

## UNIVERSITA' DEGLI STUDI DI PADOVA

Procedura selettiva 2022PO183 – allegato 22 per la chiamata di n. 1 posto di Professore di prima fascia presso il Dipartimento di Matematica "Tullio Levi-Civita" - DM per il settore concorsuale 13/D4 - METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCIENZE ATTUARIALI E FINANZIARIE (profilo: settore scientifico disciplinare SECS-S/06 - METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCIENZE ATTUARIALI E FINANZIARIE), ai sensi dell'art. 18 comma 1 legge 240/2010, bandita con Decreto Rettorale n. 94611 del 23/05/2022.

### VERBALE N. 3

La Commissione giudicatrice della procedura selettiva di cui sopra composta da:

Prof. Achille Basile professore di prima fascia presso l'Università degli Studi di Napoli "Federico II", Prof. Martino Grasselli professore di prima fascia presso l'Università degli Studi di Padova, Prof.ssa Simona Sanfelici professoressa di prima fascia presso l'Università degli Studi di Parma,

si riunisce il giorno 18 novembre 2022 alle ore 10:00 in forma telematica con le seguenti modalità: posta elettronica e videoconferenza (Zoom – ID riunione: 86403965467, basile@unina.it, simona.sanfelici@unipr.it, martino.grasselli@unipd.it), per esprimere un motivato giudizio, in conformità ai criteri formulati nel verbale n. 1, sulle pubblicazioni scientifiche, sul curriculum, comprensivo di attività di ricerca, attività istituzionali, organizzative, gestionali, di servizio e di terza missione, sull'attività didattica, didattica integrativa e di servizio agli studenti, in conformità agli standard qualitativi di cui al Titolo IV del Regolamento.

La commissione procede altresì secondo le modalità definite nel bando, all'accertamento della qualificazione scientifica e delle competenze linguistiche relative alla lingua straniera indicata nel bando. Non sono presenti candidati stranieri.

Constatato che sono trascorsi almeno 7 giorni dalla pubblicizzazione dei criteri, la Commissione può legittimamente proseguire i lavori.

La Commissione dichiara che sono pervenute le rinunce da parte dei due candidati:

Prof. Federico Salvatore, Prot. N. 0178529 del 26/09/2022,

Prof. Davide La Torre, Prot. n. 0222254 del 16/11/2022.

La Commissione prende in esame tutta la documentazione inviata telematicamente.

La Commissione stabilisce e precisa che, al fine di effettuare la valutazione dei candidati, prenderà in considerazione e valuterà esclusivamente la documentazione relativa a titoli, pubblicazioni e curriculum vitae caricata dai candidati sulla piattaforma PICA ed in essa visibile e residente. In particolare, non verranno utilizzate informazioni reperibili sulle pagine web alle quali il candidato abbia inserito link nel curriculum allegato alla domanda, se non reperibili nella domanda stessa.

La Commissione accerta che il numero di pubblicazioni inviate dai candidati non è superiore a quello massimo indicato all'allegato n. **2022PO183 – ALLEGATO 22** del bando e cioè 15.

I candidati da valutare nella presente procedura selettiva risultano pertanto i seguenti:

1. CASSESE GIANLUCA
2. FONTANA CLAUDIO
3. GNECCO GIORGIO STEFANO
4. GNOATTO ALESSANDRO
5. GROSSET LUCA
6. SGARRA CARLO
7. VARGIOLU TIZIANO

La Commissione dichiara che tutti i titoli relativi agli elementi oggetto di valutazione e tutte le pubblicazioni presentate da ciascun candidato sono valutabili.

Il Presidente ricorda che le pubblicazioni redatte in collaborazione con i membri della Commissione o con terzi devono essere valutate sulla base dei criteri individuati nella prima riunione.

Il prof. Martino Grasselli ha i seguenti 6 lavori in comune tra i 15 presentati dal candidato Prof. Alessandro Gnoatto:

General closed form basket option pricing bounds, (with R. Caldana, G. Fusai and M. Grasselli), *Quantitative Finance*, 16(4) (2015) 535-554

Analytic pricing of volatility-equity option within Wishart-based stochastic volatility models, (with J. Da Fonseca and M. Grasselli), *Operations Research Letters*, (43) (2015) 601-607

An affine multicurrency model with stochastic volatility and stochastic interest rates, (with M. Grasselli), *SIAM Journal on Financial Mathematics*, 5(1) (2014) 493-531

The explicit Laplace transform for the Wishart process, (with M. Grasselli), *Journal of Applied Probability* 51(3) (2014) 640-656

Smiles all around: FX joint calibration in a multi-Heston model, (with A. De Col and M. Grasselli), *Journal of Banking and Finance* 37(10) (2013) 3799-3818

A flexible matrix Libor model with smiles, (with J. Da Fonseca and M. Grasselli), *Journal of Economic Dynamics and Control* 37(4) (2013) 774-793

La Commissione sulla scorta delle dichiarazioni del prof. Martino Grasselli delibera di ammettere all'unanimità le pubblicazioni in questione alla successiva fase del giudizio di merito.

Per i lavori in collaborazione con terzi la Commissione rileva, in base ai criteri predeterminati al verbale n. 1, che i contributi scientifici dei candidati sono enucleabili e distinguibili e all'unanimità delibera di ammettere alla successiva valutazione di merito tutti i lavori dei candidati.

Nell'effettuare la valutazione preliminare comparativa dei candidati la Commissione 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 l'esclusione di note interne o rapporti dipartimentali quando privi di un codice internazionale ISSN o ISBN.

La Commissione esprime per ciascun candidato un motivato giudizio sulle pubblicazioni scientifiche, sul curriculum, comprensivo di attività di ricerca, attività istituzionali, organizzative, gestionali, di servizio e di terza missione, sull'attività didattica, didattica integrativa e di servizio agli studenti e sull'attività assistenziale se prevista, secondo i criteri e gli indicatori stabiliti nel verbale n. 1. La Commissione inoltre esprime una valutazione comparativa dei candidati, formulando un giudizio complessivo su ogni candidato (allegato Giudizi).

La seduta termina alle ore 13:00.

Il presente verbale è letto e approvato seduta stante da tutti i componenti della commissione che dichiarano di concordare con quanto verbalizzato.

Padova, 18 novembre 2022.

Il Presidente della commissione

Prof. Martino Grasselli presso l'Università degli Studi di Padova

Prof. Achille Basile presso l'Università degli Studi di Napoli "Federico II"

Prof.ssa Simona Sanfelici presso l'Università degli Studi di Parma

\*Firmato digitalmente ai sensi del D.Lgs. n. 82/2005\*