

**PROCEDURA PUBBLICA DI SELEZIONE PER L'ASSUNZIONE DI N.1 RICERCATORE A TEMPO DETERMINATO AI SENSI DELL'ART.24, COMMA 3, LETT. A) DELLA LEGGE 240/2010 PER IL SETTORE CONCURSALE 13/D4 - SETTORE SCIENTIFICO DISCIPLINARE SECS-S/06 - Metodi matematici dell'economia e delle scienze attuariali e finanziarie - DIPARTIMENTO DI ECONOMIA AZIENDALE - UNIVERSITA' ROMA TRE (PNR).**

**VERBALE N. 2**  
**(Valutazione preliminare dei candidati)**

Il giorno 20/6/2022 alle ore 10 si è riunita **telematicamente** la Commissione giudicatrice della suddetta selezione, nominata con D.R. n. 50386 del 12/05/2022, nelle persone di:

Prof. De Angelis Paolo (Sapienza Università di Roma) - Presidente  
Prof. Lampariello Lorenzo (Università degli Studi Roma Tre) - Segretario  
Prof.ssa Perla Francesca (Università degli Studi di Napoli Parthenope) - Componente

La Commissione, accertato che i criteri generali fissati nella precedente riunione sono stati resi pubblici per almeno sette giorni, inizia la verifica dei nomi dei candidati e tenendo conto dell'elenco fornito dall'Amministrazione dichiara di non avere relazioni di parentela ed affinità entro il 4° grado incluso con gli stessi (art. 5 comma 2 D.lgs. 07.05.1948 n.1172).

*La Commissione, presa visione dell'elenco dei candidati alla selezione trasmesso dall'Amministrazione, delle pubblicazioni effettivamente inviate, delle esclusioni operate dagli uffici, decide che i candidati da valutare ai fini della selezione sono n. 5 e precisamente:*

- 1) Aleandri Michele
- 2) Apicella Giovanna
- 3) Martire Antonio Luciano
- 4) Riccioni Jessica
- 5) Rocciolo Francesco

*e come stabilito nella riunione del 26/05/2022, data la loro numerosità, inferiore o pari a 6, sono tutti ammessi alla discussione pubblica ed alla valutazione.*

*La Commissione quindi procede a visionare la documentazione inviata dai candidati e vengono prese in esame, secondo l'ordine alfabetico dei candidati, solo le pubblicazioni corrispondenti all'elenco delle stesse allegato alla domanda di partecipazione al concorso.*

La Commissione, ai fini della presente selezione, prende in considerazione esclusivamente pubblicazioni o testi accettati per la pubblicazione secondo le norme vigenti nonché saggi inseriti in opere collettanee e articoli editi su riviste in formato cartaceo o digitale con esclusione di note interne o rapporti dipartimentali. La tesi di dottorato o dei titoli equipollenti sono presi in considerazione anche in assenza delle condizioni di cui al presente comma.

*Per la valutazione la Commissione tiene conto dei criteri indicati nella seduta preliminare del 26/5/2022.*

Il Presidente ricorda che le pubblicazioni redatte in collaborazione con i membri della Commissione e con i terzi possono essere valutate solo se rispondenti ai criteri individuati nella prima riunione del 26/5/2022.

Con particolare riguardo al candidato Antonio Luciano Martire, il Presidente dichiara che, relativamente alle pubblicazioni 2, 3, 4, 5, 6, 7 e 8, redatte in collaborazione, l'apporto del candidato è sempre enucleabile sulla base dei criteri stabiliti nella riunione del 26/5/2022: le pubblicazioni in questione affrontano tematiche trattate nella tesi di dottorato e nell'ambito di progetti di ricerca cui il candidato stesso ha partecipato.

La Commissione, terminata la fase dell'enucleazione, tiene conto di tutte le pubblicazioni presentate da ciascun candidato, come risulta dagli elenchi dei lavori dei candidati, che vengono allegati al verbale e ne costituiscono parte integrante. (Allegato A)

La Commissione procede poi all'esame dei titoli presentati da ciascun candidato, in base ai criteri individuati nella prima seduta. (Allegato B – Curriculum).

*La Commissione procede ad effettuare la valutazione preliminare di tutti i candidati con motivato giudizio analitico sui titoli, sul curriculum e sulla produzione scientifica, ivi compresa la tesi di dottorato (Allegato C)*

Alle ore 15, accertato che è terminata la fase attinente alla redazione dei giudizi analitici relativi ai candidati, che sono uniti al presente verbale come parte integrante dello stesso, (All. C verb. 2), la seduta è sciolta alle ore 15 e la Commissione unanime decide di aggiornare i lavori al giorno 22/6/2022 alle ore 10 per l'espletamento del colloquio e l'accertamento della conoscenza della lingua straniera.

Il presente verbale è letto, approvato e sottoscritto seduta stante.

Roma, 20/6/2022

PER LA COMMISSIONE:

F.to Digitalmente Prof. Lorenzo Lampariello

## **ALLEGATO A (pubblicazioni)**

**CANDIDATO: ALEANDRI MICHELE**

1. M. Aleandri, M. Colangeli, D. Gabrielli. *A combinatorial representation for the invariant measure of diffusion processes on metric graphs*. ALEA Lat. Am. J. Probab. Math. Stat. 18, 2, (2021)
2. M. Aleandri, I.G. Minelli. *Delay-induced periodic behavior in competitive populations*. Journal of Statistical Physics 185, 6 (2021)
3. M. Aleandri, M. Dall'Aglio, V. Fragnelli, S. Moretti. *Minimal winning coalitions and orders of criticality*. Annals of Operations Research. 2021
4. M. Aleandri, I. G. Minelli. *Opinion dynamics with Lotka-Volterra type interactions*. Electronic Journal of Probability 2019, Vol. 24, paper no. 122, 1-31.
5. M. Aleandri, V. Di Giulio. *A model for interfaces and its mesoscopic limit* - Mathematics and Mechanics of Complex Systems, 2018 vol 6, No. 4.

Tesi di dottorato: *Inhomogeneous mean field models and applications*. Gran Sasso Science Institute (2020)

**CANDIDATO: APICELLA GIOVANNA**

1. Apicella, Giovanna; Dacorogna, Michel, M; Di Lorenzo, Emilia; Sibillo, Marilena (2019). *Improving the Forecast of Longevity by Combining Models*, North American Actuarial Journal, 23:2, 298-319, DOI: 10.1080/10920277.2018.1556701.
2. Apicella, Giovanna; Dacorogna, Michel M.; Di Lorenzo, Emilia; Sibillo, Marilena (2018). *Improving Lee-Carter Forecasting: Methodology and Some Results*. In: Corazza, M., Durbán, M., Grané, A., Perna, C., Sibillo, M. (eds) Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance, pp. 57-61, Springer, Cham. [https://doi.org/10.1007/978-3-319-89824-7\\_10](https://doi.org/10.1007/978-3-319-89824-7_10).
3. Apicella, Giovanna; Sibillo, Marilena (2018). *Corrective factors for longevity projections in a dynamic context*, European Actuarial Journal, 8, 53-68, DOI: <https://doi.org/10.1007/s13385-018-0166-6>.
4. Apicella, Giovanna; Dacorogna, Michel (2016). *A Comprehensive Study of Mortality Dynamics in Ten Developed Countries Using the Feller Process*. Proceedings of the XVI Iberian Italian Conference on Financial and Actuarial Mathematics, pp. 7-11. ISBN: 9788861970601.
5. Apicella, Giovanna; De Giorgi, Enrico (2022). *Gender Attitudes Toward Longevity and Retirement Planning: Theory and Evidence*. In: Corazza, M., Perna, C., Pizzi, C., Sibillo, M. (eds) Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance. MAF 2022, pp. 19-24. Springer, Cham. [https://doi.org/10.1007/978-3-030-99638-3\\_4](https://doi.org/10.1007/978-3-030-99638-3_4).

Tesi di dottorato: *Stochastic Mortality in a Complex World: Methodologies and Applications within the Affine Diffusion Framework*. Sapienza Università di Roma (2018)

**CANDIDATO: MARTIRE ANTONIO LUCIANO**

1. Paolo De Angelis, Antonio Luciano Martire & Emilio Russo (2016). *A bivariate model for evaluating equity-linked policies with surrender option*. Scandinavian Actuarial Journal, 2016:3, 246 261, DOI: 10.1080/03461238.2014.924433

2. Paolo De Angelis, Roberto De Marchis, Antonio Luciano Martire (2020). *A new numerical method for a class of Volterra and Fredholm integral equations*. Journal of Computational and Applied Mathematics 379 (2020) 112944
3. Paolo De Angelis, Roberto De Marchis, Antonio Luciano Martire, Immacolata Oliva (2020). *A mean-value Approach to solve fractional differential and integral equations*. Chaos, Solitons and Fractals 138 (2020) 109895
4. Paolo De Angelis, Roberto De Marchis, Antonio Luciano Martire, Stefano Patrì (2020). *Non-Standard Volterra Integral Equations: A Mean-Value Theorem Numerical Approach*. Applied Mathematical Sciences, Vol. 14, 2020, no. 9, 423 – 43  
<https://doi.org/10.12988/ams.2020.914219>
5. Paolo De Angelis, Roberto De Marchis, Mario Marino, Antonio Luciano Martire, Immacolata Oliva (2021). *Betting on bitcoin: a profitable trading between directional and shielding strategies*. Decisions in Economics and Finance <https://doi.org/10.1007/s10203-021-00324-z>
6. Paolo De Angelis, Roberto De Marchis, Mario Marino, Antonio Luciano Martire, Immacolata Oliva. *Evaluating ruin probabilities: a streamlined approach*. Applied Mathematics E-Notes 21(2021), 634-642
7. Paolo De Angelis, Roberto De Marchis, Antonio Luciano Martire, Emilio Russo (2022). *A flexible lattice framework for valuing options on assets paying discrete dividends and variable annuities embedding GMWB riders*. Accettato per la pubblicazione su Decisions in Economics and Finance.

Tesi di dottorato: *Embedded surrender option pricing for equity-linked policies: comparisons and solutions for bivariate models*. Sapienza Università di Roma (2012)

#### CANDIDATO: **RICCIONI JESSICA**

1. Riccioni, J., Cerqueti, R., (2018). *Regular paths in financial markets: investigating the Benford's Law*. Chaos, Solitons and Fractals, 107, 186-194.
2. Cinelli, M., Ficcadenti, V., & Riccioni, J. (2021). *The interconnectedness of the economic content in the speeches of the US Presidents*. Annals of Operations Research, 299(1), 593-615.
3. Cerqueti, R., Maggi, M., Riccioni, J. (2022). *Statistical methods for decision support systems in finance: How Benford's law predicts financial risk*. Annals of Operations Research. DOI: <https://doi.org/10.1007/s10479-022-04742-z>

Tesi di dottorato: *Reliability stochastic systems and rational expectations*. Università di Macerata (2021)

#### CANDIDATO: **ROCCIOLO FRANCESCO**

1. *Explaining Abnormal Returns in Stock Markets: An Alpha-Neutral version of the CAPM*, con Chris Brooks e Andrea Gheno, International Review of Financial Analysis, 82, 2022
2. *Optimism, Volatility and decision-making in Stock Markets*, con Chris Brooks e Andrea Gheno, International Review of Financial Analysis, 66, 2019

Tesi di dottorato: *Financial Decision-Making and Asset Pricing with Biased Beliefs*. Henley Business School, University of Reading, U.K. (2020).

La nota "Arbitrage Pricing under Uncertainty", SSRN 3804478, 2021 presentata dal candidato non è presa in considerazione in quanto non soddisfa i requisiti di pubblicazione ai sensi della normativa vigente (*La Commissione, ai fini della presente selezione, prende in considerazione esclusivamente pubblicazioni o testi accettati per la pubblicazione secondo le norme vigenti nonché saggi inseriti in opere collettanee e articoli editi su riviste in formato cartaceo o digitale con esclusione di note interne o rapporti dipartimentali.*)

## ALLEGATO B (curriculum)

CANDIDATO: **ALEANDRI MICHELE**

### TITOLI PROFESSIONALI:

a) svolgimento attività didattica a livello universitario in Italia o all'estero

Il candidato ha tenuto le lezioni, in qualità di professore aggiunto, per gli insegnamenti, nell'ambito di corsi di laurea triennale, di: Metodi matematici per la valutazione finanziaria (dal 2022, Università Niccolò Cusano) e Mathematics 1 (dal 2021, LUISS). Ha, inoltre, svolto attività di esercitatore (teaching assistant) per gli insegnamenti, nell'ambito di corsi di laurea triennale, di: Games and Strategies (dal 2019, LUISS), Matematica generale (2021-2022, Università di Cassino), Matematica finanziaria (2021-2022, Università di Cassino), Social Network Analysis (2020-21, LUISS), Mathematics (2019-2021, LUISS); e per il corso di laurea magistrale di Probability (2018, LUISS). È stato tutor per gli insegnamenti, nell'ambito di corsi di laurea triennale, di: Mathematics and Financial Mathematics (dal 2020, Università telematica Guglielmo Marconi), Mathematics and Probability (2018-2020, LUISS). Ha, infine, tenuto le lezioni per i corsi preliminari di Mathematics (2020-2022, LUISS) e Probability (2019, LUISS).

b) svolgimento di attività di formazione o di ricerca presso qualificati istituti italiani o stranieri

Dal 2022, il candidato è assegnista di ricerca presso il Dipartimento di Matematica della Sapienza Università di Roma. È stato, sempre nel 2022, assegnista di ricerca presso il Dipartimento di Scienze Statistiche dell'Università di Bologna. Dal 2019 al 2022 è stato assegnista di ricerca presso la LUISS, sotto la guida del prof. Dall'Aglio. Dal 2018 al 2019, ha, infine, ricoperto la posizione di Junior scientist presso il GSSI-Gran Sasso Science Institute.

Il candidato dichiara la partecipazione alle Summer school *Preferences, decisions and games* (2019, Parigi, Francia) e *Stochastic Dynamics out of Equilibrium* (2017, Marsiglia, Francia) e, nel 2022, al corso di formazione online Erickson: "Creare giochi per la didattica".

c) organizzazione, direzione e coordinamento di gruppi di ricerca nazionali e internazionali, o partecipazione agli stessi

Il candidato dichiara la partecipazione, negli anni 2016, 2018, 2021, rispettivamente, ai 124th, 136th e 165th European Study Group with Industries. Nel caso dell'organizzazione del 136th European Studied Group with Industries, il candidato vanta, in qualità di principal investigator, un finanziamento nell'ambito COST Action TD1409.

d) titolarità di brevetti

Nulla è stato dichiarato dal candidato.

e) partecipazione in qualità di relatore a congressi e convegni nazionali e internazionali

Il candidato dichiara, dal 2018 a oggi, la partecipazione a 9 convegni nazionali e internazionali, in un caso su invito.

f) conseguimento di premi e riconoscimenti nazionali e internazionali per attività di ricerca

Il candidato dichiara di aver ottenuto un finanziamento (European Kovalevskaya Travel Grant and Kovalevskaya Grant) per la partecipazione all'International Congress of Mathematicians ICM 2022 in St. Petersburg, Russia, luglio 2022 (ora online).

### TITOLI ACCADEMICI:

a) possesso del titolo di dottore di ricerca o equivalente, conseguito in Italia o all'estero

Il candidato ha conseguito il titolo di Dottore di Ricerca in Mathematics nel 2018 presso il

GSSI-Gran Sasso Science Institute, L'Aquila, con una tesi su 'Inhomogeneous mean field models and applications' (advisor P. Dai Pra, co-advisor I. G. Minelli).

CANDIDATO: **APICELLA GIOVANNA**

**TITOLI PROFESSIONALI:**

a) svolgimento attività didattica a livello universitario in Italia o all'estero

La candidata ha svolto attività di esercitatrice per i corsi di: Mathematics A - Reduced Speed (2018 e 2021 per 24 ore, University of St. Gallen), Mathematics A - Normal Speed (2018 e 2020 per 12 ore, University of St. Gallen). È stata, inoltre, titolare del corso di Mathematics for Economists (2019 e 2020 per 48 ore, University of St. Gallen).

b) svolgimento di attività di formazione o di ricerca presso qualificati istituti italiani o stranieri

Da gennaio 2022, la candidata ricopre una posizione Postdoc (rinnovata ogni 3 mesi) presso la School of Economics and Political Science, University of St. Gallen. Da ottobre a dicembre 2021, ha ricoperto una posizione Postdoc presso la School of Economics and Political Science, University of St. Gallen, nell'ambito del progetto SNSF 100018\_189093 "Combining Actuarial and Behavioural Perspectives to the Understanding of Longevity Risk". Ha ricoperto una posizione Postdoc anche da ottobre 2019 a ottobre 2021 presso la School of Economics and Political Science, University of St. Gallen, sempre nell'ambito del progetto SNSF 100018\_189093 "Combining Actuarial and Behavioural Perspectives to the Understanding of Longevity Risk". Da luglio 2018 a ottobre 2019 ha, infine ricoperto una posizione Postdoc (rinnovata ogni 3 mesi) presso la School of Economics and Political Science, University of St. Gallen.

La candidata dichiara la partecipazione al corso "Scuola di attuariato" (Feb.-Jun. 2018, Inter Academy Center for Actuarial Science and Risk Management (CISA), Italy), al corso "Modelli per le assicurazioni contro danni" (Jan.-Feb. 2018, Inter Academy Center for Actuarial Science and Risk Management (CISA), Italy), al workshop "Economic Scenario Generators" (Jun. 2017, Zurich, Prime Re Academy), all'Amplify Bootcamp "Trading, Trading & Financial Market Analysis" (Apr. 2017, Cass Business School, City, University of London), e alla 29th International Summer School 2016 of the Swiss Association of Actuaries (SAA) on the subject Quantitative Risk Management: Concepts, Techniques and Tools (Aug. 2016, University of Lausanne).

c) organizzazione, direzione e coordinamento di gruppi di ricerca nazionali e internazionali, o partecipazione agli stessi

La candidata vanta la partecipazione alla fase 3 del progetto di ricerca internazionale (University of Waterloo (Canada) and the University of Kent (UK)) "Population Aging, Implications for Asset Values, and Impact for Pension Plans: An International Study, funded by the Society of Actuaries". La candidata dichiara, inoltre, di aver ricoperto una posizione di research trainee alla SCOR Services Switzerland Ltd. da dicembre 2015 a maggio 2016.

d) titolarità di brevetti

Nulla è stato dichiarato dalla candidata.

e) partecipazione in qualità di relatore a congressi e convegni nazionali e internazionali

La candidata dichiara, dal 2016 a oggi, la partecipazione a 14 convegni di cui 3 su invito e 7 seminari (in un caso su invito) nazionali e internazionali. È, inoltre, stata membro del comitato organizzatore per l'UNISActuarial School 2016 e per l'IbIt 2016-XVI Iberian-Italian Conference on Financial and Actuarial Mathematics.

f) conseguimento di premi e riconoscimenti nazionali e internazionali per attività di ricerca

La candidata nel 2019 ha conseguito l'*AMASES Award for the best doctoral dissertation* nel 2019. La candidata ha anche ottenuto una borsa di mobilità dalla Sapienza Università di Roma ("Fondo per il sostegno dei giovani e favorire la mobilità degli studenti", MIUR).

## **TITOLI ACCADEMICI:**

### **a) possesso del titolo di dottore di ricerca o equivalente, conseguito in Italia o all'estero**

La candidata ha conseguito il titolo di Dottore di Ricerca – Doctor Europaeus in Scuola di Scienze Statistiche – Curriculum Scienze Attuariali nel 2018 presso la Sapienza Università di Roma, con una tesi su “Stochastic Mortality in a Complex World: Methodologies and Applications within the Affine Diffusion Framework” (advisor prof.ssa M. Sibillo).

CANDIDATO: **MARTIRE ANTONIO LUCIANO**

## **TITOLI PROFESSIONALI:**

### **a) svolgimento attività didattica a livello universitario in Italia o all'estero**

Il candidato ha tenuto il corso di Neural Network for Economists nell'ambito dell'European PhD programme in Socio-Economics and Statistical Studies (2022 per 16 ore, Sapienza Università di Roma). Nel 2018 e nel 2019, è stato docente a contratto per il corso di Finanza quantitativa presso la Facoltà di Economia, Sapienza Università di Roma. È stato, infine, nel 2013, docente a contratto per lo svolgimento di attività di supporto alla didattica nell'ambito dell'insegnamento di Matematica finanziaria (Università degli studi di Roma Tre).

### **b) svolgimento di attività di formazione o di ricerca presso qualificati istituti italiani o stranieri**

Da febbraio 2022, il candidato è titolare di assegno di ricerca presso il Dipartimento di Economia dell'Università di Genova. Nel 2021, è stato assegnista di ricerca (nell'ambito del progetto di ricerca “Life market: a renewal boost for quantitative management of longevity and lapse risks”) presso il Dipartimento di Metodi e Modelli per l'Economia, il Territorio e la Finanza della Sapienza Università di Roma. A partire da ottobre 2018 e fino a ottobre 2020 (con rinnovo di un anno), è stato titolare di assegno di ricerca (con titolo “Soluzione numerica per le equazioni integrali stocastiche: un approccio basato sul teorema della media integrale”) presso il Dipartimento di Metodi e Modelli per l'Economia, il Territorio e la Finanza della Sapienza Università di Roma.

Nel 2014, ha ottenuto il diploma di specializzazione in Econometria applicata conferito dalla Scuola nazionale dell'amministrazione, al termine del Master in Econometria applicata (VIII edizione).

### **c) organizzazione, direzione e coordinamento di gruppi di ricerca nazionali e internazionali, o partecipazione agli stessi**

Il candidato ha partecipato ai progetti di ricerca “Life market: a renewal boost for quantitative management of longevity and lapse risks” e “Actuarial and financial risk management solutions in a pandemic mortality framework” presso il Dipartimento di Metodi e Modelli per l'Economia, il Territorio e la Finanza della Sapienza Università di Roma.

### **d) titolarità di brevetti**

Nulla è stato dichiarato dal candidato.

### **e) partecipazione in qualità di relatore a congressi e convegni nazionali e internazionali**

Il candidato dichiara, dal 2014 a oggi, la partecipazione a 6 convegni internazionali e a 2 seminari in ambito nazionale.

### **f) conseguimento di premi e riconoscimenti nazionali e internazionali per attività di ricerca**

Nulla è stato dichiarato dal candidato.

## **TITOLI ACCADEMICI:**



a) possesso del titolo di dottore di ricerca o equivalente, conseguito in Italia o all'estero

Il candidato ha conseguito il titolo di Dottore di Ricerca in Matematica per le applicazioni economico-finanziarie nel 2012 presso la Sapienza Università di Roma, con una tesi su "Embedded surrender option pricing for equity-linked policies: comparisons and solutions for bivariate models" (advisor prof. P. De Angelis).

CANDIDATO: **RICCIONI JESSICA**

**TITOLI PROFESSIONALI:**

a) svolgimento attività didattica a livello universitario in Italia o all'estero

La candidata ha svolto attività di esercitatrice (teaching assistant) per i corsi di: Metodi Quantitativi per l'Economia (dal 2021, Sapienza Università di Roma), Modelli Computazionali per l'Economia e la Finanza (dal 2019, Università degli Studi di Roma Unitelma Sapienza). Nel 2019, è stata, inoltre, tutor nell'ambito di vari corsi presso l'Università degli Studi di Roma Unitelma Sapienza.

b) svolgimento di attività di formazione o di ricerca presso qualificati istituti italiani o stranieri

Da aprile 2021, fino ad aprile 2022, la candidata è stata titolare di assegno di ricerca nell'ambito del progetto "Analisi delle classifiche e dei dati di preferenza: nuovi metodi e applicazioni" presso il Dipartimento di Scienze Sociali ed Economiche della Sapienza Università di Roma.

La candidata dichiara la partecipazione, nel 2021, alla Summer School "Stochastic Models and Complex Systems" presso l'Università di Salerno, alla Scuola "Machine Learning of Dynamic Processes and Time Series Analysis" (2020, presso la Scuola Normale Superiore), alla Winter School "Simplicity of Complexity" (2018, presso l'University of Wroclaw), e ai corsi "Monte Carlo Simulations for Finance" (2020, presso l'Università del Piemonte Orientale) e "Multivariate methods with R" (2017, presso la Cyprus University of Technology)

c) organizzazione, direzione e coordinamento di gruppi di ricerca nazionali e internazionali, o partecipazione agli stessi

La candidata dichiara la partecipazione, nel 2021, a un progetto di Ateneo (con il prof. Palestini come principal investigator) presso Sapienza Università di Roma.

d) titolarità di brevetti

Nulla è stato dichiarato dalla candidata.

e) partecipazione in qualità di relatore a congressi e convegni nazionali e internazionali

La candidata dichiara, dal 2017 a oggi, la partecipazione a 7 convegni e workshop nazionali e internazionali e a 1 seminario nazionale (su invito).

f) conseguimento di premi e riconoscimenti nazionali e internazionali per attività di ricerca

Nulla è stato dichiarato dalla candidata.

**TITOLI ACCADEMICI:**

a) possesso del titolo di dottore di ricerca o equivalente, conseguito in Italia o all'estero

La candidata ha conseguito il titolo di Dottore di Ricerca in co-tutela in Metodi Quantitativi per la Politica Economica per le applicazioni nel 2021 presso l'Università di Macerata e l'Université Paris 1 Panthéon-Sorbonne, con una tesi su 'Reliability stochastic systems and rational expectations' (advisor prof. R. Cerqueti e prof. J.V. Andersen).

CANDIDATO: **ROCCIOLO FRANCESCO**

**TITOLI PROFESSIONALI:**

a) svolgimento attività didattica a livello universitario in Italia o all'estero

Nel 2022, il candidato è stato titolare dell'insegnamento di Research Methodologies nell'ambito del corso di Dottorato presso l'Università Telematica Internazionale Uninettuno. È stato titolare dei seguenti insegnamenti, nell'ambito di corsi di laurea magistrale: Financial and Actuarial Sciences (2021 e 2022, Università degli studi di Roma Tre), Introductory Quantitative Methods for Finance (2019 e 2020, University of Reading). È stato titolare dei seguenti insegnamenti, nell'ambito di corsi di laurea triennale: Financial Mathematics (2021 e 2022, Università Telematica Internazionale Uninettuno), Matematica Finanziaria (2021 e 2022, Università Telematica Internazionale Uninettuno), Teoria del Portafoglio e dei Contratti Derivati (dal 2020 al 2022, Università degli studi di Roma Tre). Ha, inoltre, svolto attività di didattica integrativa per gli insegnamenti, nell'ambito di corsi di laurea magistrale, di: Financial Econometrics and Empirical Finance (2020 e 2021, Università Bocconi), Matematica Finanziaria (Università degli studi di Roma Tre), Teoria del Portafoglio e dei Contratti Derivati (Università degli studi di Roma Tre), e per i seguenti insegnamenti, nell'ambito di corsi di laurea triennale: Intro. Quant. Methods for Finance (University of Reading), Quantitative Methods for Finance (University of Reading).

b) svolgimento di attività di formazione o di ricerca presso qualificati istituti italiani o stranieri

Dal 2020 e fino a maggio 2022, il candidato è stato titolare di una posizione Postdoc presso il Brevan Howard Centre, Imperial College London. È stato visiting researcher presso l'Università Ca' Foscari nel 2020 e nel 2021 e presso l'Università Bocconi nel 2019.

Il candidato dichiara la partecipazione alle seguenti Summer School: Sustainable Finance by Harrison Hong (2020, Imperial College Business School), Functional Analysis (2019, Scuola Matematica Interuniversitaria), Numerical Analysis (2019, Scuola Matematica Interuniversitaria). Ha, inoltre, seguito (2015-2016) il graduate course presso l'Einaudi Institute for Economics and Finance.

c) organizzazione, direzione e coordinamento di gruppi di ricerca nazionali e internazionali, o partecipazione agli stessi

Nulla è stato dichiarato dal candidato.

d) titolarità di brevetti

Nulla è stato dichiarato dal candidato.

e) partecipazione in qualità di relatore a congressi e convegni nazionali e internazionali

Il candidato dichiara, dal 2018 a oggi, la partecipazione a 13 convegni internazionali e a 7 seminari per lo più internazionali. Ha, inoltre, fatto parte del comitato scientifico/organizzativo per le seguenti conferenze: World Finance Conference (2020) e Royal Economic Society Symposium of Junior Researchers (2019).

f) conseguimento di premi e riconoscimenti nazionali e internazionali per attività di ricerca

Nulla è stato dichiarato dal candidato.

**TITOLI ACCADEMICI:**

a) possesso del titolo di dottore di ricerca o equivalente, conseguito in Italia o all'estero

Il candidato ha conseguito il titolo di Dottore di Ricerca in Finance nel 2020 presso l'ICMA Center, Henley Business School, University of Reading (UK), con una tesi su 'Financial Decision-Making and Asset Pricing with Biased Beliefs' (advisor prof. C. Brooks e prof. A. Gheno).

## ALLEGATO C

### ***Giudizi analitici sui titoli, sul curriculum e sulla produzione scientifica dei candidati:***

CANDIDATO: **ALEANDRI MICHELE**

#### Titoli e curriculum

Descrizione Laurea magistrale in Matematica. Il candidato ha conseguito il titolo di Dottore di Ricerca in Mathematics nel 2018 presso il GSSI-Gran Sasso Science Institute, L'Aquila, con una tesi su 'Inhomogeneous mean field models and applications'. Il candidato ha proseguito la formazione post-doc partecipando alle Summer School Preferences, decisions and games (2019, Parigi, Francia) e Stochastic Dynamics out of Equilibrium (2017, Marsiglia, Francia) e, nel 2022, al corso di formazione online Erickson: "Creare giochi per la didattica". Il candidato ha usufruito di svariati assegni di ricerca, dal 2019 al 2022 presso la LUISS, nel 2022 presso il Dipartimento di Scienze Statistiche dell'Università di Bologna e successivamente fino a oggi presso il Dipartimento di Matematica della Sapienza Università di Roma. Dal 2018 al 2019, ha, infine, ricoperto la posizione di Junior scientist presso il GSSI-Gran Sasso Science Institute. Ha svolto attività didattica su insegnamenti per corsi di laurea triennale e una cospicua attività di esercitatore e tutor. Il candidato ha partecipato, in più anni, all'European Study Group with Industries, e dal 2018 a oggi, ha partecipato a 9 convegni nazionali e internazionali, in un caso su invito.

Giudizio I titoli riportati nel curriculum del candidato ottengono complessivamente una valutazione sufficientemente positiva. In particolare, il percorso di formazione e ricerca appare abbastanza avviato. Discreta l'esperienza didattica, attiva la presenza come relatore a congressi e convegni nazionali e internazionali.

#### Produzione scientifica

Descrizione Pubblicazioni valutabili Il candidato presenta 5 pubblicazioni ottenute nell'arco di tempo dal 2018 al 2021, oltre alla tesi di dottorato. In relazione agli elenchi pubblicati dall'ANVUR il 9/2/2022 per l'Area 13 e con riferimento al settore D4, si contano 3 contributi di cui 1 su rivista scientifica e 2 su riviste scientifiche di fascia A. Le pubblicazioni presentate dal candidato vertono prevalentemente sullo studio e analisi di processi markoviani, ordine di criticità in giochi competitivi, modelli di opinione dinamica, modelli elettorali, e un'applicazione nel contesto della termodinamica.

Giudizio La strumentazione utilizzata e i risultati originali ottenuti si riferiscono a tematiche prevalentemente di ambito probabilistico-statistico e della fisica, e pertanto sono marginalmente coerenti con il settore concorsuale 13/D4. Nei lavori eseguiti in collaborazione l'apporto individuale è deducibile dal suo percorso formativo, dalla produzione complessiva e dalla tesi di dottorato. La produzione scientifica del candidato, tutta a più nomi, è maggiormente concentrata soprattutto nell'ultimo anno e con qualche discontinuità temporale; la numerosità è adeguata.

#### **Giudizio complessivo**

La commissione, dopo aver esaminato titoli, curriculum e produzione scientifica del candidato, esprime un giudizio positivo sia sull'attività svolta che sulla produzione scientifica, atteso che quest'ultima si colloca su temi non propriamente congruenti con il settore concorsuale.

CANDIDATO: **APICELLA GIOVANNA**

#### Titoli e curriculum

Descrizione Laurea magistrale in Scienze statistiche per la finanza. La candidata ha conseguito

il titolo di Dottore di Ricerca – Doctor Europaeus in Scuola di Scienze Statistiche – Curriculum Scienze Attuariali nel 2018 presso la Sapienza Università di Roma, con una tesi su “Stochastic Mortality in a Complex World: Methodologies and Applications within the Affine Diffusion Framework”. In seguito, è stata a più riprese assegnista Postdoc presso la School of Economics and Political Science, University of St. Gallen e ha proseguito la sua formazione partecipando al corso “Scuola di attuariato” (Inter Academy Center for Actuarial Science and Risk Management (CISA)), al corso “Modelli per le assicurazioni contro danni” (Inter Academy Center for Actuarial Science and Risk Management (CISA)), all’Amplify Bootcamp “Trading, Trading & Financial Market Analysis”, Cass Business School), e alla 29th International Summer School 2016 of the Swiss Association of Actuaries (SAA). È stata titolare per due anni accademici del corso Mathematics for Economists presso l’University of St. Gallen. Ha svolto attività didattica in qualità di esercitatore per il corso di Mathematics presso l’University of St. Gallen. La candidata ha partecipato alla fase 3 di un progetto di ricerca internazionale su “Population Aging, Implications for Asset Values, and Impact for Pension Plans: An International Study, funded by the Society of Actuaries”. La candidata dal 2016 a oggi, vanta la partecipazione 14 convegni di cui 3 su invito e 7 seminari (in un caso su invito) nazionali e internazionali. Nel 2019 al XLIII Convegno AMASES ha conseguito l’*AMASES Award for the best doctoral dissertation*. È, inoltre, stata membro del comitato organizzatore per l’UNISActuarial School 2016 e per l’IbIt 2016-XVI Iberian-Italian Conference on Financial and Actuarial Mathematics.

Giudizio I titoli riportati nel curriculum della candidata ottengono complessivamente una valutazione positiva. In particolare, il percorso di formazione e ricerca appare ben avviato. Buona l’esperienza didattica, molto attiva la presenza come relatore a congressi e convegni nazionali e internazionali.

#### Produzione scientifica

Descrizione Pubblicazioni valutabili La candidata presenta 5 pubblicazioni ottenute nell’arco di tempo dal 2016 al 2022, oltre alla tesi di dottorato. In relazione agli elenchi pubblicati dall’ANVUR il 9/2/2022 per l’Area 13 e con riferimento al settore D4 si contano 2 contributi di cui 1 su rivista scientifica e 1 di fascia A. Le altre 3 pubblicazioni riguardano atti di convegno, in particolare 1 short paper e 2 abstract estesi. La produzione scientifica della candidata riguarda ambiti classici della matematica attuariale, quale studio di modelli per la previsione dei tassi di longevità-mortalità (modelli affini, Cairns-Blake-Dowd model).

#### Giudizio

La produzione della candidata è pienamente pertinente il settore concorsuale 13/D4. I contributi appaiono originali ancorché limitati rispetto all’arco temporale dell’attività scientifica. Nei lavori eseguiti in collaborazione l’apporto individuale è deducibile dal suo percorso formativo, dalla produzione complessiva e dalla tesi di dottorato.

#### **Giudizio complessivo**

La commissione, dopo aver esaminato titoli, curriculum e produzione scientifica della candidata, esprime un giudizio positivo sia sull’attività svolta che sulla produzione scientifica, atteso che quest’ultima appare limitata rispetto all’arco temporale dell’attività scientifica.

**CANDIDATO: MARTIRE ANTONIO LUCIANO**

#### Titoli e curriculum

Descrizione Laurea in Matematica. Il candidato ha conseguito il titolo di Dottore di Ricerca in Matematica per le applicazioni economico-finanziarie nel 2012 presso la Sapienza Università di Roma, con una tesi su “Embedded surrender option pricing for equity-linked policies: comparisons and solutions for bivariate models”. Nel 2014, ha ottenuto il diploma di specializzazione in Econometria applicata conferito dalla Scuola nazionale dell’amministrazione, al termine del Master in Econometria applicata (VIII edizione). Dal 2018 è stato a più riprese

assegnista di ricerca presso il Dipartimento di Metodi e Modelli per l'Economia, il Territorio e la Finanza della Sapienza Università di Roma, e dal 2022 ad oggi è titolare di un assegno di ricerca presso il Dipartimento di Economia dell'Università di Genova. Il candidato ha svolto attività didattica in qualità di docente a contratto, anche in corsi di dottorato. Ha partecipato a due progetti di ricerca: "Life market: a renewal boost for quantitative management of longevity and lapse risks" e "Actuarial and financial risk management solutions in a pandemic mortality framework" presso il Dipartimento di Metodi e Modelli per l'Economia, il Territorio e la Finanza della Sapienza Università di Roma. Dal 2014 ad oggi, vanta la partecipazione a 6 convegni internazionali e a 2 seminari in ambito nazionale.

Giudizio I titoli riportati nel curriculum del candidato ottengono complessivamente una valutazione positiva. In particolare, il percorso di formazione e ricerca appare consolidato. Molto buona l'esperienza didattica, svolta anche in corsi di dottorato, attiva la presenza come relatore a congressi e convegni nazionali e internazionali.

#### Produzione scientifica

Descrizione Pubblicazioni valutabili Il candidato presenta 7 pubblicazioni ottenute nell'arco di tempo dal 2012 al 2022, oltre alla tesi di dottorato. Si contano 7 contributi su rivista, di cui 3 su riviste scientifiche e 4 su riviste di fascia A, tenendo conto degli elenchi pubblicati dall'ANVUR il 9/2/2022 per l'Area 13 e con riferimento al settore D4. La produzione scientifica del candidato verte prevalentemente sullo sviluppo di metodi numerici e tecniche di programmazione reticolare per la risoluzione di equazioni integrali di Volterra e Fredholm, con applicazioni in alcuni casi alla teoria del rischio, e in parte rivolta alla valutazione delle opzioni di riscatto nei contratti assicurativi di tipo equity-linked, e di strategie di trading su criptovalute con l'ausilio di reti neurali.

Giudizio La produzione del candidato è pienamente pertinente il settore concorsuale 13/D4. La produzione scientifica complessivamente risulta di ottima qualità sulla base del carattere innovativo e dell'originalità dei contenuti per quanto riguarda l'ambito di ricerca che caratterizza il settore concorsuale 13/D4. Nei lavori eseguiti in collaborazione l'apporto individuale è deducibile dal suo percorso formativo, dalla produzione complessiva e dalla tesi di dottorato. La produzione scientifica del candidato, tutta a più nomi, è maggiormente concentrata negli ultimi 2 anni; la numerosità è buona, l'intensità è buona nel periodo 2020-21.

#### **Giudizio complessivo**

La commissione, dopo aver esaminato titoli, curriculum e produzione scientifica del candidato, esprime un giudizio molto positivo sia sull'attività svolta che sulla produzione scientifica.

**CANDIDATO: RICCIONI JESSICA**

#### Titoli e curriculum

Descrizione Laurea magistrale in Mercati ed Intermediari Finanziari. La candidata ha conseguito il titolo di Dottore di Ricerca in co-tutela in Metodi Quantitativi per la Politica Economica per le applicazioni nel 2021 presso l'Università di Macerata e l'Université Paris 1 Panthéon-Sorbonne, con una tesi su "Reliability stochastic systems and rational expectations". La sua formazione comprende la partecipazione a numerosi corsi e a scuole sia presso Università italiane che all'estero (nel 2021 Summer School "Stochastic Models and Complex Systems" presso l'Università di Salerno, nel 2020 alla Scuola "Machine Learning of Dynamic Processes and Time Series Analysis" presso la Scuola Normale Superiore, nel 2018 alla Winter School "Simplicity of Complexity" presso l'University of Wroclaw, nel 2020 corso "Monte Carlo Simulations for Finance" presso l'Università del Piemonte Orientale, nel 2017 corso "Multivariate methods with R", presso la Cyprus University of Technology). Ha svolto attività didattica in qualità di esercitatore e tutor presso la Sapienza Università di Roma e presso l'Università degli Studi di Roma Unitelma Sapienza. È stata membro di un progetto di ricerca finanziato dalla Sapienza Università di Roma.

Dal 2017 a oggi ha partecipato a 7 convegni e workshop nazionali e internazionali e a 1 seminario in ambito nazionale (su invito).

Giudizio I titoli riportati nel curriculum della candidata ottengono complessivamente una valutazione sufficientemente positiva. In particolare, il percorso di formazione e ricerca appare molto promettente. Sufficiente l'esperienza didattica, attiva la presenza come relatore a congressi e convegni nazionali e internazionali.

#### Produzione scientifica

Descrizione Pubblicazioni valutabili La candidata presenta 3 pubblicazioni ottenute nell'arco di tempo dal 2018 al 2022, oltre alla tesi di dottorato. Si contano 3 contributi su rivista di fascia A, tenendo conto degli elenchi pubblicati dall'ANVUR il 9/2/2022 per l'Area 13 e con riferimento al settore D4. La produzione della candidata verte prevalentemente su analisi statistiche basate sulla legge di Benford applicata a dati finanziari e su applicazioni di cluster analysis.

Giudizio La strumentazione utilizzata e i risultati originali ottenuti si riferiscono prevalentemente a tematiche di ambito probabilistico-statistico, e pertanto non del tutto pertinenti il settore concorsuale 13/D4, anche se nei lavori sottoposti a valutazione sono presenti alcune applicazioni in ambito finanziario e sociale. Nei lavori eseguiti in collaborazione l'apporto individuale è deducibile dal suo percorso formativo, dalla produzione complessiva e dalla tesi di dottorato.

#### **Giudizio complessivo**

La commissione, dopo aver esaminato titoli, curriculum e produzione scientifica della candidata, esprime un giudizio positivo sia sull'attività svolta che sulla produzione scientifica, atteso che quest'ultima si colloca su temi non del tutto pertinenti il settore concorsuale 13/D4.

CANDIDATO: **ROCCIOLO FRANCESCO**

#### Titoli e curriculum

Descrizione Laurea in Finanza e Impresa. Il candidato ha conseguito il titolo di Dottore di Ricerca in Finance nel 2020 presso l'ICMA Center, Henley Business School, University of Reading (UK), con una tesi su "Financial Decision-Making and Asset Pricing with Biased Beliefs". Durante il periodo del dottorato è stato visiting researcher presso l'Università Ca' Foscari nel 2020 e nel 2021 e presso l'Università Bocconi nel 2019. Successivamente fino a maggio 2022 è stato titolare di una posizione Postdoc presso il Brevan Howard Centre, Imperial College London. Il candidato ha integrato la sua formazione mediante la partecipazione a scuole sia presso Università italiane che all'estero (Sustainable Finance presso l'Imperial College Business School; Functional Analysis presso la Scuola Matematica Interuniversitaria; Numerical Analysis presso la Scuola Matematica Interuniversitaria). Ha, inoltre, seguito il graduate course presso l'Einaudi Institute for Economics and Finance. Il candidato ha svolto attività didattica sia in corsi di laurea triennale e magistrale sia in corsi di dottorato, presso Università in Italia e all'estero (nell'ambito di corsi di Dottorato: Research Methodologies presso l'Università Telematica Internazionale Uninettuno; nell'ambito di corsi di laurea magistrale: Financial and Actuarial Sciences presso l'Università degli studi di Roma Tre, Introductory Quantitative Methods for Finance presso l'University of Reading; nell'ambito di corsi di laurea triennale: Financial Mathematics e Matematica Finanziaria presso l'Università Telematica Internazionale Uninettuno, Teoria del Portafoglio e dei Contratti Derivati presso l'Università degli studi di Roma Tre). Ha, inoltre, svolto attività di didattica integrativa per insegnamenti nell'ambito di corsi di laurea triennale e di laurea magistrale presso l'Università Bocconi, l'Università degli studi Roma Tre e presso l'Università di Reading. Infine, il candidato vanta, dal 2018 a oggi, la partecipazione a 13 convegni internazionali e a 7 seminari. Ha, inoltre, fatto parte del comitato scientifico/organizzativo per le seguenti conferenze: World Finance Conference (2020) e Royal Economic Society Symposium of Junior Researchers (2019).

Giudizio I titoli riportati nel curriculum del candidato ottengono complessivamente una valutazione molto positiva. In particolare, dal punto di vista del percorso di formazione e ricerca,

si fanno apprezzare collaborazioni prestigiose, anche a livello internazionale. Molto buona l'esperienza didattica, così come la presenza in qualità di relatore a congressi e convegni nazionali e internazionali.

#### Produzione scientifica

Descrizione Pubblicazioni valutabili Il candidato presenta 2 pubblicazioni ottenute nell'arco di tempo dal 2019 al 2022, oltre alla tesi di dottorato. Si contano 2 contributi su rivista scientifica, tenendo conto degli elenchi pubblicati dall'ANVUR il 9/2/2022 per l'Area 13 e con riferimento al settore D4. La produzione scientifica del candidato tratta modelli decisionali in contesti finanziari e modelli di asset pricing tenendo opportunamente conto del comportamento economico dell'investitore attraverso una funzione di ottimismo/pessimismo del decisore.

Giudizio La produzione scientifica è pienamente pertinente il settore concorsuale 13/D4 e risulta di buona qualità, ancorché limitata nel tempo. Nei lavori eseguiti in collaborazione l'apporto individuale è deducibile dal suo percorso formativo, dalla produzione complessiva e dalla tesi di dottorato.

#### **Giudizio complessivo**

La commissione, dopo aver esaminato titoli, curriculum e produzione scientifica del candidato, esprime un giudizio positivo sia sull'attività svolta che sulla produzione scientifica, atteso che quest'ultima appare limitata nel tempo.



Procedura pubblica di selezione per 1 posto di ricercatore universitario a tempo determinato, ai sensi dell'Art. 24, comma 3, Lett. a) della legge 240/2010, Dipartimento di Economia Aziendale dell'Università degli Studi Roma Tre, settore concorsuale 13 D/4, settore scientifico disciplinare SECS-S/06, il cui avviso è stato pubblicato sulla G.U. – IV Serie Speciale n. 33 del 26/04/2022

### **DICHIARAZIONE**

Il sottoscritto Prof. Paolo De Angelis, membro della Commissione Giudicatrice della procedura pubblica di selezione per 1 posto di ricercatore universitario a tempo determinato, Dipartimento di Economia Aziendale dell'Università degli Studi Roma Tre, settore concorsuale 13 D/4, settore scientifico disciplinare SECS-S/06, il cui avviso è stato pubblicato sulla G.U. – IV Serie Speciale n. 33 del 26/04/2022, con la presente dichiara di aver partecipato, via telematica, alla seconda riunione per la valutazione preliminare dei titoli e delle pubblicazioni dei candidati della suddetta procedura pubblica di selezione e di concordare con il verbale a firma del Prof. Lorenzo Lampariello, che sarà presentato agli uffici dell'Ateneo di Roma Tre, per i provvedimenti di conseguenza.

In fede

20/06/2022

F.to Prof. Paolo De Angelis

Procedura pubblica di selezione per 1 posto di ricercatore universitario a tempo determinato, ai sensi dell'Art. 24, comma 3, Lett. a) della legge 240/2010, Dipartimento di Economia Aziendale dell'Università degli Studi Roma Tre, settore concorsuale 13 D/4, settore scientifico disciplinare SECS-S/06, il cui avviso è stato pubblicato sulla G.U. – IV Serie Speciale n. 33 del 26/04/2022

### **DICHIARAZIONE**

La sottoscritto Prof.ssa Francesca Perla, membro della Commissione Giudicatrice della procedura pubblica di selezione per 1 posto di ricercatore universitario a tempo determinato, Dipartimento di Economia Aziendale dell'Università degli Studi Roma Tre, settore concorsuale 13 D/4, settore scientifico disciplinare SECS-S/06, il cui avviso è stato pubblicato sulla G.U. – IV Serie Speciale n. 33 del 26/04/2022, con la presente dichiara di aver partecipato, via telematica, alla seconda riunione per la valutazione preliminare dei titoli e delle pubblicazioni dei candidati della suddetta procedura pubblica di selezione e di concordare con il verbale a firma del Prof. Lorenzo Lampariello, che sarà presentato agli uffici dell'Ateneo di Roma Tre, per i provvedimenti di conseguenza.

In fede

20/06/2022

F.to Prof. Francesca Perla