

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. 3

(individuazione argomenti per colloquio)

La Commissione, richiamate 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.

La Commissione esaminatrice della procedura sopraindicata, nominata con Decreto Rettorale n. 918, prot. n. 41893 del 10/06/2022, composta dai seguenti docenti:

Prof. Carlo Mari - Presidente

Prof.ssa Angela Anna De Sanctis - Componente

Dott.ssa Cristina Di Girolami - Componente con funzione di Segretario verbalizzante.

si insedia al completo per via telematica, il giorno 05/07/2022 alle ore 9.00, dai seguenti account riferiti ai componenti della Commissione, come da elenco che segue:

Prof. Carlo Mari - account e-mail: carlo.mari@unich.it

Prof.ssa Angela Anna De Sanctis - account e-mail : angela.desanctis@unich.it

Dott.ssa Cristina Di Girolami - account e-mail: cristina.digirolami@unich.it

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 del verbale.

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.

Come indicato nel primo verbale, la Commissione stabilisce che verranno poste ad ogni candidato due domande inerenti al programma di ricerca oggetto dell'assegno di collaborazione da lui stesso sorteggiate tra quelle predeterminate dai componenti la Commissione.

La Commissione dà atto che presso la sede in cui si trova il presidente, **in accordo con la Commissione e durante la presente seduta**, sono state predisposte $N+1$ buste (dove N

indica il numero di candidati) al fine di assicurare l'esercizio di scelta a tutti candidati, contenenti ciascuna due domande inerenti al programma di ricerca oggetto dell'assegno di collaborazione. Le domande sono state inserite **dal Presidente** in busta chiusa e sigillata a cura **del medesimo** che ne assicura l'integrità e la conservazione in luogo sicuro.

La Commissione dà atto che la stessa è stata autorizzata all'espletamento del presente colloquio via Microsoft Teams call con i candidati come previsto dal già citato **"Regolamento per lo svolgimento telematico delle sedute collegiali nelle procedure concorsuali e selettive di reclutamento del personale"** emanato con **D.R. n. 953 prot. n. 43861 del 16/06/2022.**

A tale fine la Commissione dichiara di aver ricevuto i seguenti indirizzi e-mail dei candidati:

Dott. CARLONE Giulio - account e-mail:

Dott.ssa DI BASILIO Bice - account e-mail

mediante la trasmissione di specifico modulo nel quale ciascuno dei candidati, reso edotto delle modalità con le quali sarebbe stato espletato il colloquio relativo alla presente procedura, ha comunicato il proprio indirizzo e-mail ed il proprio consenso all'espletamento in via telematica della procedura.

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

Il presente verbale viene redatto, letto e sottoscritto 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 9.30.

Letto, approvato e sottoscritto.

LA COMMISSIONE:

Prof. Carlo MARI (Presidente)

Prof.ssa: Angela Anna DE SANCTIS (Componente)

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

Chieti, 05/07/2022

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. 4

(Prova orale e relazione finale)

La Commissione, richiamate 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, il giorno 05/07/2022 alle ore 10.00, dai seguenti account riferiti ai componenti della Commissione, come da elenco che segue:

Prof. Carlo Mari - account e-mail: carlo.mari@unich.it

Prof.ssa Angela Anna De Sanctis - account e-mail : angela.desanctis@unich.it

Dott.ssa Cristina Di Girolami - account e-mail: cristina.digirolami@unich.it

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 via Microsoft Teams, 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.

La Commissione, rammentato che ai candidati sono state comunicate le modalità di svolgimento del presente colloquio mediante piattaforma Microsoft Teams e che gli stessi hanno accettato, alle ore 10.00 procede all'appello dei candidati convocati nella presente seduta mediante pubblicazione del verbale n. 2 sull'Albo Pretorio on line nonché sul sito istituzionale di Ateneo nell'area dedicata agli Assegni di Ricerca al seguente link: <https://www.unich.it/ateneo/concorsi-e-gare/assegni-di-ricerca>.

La riunione si svolge, pertanto, in contestuale presenza dei Commissari e dei candidati connessi tramite piattaforma Microsoft Teams, con la possibilità anche di soggetti terzi di accedere alla call. In tal senso è stato pubblicato avviso sulla sezione del sito su indicato.

Risultano presenti i candidati sotto indicati dei quali viene accertata l'identità personale mediante esibizione di un idoneo documento di identità direttamente da parte dei medesimi (All. A).

- 1) Dott. Giulio CARLONE Documento Passaporto
Questura Chieti, valido fino al

2) Dott.ssa Bice DI BASILIO; Documento di identità
Comune di Bisenti valido fino al

La Commissione registra i dati dei candidati ed attesta di aver verificato l'identità dei medesimi mediante il riscontro su indicato.

Il Presidente, rammentato che la modalità di espletamento delle riunioni e del colloquio in telematica è adottata dall'Ateneo sulla base del già citato **"Regolamento per lo svolgimento telematico delle sedute collegiali nelle procedure concorsuali e selettive di reclutamento del personale"**, illustra ai candidati le modalità con cui si svolgerà il presente colloquio comunicando di quanto segue:

- il candidato procederà in seduta pubblica all'espletamento del colloquio, impegnandosi a non utilizzare strumenti di ausilio e a garantire l'assenza di persone a supporto durante lo svolgimento della prova, ed in tal senso la Commissione procederà a vigilare;
- la connessione dovrà rimanere attiva per l'intera durata della prova;
- eventuali interruzioni dovranno essere debitamente segnalate alla Commissione;
- spetterà al candidato fornir prova delle eventuali cause e/o anomalie e/o criticità tecniche non imputabili a colpa o inerzia del candidato che gli hanno impedito di partecipare al colloquio; in tal caso il candidato, nell'immediatezza, dovrà darne notizia alla Commissione via mail.

Il Presidente accerta, altresì che la postazione da cui il candidato sosterrà il colloquio sia dotata sia di webcam sia di microfono e cuffie/casse audio.

Il Presidente dà, quindi, lettura delle modalità con le quali si svolgerà il colloquio durante la presente seduta:

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;

Il Presidente ricorda, inoltre, che l'utilizzo di strumenti di connessione audio-video dovrà in ogni caso consentire:

1. la visualizzazione del candidato durante l'intera prova;
2. la corretta identificazione del candidato attraverso un documento di riconoscimento in corso di validità;
3. lo svolgimento della seduta in forma pubblica, garantita dalla possibilità di collegamento in contemporanea per l'intera durata della stessa da parte di tutti i candidati e da parte dei soggetti terzi che intervengano in via di uditori.

Il Presidente ricorda che l'ordine di discussione è l'ordine alfabetico, che la Commissione procederà all'espletamento delle prove con il primo candidato e, successivamente, con ciascuno degli altri candidati, che dopo l'espletamento delle prove il Presidente della commissione chiuderà la seduta con i candidati e il relativo collegamento telematico con gli stessi e con il pubblico.

Il Presidente rammenta altresì che come da comunicazione resa dall'Amministrazione sarà facoltà della Commissione, mediante avviso 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.

Come indicato nel primo verbale, la Commissione stabilisce che verranno poste ad ogni candidato due domande inerenti al programma di ricerca, oggetto dell'assegno di collaborazione, da lui stesso sorteggiate tra quelle predeterminate dai componenti la Commissione.

La Commissione dà atto che sono predisposte per ciascun argomento indicato sono state predisposte $N+1$ buste (dove N indica il numero di candidati) al fine di assicurare l'esercizio di scelta a tutti i candidati, contenenti ciascuna due domande inerenti al programma di ricerca oggetto dell'assegno di collaborazione.

Con riferimento alla procedura relativa alla costituzione delle buste contenenti i quesiti da sottoporre ai candidati, la Commissione dà atto che le buste sono 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.

La Commissione procede alla valutazione del candidato Giulio CARLONE presente per essere stato chiamato all'indirizzo e-mail comunicato dal candidato stesso.

La Commissione invita il candidato ad illustrare i titoli e le pubblicazioni presentate.

Esponde il candidato Giulio CARLONE.

Successivamente il candidato viene invitato a scegliere una busta tra quelle chiuse e sigillate che gli vengono mostrate dal Presidente. Il candidato sceglie la busta n. 1 che contiene le seguenti domande.

- 1) Si discutano le principali misure di rischio in ambito finanziario con particolare riferimento ad un utilizzo per dati ad alta frequenza.
- 2) Modelli di Markov e modelli semi-Markov nelle applicazioni finanziarie.

La Commissione interroga il candidato.

La Commissione continua con la valutazione della candidata Bice DI BASILIO presente per essere stato chiamato all'indirizzo e-mail comunicato dalla candidata stessa.

La Commissione invita la candidata ad illustrare i titoli e le pubblicazioni presentate.

Esponde la candidata Bice DI BASILIO.

Successivamente la candidata viene invitata a scegliere una busta tra quelle chiuse e sigillate che gli vengono mostrate dal Presidente. La candidata sceglie la busta n. 3 che contiene le seguenti domande.

- 1) Si presenti una breve rassegna dei modelli utilizzati in letteratura per dati ad alta frequenza.
- 2) Si discutano le evidenze empiriche in favore dei modelli semi-Markoviani nelle applicazioni finanziarie.

La Commissione interroga la candidata.

Il Presidente invita i candidati ed il pubblico collegati ad abbandonare la seduta che continua in via riservata. La Commissione procede alla valutazione di ciascun candidato attribuendo il punteggio in relazione ai criteri stabiliti nella riunione preliminare.

Al termine del colloquio la Commissione, in applicazione dei criteri stabiliti nel primo verbale, attribuisce i punteggi (per ogni criterio approssimati alla seconda cifra decimale) come segue:

CANDIDATO	a. conoscenza degli argomenti inerenti il programma di ricerca oggetto dell'assegno	Totale	Totale punteggio rapportato al punteggio massimo attribuibile VMC_a
Giulio CARLONE	2	2	6.67

CANDIDATO	b. valutazione della competenza scientifica, del grado di approfondimento delle ricerche, conoscenza delle metodologie di ricerca da parte del candidato riferito alla produzione scientifica nel suo complesso, accertati mediante la discussione critica del candidato anche con riferimento ai risultati scientifici ottenuti	Totale	Totale punteggio rapportato al punteggio massimo attribuibile VMC_b
Giulio CARLONE	3	3	10

assegnando al termine la seguente votazione:

CANDIDATO	Totale punteggio rapportato a VMC_a per il criterio a	Totale punteggio rapportato a VMC_b per il criterio b	TOTALE
Giulio CARLONE	6.67	10	16.67

CANDIDATA	a. conoscenza degli argomenti inerenti il programma di ricerca oggetto dell'assegno	Totale	Totale punteggio rapportato al punteggio massimo attribuibile VMC_a
Bice DI BASILIO	5	5	16.67

CANDIDATA	b. valutazione della competenza scientifica, del grado di approfondimento delle ricerche, conoscenza delle metodologie di ricerca da parte del candidato riferito alla produzione scientifica nel suo complesso, accertati mediante la discussione critica del candidato anche con riferimento ai risultati scientifici ottenuti	Totale	Totale punteggio rapportato al punteggio massimo attribuibile VMC_b
Bice DI BASILIO	5	5	16.67

assegnando al termine la seguente votazione:

CANDIDATA	Totale punteggio rapportato a VMC_a per il criterio a	Totale punteggio rapportato a VMC_b per il criterio b	TOTALE
Bice DI BASILIO	16.67	16.67	33.34

La Commissione, considerati i punteggi conseguiti dai candidati nella valutazione dei titoli e delle pubblicazioni, nonché nella valutazione di cui al presente verbale, formula la seguente graduatoria:

Posizione in graduatoria	CANDIDATO	TOTALE in 100
1°	Bice DI BASILIO	69.44
2°	Giulio CARLONE	48.67

Il segretario della Commissione, redige il verbale che viene letto collegialmente dai membri della Commissione ed è sottoscritto da tutti i commissari. I commissari che non dispongono di dispositivi di firma digitale, rilasciano le proprie dichiarazioni di concordanza che sono allegate al verbale e conservate a cura del Segretario. Il verbale è trasmesso all'ufficio preposto dell'Amministrazione a chiusura della procedura concorsuale unitamente agli eventuali verbali relativi alle altre sedute.

La Commissione fa presente che la busta n.2, non estratta, conteneva le seguenti domande.

- 1) Si discuta la rilevanza dei modelli semi-Markoviani per dati ad alta frequenza.
- 2) Si illustrino le principali caratteristiche dei modelli stocastici Markoviani e dei modelli semi-Markoviani.

La seduta è tolta alle ore 12.10.
Letto, approvato e sottoscritto.

LA COMMISSIONE:

Prof. Carlo MARI (Presidente)

Prof.ssa: Angela Anna DE SANCTIS (Componente)

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

Chieti, 05/07/2022



ALLEGATO A

ELENCO DEI CANDIDATI

1. CARLONE Giulio
2. DI BASILIO Bice

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. ANNA ANGELA 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 PROVA ORALE E RELAZIONE FINALE LA SUDETTA PROCEDURA E DI CONCORDARE CON IL VERBALE NUMERO 4 A FIRMA DOTT.SSA CRISTINA DI GIROLAMI, SEGRETARIO DELLA COMMISSIONE GIUDICATRICE.

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

DATA 05 luglio 2022

IN FEDE



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

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 PROVA ORALE E RELAZIONE FINALE LA SUDETTA PROCEDURA E DI CONCORDARE CON IL VERBALE NUMERO 4 A FIRMA DOTT.SSA CRISTINA DI GIROLAMI, SEGRETARIO DELLA COMMISSIONE GIUDICATRICE.

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

DATA 05 luglio 2022

IN FEDE



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