

Procedura di chiamata ad 1 posto di professore universitario di ruolo, fascia degli ordinari, riservata a professori associati in servizio nell'Ateneo, ai sensi dell'Art. 24, c. 6 della L. 240/2010, Dipartimento di Economia Aziendale, settore concorsuale 13/D4 – Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie, S.S.D. SECS-S/06 – Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie

VERBALE N. 2

Alle ore 10:00 del giorno 26/07/2024 si è svolta la riunione in forma telematica tra i seguenti Professori:

- Prof.ssa Stefania Corsaro
- Prof. Sergio Scarlatti
- Prof. Andrea Scozzari

membri della Commissione nominata con D.R. n. 0059349 del 10/06/2024.

La Commissione, presa visione delle domande e della documentazione inviata, delle pubblicazioni effettivamente inviate, delle eventuali esclusioni operate dagli uffici e delle rinunce sino ad ora pervenute, decide che i candidati da valutare ai fini della procedura sono n. 1, e precisamente:

1. CESARONE Francesco.

I Commissari dichiarano di non avere relazioni di parentela ed affinità entro il 4° grado incluso con il candidato (art. 5 comma 2 D.lgs. 07.05.48 n. 1172).

Dichiarano, altresì, che non sussistono le cause di astensione di cui all'art. 51 c.p.c..

La Commissione, quindi, procede a visionare la documentazione che il candidato ha inviato presso l'Università degli Studi Roma Tre.

Vengono, dunque, prese in esame, solo le pubblicazioni corrispondenti all'elenco delle stesse allegato.

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.

Vengono esaminate le pubblicazioni del candidato Francesco CESARONE da parte di ciascun commissario, si procede all'esame del curriculum, dei titoli e delle pubblicazioni ai fini della formulazione dei singoli giudizi da parte degli stessi commissari; poi, ciascun Commissario formula il proprio giudizio individuale e la Commissione quello collegiale. I giudizi dei singoli commissari e quello collegiale sono allegati al presente verbale quale sua parte integrante (all. a).

Dal momento che vi è un unico candidato, la Commissione non formula giudizi comparativi.

Il Presidente invita la Commissione ad indicare il vincitore della procedura di chiamata.

Ciascun commissario esprime un voto positivo al candidato; pertanto la Commissione, all'unanimità dei componenti, indica il CANDIDATO Francesco CESARONE vincitore della procedura di chiamata per la copertura di n. 1 posto di Professore universitario di I fascia per il settore concorsuale 13/D4 – Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie, S.S.D. SECS-S/06 – Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie Dipartimento di Economia Aziendale.

Il Presidente, dato atto di quanto sopra invita la Commissione a redigere collegialmente la relazione in merito alla proposta di chiamata controllando gli allegati che ne fanno parte integrante; la relazione viene, infine, riletta dal Presidente ed approvata senza riserva alcuna dai Commissari, che la sottoscrivono.

La Commissione viene sciolta alle ore 10:40.

Roma, 26/07/2024

per la Commissione

- F.to Prof. Andrea Scozzari

ALLEGATO A)
Giudizi sui titoli e sulle pubblicazioni:

CANDIDATO: Francesco CESARONE.

Notizie biografiche

Il candidato è professore associato nel S.S.D. SECS-S/06 presso il Dipartimento di Economia Aziendale dell'Università degli Studi Roma Tre da novembre 2021; nel medesimo anno ha conseguito l'Abilitazione Scientifica Nazionale al ruolo di professore ordinario nel settore concorsuale 13/D4.

Attività didattica

Il candidato ha svolto gli insegnamenti e moduli di seguito elencati:

1. a.a. 2024-2025: Titolare del Corso di Metodi matematici per le decisioni economiche e aziendali (9 CFU - Laurea Magistrale) presso l'Università degli Studi Roma Tre, Scuola di Economia e Studi Aziendali.
2. dall'a.a. 2018-2019 al presente: Titolare del Corso di Financial Modeling (9 CFU – Laurea Magistrale percorso in inglese) presso l'Università degli Studi Roma Tre, Scuola di Economia e Studi Aziendali.
3. dall'a.a. 2013-2014 al presente: Titolare del Corso di Finanza Computazionale (9 CFU - Laurea Magistrale) presso l'Università degli Studi Roma Tre, Scuola di Economia e Studi Aziendali.
4. a.a. 2014-2015: Titolare del Corso di Matematica Finanziaria (8 CFU - Laurea Triennale) presso l'Università degli Studi della Tuscia.
5. a.a. 2011-2012 e 2012-2013: Titolare del Corso di Modelli Matematici dei Mercati Finanziari (9 CFU - Laurea Triennale) presso l'Università degli Studi di Roma Tre, Facoltà di Economia.
6. dall'a.a. 2010-2011 all'a.a. 2012-2013: Titolare di un modulo del Corso di Metodi matematici per le decisioni economiche e aziendali (9 CFU - Laurea Magistrale) presso l'Università degli Studi Roma Tre, Facoltà di Economia.
7. a.a. 2010-2011: Precorso di Matematica generale presso la Facoltà di Economia – Università degli Studi di Roma Tre - docenza a contratto.
8. dall'a.a. 2009-2010 all'a.a. 2013-2014: Corso integrativo di Ricerca Operativa nell'ambito dell'insegnamento di Metodi Quantitativi per il Management (9 CFU - Laurea Magistrale) presso la Facoltà di Economia - LUISS (Libera Università Internazionale degli Studi Sociali Guido Carli) - docenza a contratto.
9. dall'a.a. 2009-2010 all'a.a. 2012-2013: Esercitazioni di Matematica Finanziaria tramite Excel presso la Facoltà di Economia - LUISS (Libera Università Internazionale degli Studi Sociali Guido Carli) - docenza a contratto.

10. a.a. 2010-2011: Insegnamento di Gestione finanziaria e strumenti informatici per la previdenza - presso la Facoltà di Economia - Università di Roma "La Sapienza" - docenza a contratto.
11. a.a. 2008-2009 e 2009-2010: Insegnamento di Informatica 2 - Introduzione al Calcolo Finanziario tramite MATLAB presso la Facoltà di Economia - Università degli Studi di Roma Tre - docenza a contratto.
12. dall'a.a. 2007-2008 all'a.a. 2009-2010: Esercitazioni di Matematica Corso Base presso la Facoltà di Economia - Università di Roma "La Sapienza" - docenza a contratto.
13. a.a. 2008-2009: Corso integrativo di Teoria del Portafoglio nell'ambito dell'insegnamento di Metodi Quantitativi per il Management presso la Facoltà di Economia - LUISS (Libera Università Internazionale degli Studi Sociali Guido Carli) - docenza a contratto.
14. a.a. 2006-2007: Esercitazioni di Matematica Generale presso la Facoltà di Economia - Università di Roma "La Sapienza" - con assegno di collaborazione per attività didattico integrativa.

Il candidato ha svolto la seguente attività didattica nell'ambito del dottorato:

1. 25-26-27 ottobre 2022, PhD Course on Portfolio Optimization, Instituto Universitario de Investigación Matemática (IMUS) - Universidad de Sevilla.

Partecipa al collegio dei docenti del corso di dottorato in Mercati, Impresa e Consumatori dal 15-07-2016.

È stato tutor dei seguenti studenti di dottorato:

1. Supervisor della tesi di dottorato di Stefano Colucci (XXXI Ciclo, Università degli Studi di Roma Tre). Titolo: "Risk and asset management models: theoretical and practical aspects".
2. Supervisor della tesi di dottorato di Jacopo Maria Ricci (XXXII Ciclo, Università degli Studi di Roma Tre). Titolo: "Some New Perspectives on Portfolio Selection Models".
3. Supervisor della tesi di dottorato di Manuel Luis Martino (XXXVII Ciclo, Università degli Studi di Roma Tre).
4. Supervisor della tesi di dottorato di Francesca Luciani (XXXXI Ciclo, Università degli Studi di Roma Tre).

LAVORI SCIENTIFICI PRESENTATI:

1. R. Cequeti, F. Cesarone, V. Ficcadenti (2024), “Portfolio decision analysis for pandemic sentiment assessment based on finance and web queries”, *Annals of Operations Research*, pag. 1-31.
2. C. Ararat, F. Cesarone, M.C. Pinar, J.M. Ricci (2024), “MAD Risk Parity Portfolios”, *Annals of Operations Research*, pag. 1-26.
3. F. Cesarone, M.L. Martino, F. Tardella (2023), “Mean-Variance-VaR portfolios: MIQP formulation and performance analysis”, *OR Spectrum*, Vol. 45, pag. 1043-1069.
4. F. Bellini, F. Cesarone, C. Colombo, F. Tardella (2021), “Risk Parity with Expectiles”, *European Journal of Operational Research*, Vol. 291, pag. 1149-1163.
5. F. Cesarone, A. Scozzari, F. Tardella (2020). “An optimization-diversification approach to portfolio selection”, *Journal of Global Optimization*, Vol. 76, pag. 245-265, ISSN: 0925-5001.
6. F. Cesarone, S. Colucci (2018), “Minimum risk versus capital and risk diversification strategies for portfolio construction”, *Journal of the Operational Research Society*, Vol. 69, pag. 183-200.
7. R. Bruni, F. Cesarone, A. Scozzari, F. Tardella (2017), “On Exact and Approximate Stochastic Dominance Strategies for Portfolio Selection”, *European Journal of Operational Research*, Vol. 259(1), pag. 322-329, <http://dx.doi.org/10.1016/j.ejor.2016.10.006>. Classe A (Anvur, sc 13/D4).
8. F. Cesarone and F. Tardella (2017), “Equal Risk Bounding is better than Risk Parity for portfolio selection”, *Journal of Global Optimization*, Vol. 68(2), pag. 439-461.
9. R. Bruni, F. Cesarone, A. Scozzari, F. Tardella, (2015), “A Linear Risk-Return Model for Enhanced Indexation in Portfolio Optimization”, *OR Spectrum*, Vol. 37(3), pag. 735-759.
10. F. Cesarone, A. Scozzari, F. Tardella (2013), “A new method for Mean-Variance portfolio optimization with cardinality constraints”, *Annals of Operations Research*, Vol. 205(1), pag. 213–234.

ALTRI TITOLI

Il candidato ha diretto o partecipato ai gruppi di ricerca, nell’ambito di attività progettuali, di seguito elencati:

1. Partecipazione al progetto di ricerca PRIN 2022 PNRR (codice progetto: P2022NK39A, settore - SH1 linea intervento A) dal titolo: “Representation and Parliament Formation in democratic countries: fair procedures for equal and informed citizen. Dal 1-1-2024 a oggi.
2. Coordinatore e Responsabile Scientifico del Progetto di Ricerca relativo alla borsa di dottorato DM 118/2023 PNRR presso l'Università degli Studi Roma

- Tre, Dipartimento di Economia Aziendale. Titolo: “Sustainable and Resilient Finance”. Dal 01-01-2024 al 31-12-2026.
3. Coordinatore e Responsabile Scientifico del Progetto di Ricerca presso l’Università degli Studi Roma Tre, Dipartimento di Economia Aziendale. Titolo: “Sustainable Finance”. Dal 10-12-2022 al 10-12-2023.
 4. Coordinatore e Responsabile Scientifico del Progetto di Ricerca presso l’Università degli Studi Roma Tre, Dipartimento di Economia Aziendale. Titolo: “Quantitative Finance with Python”. Dal 10-12-2021 al 10-03-2022.
 5. Membro del progetto di ricerca PRIN 2017 (codice progetto: 20177WC4KE, settore - SH2 linea intervento A) dal titolo: “FinTech: the influence of enabling technologies on the future of the financial markets”. Dal 01-03-2020 a oggi.
 6. Coordinatore e Responsabile Scientifico del Progetto di Ricerca presso l’Università degli Studi Roma Tre, Dipartimento di Economia Aziendale. Titolo: “Risk Allocation for Portfolio Selection”. Dal 16-12-2019 al 16-05-2020.
 7. Coordinatore e Responsabile Scientifico del Progetto di Ricerca presso l’Università degli Studi Roma Tre, Dipartimento di Economia Aziendale. Titolo: “Portfolio Selection and Efficient Frontiers”. Dal 01-03-2016 al 01-07-2016.
 8. Membro del Progetto di Ricerca “Ricerche Universitarie” (2015) Sapienza, Università di Roma. Titolo: “La selezione di portafoglio: ottimizzazione, diversificazione e valutazione delle performance”. Le date specificate devono intendersi approssimative. Dal 01-10-2015 al 01-03-2017.
 9. Coordinatore e Responsabile Scientifico del Progetto di Ricerca presso l’Università degli Studi Roma Tre, Dipartimento di Economia Aziendale. Titolo: “Risk Diversification Strategies for Portfolio Construction”. Dal 02-03-2015 al 01-07-2015.
 10. Membro del Progetto di Ricerca “Ricerche Universitarie” (2014) Sapienza, Università di Roma. Titolo: “Indicatori e modelli per l’analisi della concentrazione nei mercati finanziari”. Le date specificate devono intendersi approssimative. Dal 21-11-2014 al 2016.
 11. Coordinatore e Responsabile Scientifico del Progetto di Ricerca presso l’Università degli Studi Roma Tre, Dipartimento di Studi Aziendali. Titolo: “Risk Parity approach for Portfolio Selection”. Dal 03-03-2014 al 01-07-2014.
 12. Membro del Progetto di Ricerca “Ricerche Universitarie” (2013) Sapienza, Università di Roma. Titolo: “Stabilità nei mercati finanziari: analisi, modelli ed algoritmi”. Dal 09-12-2013 al 08-06-2015.
 13. Membro del Progetto di Ricerca “Ricerche Universitarie” (2011) Sapienza, Università di Roma. Titolo: “Modelli di ottimizzazione in finanza”. Le date specificate devono intendersi approssimative. Dal 01-01-2011 al 31-12-2012.
 14. Coordinatore e Responsabile Scientifico del Progetto di Ricerca presso l’Università degli Studi Roma Tre, Dipartimento di Economia. Titolo: “Modelli di selezione di portafogli azionari” (2012).
 15. Membro del Progetto di Ricerca “Ricerche Universitarie” (2011) Sapienza, Università di Roma. Titolo: “Algoritmi di ottimizzazione al servizio del legislatore: procedure corrette ed efficienti per l’allocazione dei seggi nei sistemi

- elettorali biproporzionali”. Le date specificate devono intendersi approssimative. Dal 01-01-2011 al 31-12-2012.
16. Titolare di un contratto di collaborazione coordinata e continuativa per lo “Sviluppo di algoritmi efficienti per la risoluzione di problemi di selezione di portafoglio computazionalmente difficili” nell’ambito della ricerca “Ottimizzazione discreta: nuovi trend applicativi nelle discipline economiche, finanziarie e sociali” presso il Dipartimento di Statistica, Probabilità e Statistiche Applicate, Università di Roma “La Sapienza”. Dal 01-06-2010 al 15-08-2010.
 17. Membro del Progetto di ricerca CASPUR “Standard HPC Grant 2010” Titolo: “Algoritmi Paralleli per problemi di scelta di portafoglio computazionalmente difficili”. Dal 01-01-2010 al 31-12-2010.
 18. Membro del Progetto di Ricerca “Ricerche Universitarie” (2010) Sapienza, Università di Roma. Titolo: “Analisi e ottimizzazione di portafogli e di reti azionarie”. Le date specificate devono intendersi approssimative Dal 01-01-2010 al 31-12-2011.
 19. Membro del Progetto di Ricerca “Ricerche Universitarie” (2008) Università di Roma “La Sapienza” Titolo: “Modelli di ottimizzazione e di matematica discreta per la finanza e la previdenza”. Le date specificate devono intendersi approssimative. Dal 01-01-2008 al 31-12-2010.

Ha partecipato al comitato organizzatore delle seguenti conferenze:

1. Aprile 2023: ORGANIZZAZIONE del convegno “XXIV Workshop on Quantitative Finance (QFW2023)”, Gaeta, Italia.
2. Gennaio 2018: ORGANIZZAZIONE del convegno “XIX Workshop on Quantitative Finance (QFW2018)”, Roma, Italia.
3. Maggio 2009: membro del comitato organizzativo per l’International Conference NET2009 evolution and complexity and COST-ESF workshop on Physics of Competition and Conflicts, Roma, Italia.

Partecipa, inoltre, al comitato scientifico del Workshop on Quantitative Finance, che si svolge con cadenza annuale, dal 2018.

E’ stato relatore nei seguenti convegni nazionali e internazionali:

1. “GREEN FINANCE 2024” con una comunicazione dal titolo “Managing ESG Ratings Disagreement in Sustainable Portfolio Selection”, Milano, Italia. Dal 01-02-2024 al 02-02-2024.
2. “1st ADRiO and 68th EWGCFM Conferences” con una comunicazione dal titolo “New approximate stochastic dominance approaches for Enhanced Indexation models”, Abu Dhabi, Emirati Arabi Uniti. Dal 04-12-2023 al 08-12-2023.
3. “AMASES 2023” con una comunicazione dal titolo “New approximate stochastic dominance approaches for Enhanced Indexation models”, Milano, Italia. Dal 20-09-2023 al 22-09-2023.

4. “V Riunione Scientifica del Dipartimento di Scienze Sociali ed Economiche – Sapienza Università di Roma” con una comunicazione dal titolo “Portfolio decision analysis for pandemic sentiment assessment based on finance and web queries”, Roma, Italia. Dal 29-05-2023 al 31-05-2023.
5. “XXIV Workshop on Quantitative Finance” con una comunicazione dal titolo “New approximate stochastic dominance approaches for Enhanced Indexation models”, Gaeta, Italia. Dal 20-04-2023 al 22-04-2023.
6. “XXIII Workshop on Quantitative Finance” con una comunicazione dal titolo “Maximum risk diversification for portfolio selection”, Roma, Italia. Dal 31-03-2022 al 01-04-2022.
7. “VI Workshop in Finance and Markets - 2022” con una comunicazione dal titolo “Risk diversification models and applications to portfolio selection”, Bari, Italia. Dal 06-05-2022 al 09-05-2022.
8. “AMASES 2021” con una comunicazione dal titolo “Maximum risk diversification for portfolio selection”, “Distributed” Remote Mode. Dal 15-09-2017 al 18-09-2021.
9. “31st European Conference on Operational Research” con una comunicazione dal titolo “Maximum risk diversification for portfolio selection”, Atene, Grecia. Dal 11-07-2021 al 14-07-2021.
10. “Finance in the Dynamic Network Society & Small Island Economies - FIDNES2019” con una comunicazione dal titolo “Z-score vs Markowitz preselection for constructing small portfolios”, Curacao. Dal 07-11-2019 al 09-11-2019.
11. “International Conference on Optimization and Decision Science - ODS2019” con una comunicazione dal titolo “Risk Parity with Expectiles”, Genova, Italia. Dal 04-09-2019 al 07-09-2019.
12. “30th European Conference on Operational Research” con una comunicazione dal titolo “Risk Parity with Expectiles”, Dublino, Irlanda. Dal 23-06-2019 al 26-06-2019.
13. “UCL-Rome Workshop on Stochastic and Partial Differential Equation Methods in Finance and Economics” con una comunicazione dal titolo “Risk Parity with Expectiles”, Roma, Italia. Dal 23-01-2019 al 25-01-2019.
14. “XX Workshop on Quantitative Finance” con una comunicazione dal titolo “Risk Parity with Expectiles”, Zurigo, Svizzera. Dal 23-01-2019 al 25-01-2019.
15. “29th European Conference on Operational Research” con una comunicazione dal titolo “On the stability of portfolio selection models”, Valencia, Spagna. Dal 08-07-2018 al 11-07-2018.
16. “AMASES 2017” con una comunicazione dal titolo “Diversified Optimal Portfolios: a new approach to portfolio selection”, Cagliari, Italia. Dal 14-09-2017 al 16-09-2017.
17. “Innovations in Insurance, Risk- and Asset Management” con una comunicazione dal titolo “Joining Diversification and Optimization for Asset Allocation”, Monaco, Germania. Dal 05-04-2017 al 07-04-2017.

18. "XVIII Workshop on Quantitative Finance" con una comunicazione dal titolo "Diversification+Optimization=Portfolio Selection", Milano, Italia. Dal 25-01-2017 al 27-01-2017.
19. "International Rome Conference on Money, Banking and Finance XXV Edition" con una comunicazione dal titolo "Improving the Risk Parity Approach to Portfolio Selection", Roma, Italia. Dal 01-12-2016 al 02-12-2016.
20. "AMASES 2016" con una comunicazione dal titolo "Exact and Approximate Stochastic Dominance for Portfolio Selection", Catania, Italia. Dal 15-09-2016 al 17-09-2016.
21. "XVII Workshop on Quantitative Finance" con una comunicazione dal titolo "On Exact and Approximate Stochastic Dominance Strategies for Portfolio Selection", Pisa, Italia. Dal 28-01-2016 al 29-01-2016.
22. "XVI Workshop on Quantitative Finance" con una comunicazione dal titolo "Does Greater Diversification Really Improve Performance in Portfolio Selection?", Parma, Italia. Dal 29-01-2015 al 30-01-2015.
23. "XV Workshop on Quantitative Finance" con una comunicazione dal titolo "Risk Bounding is better than Risk Parity for portfolio selection", Firenze, Italia. Dal 23-01-2014 al 24-01-2014.
24. "26th European Conference on Operational Research" con una comunicazione dal titolo "Risk disparity is better than risk parity for portfolio selection", Roma, Italia. Dal 01-07-2013 al 04-07-2013.
25. "XIV Workshop on Quantitative Finance" con una comunicazione dal titolo "A Practically Realizable Strong Stochastic Dominance Model for Enhanced Indexation", Rimini, Italia. Dal 24-01-2013 al 25-01-2013.
26. "25th European Conference on Operational Research" con una comunicazione dal titolo "A Risk-Return Approach to Enhanced Indexation", Vilnius, Lithuania. Dal 08-07-2012 al 11-07-2012.
27. "XIII Workshop on Quantitative Finance" con una comunicazione dal titolo "A Linear Risk-Return Model for Enhanced Indexation", L'Aquila, Italia. Dal 26-01-2012 al 27-01-2012.
28. "24th European Conference on Operational Research" con una comunicazione dal titolo "A new portfolio selection approach: Models and Algorithms", Lisbona, Portogallo. Chair della sessione Financial Optimization. Dal 11-07-2010 al 14-07-2010.
29. "5th Annual Meeting of the European Meteorological Society" con una comunicazione dal titolo "Mediterranean Jetstream and Mediterranean Winter Anomalies", Utrecht, the Netherlands. Dal 12-09-2005 al 16-09-2005.
30. "5th International Walnut Symposium" con una comunicazione dal titolo "Mitigation and Recover of Semi-Arid and Arid Regions in China", Sant'Agello di Sorrento (Napoli), Italia. Dal 09-11-2004 al 13-11-2004.

Giudizi individuali:

-Commissario Stefania CORSARO

Il curriculum del candidato mostra una attività scientifica intensa, continua e pienamente coerente con le tematiche di interesse per il settore concorsuale 13/D4, comprovata anche da pubblicazioni di elevata qualità per collocazione, innovatività e rigore metodologico. Tutti i lavori presentati sono collocati su riviste di classe A per il settore concorsuale 13/D4. Le tematiche di ricerca riguardano prevalentemente lo sviluppo di modelli e algoritmi per la risoluzione del problema di selezione di portafoglio. Il candidato ha partecipato in qualità di relatore a numerosi convegni nazionali e internazionali di interesse per il SC oggetto della presente procedura, e ha partecipato, anche in qualità di responsabile scientifico, a numerosi progetti di ricerca. Complessivamente, l'attività scientifica del candidato è ottima.

Molto buona l'attività didattica, che comprende numerosi corsi istituzionali, erogati nell'ambito di corsi di laurea triennali e magistrali, nonché attività di tutoraggio nell'ambito del dottorato.

-Commissario Sergio SCARLATTI

Il curriculum presentato dal candidato Francesco CESARONE certifica una intensa attività didattica continuativa a partire dal 2006 fino all'anno corrente, attività che si è esplicitata in vari corsi universitari, inerenti tematiche del settore concorsuale in questione, a livello sia di laurea triennale che magistrale. Inoltre anche a livello di dottorato si evince un doppio impegno sia come tutor che come partecipante al relativo collegio dei docenti. Giudizio: MOLTO BUONO

Per quanto concerne l'attività scientifica, dai titoli presentati risulta evidente una linea di ricerca incentrata sulla selezione e gestione dei portafogli finanziari, basata sulla considerazione, conoscenza e miglioramento degli approcci più moderni presenti nel panorama di ricerca internazionale, con attenzione all'implementazione dei risultati ottenuti attraverso l'utilizzo di differenti dataset finanziari. Le pubblicazioni presentate sono posizionate in riviste internazionali di alto livello. Giudizio: ECCELLENTE.

-Commissario Andrea SCOZZARI

Il candidato Francesco CESARONE ha svolto una ricca, differenziata e continua attività didattica a partire dall'a.a. 2006-2007 e ha regolarmente fatto parte di commissioni di esami di profitto. Ha, inoltre, svolto una notevole attività di tutoraggio, in particolare, a studenti del dottorato in Mercati, Impresa e Consumatori presso l'Università Roma Tre di cui è anche membro del collegio dei docenti dal 15-07-2016. Nel periodo 25-26-27 ottobre 2022, ha svolto un corso di dottorato su "Portfolio

Optimization” presso l’Università di Siviglia. L’attività didattica nel suo complesso viene pertanto giudicata OTTIMA.

L’attività di ricerca del candidato si è espletata prevalentemente nel campo dell’Ottimizzazione finanziaria e nei problemi di Selezione di Portafoglio. In particolare, per la presente valutazione, ha presentato 10 articoli tutti pubblicati su riviste di fascia A per il SC 13/D4. Nell’ambito della sua attività di ricerca il candidato ha diretto o partecipato a numerosi gruppi di ricerca; molto rilevante risulta anche l’organizzazione di conferenze e workshop sia nazionali che internazionali. Pertanto, l’attività scientifica nel suo complesso viene giudicata ECCELLENTE.

Giudizio collegiale:

CANDIDATO: Francesco CESARONE.

L’attività scientifica del candidato riguarda prevalentemente lo sviluppo di modelli matematici e algoritmi risolutivi per il problema di selezione di portafoglio. L’attività di ricerca è pienamente coerente con il SC 13/D4 ed è valutata OTTIMA dalla Commissione.

L’attività didattica, intensa e continua, è pienamente coerente con il SC 13/D4 e valutata MOLTO BUONA dalla Commissione.

ALLEGATO B)
Giudizi comparativi della Commissione:

Dal momento che vi è un unico candidato, la Commissione non formula giudizi comparativi.

Il presente documento, conforme all'originale, è conservato nell'Archivio dell'Ufficio Reclutamento Personale Docente e Ricercatore.

ALLEGATO 2)

RELAZIONE della commissione giudicatrice della procedura di chiamata ad 1 posto di professore universitario di ruolo, fascia degli ordinari, riservata a professori associati in servizio nell'Ateneo, ai sensi dell'Art. 24, c. 6 della L. 240/2010, Dipartimento di Economia Aziendale, settore concorsuale 13/D4 – Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie, S.S.D. SECS-S/06 – Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie.

La commissione giudicatrice per la procedura di chiamata ad 1 posto di professore universitario di ruolo, fascia degli ordinari, si è riunita nei seguenti giorni ed orari:

I riunione: giorno 03/07/2024 dalle ore 10:00 alle ore 10:45;

II riunione: giorno 26/07/2024 dalle ore 10:00 alle ore 10:40.

La Commissione ha tenuto complessivamente n. 2 riunioni iniziando i lavori il 03/07/2024 e concludendoli il 26/07/2024.

- Nella prima riunione la commissione ha stabilito i criteri;
- nella seconda riunione la commissione ha valutato i candidati ed ha indicato il candidato vincitore.

La Commissione redige la seguente relazione in merito alla proposta di chiamata del Prof. Francesco CESARONE vincitore della procedura di chiamata ad 1 posto di professore universitario di ruolo, fascia degli ordinari, Dipartimento di Economia Aziendale settore concorsuale 13/D4 – Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie, S.S.D. SECS-S/06 – Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie.

Il candidato è professore associato nel S.S.D. SECS-S/06 presso il Dipartimento di Economia Aziendale dell'Università degli Studi Roma Tre da novembre 2021; nel medesimo anno ha conseguito l'Abilitazione Scientifica Nazionale al ruolo di professore ordinario nel settore concorsuale 13/D4. L'attività di ricerca, intensa e continua, riguarda prevalentemente il problema di selezione di portafoglio. Il candidato è autore di 49 pubblicazioni scientifiche; ha partecipato, anche in qualità di responsabile scientifico, a numerosi progetti di ricerca ed è stato relatore a convegni nazionali e internazionali contribuendo anche in qualità di membro del comitato organizzatore e scientifico; i 10 lavori presentati alla seguente procedura sono tutti pubblicati su riviste di classe A per il SC 13/D4.

L'attività didattica, iniziata nell'a.a. 2006/07, comprende numerosi insegnamenti, coerenti con il SSD SECS-S/06, erogati nell'ambito di corsi di laurea triennale e magistrale. Inoltre, il candidato è stato *supervisor* di tesi di dottorato nell'ambito del Dottorato in "Mercati, Impresa e Consumatori" dell'Università degli Studi Roma Tre; è membro del collegio dei docenti del medesimo dottorato dal 15 luglio 2016.

Il Prof. Andrea Scozzari Presidente della presente Commissione si impegna a inviare tutti gli atti concorsuali (verbali delle singole riunioni, dei quali costituiscono parte integrante i giudizi individuali e collegiali espressi su ciascun candidato, e la presente relazione), al Responsabile del Procedimento.

La Commissione viene sciolta alle ore 10:40.

Roma, 26/07/2024

per la Commissione

- F.to Prof. Andrea Scozzari

Procedura di chiamata ad 1 posto di professore universitario di I fascia, Dipartimento di Economia Aziendale dell'Università degli Studi di Roma Tre, settore concorsuale 13/D4 – Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie, S.S.D. SECS-S/06 – Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie, riservata a professori associati in servizio nell'Ateneo, ai sensi dell'Art. 24, c. 6 della L. 240/2010, il cui avviso è stato pubblicato all'Albo Pretorio di Ateneo il 02/05/2024.

DICHIARAZIONE

Il sottoscritto Prof. Sergio Scarlatti, membro della Commissione Giudicatrice della procedura di chiamata ad 1 posto di professore universitario di I fascia, Dipartimento di Economia Aziendale dell'Università degli Studi di Roma Tre, settore concorsuale 13/D4 – Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie, S.S.D. SECS-S/06 – Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie, riservata a professori associati in servizio nell'Ateneo, ai sensi dell'Art. 24, c. 6 della L. 240/2010, il cui avviso è stato pubblicato all'Albo Pretorio di Ateneo il 02/05/2024, con la presente dichiara di aver partecipato, in via telematica, alla suddetta procedura di chiamata e di concordare con il verbale a firma del Prof. Andrea Scozzari, che sarà presentato agli uffici dell'Ateneo di Roma Tre, per i provvedimenti di conseguenza.

In fede

Data 26 luglio 2024

F.to Prof. Sergio Scarlatti

Procedura di chiamata ad 1 posto di professore universitario di I fascia, Dipartimento di Economia Aziendale dell'Università degli Studi di Roma Tre, settore concorsuale 13/D4 – Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie, S.S.D. SECS-S/06 – Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie, riservata a professori associati in servizio nell'Ateneo, ai sensi dell'Art. 24, c. 6 della L. 240/2010, il cui avviso è stato pubblicato all'Albo Pretorio di Ateneo il 02/05/2024.

DICHIARAZIONE

La sottoscritta Prof.ssa Stefania Corsaro, membro della Commissione Giudicatrice della procedura di chiamata ad 1 posto di professore universitario di I fascia, Dipartimento di Economia Aziendale dell'Università degli Studi di Roma Tre, settore concorsuale 13/D4 – Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie, S.S.D. SECS-S/06 – Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie, riservata a professori associati in servizio nell'Ateneo, ai sensi dell'Art. 24, c. 6 della L. 240/2010, il cui avviso è stato pubblicato all'Albo Pretorio di Ateneo il 02/05/2024, con la presente dichiara di aver partecipato, in via telematica, alla suddetta procedura di chiamata e di concordare con il verbale a firma del Prof. Andrea Scozzari, che sarà presentato agli uffici dell'Ateneo di Roma Tre, per i provvedimenti di conseguenza.

In fede

Data 26 luglio 2024

F.to Prof.ssa Stefania Corsaro