intelligence in Finance, Frontiers accepted for publication	Buona pubblicazione attinente al settore.
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)	Ottima collocazione editoriale su tema pienamente attinente al settore
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	Buona pubblicazione attinente al settore e su temi di rilevante attualità.

4. Morelli, G., and Petrella, L. (2021). Option Pricing, Zero Lower Bound, and COVID--19. Risks, 9:167	Buona pubblicazione attinente al settore e su temi di rilevante attualità.
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	Pubblicazione attinente al settore, ma di limitata rilevanza editoriale.
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	Buona pubblicazione parzialmente attinente al settore.
7. Morelli, G. (2019). A unified approach for interest rates derivatives pricing. Annals of Operations Research, 299 (Fascia A, I.F. 4.854)	Ottima collocazione editoriale su tema pienamente attinente al settore
8. Morelli, G. (2019). Liquidity drops. Annals of Operations Research, 299:711-719 (Fascia A, I.F. 4.854)	Ottima collocazione editoriale su tema pienamente attinente al settore
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)	Ottima collocazione editoriale su tema pienamente attinente al settore
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	Pubblicazione attinente al settore, ma di limitata rilevanza editoriale.

CONSISTENZA COMPLESSIVA DELLA PRODUZIONE SCIENTIFICA

La consistenza complessiva è caratterizzata da continuità temporale su temi pienamente attinenti al settore con collocazione editoriale mediamente molto buona.

Valutazione sulla produzione complessiva

Il candidato mostra una produzione scientifica complessiva molto buona, in alcuni casi ottima, ed un profilo complessivo di notevole maturità scientifica.

GIUDIZIO COLLEGIALE

TITOLI

Valutazione sui titoli

Il candidato ha una posizione attuale come RTdA dal 20/3/2020. Ha conseguito il PhD nel 2017 in statistica "Asymmetric Risks in Finance and Insurance". Il dottorato è pienamente congruente al settore. Ha una Laurea magistrale in Finanza e assicurazioni. Il candidato presenta una solida formazione post lauream pienamente congruente al settore (Master Degree in Economics and Finance conseguito il 10.07.2014 presso Universitat Pompeu Fabra e Barcelona Graduate School of Economics).

E' stato titolare di due Assegni di Ricerca "Prezzi e capacità dell'energia" presso l'Università Luiss Guido Carli per più di due anni ed è risultato vincitore di tre Borse di studio.

Ha un discreta esperienza di didattica come titolare di corso in Italia in lingua inglese, in particolare in Financial risk management (9 CFU 2020 e 2021) e Mathematics for Investments (Dottorato, 2020) ed in lingua italiana Financial and Actuarial Mathematics (6 CFU).

Partecipa a progetti di ricerca di Ateneo ed è relatore a numerosi convegni e seminari.

PUBBLICAZIONI PRESENTATE

1. Maccarrone, G., Morelli, G., and Spadaccini, S. (2021) GDP Forecasting: Machine Learning, Linear or	Buona pubblicazione attinente al settore.
--	---

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)	Ottima collocazione editoriale su tema pienamente attinente al settore
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	Buona pubblicazione attinente al settore e su temi di rilevante attualità.
4. Morelli, G., and Petrella, L. (2021). Option Pricing, Zero Lower Bound, and COVID--19. Risks, 9:167	Buona pubblicazione attinente al settore e su temi di rilevante attualità.
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	Pubblicazione attinente al settore, ma di limitata rilevanza editoriale.
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	Buona pubblicazione parzialmente attinente al settore.
7. Morelli, G. (2019). A unified approach for interest rates derivatives pricing. Annals of Operations Research, 299 (Fascia A, I.F. 4.854)	Ottima collocazione editoriale su tema pienamente attinente al settore
8. Morelli, G. (2019). Liquidity drops. Annals of Operations Research, 299:711-719 (Fascia A, I.F. 4.854)	Ottima collocazione editoriale su tema pienamente attinente al settore
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)	Ottima collocazione editoriale su tema pienamente attinente al settore
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	Pubblicazione attinente al settore, ma di limitata rilevanza editoriale.

CONSISTENZA COMPLESSIVA DELLA PRODUZIONE SCIENTIFICA

La consistenza complessiva della produzione scientifica del candidato nell'ambito delle tematiche del settore denota una buona intensità e continuità temporale.

Valutazione sulla produzione complessiva

Il candidato presenta pubblicazioni pienamente congruenti con le tematiche del settore scientifico SECS-S/06. La collocazione editoriale della produzione scientifica è mediamente molto buona, in alcuni casi ottima, con continuità temporale.

Complessivamente, il candidato presenta un profilo di notevole maturità scientifica.

La Commissione termina i propri lavori alle ore 12:00.

Letto, approvato e sottoscritto.

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