

UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI PADOVA

Procedura selettiva 2023PO183 - Allegato **10** per la chiamata di n. **1** professore di prima fascia presso il Dipartimento di Matematica "Tullio Levi-Civita" per il settore concorsuale **01/A3 Analisi Matematica, Probabilità e Statistica Matematica** (profilo: settore scientifico disciplinare **MAT/06 – Probabilità e Statistica Matematica**) ai sensi dell'art.18, comma 1, Legge 240/2010, bandita con Decreto Rettorale n. **2164** del **24 maggio 2023**

VERBALE N. 3

La Commissione giudicatrice composta da:

Prof. Marco Ferrante	professore di prima fascia presso l'Università degli Studi di Padova
Prof. Andrea Pascucci	professore di prima fascia presso ALMA MATER STUDIORUM – Università di Bologna
Prof.ssa Luisa Beghin	professoressa di prima fascia presso Sapienza Università di Roma

si riunisce il giorno **14 settembre 2023** alle ore **14:00** in forma telematica con le seguenti modalità: riunione ZOOM (Meeting ID: 598 175 8564). E-Mail ufficiali dei commissari: marco.ferrante@unipd.it, andrea.pascucci@unibo.it, luisa.beghin@uniroma1.it

per esprimere un motivato giudizio in conformità ai criteri formulati nel Verbale 1, su:

- pubblicazioni scientifiche
- attività didattica, didattica integrativa, servizi agli studenti
- attività di ricerca, produzione scientifica complessiva, attività istituzionali, organizzative, gestionali, di servizio, in quanto pertinenti al ruolo
- attività di terza missione, impatto sulla società, imprenditorialità scientifica, trasferimento tecnologico, in quanto pertinenti al ruolo
- attività assistenziali, se rilevanti

La Commissione procederà altresì secondo le modalità definite nel bando, all'accertamento della qualificazione scientifica e delle competenze linguistiche.

La Commissione stabilisce e precisa che, al fine di effettuare la valutazione, prenderà in considerazione e valuterà esclusivamente la documentazione caricata nella piattaforma PICA ed in essa visibile e residente. In particolare, non verranno utilizzate informazioni reperibili sulle pagine web raggiungibili tramite link inseriti nel curriculum allegato alla domanda, se non reperibili nella domanda stessa.

Nell'effettuare la valutazione preliminare comparativa 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.

Ai fini della valutazione delle attività di cui alle lettere b), c), d), e) si terrà conto di quanto riportato nel curriculum vitae.

La Commissione dichiara che non sono pervenute rinunce da parte delle candidate e dei candidati.

I componenti della Commissione hanno visualizzato sulla piattaforma PICA la documentazione trasmessa dai candidati ai fini della partecipazione alla predetta procedura selettiva.

La Commissione accerta che il numero di pubblicazioni inviate non è superiore a quello massimo indicato all'allegato al bando e cioè 15.

I candidati da valutare nella presente procedura selettiva risultano pertanto:

FISCHER Markus
FONTANA Claudio
PAGLIARANI Stefano

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

Il Prof. Andrea Pascucci ha in comune:
con il Dott. Stefano PAGLIARANI i lavori:

- n. 1 titolo: On the Stochastic Magnus Expansion and Its Application to SPDEs.
apporto individuale del candidato paritetico a quello degli altri coautori
- n. 3 titolo: Local densities for a class of degenerate diffusions.
apporto individuale del candidato paritetico a quello degli altri coautori
- n. 6 titolo: The exact Taylor formula of the implied volatility.
apporto individuale del candidato paritetico a quello degli altri coautori
- n. 7 titolo: Intrinsic Taylor formula for Kolmogorov-type homogeneous groups.
apporto individuale del candidato paritetico a quello degli altri coautori
- n. 8 titolo: Explicit implied volatilities for multifactor local-stochastic volatility models.
apporto individuale del candidato paritetico a quello degli altri coautori
- n. 10 titolo: A family of density expansions for Lévy-type processes.
apporto individuale del candidato paritetico a quello degli altri coautori
- n. 12 titolo: Approximations for Asian options in local volatility models
apporto individuale del candidato paritetico a quello degli altri coautori
- n. 14 titolo: Adjoint expansions in local Lévy models.
apporto individuale del candidato paritetico a quello degli altri coautori
- n. 15 titolo: Analytical expansions for parabolic equations.
apporto individuale del candidato paritetico a quello degli altri coautori

La Commissione, sulla scorta delle dichiarazioni del Prof. Andrea PASCUCCI delibera all'unanimità di ammettere alla successiva fase del giudizio di merito le pubblicazioni in questione.

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

La Commissione esprime per ciascuna candidata e ciascun candidato un motivato giudizio sulle pubblicazioni scientifiche, sull'attività di didattica, didattica integrativa, servizi agli studenti, sulle attività di ricerca, produzione scientifica complessiva, attività istituzionali, organizzative, gestionali, di servizio, in quanto pertinenti al ruolo, sulle attività di terza missione, impatto sulla società, imprenditorialità scientifica, trasferimento tecnologico, in quanto pertinenti al ruolo e sulle attività assistenziali, se rilevanti, secondo i criteri e gli indicatori stabiliti nel Verbale 1.

CANDIDATO: FISCHER Markus

A) PUBBLICAZIONI SCIENTIFICHE

L'attività di ricerca, nell'ambito del controllo stocastico, i principi di grandi deviazioni e i giochi a campo medio è documentata da una ottima e consistente produzione scientifica. Presenta 15 pubblicazioni, tutte pienamente congruenti col settore concorsuale 01/A3 e il settore scientifico disciplinare MAT/06. Il livello di originalità, innovatività e rigore metodologico è mediamente molto buono. La rilevanza scientifica della collocazione editoriale è mediamente molto buona, con alcune collocazioni ottime. Presenta 2 lavori a nome singolo e 13 lavori in collaborazione con altri autori.

B) ATTIVITÀ DIDATTICA, DIDATTICA INTEGRATIVA, SERVIZI AGLI STUDENTI

Il candidato presenta un'attività didattica ampia e continuativa come titolare di insegnamenti a livello di laurea e laurea magistrale, più alcuni insegnamenti a livello di Scuola di Dottorato. È stato relatore di 15 tesi di laurea magistrale, relatore o correlatore di 3 tesi di dottorato. Non presenta valutazioni degli studenti.

C) ATTIVITÀ DI RICERCA, PRODUZIONE SCIENTIFICA COMPLESSIVA, ATTIVITÀ ISTITUZIONALI, ORGANIZZATIVE, GESTIONALI, DI SERVIZIO

Responsabile di 1 progetto di ricerca finanziato italiano e partecipante a 1 progetto di ricerca finanziato nazionale. Non presenta premi e/o riconoscimenti nazionali e/o internazionali. Ottima e intensa attività seminariale su invito, sia internazionale che nazionale. Molto buona e continua nel tempo la consistenza complessiva della produzione scientifica dimostrata dai due indicatori H-index pari a 12 e Citazioni totali pari a 427 (Scopus - 14 settembre 2023). Limitata attività organizzativa, gestionale e di servizio, pienamente coerente con il ruolo ricoperto.

D) ATTIVITÀ DI TERZA MISSIONE, IMPATTO SULLA SOCIETÀ, IMPRENDITORIALITÀ SCIENTIFICA, TRASFERIMENTO TECNOLOGICO, IN QUANTO PERTINENTI AL RUOLO

Il candidato non certifica rilevanti attività di terza missione.

ACCERTAMENTO QUALIFICAZIONE SCIENTIFICA E COMPETENZE LINGUISTICHE

a) giudizio sulla qualificazione scientifica: sulla base del curriculum, dei titoli e delle pubblicazioni presentate il livello scientifico del candidato è **molto buono**.

b) giudizio sulle competenze linguistiche relative alla lingua straniera indicata nel bando: competenze **ottime**.

CANDIDATO: FONTANA Claudio

A) PUBBLICAZIONI SCIENTIFICHE

L'attività di ricerca, nell'ambito delle applicazioni dei modelli stocastici in Finanza, gestione del rischio e arbitraggio, è documentata da una ottima e consistente produzione scientifica. Presenta 15 pubblicazioni, tutte pienamente congruenti col settore concorsuale 01/A3 e il settore scientifico disciplinare MAT/06. Il livello di originalità, innovatività e rigore metodologico è mediamente molto buono. La rilevanza scientifica della collocazione editoriale è mediamente molto buona. Presenta 3 lavori a nome singolo e 12 lavori in collaborazione con altri autori.

B) ATTIVITÀ DIDATTICA, DIDATTICA INTEGRATIVA, SERVIZI AGLI STUDENTI

Il candidato presenta un'attività didattica ampia e continuativa come titolare di insegnamenti a livello di laurea e laurea magistrale, più alcuni insegnamenti a livello più avanzato. È stato relatore di 26 tesi di laurea magistrale, relatore o correlatore di 2 tesi di dottorato. Non presenta valutazioni degli studenti.

C) ATTIVITÀ DI RICERCA, PRODUZIONE SCIENTIFICA COMPLESSIVA, ATTIVITÀ ISTITUZIONALI, ORGANIZZATIVE, GESTIONALI, DI SERVIZIO

Responsabile di 5 progetti di ricerca finanziati internazionali e 3 progetti di ricerca finanziati italiani. Partecipante a 2 progetti di ricerca finanziati internazionali e 3 progetti di ricerca finanziati nazionali. Membro dell'editorial board di una rivista internazionale. Vincitore di 4 premi e/o riconoscimenti internazionali e 3 premi e/o riconoscimenti nazionali. Ottima e intensa l'attività seminariale su invito, sia internazionale che nazionale. Molto buona e continua nel tempo la consistenza complessiva della produzione scientifica dimostrata dai due indicatori H-index pari a 9 e Citazioni totali pari a 230 (Scopus – 14 settembre 2023). Molto buona l'attività organizzativa, gestionale e di servizio, pienamente coerente con il ruolo ricoperto.

D) ATTIVITÀ DI TERZA MISSIONE, IMPATTO SULLA SOCIETÀ, IMPRENDITORIALITÀ SCIENTIFICA, TRASFERIMENTO TECNOLOGICO, IN QUANTO PERTINENTI AL RUOLO

Il candidato presenta una limitata attività di terza missione nell'ambito della promozione e divulgazione scientifica.

ACCERTAMENTO QUALIFICAZIONE SCIENTIFICA E COMPETENZE LINGUISTICHE

a) giudizio sulla qualificazione scientifica: sulla base del curriculum, dei titoli e delle pubblicazioni presentate il livello scientifico del candidato è **ottimo**.

b) giudizio sulle competenze linguistiche relative alla lingua straniera indicata nel bando: competenze **ottime**.

CANDIDATO: PAGLIARANI Stefano

A) PUBBLICAZIONI SCIENTIFICHE

L'attività di ricerca, nell'ambito delle equazioni differenziali stocastiche, la loro regolarità e approssimazione, oltre alle applicazioni alla Finanza, è documentata da una ottima e consistente produzione scientifica. Presenta 15 pubblicazioni, tutte pienamente congruenti col settore concorsuale 01/A3 e il settore scientifico disciplinare MAT/06. Il livello di originalità, innovatività e rigore metodologico è mediamente molto buono. La rilevanza scientifica della collocazione editoriale è mediamente molto buona. Tutti i 15 lavori presentati sono in collaborazione con altri autori.

B) ATTIVITÀ DIDATTICA, DIDATTICA INTEGRATIVA, SERVIZI AGLI STUDENTI

Il candidato presenta un'attività didattica ampia e continuativa come titolare di insegnamenti a livello di laurea e laurea magistrale, più svariati insegnamenti a livello più avanzato. È stato relatore o correlatore di 9 tesi di laurea magistrale. Non presenta valutazioni degli studenti.

C) ATTIVITÀ DI RICERCA, PRODUZIONE SCIENTIFICA COMPLESSIVA, ATTIVITÀ ISTITUZIONALI, ORGANIZZATIVE, GESTIONALI, DI SERVIZIO

Responsabile di 1 progetto di ricerca finanziato internazionale e 2 progetti di ricerca finanziati italiani. Partecipante a 2 progetti di ricerca finanziati nazionali. Non presenta premi e/o riconoscimenti nazionali e/o internazionali. Ottima e intensa l'attività seminariale su invito, sia internazionale che nazionale. Molto buona e continua nel tempo la consistenza complessiva della produzione scientifica dimostrata dai due indicatori H-index pari a 10 e Citazioni totali pari a 289 (Scopus – 14 settembre 2023). Buona l'attività organizzativa, gestionale e di servizio, pienamente coerente con il ruolo ricoperto.

D) ATTIVITÀ DI TERZA MISSIONE, IMPATTO SULLA SOCIETÀ, IMPRENDITORIALITÀ SCIENTIFICA, TRASFERIMENTO TECNOLOGICO, IN QUANTO PERTINENTI AL RUOLO

Il candidato non certifica rilevanti attività di terza missione

ACCERTAMENTO QUALIFICAZIONE SCIENTIFICA E COMPETENZE LINGUISTICHE

a) giudizio sulla qualificazione scientifica: sulla base del curriculum, dei titoli e delle pubblicazioni presentate il livello scientifico del candidato è **molto buono**.

b) giudizio sulle competenze linguistiche relative alla lingua straniera indicata nel bando: competenze **ottime**.

La seduta termina alle ore **16:00**.

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

Padova, 14 settembre 2023

Il Presidente della commissione

Prof. Marco Ferrante

Firma

Il Segretario della commissione

Prof. Andrea Pascucci

Firma

La componente della commissione

Prof.ssa Luisa Beghin

Firma