

PROCEDURA VALUTATIVA DI CHIAMATA A PROFESSORE DI II FASCIA AI SENSI DELL'ART. 24 COMMA 5 DELLA L. 240/2010 DELLA DOTT.SSA IMMACOLATA OLIVA IN SERVIZIO PRESSO IL DIPARTIMENTO DI METODI E MODELLI PER L'ECONOMIA IL TERRITORIO E LA FINANZA IN QUALITÀ DI RICERCATORE A TEMPO DETERMINATO DI TIPO B, INQUADRATO NEL SC 13/D4 SSD SECS S/06

Per la procedura valutativa di chiamata a professore di II fascia ai sensi dell'art. 24, comma 5, della L. 240/2010 della dott.ssa Immacolata Oliva in servizio presso il Dipartimento di Metodi e modelli per l'economia il territorio e la finanza in qualità di ricercatore a tempo determinato di tipo B, inquadrato nel SC 13/D4 SSD SECS S/06 la Commissione Giudicatrice, nominata con D.D. Prot. n.48/2021, rep. n.556/2021 del 15/07/2021, e composta dai professori:

- Sergio BIANCHI
- Andrea CONSIGLIO
- Silvia ROMAGNOLI

si è riunita il giorno 30 luglio 2021 alle ore 08:00 per via telematica.

Ciascun Commissario dichiara l'insussistenza delle cause di incompatibilità e l'assenza di conflitto di interessi con gli altri componenti la Commissione e che non sussistono le cause di astensione e di ricsuzione di cui agli artt. 51 e 52 del c.p.c.

La Commissione procede alla nomina del Presidente nella persona del prof. Andrea Consiglio e del Segretario verbalizzante nella persona del prof. Sergio Bianchi.

I Commissari dichiarano:

- di non avere alcun rapporto di parentela o affinità entro il quarto grado incluso con il candidato;
- che non sussistono le cause di astensione e di ricsuzione di cui alla norma indicata;
- che non sussistono cause di incompatibilità e di conflitto di interessi.

La Commissione, visto il D.D. Prot. n.48/2021, rep. n.556/2021 del 15/07/2021, con il quale i termini per la conclusione dei lavori della Commissione sono stati fissati in 30 giorni dalla comunicazione del provvedimento di nomina, avvenuta in data 15/07/2021, prende atto che il termine per la conclusione dei lavori è fissato per il 14/08/2021.

La Commissione stabilisce, inoltre, che, secondo quanto previsto dall'art. 11 del Regolamento per il reclutamento di Ricercatori con contratto a tempo determinato di tipologia "B" (D.R. n. 1821/2019), verranno valutati:

1. l'attività didattica, la didattica integrativa e di servizio agli studenti, nonché le attività di ricerca svolte della dott.ssa Immacolata Oliva nell'ambito del contratto;

2. l'attività che la dott.ssa Immacolata Oliva ha svolto nel corso dei rapporti in base ai quali ha avuto accesso al contratto di RTD-B;
3. la produzione scientifica elaborata della dott.ssa Immacolata Oliva successivamente alla presentazione della domanda di partecipazione alla procedura per il conseguimento dell'Abilitazione Scientifica Nazionale, in modo da verificare la continuità della produzione scientifica, ai fini della valutazione dell'attività di ricerca.

I criteri di valutazione del ricercatore sono definiti ai sensi di quanto stabilito dagli artt. 3 e 4 del D.M. del 4 agosto 2011 n. 344.

La Commissione, preso atto che la candidata, dott.ssa Immacolata Oliva, Ricercatore a tempo determinato di tipo B (ex art. 24, comma 5, della L. 240/2010) presso il Dipartimento di Metodi e modelli per l'economia il territorio e la finanza di Sapienza Università di Roma, ha conseguito il giorno 20/04/2021 l'ASN per la II fascia per il Settore Concorsuale SC 13/D4 SSD SECS S/06, valida dal 20 aprile 2021 al 20 Aprile 2030, procede a esaminare la sua attività scientifica e didattica svolta nel periodo 01/03/2019-06/07/2021 secondo gli standard qualitativi riconosciuti a livello internazionale e descritti nell'apposito regolamento di Ateneo nell'ambito dei criteri fissati con decreto del Ministro, formulando il giudizio riportato di seguito.

Attività Didattica

La dott.ssa Immacolata Oliva ha svolto una intensa attività didattica nell'arco dei tre anni, testimoniata dagli insegnamenti

1. Corso di Metodi e Modelli per la Finanza – C.d.L.M. Finanza e Assicurazioni, Facoltà di Economia, Sapienza Università di Roma, a.a. 2018/2019 (9 CFU), a.a. 2019/2020 (6 CFU), a.a. 2020/2021 (9 CFU).
2. Corso di Finanza Quantitativa – C.d.L.M. Finanza e Assicurazioni, Facoltà di Economia, Sapienza Università di Roma, a.a. 2019/2020 (6 CFU), a.a. 2020/2021 (6 CFU).
3. Corso di Computational tools for statistics and Finance (PhD course – XXXV ciclo, XXXVI ciclo), 15 ore.
4. Ciclo di seminari per ulteriori attività formative Metodi computazionali per la finanza con Matlab – C.d.L.M. Finanza e Assicurazioni, Facoltà di Economia, Sapienza Università di Roma, a.a. 2018/2019 (3 CFU), a.a. 2019/2020 (3 CFU)

Tesi ed elaborati

1. Relatrice di ventiquattro tesi magistrali, C.d.L.M. Finanza e Assicurazioni.
2. Supervisor di due studenti di Dottorato XXXVI ciclo

Attività Scientifica

Pubblicazioni e monografie

1. Bonollo M., Di Persio L., Oliva, I. (2020) A Quantization Approach to the Credit Exposure Estimation, *International Review of Economics and Finance* 70 (2020) 335-356
2. Di Persio L., Wallbaum K., Oliva I. (2020) Options on constant proportion portfolio insurance with guaranteed minimum equity exposure, *Applied Stochastic Models in Business and Industry*, 37(1), 98–112.
3. De Angelis P., De Marchis R., Martire A., Oliva I. (2020) A mean-value approach to solve fractional differential and integral equations, *Chaos Solitons Fractals*, 138, 109895.
4. De Angelis P., De Marchis R., Marino M., Martire A., Oliva I. (2021) Betting on Bitcoin: a profitable trading between directional and shielding strategies, to appear in *Decisions in Economics and Finance*.
5. De Angelis P., De Marchis R., Marino M., Martire A., Oliva I. (2021) Evaluating ruin probabilities: a streamlined approach, to appear in *Applied Mathematics E-Notes*.
6. Biagini F., Gnoatto A., Oliva I. (2021) BSDEs of counterparty risk and funding under different aggregation levels, to appear in *SIAM Journal of Financial Mathematics*.
7. Oliva I., Renò R. (2021) Principi di Finanza Quantitativa, Maggioli Editore (in stampa).

Presentazioni a conferenze e workshop

1. IME Congress 2021, online, 5–9 Luglio 2021
2. XI Giornata della Ricerca MEMOTEF, Roma, 19–20 Febbraio 2020
3. XXI Workshop on Quantitative Finance, Napoli, 29–31 Gennaio 2020
4. 42th Annual Meeting of the Italian Association for Mathematics Applied to Economic and Social Sciences (AMASES) Perugia, 9–11 Settembre 2019
5. X Giornata della Ricerca MEMOTEF, Roma, 21 Febbraio 2020

Working papers

1. Oliva I., Stefani I., Torricelli L. (2021) *Optimal portfolio allocation with derivatives under volatility and co-jumps risks*.
2. Mancino M.E., Oliva I., Toscano G. (2021) *Estimation of volatility feedback via Fourier transforms*.
3. Bonollo M., Di Persio L., Mori G., Oliva I. (2021) *Default Risk Charge evaluation in large portfolios*.
4. Di Persio L., Mancinelli D., Oliva I., Wallbaum K. (2021) *Options on TIPP*.
5. Mancinelli D., Oliva I. (2021) Measuring the efficiency of portfolio insurance strategies with guaranteed minimum equity exposure, sottoposto per la pubblicazione.

Attività istituzionale e partecipazione a progetti di ricerca

1. Membro del Collegio di Dottorato in Modelli per l'Economia e la Finanza a partire dal XXXV ciclo
2. Partecipazione al Progetto di Ateneo 2019 Life market: a renewal boost for quantitative management of longevity and lapse risks, P.I.: Gabriele Stabile (Uniroma1), finanziamento 14.000€;
3. Principal Investigator del Progetto di Ateneo 2020 Actuarial and financial risk management solutions in a pandemic mortality, finanziamento 10.000€;
4. Partecipazione al Progetto Indam–Gnampa 2020 Una classe di problemi di ottimizzazione in ambito attuariale ed economico, P.I.: Claudia Ceci (Unich), finanziamento 2.500€;
5. Partecipazione PRIN 2020 Building resilience to the emerging risks: the social impact of the financial and insurance market dynamics. Principal Investigator: Valeria D'Amato (Unisa), Responsabile Unità di ricerca locale: Gabriele Stabile, under review.
6. Organizzatore della XI Giornata della Ricerca MEMOTEF, Roma, 19–20 Febbraio 2020

In base a quanto sopra esposto, la Commissione giudica l'attività didattica, la didattica integrativa e di servizio agli studenti, l'attività di ricerca e la produzione scientifica svolta dalla dott.ssa Immacolata Oliva pienamente congrua con le declaratorie del SC 13/D4 SSD SECS S/06 e la valuta di qualità ottima. Pertanto, al termine dei suoi lavori, la Commissione esprime una valutazione pienamente positiva delle attività di insegnamento e di ricerca svolte dalla dott.ssa Immacolata Oliva e giudica la candidata idonea a ricoprire la posizione di Professore Associato per il SC 13/D4 SSD SECS S/06 presso l'Università Sapienza di Roma, come previsto dal comma 5 dell'articolo 24 della legge 30.12.2010, n. 240 e dall'art. 11 del Regolamento di Ateneo per il reclutamento dei Ricercatori a tempo determinato tipologia B.

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

Il presente verbale, letto, approvato e sottoscritto, viene chiuso alle ore 09:00 del 30 luglio 2021.

La Commissione:

Prof. Andrea Consiglio (presidente)

Prof. Sergio Bianchi (segretario)

Prof. Silvia Romagnoli (componente)