

Concorso per il conferimento di n. 1 assegno di ricerca ai sensi dell'art. 22 della L. 240/10 dal titolo "Un approccio semi-Markoviano alle misure dei rischi finanziari per dati ad alta frequenza", da svolgersi presso il Dipartimento di Economia, Area 13, settore concorsuale 13/D4, SSD SECS-S/06, bandito con D.R. n. 1330, prot. n. 73629 del 29/09/2021

VERBALE N. 2

(Valutazione titoli e pubblicazioni – modalità telematica)

La Commissione, considerate le specifiche disposizioni dell'Ateneo che ha indetto la presente procedura contenute nel **D.R. n. 953 prot. n. 43861 del 16/06/2022** con cui è stato emanato il **"Regolamento per lo svolgimento telematico delle sedute collegiali nelle procedure concorsuali e selettive di reclutamento del personale"**, rammenta di aver stabilito che tutte le riunioni del concorso saranno tenute in via telematica.

Premesso quanto sopra, quindi, la Commissione si insedia al completo per via telematica tramite piattaforma Microsoft Teams il giorno 29/06/2022 alle ore 9.00 dai seguenti account riferiti ai componenti della commissione, come da elenco che segue:

Prof. Carlo Mari: carlo.mari@unich.it - Presidente

Prof.ssa Angela Anna De Sanctis: angela.desanctis@unich.it - Componente

Dott.ssa Cristina Di Girolami: cristina.digirolami@unich.it - Componente anche con funzione di Segretario verbalizzante.

La Commissione precisa che si riunisce per via telematica, attraverso la modalità di conversazione diretta via Microsoft Teams in presenza di tutti seguita dallo scambio di posta elettronica per l'approvazione di quanto discusso dalla Commissione. La riunione telematica si sviluppa nel modo seguente: i Commissari, tramite collegamento sincrono, si scambiano informazioni ed opinioni in conversazione diretta, al fine di addivenire alla decisione finale che si andrà formando progressivamente con il concorso contemporaneo di tutti i componenti della Commissione. Di quanto sopra, sarà dato atto da parte del Segretario verbalizzante che provvederà alla stesura dei verbali.

Lo scambio della documentazione potrà avvenire tramite e-mail dagli account personali sopra riportati.

Ciascun Commissario, presa visione dell'elenco dei candidati trasmesso dal competente Ufficio dell'Amministrazione Centrale, successivamente alla consegna del 1° verbale da parte della Commissione medesima (Allegato A, composto da una pagina), dichiara che non sussistono situazioni di incompatibilità con i candidati ai sensi degli artt. 51 e 52 c.p.c. e di non avere relazioni di parentela, coniugio o di unione civile o convivenza regolamentati ai sensi della L.76/2016, di parentela ed affinità, entro il quarto grado incluso, con gli stessi.

Ciascun Commissario dichiara che non sussistono collaborazioni che presentino i caratteri della sistematicità, stabilità, continuità tali da dar luogo ad un vero e proprio sodalizio professionale con i candidati. La Commissione dichiara inoltre l'assenza di interessi ovvero l'assenza di conflitto di interessi rispetto ai lavori da valutare.

La suddetta Commissione prende atto che risultano pervenute tempestivamente le domande dei seguenti Candidati:

1)	CARLONE Giulio
2)	DI BASILIO Bice

La Commissione da atto di aver ricevuto la documentazione presentata dai candidati come consegnata dal Settore Reclutamento di Ateneo.

La Commissione procede, quindi, alla verifica del possesso dei requisiti da parte dei candidati rilevando che tutti i candidati sono in possesso dei requisiti richiesti.

La Commissione, attenendosi a quanto stabilito nel verbale n. 1 inerente la predeterminazione dei criteri di valutazione dei titoli, attribuisce il seguente punteggio analitico comparativo a ciascun candidato per i titoli presentati per il concorso di che trattasi, rammentando che ai titoli può essere attribuito al massimo il seguente punteggio: 30 (VT):

CANDIDATO/A	A) titolo di dottore di ricerca o equipollenti conseguiti all' estero/diploma di specializzazione medica o equivalente, conseguito in Italia o all'Estero (se previsto)	B) attestati di frequenza corsi di perfezionamento post laurea conseguiti in Italia o all'Estero	C) svolgimento di documentata attività di ricerca presso soggetti pubblici o privati con contratti, borse di studio o incarichi sia in Italia o all'Estero	D) Partecipazione in qualità di relatore a congressi e convegni	Totale	Totale punteggio rapportato al punteggio massimo attribuibile (VT)
CARLONE Giulio	20	0	1	3	24	24 su 30
DI BASILIO Bice	20	3	1	3	27	27 su 30

Successivamente, la Commissione, allega per ciascun candidato l'elenco delle pubblicazioni che sono state presentate e che sono ammesse alla valutazione:

Candidato CARLONE Giulio - Allegato 1 PUBBLICAZIONI

Candidata DI BASILIO Bice - Allegato 2 PUBBLICAZIONI

Il Candidato Giulio CARLONE presenta sette pubblicazioni. Di queste, solo sei sono ammesse alla valutazione, e dunque riportate nell'Allegato 1, in quanto la pubblicazione "Introduction to credit risk" non è presente nella documentazione di partecipazione alla procedura (è presente solo il contratto firmato con la casa editrice).

La Candidata Bice DI BASILIO presenta quattro pubblicazioni. Di queste, solo tre sono ammesse alla valutazione, e dunque riportate nell'Allegato 2, in quanto la pubblicazione "Optimal management of wind power production via dispatchable energy sources" è stata sottomessa ad una rivista scientifica ma non risulta ancora accettata.

La Commissione precisa, che per quanto riguarda i lavori in collaborazione con i Commissari

della presente procedura o con altri coautori non appartenenti alla Commissione, l'apporto individuale del candidato verrà valutato senza considerare l'ordine degli autori; ove l'apporto individuale del candidato non risulti oggettivamente enucleabile o accompagnato da una dichiarazione debitamente sottoscritta dal candidato, il suo contributo verrà considerato paritetico tra gli autori.

Vengono quindi prese in esame le pubblicazioni redatte in collaborazione con i commissari della presente procedura di valutazione o con altri coautori non appartenenti alla Commissione, al fine di valutare l'apporto di ciascun candidato.

Successivamente, la Commissione rileva che i lavori presentati dal Candidato Giulio CARLONE sono tutti a firma singola e unanimemente delibera di ammettere alla successiva valutazione di merito i lavori elencati e numerati nell'Allegato 1.

La Commissione rileva altresì che la Candidata Bice DI BASILIO presenta tutti lavori a più autori. Il contributo della Candidata ai lavori presentati è esplicitamente dichiarato nella domanda di partecipazione e la Commissione unanimemente delibera di ammettere alla successiva valutazione di merito i lavori elencati e numerati nell'Allegato 2.

La Commissione, attenendosi a quanto stabilito nel verbale n. 1 inerente la predeterminazione dei criteri di valutazione delle pubblicazioni, attribuisce il seguente punteggio analitico comparativo a ciascun candidato per le pubblicazioni presentate, rammentando che alle pubblicazioni può essere attribuito al massimo il seguente punteggio: 30 (VP):

Candidato CARLONE Giulio

Pubblicazione n.	ELEMENTI OGGETTO DI VALUTAZIONE: a) originalità, innovatività, rigore metodologico e rilevanza di ciascuna pubblicazione scientifica; b) congruenza di ciascuna pubblicazione con il settore disciplinare inerente al programma di ricerca per il quale è bandita la procedura; c) rilevanza scientifica della collocazione editoriale di ciascuna pubblicazione e sua diffusione all'interno della comunità scientifica; d) determinazione dell'apporto individuale del candidato nel caso di partecipazione del medesimo a lavori in collaborazione.	Totale
1.	Valutazione=1, N=1, Q=1, F=1	1
2.	Valutazione=1, N=1, Q=1, F=1	1
3.	Valutazione=1, N=1, Q=1, F=1	1
4.	Valutazione=1, N=1, Q=1, F=1	1
5.	Valutazione=2, N=1, Q=1, F=1	2
6.	Valutazione=2, N=1, Q=1, F=1	2

Pubblicazione n.	ELEMENTI OGGETTO DI VALUTAZIONE: a) originalità, innovatività, rigore metodologico e rilevanza di ciascuna pubblicazione scientifica; b) congruenza di ciascuna pubblicazione con il settore disciplinare inerente al programma di ricerca per il quale è bandita la procedura; c) rilevanza scientifica della collocazione editoriale di ciascuna pubblicazione e sua diffusione all'interno della comunità scientifica; d) determinazione dell'apporto individuale del candidato nel caso di partecipazione del medesimo a lavori in collaborazione.	Totale
1.	Valutazione=4, N=3, Q=0.5, F=0.8	3.2
2.	Valutazione=3, N=4, Q=0.75, F=0.9	2.7
3.	Valutazione=4, N=3, Q=0.5, F=0.8	3.2

Sulla base dei punteggi come sopra attribuiti i seguenti candidati risultano ammessi al colloquio ai sensi dell'art. 4 punto B) del Regolamento di Ateneo:

Candidato/a	Totale punteggio valutazione titoli	Totale punteggio valutazione pubblicazioni	TOTALE
CARLONE Giulio	24	8	32
DI BASILIO Bice	27	9.1	36.1

La Commissione rammenta quanto già previsto nel primo verbale ovvero che il colloquio orale, nel rispetto del già citato **"Regolamento per lo svolgimento telematico delle sedute collegiali nelle procedure concorsuali e selettive di reclutamento del personale"**, avverrà esclusivamente per via telematica tramite piattaforma Microsoft Teams il giorno 05/07/2022 alle ore 10.00.

Circa la modalità di svolgimento del predetto colloquio, la Commissione rimanda a quanto già indicato nel primo verbale. In tal senso i candidati ammessi alla prova orale dovranno esprimere il proprio assenso all'espletamento del colloquio mediante piattaforma Microsoft Teams e **comunicare il proprio indirizzo e-mail** al fine di essere contattati nella call pubblica durante la quale sarà espletato il colloquio.

La Commissione precisa che il colloquio dovrà svolgersi nel rispetto dei seguenti principi:

- a) collegamento simultaneo tra i partecipanti;
- b) sicurezza dei dati e delle informazioni scambiate durante la seduta;
- c) pubblicità delle prove;
- d) garanzia di certa identificazione dei candidati.

Al pari dei membri della Commissione, i candidati partecipano alla seduta relativa al colloquio utilizzando i propri dispositivi telematici.

Il colloquio in modalità telematica sarà preceduto dalle seguenti attività preliminari:

- a) il candidato deve accettare formalmente la modalità telematica impegnandosi a non utilizzare strumenti di ausilio e a garantire l'assenza di persone a supporto durante lo svolgimento della prova;

- b) il candidato deve attestare di essere consapevole che l'Università "G. d'Annunzio" è esclusa da ogni responsabilità in caso di problemi tecnici di qualunque natura non imputabili alla medesima, che non consentano il corretto avvio o lo svolgimento della prova;
- c) il collegamento telematico tra i membri della commissione e tutti i candidati deve necessariamente avvenire nella data e nell'orario prestabilito dalla commissione di concorso, come risultante da calendario pubblicato sul sito di Ateneo;
- d) Il collegamento deve essere audio e video;
- e) la seduta è condotta dal Presidente della Commissione che deve verificare tempestivamente il funzionamento della connessione audio-video con i candidati e con gli altri membri della Commissione. A tal fine, è richiesto ai candidati di avviare la connessione almeno 20 minuti prima dell'inizio della seduta telematica;
- f) Si precisa che sarà facoltà della Commissione, mediante comunicazione del Presidente - una volta contattati i candidati tramite l'indirizzo e-mail comunicato - invitare tutti i candidati ed eventuali altri presenti alla call a entrare in altra piattaforma virtuale al fine di assicurare la migliore funzionalità delle interazioni;
- g) la Commissione accerterà l'identità del candidato attraverso la verifica di un idoneo documento di identità.

Al fine di sostenere il colloquio nella modalità telematica i candidati dovranno garantire che la postazione da cui sosterranno il colloquio sia dotata sia di webcam - indispensabile per il riconoscimento del candidato - sia di microfono e cuffie/casse audio.

Si precisa che il candidato dovrà risultare reperibile al contatto e-mail comunicato nel giorno e orario indicati per il colloquio. L'omessa o errata comunicazione del contatto personale e-mail saranno considerati rinuncia alla partecipazione al colloquio e, dunque, alla selezione. In caso di mancata risposta e/o irreperibilità del candidato nel giorno o nell'orario stabilito la Commissione immediatamente tenterà di contattare il candidato sia via e-mail sia chiamandolo al numero di cellulare per invitarlo a rispondere alla chiamata Microsoft Teams e, dunque, a sostenere il colloquio. Anche l'omessa risposta sarà considerata rinuncia alla partecipazione al colloquio e, dunque, alla selezione.

La Commissione si riconvoca alle ore 09.00 del giorno 05/07/2022 per la predeterminazione delle domande da proporre a ciascun candidato previa estrazione a sorte. Con riferimento alla procedura relativa alla costituzione delle buste contenenti i quesiti da sottoporre ai candidati la Commissione da atto che le buste saranno nella materiale disponibilità del solo Presidente che presenterà le stesse ai candidati che avranno cura di espletare la scelta indicando il numero della busta che intendono estrarre.

Il Segretario invia il verbale sin qui redatto a mezzo di posta elettronica agli altri Commissari.

I Commissari rendono per e-mail apposita dichiarazione di approvazione delle valutazioni concordate.

Tutte le dichiarazioni inviate dai Commissari al Segretario si allegano al presente verbale.

Il presente verbale viene redatto, letto e sottoscritto dal Segretario con dichiarazione di formale sottoscrizione per via telematica dalla Commissione, anticipato via email al seguente indirizzo: assegnidiricerca@unich.it.

La seduta è tolta alle ore 10.45

Letto, approvato e sottoscritto.

LA COMMISSIONE:

Prof. Carlo MARI (Presidente)

Prof.ssa Angela Anna DE SANCTIS (Componente)

Dott.ssa Cristina DI GIROLAMI Cristina (Componente-Segretario)

Chieti, 29/06/2022

ALLEGATO A

ELENCO DEI CANDIDATI

1. CARLONE Giulio
2. DI BASILIO Bice

ALLEGATO 1

ELENCO DELLE PUBBLICAZIONI VALUTABILI

Candidato CARLONE Giulio

1. Carlone Giulio. "Rischio di credito". Pearson Educational Italia (2020).
2. Carlone Giulio. "Market risk model agriculture commodity portfolio value-at-risk". (2020) (Research square.com ARTICOLO ON LINE).
3. Carlone Giulio. "Credit risk management" (E-BOOK prima versione 2015) Scienpress Ltd.
4. Carlone Giulio. "Credit risk management" (PRINT BOOK seconda versione 2017) Scienpress Ltd.
5. Carlone Giulio. "Monte Carlo Optimal Distribution of simulation dates". Journal of Finance and investment analysis. Vol 4, n.3, (2015) Scienpress Ltd.
6. Carlone Giulio. "High frequency trading an analysis regarding volatility and liquidity starting from a base case of algorithms and a dedicated software architecture". Proceedings of the IEEE Conference on "Computational intelligence for Financial Engineering and Economics". (2014)

ALLEGATO 2

ELENCO DELLE PUBBLICAZIONI VALUTABILI

Candidata DI BASILIO Bice

1. D'Amico Guglielmo, Bice Di Basilio, and Filippo Petroni. "Hedging the Risk of Wind Power Production Using Dispatchable Energy Source". *Stochastics and Quality Control* 36.1 (2021): 1-20.
2. D'Amico Guglielmo, Bice Di Basilio, Filippo Petroni, and Fulvio Gismondi. "An econometric analysis of drawdown-based measures" accettato per la pubblicazione in un volume della serie "Springer proceedings in Mathematics & Statistics" dal titolo "Stochastic processes, statistical methods and engineering mathematics".
3. D'Amico Guglielmo, Bice Di Basilio, and Filippo Petroni. "A Semi-Markovian Approach To Drawdown-Based Measures". *Advances in Complex Systems* (ACS) 23.08 (2020): 1-28.

Il sottoscritto Carlo Mari nato a Orvieto il 18 agosto 1962, in qualità di Componente per Concorso per il Conferimento di un Assegno per la Collaborazione ad Attività di Ricerca dal titolo "Un approccio semi-Markoviano alle misure dei rischi finanziari per dati ad alta frequenza", da svolgersi presso il Dipartimento di Economia dell'Università degli studi "G. d'Annunzio" di Chieti-Pescara, Area 13, settore concorsuale 13/D4, SSD SECS-S/06, bandito con D.R. n. 1330, prot. n. 73629 del 29/09/2021

DICHIARA

sotto la propria responsabilità che non vi sono condizioni di incompatibilità per l'incarico di Componente della Commissione in quanto:

- 1) non sussiste grado di parentela o di affinità fino al quarto grado compreso, con il candidato
- 2) non è condannato, anche con sentenza non passata in giudicato, per i Delitti dei Pubblici Ufficiali contro la Pubblica Amministrazione, per i reati previsti nel Capo I del Titolo II del Libro secondo del Codice Penale, dall'articolo 314 all' art. 315-bis.

29/06/2022

II DICHIARANTE

Per la dichiarazione sostitutiva di notorietà, qualora essa non venga sottoscritta in presenza del dipendente addetto deve essere presentata unitamente a copia fotostatica non autenticata di un documento di identità del sottoscrittore (art. 38 D.P.R. 445/2000)

La sottoscritta Angela Anna De Sanctis, nata a Tocco da Casauria (PE) il 04/03/1957, in qualità di Componente per Concorso per il Conferimento di Assegni per la Collaborazione ad Attività di Ricerca, titolo del progetto "Un approccio semi-Markoviano alle misure dei rischi finanziari per dati ad alta frequenza", presso il Dipartimento di Economia dell'Università degli studi "G. D'Annunzio" di Chieti-Pescara,

D I C H I A R A

sotto la propria responsabilità che non vi sono condizioni di incompatibilità per l'incarico di Componente della Commissione in quanto:

- 1) non sussiste grado di parentela o di affinità fino al quarto grado compreso, con il candidato
- 2) non è condannato, anche con sentenza non passata in giudicato, per i Delitti dei Pubblici Ufficiali contro la Pubblica Amministrazione, per i reati previsti nel Capo I del Titolo II del Libro secondo del Codice Penale, dall'articolo 314 all' art. 315-bis.

29 / 06 / 2022

II DICHIARANTE

Per la dichiarazione sostitutiva di notorietà, qualora essa non venga sottoscritta in presenza del dipendente addetto deve essere presentata unitamente a copia fotostatica non autenticata di un documento di identità del sottoscrittore (art. 38 D.P.R. 445/2000)

La sottoscritta Cristina DI GIROLAMI nata a San Benedetto del Tronto il 05/10/1980, in qualità di Componente-Segretario per Concorso per il Conferimento di Assegni per la Collaborazione ad Attività di Ricerca titolo del N. 1 ASSEGNO DI RICERCA AI SENSI DELL'ART. 22 DELLA L. 240/10 DAL TITOLO: "Un approccio semi-Markoviano alle misure dei rischi finanziari per dati ad alta frequenza ", AREA 13 SETTORE CONCORSUALE 13/D4 SSD SECS-S/06 presso il Dipartimento di Economia dell'Università degli studi "G. D'Annunzio" di Chieti-Pescara,

DICHIARA

sotto la propria responsabilità che non vi sono condizioni di incompatibilità per l'incarico di Componente della Commissione in quanto:

- 1) non sussiste grado di parentela o di affinità fino al quarto grado compreso, con il candidato
- 2) non è condannato, anche con sentenza non passata in giudicato, per i Delitti dei Pubblici Ufficiali contro la Pubblica Amministrazione, per i reati previsti nel Capo I del Titolo II del Libro secondo del Codice Penale, dall'articolo 314 all' art. 315-bis.

Chieti, 29/06/2022

II DICHIARANTE

Per la dichiarazione sostitutiva di notorietà, qualora essa non venga sottoscritta in presenza del dipendente addetto deve essere presentata unitamente a copia fotostatica non autenticata di un documento di identità del sottoscrittore (art. 38 D.P.R. 445/2000)

Concorso per il conferimento di n. 1 assegno di ricerca ai sensi dell'art. 22 della L. 240/10 dal titolo "Un approccio semi-Markoviano alle misure dei rischi finanziari per dati ad alta frequenza", da svolgersi presso il Dipartimento di Economia, Area 13, settore concorsuale 13/D4, SSD SECS-S/06, bandito con D.R. n. 1330, prot. n. 73629 del 29/09/2021

DICHIARAZIONE

Il sottoscritto prof. Carlo Mari, presidente della commissione esaminatrice della procedura sopraindicata, nominata con Decreto Rettorale n. 918, prot. n. 41893 del 10/06/2022, dichiara, con la presente, di aver partecipato, in via telematica a mezzo del proprio account e-mail: carlo.mari@unich.it, alla riunione in data odierna e di concordare con il verbale a firma della dott.ssa Cristina Di Girolami, segretario della commissione esaminatrice.

Il sottoscritto dichiara altresì di allegare copia del proprio documento di identità.

Data, 29 giugno 2022

In fede

DIVISIONE 13
AL SETTORE RECLUTAMENTO
PERSONALE DOCENTE E
RICERCATORI

OGGETTO: CONCORSO PER CONFERIMENTO DI N. 1 ASSEGNO DI RICERCA AI SENSI DELL'ART. 22 DELLA L. 240/10 DAL TITOLO:" Un approccio semi-Markoviano alle misure dei rischi finanziari per dati ad alta frequenza ", AREA 13 SETTORE CONCORSUALE 13/D4 SSD SECS-S/06 PRESSO IL DIPARTIMENTO DI Economia DELL'UNIVERSITÀ DEGLI STUDI "G. D'ANNUNZIO" DI CHIETI-PESCARA, BANDITO CON D.R. N. 1330, prot. n. 73629 DEL 29/09/2021

IL SOTTOSCRITTO PROF. Angela Anna De Sanctis, MEMBRO DELLA COMMISSIONE, nominata con Decreto Rettorale n. 918, prot. n. 41893 del 10/06/2022

DICHIARA

CON LA PRESENTE DI AVER PARTECIPATO, IN VIA TELEMATICA A MEZZO DEL PROPRIO ACCOUNT E-MAIL: angela.desanctis@unich.it, ALLA RIUNIONE IN DATA ODIERNA E DI CONCORDARE CON IL VERBALE A FIRMA DELLA DOTT.SSA CRISTINA DI GIROLAMI, SEGRETARIO DELLA COMMISSIONE ESAMINATRICE.

IL SOTTOSCRITTO DICHIARA ALTRESI' DI ALLEGARE COPIA DEL PROPRIO DOCUMENTO DI IDENTITA'.

DATA 29 giugno 2022

IN FEDE

DIVISIONE 13
AL SETTORE RECLUTAMENTO
PERSONALE DOCENTE E
RICERCATORI

OGGETTO: CONCORSO PER CONFERIMENTO DI N. 1 ASSEGNO DI RICERCA AI SENSI DELL'ART. 22 DELLA L. 240/10 DAL TITOLO: "Un approccio semi-Markoviano alle misure dei rischi finanziari per dati ad alta frequenza ", AREA 13 SETTORE CONCORSUALE 13/D4 SSD SECS-S/06 PRESSO IL DIPARTIMENTO DI Economia DELL'UNIVERSITÀ DEGLI STUDI "G. D'ANNUNZIO" DI CHIETI-PESCARA, BANDITO CON D.R. N. 1330, prot. n. 73629 DEL 29/09/2021

IL SOTTOSCRITTO PROF. DI GIROLAMI CRISTINA, MEMBRO DELLA COMMISSIONE nominata con Decreto Rettorale n. 918, prot. n. 41893 del 10/06/2022

DICHIARA

CON LA PRESENTE DI AVER PARTECIPATO, IN VIA TELEMATICA A MEZZO DEL PROPRIO ACCOUNT E-MAIL: cristina.digirolami@unich.it, ALLA VALUTAZIONE TITOLI e PUBBLICAZIONI DEI CANDIDATI PER LA SUDETTA PROCEDURA E DI CONCORDARE CON IL VERBALE A FIRMA DOTT.SSA CRISTINA DI GIROLAMI, SEGRETARIO DELLA COMMISSIONE GIUDICATRICE.

IL SOTTOSCRITTO DICHIARA ALTRESI' DI ALLEGARE COPIA DEL PROPRIO DOCUMENTO DI IDENTITA'.

DATA 29 giugno 2022

IN FEDE

(Allegare copia scansionata del proprio documento di identità in corso di validità)