

PROCEDURA SELETTIVA PER LA COPERTURA, MEDIANTE CHIAMATA AI SENSI DELL'ART. 18, COMMA 1, DELLA L. 240/2010, DI N. 1 POSTO DI PROFESSORE UNIVERSITARIO DI RUOLO DI I FASCIA, PRESSO L'UNIVERSITA' DI FOGGIA – DIPARTIMENTO DI ECONOMIA, MANAGEMENT E TERRITORIO PER IL SETTORE CONCORSUALE 13/D4 “METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCIENZE ATTUARIALI E FINANZIARIE” - SETTORE SCIENTIFICO DISCIPLINARE SECS-S/06 “METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCIENZE ATTUARIALI E FINANZIARIE”, BANDITA CON DECRETO RETTORALE N. 18/2023 DEL 12/01/2023 E PUBBLICATA SUL SITO WEB DI ATENEO, ALLA SEZIONE “BANDI PER DOCENTI”, IN DATA 13/01/2023.

### VERBALE N. 3

Il giorno 27/04/2023, alle ore 13.00, si è riunita per via telematica la Commissione giudicatrice della procedura selettiva sopraindicata, nominata con delibera del Senato Accademico n. 86/2023 del 20/03/2023, pubblicato sul sito web di Ateneo ([www.unifg.it](http://www.unifg.it)), alla sezione “Bandi per docenti”, e composta dai:

- Prof.ssa Lucia MADDALENA (Presidente) Professore ordinario per il settore scientifico-disciplinare SECS-S/06  
presso l'Università degli Studi di Foggia
- Prof. Massimiliano FERRARA (Segretario) Professore ordinario per il settore scientifico-disciplinare SECS-S/06  
presso l'Università Mediterranea di Reggio Calabria
- Prof.ssa Francesca PERLA (Componente) Professore ordinario per il settore scientifico-disciplinare SECS-S/06  
presso l'Università degli Studi di Napoli Parthenope

Ciascun membro è presente nella propria sede e utilizzerà per le comunicazioni il proprio indirizzo di posta elettronica istituzionale come segue:

[lucia.maddalena@unifg.it](mailto:lucia.maddalena@unifg.it)

[francesca.perla@uniparthenope.it](mailto:francesca.perla@uniparthenope.it)

[massimiliano.ferrara@unirc.it](mailto:massimiliano.ferrara@unirc.it)

In apertura di seduta la Commissione dà atto che partecipano alla presente procedura i seguenti candidati:

- FANELLI Viviana
- GRASSI Stefano
- GRILLI Luca
- ORLANDO Giuseppe

La Commissione procede, quindi, all'esame della documentazione presentata dai suddetti candidati.

La Commissione, sulla base dell'esame analitico, esprime per ciascun candidato le valutazioni del curriculum, dell'attività di ricerca, delle pubblicazioni scientifiche, dell'attività didattica (compresa quella integrativa e di servizio agli studenti) e dell'attività istituzionale, in conformità ai criteri stabiliti nella riunione preliminare.

Le predette valutazioni vengono allegate al presente verbale e ne costituiscono parte integrante (All. 1).

La seduta è tolta alle ore 19.30.

Letto, approvato e sottoscritto.

#### LA COMMISSIONE GIUDICATRICE

Prof.ssa Lucia MADDALENA,                      Presidente                      \_\_\_\_\_

Prof.ssa Francesca PERLA ,                      Componente                      \_\_\_\_\_

Prof. Massimiliano FERRARA ,                      Segretario                      \_\_\_\_\_

Al termine della seduta, ciascun Commissario trasmette dalla propria sede all'indirizzo di posta elettronica [reclutamentodocente@unifg.it](mailto:reclutamentodocente@unifg.it) del Responsabile del procedimento, per gli adempimenti di competenza, copia del presente verbale letto, approvato, sottoscritto e siglato in ogni foglio. Il Presidente della Commissione è tenuto altresì ad inviare, contestualmente, copia del presente verbale in formato word al medesimo indirizzo.

### Allegato n. 1 al verbale n. 3

## VALUTAZIONE DEL CURRICULUM, DELL'ATTIVITÀ DI RICERCA, DELLE PUBBLICAZIONI SCIENTIFICHE, DELL'ATTIVITÀ DIDATTICA E DEI COMPITI ISTITUZIONALI DEL CANDIDATO:

**FANELLI VIVIANA** Nata a \*\*\*\*\* il \*\*\*\*\*. ASN per il SC 13/D4 conseguita il 13/11/2020.

#### Posizione professionale.

Attualmente Professore Associato del SC 13/D4 presso l'Università degli Studi di Bari Aldo Moro, Dipartimento di Economia, Management e Diritto dell'Impresa dal 01/04/2019  
RTDA del SC 13/D4 presso l'Università di Bari dal 30/12/2013 al 31/03/2019

\*\*\*\*\*

#### Posizioni post-doc.

Assegnista di ricerca presso l'Università di Bari dal 15/06/2013 al 30/12/2013 (Progetto dal titolo: Modelli matematici per il pricing dei prodotti derivati su commodity).

Assegnista di ricerca presso l'Università di Foggia dal giugno 2008 al giugno 2010 (Progetto dal titolo: Lo sviluppo del nuovo mercato energetico in Italia: implicazioni economico-finanziarie).

#### Formazione.

Dottorato di Ricerca in Metodi matematici per le decisioni economiche e finanziarie - XX ciclo - conseguito presso l'Università di Foggia (triennio 2004-2007).

Laurea in Economia e Commercio presso l'Università di Foggia nell'anno 2000

Master in Finanza avanzata (gennaio - luglio 2006) presso l'Istituto per ricerche ed attività educative, Napoli, Corso di Alta Formazione in Energy Finance, Renewables & Commodity Trading (marzo-novembre 2009)

| CURRICULUM E ATTIVITÀ DI RICERCA  | TITOLI VALUTABILI   |
|---|---|
| <p><u>a) organizzazione, direzione e coordinamento di gruppi di ricerca nazionali e internazionali, ovvero la partecipazione agli stessi; altre attività quali la direzione o la partecipazione a comitati editoriali di riviste scientifiche o comitati scientifici o organizzatori di conferenze rilevanti per il settore</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>La candidata ha svolto una buona attività di partecipazione a gruppi di ricerca sia nazionali che internazionali, ricoprendo in alcuni di essi il ruolo di responsabile, su tematiche coerenti con il SC 13/D4. Svolge una limitata attività editoriale e di organizzazione di conferenze inerenti il settore concorsuale.</p> | <p><i>Organizzazione, direzione e coordinamento di gruppi di ricerca nazionali e internazionali, ovvero la partecipazione agli stessi</i></p> <ul style="list-style-type: none"><li>- Membro del <i>COST Action 19130 - Fintech and Artificial Intelligence in Finance - Towards a transparent financial industry</i>, finanziato da European Cooperation in Science and Technology (COST). Durata quadriennale. 31/03/2020-oggi.</li><li>- Proponente e responsabile del progetto di ricerca: <i>Evaluation of the Collateralized Commodity Obligations</i>, in collaborazione con il Prof. Andrea Roncoroni. Finanziato dal Research Grant Program dell'ESSEC Business School, Parigi, Francia. 01/01/2012-31/12/2013.</li><li>- Partecipazione all'attività di gruppo per il progetto <i>La Matematica tra gioco e realtà</i>, Facoltà di Economia, Dipartimento di Scienze Economiche, Matematiche e Statistiche, Università degli Studi di Foggia. Finanziamento</li></ul> |

|   |   |
|---|---|
| <p><u>b) partecipazione in qualità di relatore a congressi e convegni nazionali e internazionali</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>La candidata ha svolto una buona attività convegnistica in qualità di relatrice, in occasione di consessi scientifici inerenti il settore.</p> <p><u>c) conseguimento di premi e riconoscimenti nazionali e internazionali per attività di ricerca</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>La candidata ha conseguito alcuni riconoscimenti internazionali per la sua attività di ricerca. La Commissione pertanto esprime un giudizio buono su tale criterio.</p> | <p>della Fondazione Banca del Monte "D. Siniscalco Ceci". 01/10/2011-30/09/2012.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Responsabile scientifico del progetto di ricerca dal titolo: <i>Commodity markets: statistical arbitrage, price dynamics and long-memory econometrics</i>, finanziato mediante bando Giovani ricercatori 2022 (Decreto Direttoriale n. 502 del 25-11-2022). Il finanziamento si inserisce nel quadro dell'attuazione del Piano Nazionale di Ripresa e Resilienza (PNRR), Missione 4 "Istruzione e Ricerca" – Componente 2 "Dalla ricerca all'impresa", Investimento 1.2 01/01/2023- 31/12/2024</li> <li>- Co-responsabile scientifico del progetto di ricerca dal titolo <i>Metodi quantitativi in Finanza</i>, finanziato mediante bando Giovani ricercatori, Università degli Studi di Foggia. 01/09/2005-01/09/2006</li> </ul> <p><u>Direzione o partecipazione a comitati editoriali di riviste scientifiche</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Membro del Comitato Editoriale della rivista <i>Economics, Management and Financial Markets</i>, Addleton Academic Publishers, New York.</li> </ul> <p><u>Direzione o partecipazione a comitati scientifici o organizzatori di conferenze rilevanti per il settore</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Componente del Comitato organizzatore del XXXIII Convegno annuale A.M.A.S.E.S., Vieste (FG), 13-15 settembre.</li> </ul> <p>La candidata a partire dall'anno 2005 ha presentato 24 relazioni in Convegni nazionali ed internazionali in qualità di Speaker ufficiale. Ha tenuto inoltre due <i>seminari su invito</i> rispettivamente del Dipartimento di Matematica del Politecnico di Milano e dell'Imperial College di Londra.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Seal of Excellence per la proposta di progetto di ricerca <i>Commodity markets: statistical arbitrage, price dynamics and long-memory econometrics</i>, presentato alla action call di Horizon Marie Skłodowska-Curie 2020 in cooperazione con l'University College Dublin, National University of Ireland, Dublino.</li> <li>- Premio assegnato al paper <i>The seasonality in the</i></li> </ul> |
|---|---|

|   |  |
|---|--|
| <p><u>d) rilevanza dell'attività di ricerca globalmente svolta desumibile dall'analisi curriculare</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>L'attività curricolare e di ricerca globalmente svolta della candidata è valutata dalla Commissione più che buona, anche in considerazione dello spettro temporale di attività.</p> | <p><i>Implied Accumulated Volatility of Electricity Options</i> (primo draft del paper dal titolo <i>On the seasonality of the implied volatility of electricity options</i> pubblicato sulla rivista <i>Quantitative Finance</i>), presentato alla conferenza <i>Energy Finance Italia 3 Workshop</i> – Università di Chieti-Pescara Gabriele D'Annunzio, Dipartimento di Economia.</p> |
|---|--|

| PUBBLICAZIONI SCIENTIFICHE  | TITOLI VALUTABILI   |
|---|---|
| <p><u>a) coerenza con le tematiche del settore concorsuale o con tematiche interdisciplinari ad esso pertinenti;</u></p> <p><u>b) qualità della produzione scientifica, valutata all'interno del panorama nazionale e internazionale della ricerca, sulla base dell'originalità, del rigore metodologico e del carattere innovativo;</u></p> <p><u>c) collocazione editoriale dei prodotti scientifici presso editori, collane o riviste di rilievo nazionale o internazionale che utilizzino procedure trasparenti di valutazione della qualità del prodotto da pubblicare;</u></p> <p><u>d) numero e il tipo delle pubblicazioni presentate nonché la continuità della produzione scientifica sotto il profilo temporale;</u></p> <p><u>e) rilevanza delle pubblicazioni all'interno del settore concorsuale, tenuto conto delle specifiche caratteristiche dello stesso e dei settori scientifico-disciplinari ricompresi.</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>La candidata sottopone a valutazione 12 pubblicazioni di cui 10 collocate in riviste di classe A secondo la classificazione ANVUR, 1 collocata su rivista scientifica, e 1 volume. La produzione scientifica della candidata sottoposta a valutazione riguarda principalmente lo sviluppo di modelli</p> | <p>[1] C. Frau, V. Fanelli (2023). <i>Seasonality in commodity prices: new approaches for pricing plain vanilla options</i>. <i>Annals of Operations Research</i>, ISSN 15729338, doi: 10.1007/s10479-022-05128-x.</p> <p>[2] F. Miglietta, F. Di Martino, V. Fanelli (2022). <i>The environmental policy of the Norwegian Government Pension Fund-Global and investors' reaction over time</i>. <i>Business Strategy and the Environment</i>, ISSN 09644733, doi: 10.1002/bse.3324.</p> <p>[3] R. Cerqueti, V. Fanelli (2021). <i>Long memory and crude oil's price predictability</i>. <i>Annals of Operations Research</i>, 299(1): 895-906, ISSN 15729338, doi:10.1007/s10479-019-03376-y.</p> <p>[4] V. Fanelli, L. Maddalena (2020). <i>A nonlinear dynamic model for credit risk contagion</i>. <i>Mathematics and Computers in Simulation</i>, 174, pp. 45-58, ISSN 0378-4754, doi: 10.1016/j.matcom.2020.02.010.</p> <p>[5] V. Fanelli, M.D. Schmeck (2019). <i>On the seasonality of the implied volatility of electricity options</i>. <i>Quantitative Finance</i>, Volume 19(8), pp. 1321-1337, ISSN 1469-7696, doi: 10.1080/14697688.2019.1582792.</p> <p>[6] R. Cerqueti, V. Fanelli, G. Rotundo (2019). <i>Long Run Analysis of Crude Oil Portfolios</i>. <i>Energy Economics</i>, Volume 79, pp. 183-205, ISSN 0140-9883, doi:10.1016/j.eneco.2017.12.005.</p> <p>[7] V. Fanelli (2017). <i>Implications of implicit credit spread volatilities on interest rate modelling</i>. <i>European Journal of Operational Research</i>, Volume</p> |

|  |   |
|--|---|
| <p>stocastici per la valutazione di opzioni, futures e credit spread (1, 4, 8, 9, 10, 11). Particolarmente rilevante il contributo fornito alla modellistica relativamente alla dinamica in presenza di ritardo. Alcune pubblicazioni si riferiscono ad analisi empiriche per la valutazione del comportamento dello stock price, della volatilità implicita e delle proprietà di long term memory di portafogli di commodities. La produzione scientifica della candidata sottoposta a valutazione riguarda pertanto il pricing di opzioni e derivati e l'analisi della volatilità, anche mediante lo studio e l'utilizzo di modelli stocastici e simulazione Monte Carlo. La produzione scientifica è pertanto pertinente al SC 13/D4. Nei lavori eseguiti in collaborazione l'apporto individuale della candidata è desumibile dal suo percorso formativo e dalla produzione complessiva, e dal lavoro a nome singolo. Il rigore metodologico, l'originalità e il carattere innovativo in relazione al panorama nazionale e internazionale di riferimento per il settore concorsuale 13/D4 sono di livello più che buono. La collocazione editoriale è nel complesso molto buona e in grado di assicurare l'adeguata visibilità all'interno del panorama nazionale e internazionale della ricerca per il presente settore concorsuale. La continuità temporale e l'intensità della produzione scientifica sono buone.</p> | <p>263(2), pp. 707–718, ISSN 0377-2217, doi: 10.1016/j.ejor.2017.06.003.<br/> [8] V. Fanelli, L. Maddalena, S. Musti (2016). <i>Modelling electricity futures prices using seasonal path-dependent volatility</i>. Applied Energy, Volume 173, p. 92-102, ISSN 0306-2619, doi: 10.1016/j.apenergy.2016.04.003.<br/> [9] V. Fanelli (2016). <i>A Defaultable HJM Modelling of the Libor Rate for Pricing Basis Swaps after the Credit Crunch</i>. European Journal of Operational Research, Volume 249(1), pp. 238–244, ISSN 0377-2217, doi: 10.1016/j.ejor.2015.08.031.<br/> [10] V. Fanelli, L. Maddalena (2012). <i>A time delay model for the diffusion of a new technology</i>. Nonlinear Analysis: Real World Applications, Volume 13 (2), pp. 643-649, ISSN 1468-1218, doi:10.1016/j.nonrwa.2011.08.001.<br/> [11] C. Chiarella, V. Fanelli, S. Musti (2011). <i>Modelling the evolution of Credit Spreads using the Cox process within the HJM framework: a CDS option pricing model</i>. European Journal of Operational Research Volume 208 (2), pp. 95-108, ISSN 0377-2217. doi: 10.1016/j.ejor.2010.03.006.<br/> [12] V. Fanelli (2020). <i>Financial Modelling in Commodity Markets</i>. New York: Chapman and Hall/CRC, Taylor and Francis Group, doi: 10.1201/9781315184371, ISBN: 978-1-138-73910-9.</p> |
|--|---|

| ATTIVITÀ DIDATTICA   | TITOLI VALUTABILI   |
|--|---|
| <p><u>a) numero dei moduli/corsi tenuti e continuità della tenuta degli stessi</u></p> <p><u>b) partecipazione alle commissioni istituite per gli esami di profitto</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>La candidata ha svolto un'ampia attività didattica, diversificata e tutta d'interesse per il settore. Il giudizio della Commissione è pertanto molto buono.</p> | <p>Presso l'Università di Foggia:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Matematica Generale, Corso di Laurea in Economia Aziendale, Dipartimento di Economia, dall'a.a. 2016/2017 all'a.a. 2019/20</li> </ul> <p>Presso l'Università di Bari Aldo Moro:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Matematica per l'Economia, Corso di Laurea in Marketing e comunicazione d'azienda, Dipartimento di Economia, Management e Diritto dell'Impresa, dall'a.a. 2016/17 - corrente</li> <li>- Matematica Finanziaria, Corso di Laurea in Economia Aziendale, Dipartimento di Economia, Management e Diritto dell'Impresa, dall'a.a. 2014/2015 - corrente</li> </ul> |

|  |  |
|--|--|
| <p><u>c) quantità e qualità dell'attività di tipo seminariale, di quella mirata alle esercitazioni e al tutoraggio degli studenti, ivi inclusa quella relativa alla predisposizione delle tesi di laurea, di laurea magistrale e delle tesi di dottorato</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>L'attività di tutorato e di predisposizione delle tesi di laurea e di laurea magistrale svolta dalla candidata è rilevante. Il giudizio della Commissione è pertanto</p> | <ul style="list-style-type: none"> <li>- Matematica per l'Economia, Corso di Laurea in Economia Aziendale, Dipartimento di Studi Aziendali e Giusprivatistici, a.a. 2014/15 e a.a. 2015/16</li> <li>- Matematica per l'Economia, Corso di Laurea in Economia Aziendale, Facoltà di Economia, sede di Brindisi, a.a. 2010/2011</li> </ul> <p><u>Attività Didattica in Corsi di Dottorato di Ricerca</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Insegnamento <i>Quantitative methods</i> (in lingua inglese) nell'ambito del corso di Dottorato di Ricerca in Economia e Management, Dipartimento di Economia, Management e Diritto dell'Impresa, Università degli Studi di Bari Aldo Moro, dall'a.a. 2019/2020 - corrente</li> <li>- Insegnamento <i>Options: contracts and pricing</i>, Corso di Dottorato di ricerca, XXX Ciclo, Dipartimento di Scienze economiche e aziendali, Università di Cagliari e Sassari, a.a. 2014/2015</li> </ul> <p><u>Attività Didattica ufficiale presso Università straniere</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Incarico di docenza per il modulo di <i>Financial Risk</i>, 8 ore, nel corso di preparazione all'esame per la certificazione Energy Risk Professional (ERP®) rilasciata da Global Association of Risk Professionals (GARP®), presso la Cass Business School (ora Bayes Business School) della City University of London, UK.</li> <li>- Incarico di docenza per il modulo di <i>Financial Risk</i>, 8 ore, nel corso di preparazione all'esame per la certificazione Energy Risk Professional (ERP®) rilasciata da Global Association of Risk Professionals (GARP®), presso l'Università di Ginevra, Svizzera.</li> </ul> <p>La Candidata dichiara numerose esperienze didattiche in percorsi formativi di Master di I e II livello e Corsi di alta formazione</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Dall'a.a. 2007/08 all'a.a. 2010/11 Attività di supporto didattico-scientifico al corso di Modelli Matematici, Corso di Laurea Specialistica in Economia, Mercati Globali e Informazione, Università degli Studi di Foggia. Tutor del corso.</li> <li>- Dall'a.a. 2011/12 all'a.a. 2014/15 Attività di tutorato didattico per il corso di Matematica per l'Economia, Università degli Studi di Bari Aldo Moro, Dipartimento di Economia.</li> <li>- Dall'a.a. 2006/07 all'a.a. 2010/11 Attività di</li> </ul> |
|--|--|

|                |   |
|----------------|---|
| <p>ottimo.</p> | <p>supporto didattico-scientifico per il corso di Matematica Finanziaria, Corso di Laurea in Economia Aziendale, Università degli Studi di Foggia, Facoltà di Economia.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Dall'a.a. 2005/06 all'a.a. 2010/11 Tutor nei corsi di Matematica Generale, Matematica per l'Economia e la Finanza, Matematica Finanziaria 1, Matematica Finanziaria 2, Facoltà di Economia, Università degli Studi di Foggia.</li> <li>- Dall'a.a. 2004/05 all'a.a. 2010/11 Attività di supporto didattico-scientifico per il corso di Matematica per l'Economia e la Finanza, Corso di Laurea in Economia, Facoltà di Economia, Università degli Studi di Foggia.</li> </ul> <p>Relatore di tesi di laurea magistrale e triennale (n° 50 tesi) presso l'Università di Bari.</p> |
|----------------|---|

| ATTIVITÀ ISTITUZIONALI  | TITOLI VALUTABILI   |
|---|---|
| <p><u>volume e continuità delle attività svolte con particolare riferimento agli incarichi di gestione e agli impegni assunti in organi collegiali, commissioni e consulte dipartimentali, di Ateneo, del Ministero dell'Università e della Ricerca ed eventuali attività inquadrabili nella terza missione.</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>La candidata presenta una buona esperienza curriculare nello svolgimento di incarichi gestionali e istituzionali.</p> | <ul style="list-style-type: none"> <li>- Referente del visiting Professor Giulia Iori (City, University of London) per il Dipartimento di Economia, Management e Diritto dell'Impresa, Università degli Studi Aldo Moro di Bari.</li> <li>- Dal 2022 ad oggi Componente del Comitato Tecnico Scientifico del Master di II livello in Economia e Management delle Aziende Sanitarie, Università degli Studi Aldo Moro di Bari, Dipartimento di Economia, Management e Diritto dell'Impresa.</li> <li>- Dal 2019 ad oggi Componente del Collegio dei docenti del corso di Dottorato di Ricerca in Economia e Management, Dipartimento di Economia, Management e Diritto dell'Impresa, Università degli Studi di Bari Aldo Moro.</li> <li>- Dal 2018 ad oggi Componente del Gruppo di Riesame e Qualità dei corsi di studio, Dipartimento di Economia, Management e Diritto dell'Impresa, Università degli Studi di Bari Aldo Moro.</li> <li>- Nel 2019 Componente della Commissione dell'esame finale del Dottorato in Economia e Finanza della Scuola di Dottorato in Economia dell'Università La Sapienza di Roma.</li> <li>- Nel 2017 Componente della Commissione dell'esame finale del Dottorato in Statistica e Finanza Matematica, XXIX ciclo, dell'Università degli Studi di Milano-Bicocca.</li> <li>- Nel 2016 Componente del Gruppo di Orientamento per gli studenti della scuola secondaria, Dipartimento di Economia,</li> </ul> |

|  |  |
|--|--|
|  | <p>Management e Diritto dell'Impresa, Università degli Studi di Bari Aldo Moro.</p> <ul style="list-style-type: none"><li>- Dal 2013 ad oggi Componente del Comitato scientifico ed organizzativo della competizione Maths Challenge per studenti frequentanti il quinto anno della scuola secondaria, Dipartimento di Economia, Università degli studi di Foggia.</li></ul> |
|--|--|

**VALUTAZIONE DEL CURRICULUM, DELL'ATTIVITÀ DI RICERCA, DELLE PUBBLICAZIONI SCIENTIFICHE, DELL'ATTIVITÀ DIDATTICA E DEI COMPITI ISTITUZIONALI DEL CANDIDATO:**

**GRASSI STEFANO** Nato a \*\*\*\*\* il \*\*\*\*\*. ASN per il SSD 13/D2 conseguita il 27/01/2020. In possesso anche della idoneità a ricoprire il ruolo di PO anche per i settori 13/A2 e 13/A5.

Posizione professionale.

Attualmente Professore Associato del SC 13/D2 presso l'Università di Roma Tor Vergata, Dipartimento di Economia e Finanza dal 01/04/2019

Lecturer di Statistica Economica presso l'Università di Roma Tor Vergata, Dipartimento di Economia e Finanza dal 10/11/2016 al 10/11/2019

Lecturer di Economics presso l'Università di Kent (UK) dal 01/08/2013 al 09/11/2016

\*\*\*\*\*.

Posizioni post-doc.

Assegnista Post-Doc presso il CREATES, Dept. of Economics and Business dell'Università di Aarhus (DK), dal 01/01/2011 al 01/07/2013.

Assegnista di ricerca presso l'Università di Perugia presso il Dipartimento di Statistica dal 01/04/2010 al 31/12/2010.

Formazione.

Dottorato di Ricerca in Econometria ed Economia Empirica conseguito presso l'Università di Roma Tor Vergata (conseguito nel maggio 2010).

Laurea in Economia e Commercio presso l'Università della Tuscia nel luglio 2003

Master in Finanza (dicembre 2004) presso l'ISTAO di Ancona (dicembre 2004)

Visiting Positions presso la Free University of Amsterdam, Department of Econometrics, January to July 2009. February 2010.

| CURRICULUM E ATTIVITÀ DI RICERCA  | TITOLI VALUTABILI   |
|---|---|
| <p>a) <u>organizzazione, direzione e coordinamento di gruppi di ricerca nazionali e internazionali, ovvero la partecipazione agli stessi; altre attività quali la direzione o la partecipazione a comitati editoriali di riviste scientifiche o comitati scientifici o organizzatori di conferenze rilevanti per il settore</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>Il candidato ha svolto una limitata attività di partecipazione a gruppi di ricerca sia nazionali che internazionali, su tematiche non sempre coerenti con il SC 13/D4. Svolge una limitata attività editoriale e di organizzazione di conferenze inerenti il settore concorsuale, non sempre perfettamente centrata sugli interessi del settore.</p> | <p><u>Organizzazione, direzione e coordinamento di gruppi di ricerca nazionali e internazionali, ovvero la partecipazione agli stessi</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- PRIN (Progetto di ricerca di interesse nazionale) 2020, <i>Towards an Anticipatory Governance System</i>.</li> <li>- Principal investigator del progetto <i>Big dimensional data: new methods and application</i>, finanziato dal progetto 'Beyond Borders' dell'Università di Roma 'Tor Vergata'.</li> <li>- PRIN (Progetto di ricerca di interesse nazionale) 2012 <i>Modelling and Forecasting Structural Change in Economic and Financial Time Serie</i>.</li> </ul> <p><u>Direzione o partecipazione a comitati editoriali di riviste scientifiche</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Guest Editor del Journal of Risk and Financial Management.</li> <li>- Co-editor della rivista Bayesian Econometrics.</li> </ul> <p><u>Direzione o partecipazione a comitati scientifici o</u></p> |

|  |  |
|--|--|
| <p><u>b) partecipazione in qualità di relatore a congressi e convegni nazionali e internazionali</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>Il candidato ha tenuto relazioni a diversi convegni, per la maggior parte dei quali la finalità scientifica non rientra nel perimetro della declaratoria del SC 13/D4.</p> <p><u>c) conseguimento di premi e riconoscimenti nazionali e internazionali per attività di ricerca</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>Il candidato non ha ricevuto premi e riconoscimenti per attività di ricerca di pertinenza del settore concorsuale.</p> <p><u>d) rilevanza dell'attività di ricerca globalmente svolta desumibile dall'analisi curriculare</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>Dall'analisi curriculare emerge che il candidato ha svolto un'attività di ricerca poco rilevante per il SC 13/D4.</p> | <p><u>organizzatori di conferenze rilevanti per il settore</u></p> <p>- Componente del Comitato organizzatore del “First Rome Workshop of Time Series and Financial Econometrics”, Roma 2019.</p> <p>Il candidato dichiara di essere stato relatore ai seguenti convegni: Ninth Italian Congress of Econometrics and Empirical Economics, Cagliari, 2021 - XXI Workshop on Quantitative Finance, Napoli, 2020 - Eighth Italian Congress of Econometrics and Empirical Economics, Lecce 2019 - 6th and 7th Annual ESOBE Meeting - The IAAE 2014 and 2016 Annual conference - CFE 2009-2010-2011-2013 conferences - 2013 Econometric Institute Erasmus University Rotterdam - GSBE/EFME econometric seminar, Maastricht 2016 [invited speaker, cost cover] - SNDE Conferences 2012 and 2013 - The 34th International Symposium of Forecasting, Rotterdam, The Netherlands, 2014 - Econometric Society, European Meeting, Barcelona, Spain, 2009 - RCEA 9rd Rimini Bayesian Workshop, Rimini, Italy, 2015</p> <p>Winner of NVIDIA Hardware Grant (NVIDIA Corporation), amount received 5,000 pounds. July 2016.</p> |
|--|--|

| PUBBLICAZIONI SCIENTIFICHE                                  | TITOLI VALUTABILI                                      |
|---|--|
| <u>a) coerenza con le tematiche del settore concorsuale</u> | Gli articoli [1] e [2] dell'elenco delle pubblicazioni |

|  |  |
|--|--|
| <p><u>o con tematiche interdisciplinari ad esso pertinenti;</u></p> <p><u>b) qualità della produzione scientifica, valutata all'interno del panorama nazionale e internazionale della ricerca, sulla base dell'originalità, del rigore metodologico e del carattere innovativo;</u></p> <p><u>c) collocazione editoriale dei prodotti scientifici presso editori, collane o riviste di rilievo nazionale o internazionale che utilizzino procedure trasparenti di valutazione della qualità del prodotto da pubblicare;</u></p> <p><u>d) numero e il tipo delle pubblicazioni presentate nonché la continuità della produzione scientifica sotto il profilo temporale;</u></p> <p><u>e) rilevanza delle pubblicazioni all'interno del settore concorsuale, tenuto conto delle specifiche caratteristiche dello stesso e dei settori scientifico-disciplinari ricompresi.</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>Il candidato sottopone a valutazione 12 pubblicazioni di cui 2 non valutabili in quanto non ancora pubblicati. Le 10 pubblicazioni sono tutte collocate in riviste di classe A secondo la classificazione ANVUR. La produzione scientifica del candidato sottoposta a valutazione è rivolta prevalentemente allo studio e analisi di modelli statistici ed econometrici per il trattamento di serie storiche. La produzione scientifica pertanto non è pertinente al SC 13/D4. Se pur alcune applicazioni all'economia e alla finanza possano essere di qualche interesse per il settore, l'approccio e i contributi forniti non sono riconducibile al settore a concorso in quanto la strumentazione utilizzata e i risultati originali ottenuti si riferiscono a tematiche più proprie della Statistica e dell'Econometria, come testimoniato dalla collocazione editoriale delle pubblicazioni sottoposte a valutazione. Nei lavori eseguiti in collaborazione l'apporto individuale del candidato è desumibile dal suo percorso formativo e dalla produzione complessiva. La continuità temporale e l'intensità della produzione scientifica sono buone.</p> | <p>del candidato non sono valutabili in quanto allo stato non hanno acquisito il crisma dell'ufficialità della pubblicazione.</p> <p>[3] <i>Forecasting Crypto Currencies Volatility</i> (2021) with Catania L. <i>International Journal of Forecasting</i>, Vol. 38, 3, 878-894<br/> <a href="https://doi.org/10.1016/j.ijforecast.2021.06.005">https://doi.org/10.1016/j.ijforecast.2021.06.005</a></p> <p>[4] <i>Forecast Density Combinations of Dynamic Models and Data Driven Portfolio Strategies</i> (2019) with Basturk N., Hoogerheide, L., Borowska, A. and van Dijk H. <i>Journal of Econometrics</i>, Vol 200, 170-186.<br/> <a href="https://doi.org/10.1016/j.jeconom.2018.11.011">https://doi.org/10.1016/j.jeconom.2018.11.011</a></p> <p>[5] <i>Forecasting Cryptocurrencies under Model and Parameter Instability</i> (2019) with Catania L. and Ravazzolo, F. <i>International Journal of Forecasting</i>, Vol. 35, 485-501.<br/> <a href="https://doi.org/10.1016/j.ijforecast.2018.09.005">https://doi.org/10.1016/j.ijforecast.2018.09.005</a></p> <p>[6] <i>Selecting Structural Innovations in DSGE Models</i> (2019) with Ferroni, F. and Leon-Ledesma M.A. <i>Journal of Applied Econometrics</i>, Vol. 34, 205-220.<br/> DOI: 10.1002/jae.2664</p> <p>[7] <i>Forecasting with the Standardized Self-Perturbed Kalman Filter</i> (2016), with Nonejad N. and Santucci de Magistris P. <i>Journal of Applied Econometrics</i>, Vol. 32, 318-341.<br/> DOI: 10.1002/jae.2522</p> <p>[8] <i>The R package MitISEM: Efficient and Robust Simulation Procedures for Bayesian Inference</i> (2017), with Basturk N, Hoogerheide, L, Opschoor A, van Dijk H K, <i>Journal of Statistical Software</i> 1-42, ISSN: 1548-7660, doi: 10.18637/jss.v079.i01</p> <p>[9] <i>Parallel Sequential Monte Carlo for Efficient Density Combination: The Deco Matlab Toolbox</i> (2015), with Casarin R., Ravazzolo F. and van Dijk H. K., <i>Journal of Statistical Software</i>, Vol. 68. 1-30.<br/> DOI: 10.18637/jss.v068.i03</p> <p>[10] <i>EuroMInd-C: a Disaggregate Monthly Indicator of Economic Activity for the Euro Area and member countries</i> (2015), with Proietti T., Frale C., Marcellino M. and Mazzi G., <i>International Journal of Forecasting</i>, Vol 31, 712-738.<br/> <a href="http://dx.doi.org/10.1016/j.ijforecast.2014.08.015">http://dx.doi.org/10.1016/j.ijforecast.2014.08.015</a></p> <p>[11] <i>It's all about volatility (of volatility): Evidence from a two-factor Stochastic Volatility model</i> (2014), with Santucci de Magistris P., <i>Journal of Empirical Finance</i>, Vol. 30, 62-78.<br/> <a href="http://dx.doi.org/10.1016/j.jempfin.2014.11.007">http://dx.doi.org/10.1016/j.jempfin.2014.11.007</a></p> <p>[12] <i>Item Response Models to Measure Corporate Social Responsibility</i> (2014), con Nicolosi M. e Stanghellini E., <i>Applied Financial Economics</i>,</p> |
|--|--|

|  |  |
|--|--|
|  | Vol. 24, 1449-1464.<br><a href="https://doi.org/10.1080/09603107.2014.925070">https://doi.org/10.1080/09603107.2014.925070</a> |
|--|--|

| ATTIVITÀ DIDATTICA   | TITOLI VALUTABILI  |
|--|--|
| <p><u>a) numero dei moduli/corsi tenuti e continuità della tenuta degli stessi</u></p> <p><u>b) partecipazione alle commissioni istituite per gli esami di profitto</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>L'attività didattica del candidato non è centrata su discipline proprie del settore concorsuale 13/D4.</p> <p><u>c) quantità e qualità dell'attività di tipo seminariale, di quella mirata alle esercitazioni e al tutoraggio degli studenti, ivi inclusa quella relativa alla predisposizione delle tesi di laurea, di laurea magistrale e delle tesi di dottorato</u></p> | <p>Presso l'Università di Roma Tor Vergata ha svolto i seguenti insegnamenti:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Quantitative Methods dall'a.a. 2017/2018 all'a.a. 2021/2022.</li> <li>- Macroeconometrics, dall'a.a. 2018/19 all'a.a. 2020/21</li> <li>- Financial Econometrics, a.a. 2016-2017</li> <li>- Time Series Analysis, a.a. 2016-2017</li> </ul> <p>Presso la LUISS Guido Carli:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Statistica, dall'a.a. 2018/19 all'a.a. 2020/21</li> <li>- Econometria per la finanza dall'a.a. 2018/19 all'a.a. 2020/21</li> </ul> <p><u>Attività Didattica in Corsi di Dottorato di Ricerca</u></p> <p>Presso l'Università di Roma Tor Vergata:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Bayesian Macroeconomics, dall'a.a. 2018-2019 all'a.a. 2020-2021</li> </ul> <p>Presso l'Università di Kent (UK):</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Bayesian Macroeconomics, aa.aa. 2013-2019/2019-2020/2020-2021</li> </ul> <p>Presso l'Università di Aarhus (Dk):</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Bayesian Macroeconomics., dall'a.a. 2013-2014 all'a.a. 2015-2016</li> </ul> <p><u>Attività didattica ufficiale presso Università straniere</u></p> <p>Presso l'Università Kent (UK):</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Quantitative Economics, dall'a.a. 2013/2014 all'a.a. 2015/2016</li> </ul> <p>Presso l'Università di Aarhus (Dk):</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Time Series Econometrics, dall'a.a. 2011-2012 all'a.a. 2012-2013.</li> </ul> <p>Il candidato dichiara alcune esperienze didattiche in percorsi formativi di Master.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Teaching assistant del corso Time Series for Financial Markets dell'Università LUISS Guido Carli.</li> </ul> <p>Supervisor di tesi di dottorato di ricerca (n° 03 tesi).</p> |

|   |  |
|---|--|
| <p><u>Giudizio:</u></p> <p>Marginale l'attività di tutorato e predisposizione di tesi dichiarata dal candidato.</p> |  |
|---|--|

| ATTIVITÀ ISTITUZIONALI   | TITOLI VALUTABILI   |
|--|---|
| <p><u>volume e continuità delle attività svolte con particolare riferimento agli incarichi di gestione e agli impegni assunti in organi collegiali, commissioni e consulte dipartimentali, di Ateneo, del Ministero dell'Università e della Ricerca ed eventuali attività inquadrabili nella terza missione.</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>Poco rilevante l'attività gestionale e istituzionale dichiarata dal candidato.</p> | <ul style="list-style-type: none"> <li>- Coordinator of Young Universities for the Future of Europe (YUFE) PhD program. Università di Roma 'Tor Vergata', 2020 - corrente</li> <li>- Business Administration and Economics (BAE) committee member, Università di Roma 'Tor Vergata', 2019 - corrente</li> </ul> |

**VALUTAZIONE DEL CURRICULUM, DELL'ATTIVITÀ DI RICERCA, DELLE PUBBLICAZIONI SCIENTIFICHE, DELL'ATTIVITÀ DIDATTICA E DEI COMPITI ISTITUZIONALI DEL CANDIDATO:**

**GRILLI LUCA** Nato a \*\*\*\*\* il \*\*\*\*\*. ASN per il SC 13/D4 conseguita il 02/10/2022.

Posizione professionale.

Attualmente Professore Associato del SC 13/D4 presso l'Università degli Studi di Foggia, dal 16/06/2007

Ricercatore universitario Confermato del SC 13/D4 presso l'Università di Foggia dal 17/04/2001–15/06/2007

Formazione.

Dottorato di Ricerca in Matematica per l'analisi economica e la finanza - Università di Napoli "Federico II", Napoli - data conseguimento 17/01/2004

Laurea in Matematica (4 anni - vecchio ordinamento) Università degli Studi di L'Aquila, L'Aquila, 1994-1998

Master II Livello in Economia e Finanza (MEF), Università di Napoli "Federico II", Napoli (one year, full time) - V edizione

| CURRICULUM E ATTIVITÀ DI RICERCA  | TITOLI VALUTABILI   |
|---|---|
| <p><u>a) organizzazione, direzione e coordinamento di gruppi di ricerca nazionali e internazionali, ovvero la partecipazione agli stessi; altre attività quali la direzione o la partecipazione a comitati editoriali di riviste scientifiche o comitati scientifici o organizzatori di conferenze rilevanti per il settore</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>L'attività di partecipazione e coordinamento di gruppi di ricerca nazionali e internazionali è ampia e per lo più centrata sui temi di interesse per il SC 13/D4. Il candidato è membro dell'editorial board di riviste di interesse per il settore concorsuale. Ha partecipato a numerosi comitati organizzativi di convegni nazionali e internazionali prevalentemente su tematiche proprie del SC 13/D4. Pertanto il giudizio della Commissione sul presente criterio è ottimo.</p> | <p><u>Organizzazione, direzione e coordinamento di gruppi di ricerca nazionali e internazionali, ovvero la partecipazione agli stessi</u></p> <ul style="list-style-type: none"><li>- Research Project: Malta-Italy Mobility for the Exploration and Elaboration of Future Projects in Artificial Intelligence, Robotics and Blockchain in Agri- and Aqua- Culture. Acronimo: MIMOSA. Malta Council for Science and Technology (MCST) (member of the project team)</li><li>- Research Project - TRUBLO OPEN CALL 3 FOR PROPOSALS - Project CERES - Title: AgriCultural product Traceability and mERchant Escrow, This project has received funding from the European Union's Horizon 2020 Research and Innovation programme under grant agreement n° 957228 (member of the project team)</li><li>- Research Project - "Data Analytics applicate alla Learning Analytics" - Responsabile/Tutor Research Fellow - Finanziamento da Progetto di ricerca "TILD (Teaching and Learning Development)", Università di Foggia.</li><li>- Research Project - ARTIFICIAL INTELLIGENCE TO SUPPORT THE DIGITALIZATION AND INDUSTRIAL ENGINEERING PROCESS - Responsabile del Progetto/Tutor Research Fellow - Finanziamento da Bando Competitivo Ministero dello Sviluppo Economico (M.I.S.E.), Progetto MiSE-DGPIIPMI "Industrial engineering and management di impresa", Progetto prot. n. 55214 del 03.03.2021.</li></ul> |

|  |  |
|--|--|
|  | <ul style="list-style-type: none"> <li>- Research Project - ANALISI E STUDIO DELL'IMPATTO DI MODELLI IT-BASED PER LA GOVERNANCE TERRITORIALE, IL MANAGEMENT SANITARIO E LA VALORIZZAZIONE DEL TRASFERIMENTO TECNOLOGICO (Hermes), Dipartimento di Economia, Università di Foggia.</li> <li>- Progetto MARINE - Rete Pugliese Interdisciplinare multi-settore per l'innovazione tecnologica, la ricerca scientifica e lo sviluppo di servizi Marini e Marittimi nell'ambito dell'Economia Blu (Gruppo Energia dal mare) Regione Puglia, (Componente GDL10 e GDL 14 contributo su metodi matematici per il supporto alle decisioni strategiche), da aprile 2016 fino ad oggi.</li> <li>- Progetto PON (cod. 02 00186 3417392 PON 2007-2013) dal titolo: "Soluzioni innovative di packaging per il prolungamento della shelf-life di prodotti alimentari (InFoPack)", responsabile scientifico Prof.ssa Carla Severini (Componente - supporto all'elaborazione dati e alla valutazione delle alternative ottimali con metodi di analisi multicriteria).</li> <li>- P.S.R. 2007-2013 Misura 124 Progetti Integrati di Filiera - 2012 (Responsabile Scientifico Prof. Francesco CONTO) "NORD WINE" - "SUD WINE" - "CEREAL QUALITY" (Componente - Elaborazione dati e stesura di report per ciascuna filiera).</li> <li>- PRIN, Anno 2012, Titolo "Long Life, High Sustainability", Coordinatore Scientifico Piergiovanni Luciano (Univ. di Milano), (Componente - Analisi Multicriteria applicata alla scelta delle diverse alternative).</li> <li>- Progetto ``LOGIN - Logistica integrata", primo proponente/referente: Driving Advances of ICT in South Italy - Net, S. C. AR. L con sede legale presso Università di Bari, finanziato da PON FESR 2007 - progetto Nuove Tecnologie per il Made in Italy (Componente - Analisi Stato dell'arte e della pratica - Analisi statistica e gestione dati).</li> <li>- PRIN, Anno 2011, Titolo "Long Life, High Sustainability", Coordinatore Scientifico Piergiovanni Luciano (Univ. di Milano), approvato e non finanziato (Componente - Applicazione dell'Analisi Multicriteria in contesto fuzzy).</li> <li>- A.A.2009-2010 Progetto Reti di Laboratori LAIFF, capofila centro di ricerca interdipartimentale BioAgroMed, Università di</li> </ul> |
|--|--|

|  |  |
|--|--|
|  | <p>Foggia, finanziato dalla Regione Puglia (Componente - Implementazione e aggiornamento del Laboratorio di Analisi Quantitativa dei Dati).</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Local Project, 2009/2010 Progetto “Lo sviluppo del mercato energetico in Puglia: energie rinnovabili ed implicazioni economico-finanziarie”, finanziato dalla Fondazione Cassa DiRisparmio Di Puglia, (Componente - Modelli Matematici per la gestione delle risorse rinnovabili).</li> <li>- Local Project, Università di Foggia, 2005/2006, Title “Strategical Interactions and Applications to Economics and Finance” (Responsabile - Teoria e Applicazioni della teoria dei giochi).</li> <li>- National Project, PRIN-2004, Titolo “Non-Linear Models in Economics and Finance” (Componente - Teoria e applicazione della teoria dei giochi).</li> <li>- Local Project, Università di Foggia, 2003/2004/2005, Title “Mathematical Methods for Renewable Resources Management” (Responsabile - Modelli matematici per la gestione delle risorse rinnovabili).</li> <li>- National Project PRIN-2002, Titolo “Non-Linear Models in Economics and Finance” (Componente - Teoria e Applicazione della teoria dei giochi).</li> <li>- Local Project, Università di Foggia, 2002, “Mathematical Methods for Decisions in Economics and Finance” (Responsabile - Teoria e Applicazione della teoria dei giochi).</li> <li>- Local Project, Università di Foggia, 2001, “Mathematical Methods in Economics and Finance” (Responsabile - Teoria e Applicazione della teoria dei giochi).</li> <li>- Research Project, 1999-2000, “Quantitative Methods in Finance” at IAC-CNR Roma (Componente - Studio dei Mercati Fixed-Income).</li> </ul> <p><u>Direzione o partecipazione a comitati editoriali di riviste scientifiche</u></p> <p>Membro dell’Editorial Board delle seguenti riviste:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Applied Mathematical Sciences</li> <li>- Journal of Applied Economic Sciences</li> <li>- Symmetry</li> </ul> <p><u>Direzione o partecipazione a comitati scientifici o</u></p> |
|--|--|

|   |  |
|---|--|
| <p><u>b) partecipazione in qualità di relatore a congressi e convegni nazionali e internazionali</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>Il candidato ha partecipato a 38 convegni nazionale e internazionali tutti di interesse per il settore concorsuale. Il giudizio della Commissione su tale criterio è pertanto ottimo.</p> <p><u>c) conseguimento di premi e riconoscimenti nazionali e internazionali per attività di ricerca</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>Dalle dichiarazione del candidato non risulta il</p> | <p><u>organizzatori di conferenze rilevanti per il settore</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- MEMBRO del Technical Program Committee The International Conference on Data Analytics DATAANALYTICS. Convegno annuale organizzato da IARA: International Academy, Research, and Industry Association.</li> <li>- MEMBRO del Technical Program Committee del DBKDA, The International Conference on Advances in Databases, Knowledge, and Data Applications. Convegno annuale organizzato da IARA, International Academy, Research, and Industry Association.</li> <li>- Componente del Comitato Organizzatore del Convegno X IAQVEC 2019, 10TH INT. CONFERENCE ON INDOOR AIR QUALITY, VENTILATION AND ENERGY CONSERVATION IN BUILDINGS. CONFERENCE THEME: HEALTHY NEARLY ZERO ENERGY BUILDINGS.</li> <li>- Membro del Comitato scientifico dell'International Conference on Mathematics and Mathematics Education 2019 (ICMME-2019)</li> <li>- Membro del Comitato scientifico dell'International Conference on Mathematics and Mathematics Education 2018 (ICMME-2018)</li> <li>- Membro del Comitato scientifico della Global Conference on Business, Hospitality and Tourism Research (GLOSEARCH)</li> <li>- Membro del Comitato organizzatore del Convegno A.M.A.S.E.S. 2012</li> <li>- Membro del Comitato organizzatore del II Spain Italy Netherlands Meeting on Game Theory - SING 2.</li> </ul> <p>Il candidato dall'anno 2003 è stato relatore a 38 di Convegni nazionali ed internazionali in qualità di Speaker ufficiale. È stato Keynote Speaker in due Convegni internazionali.</p> |
|---|--|

|   |  |
|---|--|
| <p>conseguimento di premi e riconoscimenti nazionali e internazionali per attività di ricerca</p> <p><u>d) rilevanza dell'attività di ricerca globalmente svolta desumibile dall'analisi curricolare</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>L'attività curricolare e di ricerca globalmente svolta dal candidato è valutata dalla Commissione ottima.</p> |  |
|---|--|

| <b>PUBBLICAZIONI SCIENTIFICHE</b>   | <b>TITOLI VALUTABILI</b>  |
|---|---|
| <p><u>a) coerenza con le tematiche del settore concorsuale o con tematiche interdisciplinari ad esso pertinenti;</u></p> <p><u>b) qualità della produzione scientifica, valutata all'interno del panorama nazionale e internazionale della ricerca, sulla base dell'originalità, del rigore metodologico e del carattere innovativo;</u></p> <p><u>c) collocazione editoriale dei prodotti scientifici presso editori, collane o riviste di rilievo nazionale o internazionale che utilizzino procedure trasparenti di valutazione della qualità del prodotto da pubblicare;</u></p> <p><u>d) numero e il tipo delle pubblicazioni presentate nonché la continuità della produzione scientifica sotto il profilo temporale;</u></p> <p><u>e) rilevanza delle pubblicazioni all'interno del settore concorsuale, tenuto conto delle specifiche caratteristiche dello stesso e dei settori scientifico-disciplinari ricompresi.</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>Il candidato sottopone a valutazione 12 pubblicazioni di cui 11 collocate in riviste di classe A secondo la classificazione ANVUR e 1 su rivista scientifica. La produzione scientifica del candidato sottoposta a valutazione riguarda vari ambiti; parte è rivolta allo sviluppo e analisi di giochi differenziali con applicazioni al settore dell'healthcare, alla valutazione del profitto in competizioni sportive e a modelli di duopolio sull'utilizzo di risorse rinnovabili e sulla concorrenza virtuale; parte è rivolta all'analisi e all'applicazioni dell'uso congiunto di reti neurali e della sentiment analysis o</p> | <p>[1] Luca Grilli and Domenico Santoro. 2022. "Forecasting Financial Time Series with Boltzmann Entropy through Neural Networks" Computational Management Science, 19, pages 665–681 (2022) <a href="https://doi.org/10.1007/s10287-022-00430-2">https://doi.org/10.1007/s10287-022-00430-2</a></p> <p>[2] Alfonso Guarino, Luca Grilli, Domenico Santoro, Francesco Messina, Rocco Zaccagnino. To learn or not to learn? Evaluating autonomous, adaptive, automated traders in cryptocurrencies financial bubbles, Neural Computing and Applications, 34, pages 20715–20756 (2022). <a href="https://doi.org/10.1007/s00521-022-07543-4">https://doi.org/10.1007/s00521-022-07543-4</a>.</p> <p>[3] Luca Grilli, Domenico Santoro, Generative Adversarial Network to evaluate quantity of information in financial markets, Neural Computing and Applications, 34(20), pp. 17473-17490, (2022). <a href="https://doi.org/10.1007/s00521-022-07401-3">https://doi.org/10.1007/s00521-022-07401-3</a>.</p> <p>[4] Luca Grilli, Domenico Santoro, Francesco Colasanto, Giovanni Villani BERT's sentiment score for portfolio optimization: a fine-tuned views in Black and Litterman model, Neural Computing and Applications, 34(20), pp. 17507-17521, (2022). <a href="https://doi.org/10.1007/s00521-022-07403-1">https://doi.org/10.1007/s00521-022-07403-1</a>.</p> <p>[5] Francesco Colasanto, Luca Grilli, Domenico Santoro, Giovanni Villani, ALBERTino for stock price prediction: a Gibbs sampling approach, Information Sciences, Volume 597, 2022, Pages 341-357, ISSN 0020-0255, <a href="https://doi.org/10.1016/j.ins.2022.03.051">https://doi.org/10.1016/j.ins.2022.03.051</a>.</p> <p>[6] M. Bisceglia, R. Cellini, L. Grilli "On the Dynamic Optimality of Yardstick Regulation", Annals of Operations Research, 315(1), pp. 73-92 (2022). <a href="https://doi.org/10.1007/s10479-022-04671-x">https://doi.org/10.1007/s10479-022-04671-x</a></p> <p>[7] M. Bisceglia, L. Grilli, "A Dynamic Private Property Resource Game with Asymmetric Firms", Decisions in Economics and Finance, 43, 109–127 (2020). <a href="https://doi.org/10.1007/s10203-019-00266-7">https://doi.org/10.1007/s10203-019-00266-7</a></p> <p>[8] G. M. Cappelletti; L. Grilli, G. M. Nicoletti, C.</p> |

|  |  |
|--|--|
| <p>di metodi fuzzy alla valutazione dei prezzi azionari e delle criptovalute; un lavoro riguarda l'utilizzo dell'analisi multicriteriale in un contesto fuzzy. In un quadro generale, la produzione scientifica del candidato è da considerare globalmente pertinente al settore concorsuale. Nei lavori eseguiti in collaborazione l'apporto individuale del candidato è desumibile dal suo percorso formativo e dalla produzione complessiva. Il rigore metodologico, l'originalità e il carattere innovativo in relazione al panorama nazionale e internazionale di riferimento per il settore concorsuale 13/D4 sono di livello più che buono. La collocazione editoriale è nel complesso più che buona e in grado di assicurare l'adeguata visibilità all'interno del panorama nazionale e internazionale della ricerca per il presente settore concorsuale. La continuità temporale e l'intensità della produzione scientifica sono buone.</p> | <p>Russo "Innovations in the Olive Oil Sector: a Fuzzy Multicriteria Approach", Journal of Cleaner Production, 159, 2017, pp. 95-105 (<a href="https://doi.org/10.1016/j.jclepro.2017.05.039">https://doi.org/10.1016/j.jclepro.2017.05.039</a>).</p> <p>[9] M. Bisceglia, R. Cellini, L. Grilli "Quality competition in healthcare services with regional regulators: A differential game approach", Dynamic Games and Applications, Vol. 9, Issue 1, pp. 1-23 (2019), <a href="https://doi.org/10.1007/s13235-018-0245-y">https://doi.org/10.1007/s13235-018-0245-y</a></p> <p>[10] M. Bisceglia, A. G. Caputi, L. Grilli, V. Pacelli "Internal Balance and International Competitiveness: Sports Leagues Decision Models", Italian Economic Journal, November 2018, Volume 4, Issue 3, pp 567-578, <a href="https://doi.org/10.1007/s40797-018-0079-1">https://doi.org/10.1007/s40797-018-0079-1</a></p> <p>[11] M. Bisceglia, R. Cellini, L. Grilli "Regional regulators in healthcare service under quality competition: A game theoretical model", Health Economics, Volume 27, Issue 11, November 2018, Pages 1821-1842; <a href="https://doi.org/10.1002/hec.3805">https://doi.org/10.1002/hec.3805</a></p> <p>[12] M. Bisceglia, L. Grilli, "A Differential Game in a Duopoly with Instantaneous Incentives", Decisions in Economics and Finance, Vol. 40, Issue 1-2, pp. 317-333 (2017), (<a href="https://doi.org/10.1007/s10203-017-0189-5">https://doi.org/10.1007/s10203-017-0189-5</a>)</p> |
|--|--|

| ATTIVITÀ DIDATTICA  | TITOLI VALUTABILI   |
|---|---|
| <p>a) <u>numero dei moduli/corsi tenuti e continuità della tenuta degli stessi</u></p> <p>b) <u>partecipazione alle commissioni istituite per gli esami di profitto</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>L'attività didattica del candidato è molto ampia, rilevante, continua e pienamente attinente con il profilo concorsuale del settore. Il giudizio della Commissione su questo criterio è pertanto ottimo.</p> | <ul style="list-style-type: none"> <li>- Semestre 2022/2023: "Decisioni in Economia e Finanza", Università degli Studi di Foggia, Dipartimento di Economia, Management e Territorio, 8 CFU.</li> <li>- I Semestre 2022/2023: "Matematica per l'Economia", Università degli Studi di Foggia, Dipartimento di Economia, Management e Territorio, 8 CFU.</li> <li>- I Semestre 2021/2022: "Matematica Generale", Università degli Studi di Foggia, Dipartimento di Economia, 8 CFU.</li> <li>- I Semestre 2021/2022: "Matematica per l'Economia", Università degli Studi di Foggia, Dipartimento di Economia, Management e Territorio, 8 CFU.</li> <li>- I Semestre 2020/2021: "Matematica Generale", Università degli Studi di Foggia, Dipartimento di Economia, 8 CFU.</li> <li>- I Semestre 2020/2021: "Matematica per l'Economia e la Finanza", Università degli Studi di Foggia, Dipartimento di Economia, 8 CFU.</li> <li>- I Semestre 2019/2020: "Matematica Generale", Università degli Studi di Foggia, Dipartimento di Economia, 8 CFU.</li> <li>- I Semestre 2019/2020: "Matematica per l'Economia e la Finanza", Università degli Studi</li> </ul> |

|  |  |
|--|--|
|  | <p>di Foggia, Dipartimento di Economia, 8 CFU.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- I Semestre 2018/2019: "Matematica Generale", Università degli Studi di Foggia, Dipartimento di Economia, 8 CFU.</li> <li>- I Semestre 2018/2019: "Matematica per l'Economia e la Finanza", Università degli Studi di Foggia, Dipartimento di Economia, 8 CFU.</li> <li>- I Semestre 2017/2018: "Matematica Generale", Università degli Studi di Foggia, Dipartimento di Economia, 8 CFU.</li> <li>- I Semestre 2017/2018: "Matematica per l'Economia e la Finanza", Università degli Studi di Foggia, Dipartimento di Economia, 8 CFU.</li> <li>- I Semestre 2016/2017: "Matematica Generale", Università degli Studi di Foggia, Dipartimento di Economia, 8 CFU.</li> <li>- I Semestre 2016/2017: "Matematica per l'Economia e la Finanza", Università degli Studi di Foggia, Dipartimento di Economia, 8 CFU.</li> <li>- I Semestre 2015/2016: "Matematica Generale", Università degli Studi di Foggia, Dipartimento di Economia, 8 CFU.</li> <li>- I Semestre 2015/2016: "Matematica per l'Economia e la Finanza", Università degli Studi di Foggia, Dipartimento di Economia, 8 CFU.</li> <li>- I Semestre 2014/2015: "Matematica Generale", Università degli Studi di Foggia, Dipartimento di Economia, 8 CFU.</li> <li>- I Semestre 2014/2015: "Matematica per l'Economia e la Finanza", Università degli Studi di Foggia, Dipartimento di Economia, 8 CFU.</li> <li>- I Semestre 2014/2015: "Strumenti Quantitativi per il Supporto alle Decisioni Strategiche In Marketing" (LM), Università degli Studi di Foggia, Dipartimento di Economia, 8 CFU.</li> <li>- I Semestre 2013/2014: "Matematica Generale", Università degli Studi di Foggia, Dipartimento di Economia, 8 CFU.</li> <li>- I Semestre 2013/2014: "Strumenti Quantitativi per il Supporto alle Decisioni Strategiche In Marketing" (LM), Università degli Studi di Foggia, Dipartimento di Economia</li> <li>- II Semestre 2012/2013: "Strumenti Quantitativi per il Supporto alle Decisioni Strategiche In Marketing" (LM), Università degli Studi di Foggia, Dipartimento di Economia, 8 CFU.</li> <li>- I Semestre 2012/2013: "Matematica Generale", Università degli Studi di Foggia, Dipartimento di Economia, 8 CFU.</li> <li>- II Semestre 2011/2012: "Strumenti Quantitativi per il Supporto alle Decisioni Strategiche In Marketing" (LM), Università degli Studi di Foggia, Facoltà di Economia, 8 CFU.</li> <li>- I Semestre 2011/2012: "Matematica Generale", Università degli Studi di Foggia, Facoltà di</li> </ul> |
|--|--|

|  |   |
|--|---|
|  | <p>Economia, 8 CFU.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- II Semestre 2010/2011: "Metodi e Modelli Matematici per l'Economia e l'Ambiente", Università degli Studi di Foggia, Facoltà di Economia, 8 CFU.</li> <li>- I Semestre 2010/2011: "Matematica Generale", Università degli Studi di Foggia, Facoltà di Economia, 8 CFU.</li> <li>- II Semestre 2009/2010: "Metodi e Modelli Matematici per l'Economia e l'Ambiente", Università degli Studi di Foggia, Facoltà di Economia (Manfredonia), 8 CFU.</li> <li>- I Semestre 2009/2010: "Matematica Generale", Università degli Studi di Foggia, Facoltà di Economia, 8 CFU.</li> <li>- II Semestre 2008/2009: "Metodi e Modelli Matematici per l'Economia e l'Ambiente", Università degli Studi di Foggia, Facoltà di Economia (Manfredonia), 8 CFU.</li> <li>- I Semestre 2008/2009: "Matematica Generale", Università degli Studi di Foggia, Facoltà di Economia, 8 CFU.</li> <li>- I Semestre 2007/2008: "Matematica Generale", Università degli Studi di Foggia, Facoltà di Economia, 8 CFU.</li> <li>- II Semestre 2006/2007: "Metodi e Modelli Matematici per l'Economia e l'Ambiente", Università degli Studi di Foggia, Facoltà di Economia (Manfredonia), 8 CFU.</li> <li>- I Semestre 2006/2007: "Matematica Generale", Università degli Studi di Foggia, Facoltà di Economia, 8 CFU.</li> <li>- II Semestre 2005/2006: "Elaborazione Automatica dei Dati per le Decisioni Economiche e Finanziarie", Università degli Studi di Foggia, Facoltà di Economia(Manfredonia), 8 CFU.</li> <li>- II Semestre 2005/2006: "Sistemi Informatici per il Supporto alle Decisioni", Università degli Studi di Foggia, Facoltà di Economia (Manfredonia)</li> <li>- I Semestre 2005/2006: "Matematica Generale", Università degli Studi di Foggia, Facoltà di Economia, 8 CFU.</li> <li>- II Semestre 2004/2005: "Elaborazione Automatica dei Dati per le Decisioni Economiche e Finanziarie", Università degli Studi di Foggia, Facoltà di Economia(Manfredonia), 8 CFU.</li> <li>- II Semestre 2004/2005: "Sistemi Informatici per il Supporto alle Decisioni", Università degli Studi di Foggia, Facoltà di Economia (Manfredonia)</li> <li>- I Semestre 2004/2005: "Matematica Generale", Università degli Studi di Foggia, Facoltà di</li> </ul> |
|--|---|

|  |  |
|--|--|
|  | <p>Economia, 8 CFU.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- II Semestre 2003/2004: "Matematica Generale", Università degli Studi di Foggia, Facoltà di Economia ( Manfredonia), 8 CFU.</li> <li>- II Semestre 2003/2004: "Elaborazione Automatica dei Dati per le Decisioni Economiche e Finanziarie", Università degli Studi di Foggia, Facoltà di Economia (Manfredonia), 8 CFU.</li> <li>- II Semestre 2003/2004: "Sistemi Informatici per il Supporto alle Decisioni", Università degli Studi di Foggia, Facoltà di Economia (Manfredonia)</li> <li>- I Semestre 2002/2003 "Elaborazione Automatica dei Dati per le Decisioni Economiche e Finanziarie", Università degli Studi di Foggia, Facoltà di Economia, 8 CFU.</li> <li>- I Semestre 2002/2003 "Sistemi Informatici per il Supporto alle Decisioni", Università degli Studi di Foggia, Facoltà di Economia</li> <li>- I Semestre 2002/2003 "Matematica Generale", Università degli Studi di Foggia, Facoltà di Economia (Manfredonia), 8 CFU.</li> <li>- II Semestre 2001/2002 "Elaborazione Automatica dei Dati per le Decisioni Economiche e Finanziarie", Università degli Studi di Foggia, Facoltà di Economia (Manfredonia), 8 CFU.</li> </ul> <p><u>Attività Didattica in Corsi di Dottorato di Ricerca</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- “Game Theory and Environment” - 0.5 cfu - Dottorato di Ricerca in Scienze Economiche, XXXVIII Ciclo, a.a. 2022/2023 (in corso)</li> <li>- “Scrittura di un Paper Scientifico con LATEX” - 8 ore, Dottorato in “Economia, cultura, ambiente. Scienze economiche e umanistiche per la valorizzazione dei territori” (XXXVII ciclo), a.a. 2021/2022</li> <li>- “Intelligenza Artificiale: elementi fondanti e applicazioni”, 2 ore, Dottorato in “Neuroscience and Education, XXXVII Ciclo, UniFG, a.a. 2021/2022</li> </ul> <p><u>Attività didattica ufficiale presso Università straniere</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Incarico di Insegnamento per un totale di 16 ore di lezione nel corso: Economic Problems in English. Il corso è incardinato in un Master Degree Program, Faculty of Economics, Poznan University of Life Science (Poland). dal 01-03-2022 al 31-05-2022</li> <li>- Incarico di Insegnamento per un totale di 45 ore di lezione nel corso: Trade Policy Analysis and</li> </ul> |
|--|--|

|  |   |
|--|---|
| <p><u>c) quantità e qualità dell'attività di tipo seminariale, di quella mirata alle esercitazioni e al tutoraggio degli studenti, ivi inclusa quella relativa alla predisposizione delle tesi di laurea, di laurea magistrale e delle tesi di dottorato</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>Il candidato ha svolto un'attività di relatore di tesi di laurea molto consistente ed è stato anche tutor e co-tutor di tesi di dottorato. Il giudizio della Commissione è ottimo.</p> | <p>Forecasting, decisions making and game theory. Il corso è incardinato in un Master Degree Program, Faculty of Economics, Poznan University of Life Science (Poland) dal 01-03-2022 al 31-05-2022</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Incarico di Insegnamento per un totale di 30 ore di lezione nel corso: Trade Policy Analysis and Forecasting, decisions making and game theory. Il corso è incardinato in un Master Degree Program, Faculty of Economics, Poznan University of Life Science (Poland) dal 19-02-2021 al 15-06-2021</li> <li>- Deuxième Module (femmes et developpement), Master Tempus: Femmes, Travail et Formation, Université Cadi Ayyad, Marrakech, Maroc, 23/01/2006-27/01/2006: Course PCIE, 20 ore.</li> <li>- Premier Module (formation des femmes), Master Tempus: Femmes, Travail et Formation, Université de Tunis, 22/11/2005-25/11/2005: Course PCIE, 20 ore.</li> </ul> <p>Il candidato dichiara alcune esperienze didattiche in percorsi formativi di Master.</p> <p>Durante il periodo di servizio presso l'Università di Foggia è stato relatore di 183 tesi di laurea e ha svolto regolarmente attività di ricevimento studenti.</p> <p>Tutor e co-tutor di tesi di dottorato di ricerca (n° 05 tesi) e tutor di assegni di ricerca (n° 02)</p> |
|--|---|

| ATTIVITÀ ISTITUZIONALI   | TITOLI VALUTABILI   |
|--|---|
| <p><u>volume e continuità delle attività svolte con particolare riferimento agli incarichi di gestione e agli impegni assunti in organi collegiali, commissioni e consulte dipartimentali, di Ateneo, del Ministero dell'Università e della Ricerca ed eventuali attività inquadrabili nella terza missione.</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> | <ul style="list-style-type: none"> <li>- COMPONENTE DEL COLLEGIO DEI DOCENTI DEI PhD Programs: <ul style="list-style-type: none"> <li>▪ Dottorato in "SCIENZE ECONOMICHE" Anno accademico di inizio: 2022/2023 - Cielo: XXXVIII</li> <li>▪ Dottorato in "ECONOMIA, CULTURA, AMBIENTE. SCIENZE ECONOMICHE E UMANISTICHE PER LA VALORIZZAZIONE DEI TERRITORI" Anno accademico di inizio:</li> </ul> </li> </ul> |

|   |   |
|---|---|
| <p>Rilevante e continuativa l'attività gestionale e istituzionale svolta sia a livello di corsi di laurea sia a livello di corsi di dottorato. Il giudizio della Commissione è pertanto ottimo.</p> | <p>2021/2022 - Ciclo: XXXVII</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>▪ Dottorato in "ECONOMIA, CULTURA, AMBIENTE. SCIENZE ECONOMICHE E UMANISTICHE PER LA VALORIZZAZIONE DEI TERRITORI" Anno accademico di inizio: 2020/2021 - Ciclo: XXXVI</li> <li>▪ Dottorato di Ricerca in INNOVAZIONE E MANAGEMENT DI ALIMENTI AD ELEVATA VALENZA SALUTISTICA, XXIX Ciclo, Università di Foggia;</li> <li>▪ Dottorato di Ricerca in Economia e Ingegneria Agro-Alimentari, Ambientali e Forestali, XXVII Ciclo, Università degli Studi della Basilicata.</li> <li>▪ Dottorato di Ricerca in Teoria delle Scelte Economiche XXV Ciclo, Università di Foggia.</li> <li>▪ Dottorato di Ricerca in Economia e Finanza, XXII Ciclo, Università di Foggia.</li> <li>▪ Dottorato di Ricerca in Metodi Matematici per le Decisioni Economiche e Finanziarie, XVI-XVIII Ciclo, Università di Foggia.</li> </ul> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Delegato del Rettore ai Dati e Flussi Informativi (dal 27/11/2019 al 09/01/2023)</li> <li>- Delegato alla Didattica, Dipartimento DEMeT, Università di Foggia (dal 28/11/2022 a tutt'oggi)</li> <li>- Responsabile Scientifico del "Data Analytics and Artificial Intelligence Lab" – Dipartimento DEMeT, Università di Foggia (dal 17 dicembre 2020 a tutt'oggi)</li> <li>- Coordinatore del Corso di Studio di Economia e Management L-33, dalla sua istituzione (a.a. 2021-2022 a tutt'oggi)</li> <li>- Coordinatore dello Short Master "Technological core Competencies and Digital Transformation (acronimo T4.0)" - Università di Foggia, a.a. 2021-2022</li> <li>- Direttore del Corso di Perfezionamento "Learning Analytics" - Università Telematica degli Studi IUL e Università di Foggia a.a. 2021-2022</li> <li>- Membro del Comitato Unico di Garanzia (componente supplente dal 14/10/2022 a tutt'oggi), Università di Foggia</li> <li>- Membro del Gruppo di Lavoro per il Piano Energetico di Ateneo (dal 30/09/2022 a tutt'oggi)</li> <li>- Responsabile Laboratori del Polo PUGLIESE – SEZ. FOGGIA – MATEMATICA – 2022-2023 della Fondazione "I Lincei Per la Scuola".</li> <li>- Membro del Gruppo di Lavoro per la PRO3-2021-2023 (dal 25/02/2021 a tutt'oggi)</li> <li>- Membro della Commissione didattica del Dottorato in Scienze Economiche, XXXVIII Ciclo, Università di Foggia</li> <li>- Membro della Commissione didattica del</li> </ul> |
|---|---|

|  |  |
|--|--|
|  | <p>Dottorato in Economia, Cultura e Ambiente, XXXVII Ciclo, Università di Foggia</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Membro della Commissione Orientamento del Dipartimento di Economia, Management e Territorio (dal 03 giugno 2020 a tutt'oggi)</li> <li>- Componente del Presidio di Qualità (dal 2016 al 2021) - Università di Foggia</li> <li>- Coordinatore del Gruppo di Lavoro per il monitoraggio e la revisione delle schede SUA-CDS di Ateneo (dal 2017 - al 2021), Università di Foggia</li> <li>- Coordinatore del Corso di Studio in Economia L-33, Università di Foggia .dal 09/11/2016 al 04/05/2020</li> <li>- Delegato del Direttore del Dipartimento di Economia per i Servizi alla Disabilità (dal 22/09/2017 al 31/03/2020).</li> <li>- Responsabile tecnico e scientifico dell'archivio RePEc presso il Dipartimento di Economia dell'Università di Foggia (dalla sua istituzione a tutt'oggi).</li> <li>- Liceo MATEMATICO - Università di Foggia (Membro del Team di lavoro Team, dalla sua istituzione a tutt'oggi)</li> <li>- Maths Challenge Competition (Coordinatore del Comitato Scientifico dal 2013 a tutt'oggi)</li> </ul> |
|--|--|

**VALUTAZIONE DEL CURRICULUM, DELL'ATTIVITÀ DI RICERCA, DELLE PUBBLICAZIONI SCIENTIFICHE, DELL'ATTIVITÀ DIDATTICA E DEI COMPITI ISTITUZIONALI DEL CANDIDATO:**

**ORLANDO GIUSEPPE** Nato a \*\*\*\*\* il \*\*\*\*\*. NON risulta in possesso dell'ASN per la qualifica posta a concorso.

Posizione professionale.

Attualmente “Full Professor” di Economia, Finanza, Economia Matematica, Matematica Finanziaria e Attuariale, HSE University - Dipartimento di Economia

Professore a contratto presso l'Università di Bari – Dipartimento di Economia e Finanza/Dipartimento di Matematica

Il Candidato ha ricoperto diverse posizioni lavorative presso Istituti Bancari e Assicurativi e Società di consulenza in ambito finanziario e assicurativo.

Posizioni post-doc.

Il Candidato NON ha ricoperto alcuna posizione di ricerca nella qualità di titolare di Assegnista e/o Borsista Post-Doc.

Formazione.

Dottorato di Ricerca in Scienze Sociali, Economiche e Finanziarie presso il Dipartimento di Investimenti Finanziari e Risk Management, Wroclaw University of Economics and Business, Wroclaw, Polonia. (2020-22).

Dottorato di Ricerca in Scienze e Tecnologie presso la Scuola di Scienze e Tecnologie - Università di Camerino, Italia. (2016-20).

Master in Economics tenuto in lingua inglese presso l'università “L. Bocconi” di Milano 1997-98

Laurea/Laurea Magistrale in Economia (110/110 e lode) presso l'Università degli Studi di Bari. Laurea in itinere pre-Bologna. (1989-95).

Visiting Positions presso Nihon (Japan), Ostrava (Repubblica Ceca), Jaén (Spagna), Wroclaw and Warsaw (Polonia).

| CURRICULUM E ATTIVITÀ DI RICERCA  | TITOLI VALUTABILI   |
|---|---|
| <p>a) <u>organizzazione, direzione e coordinamento di gruppi di ricerca nazionali e internazionali, ovvero la partecipazione agli stessi; altre attività quali la direzione o la partecipazione a comitati editoriali di riviste scientifiche o comitati scientifici o organizzatori di conferenze rilevanti per il settore</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>Il candidato ha svolto una limitata attività di partecipazione a gruppi di ricerca sia nazionali che internazionali, su tematiche non sempre coerenti con il SC 13/D4. Svolge una limitata organizzazione di conferenze inerenti il settore concorsuale, e una discreta attività editoriale.</p> | <p><u>Organizzazione, direzione e coordinamento di gruppi di ricerca nazionali e internazionali, ovvero la partecipazione agli stessi</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- 2023 Progetto su” Symmetry and coherence in critical quantum systems” con J. Guerrero (University of Jaén) e M. Calixto (University of Granada)</li> <li>- 2022 Progetto su anomalous diffusion and its applications to fractal domains funded by GNAMPA</li> <li>- 2021 Progetto su mathematic modelling of the impact of SARS-COV-2 transmission dynamics in the province of Jaén with J. Guerrero and A. Lopez, University of Jaén, Spain</li> <li>- 2021 Progetto su oligopolio with M. Lampart and A. Lampartova, Technical University of Ostrava, Repubblica Ceca</li> <li>- 2020 Progetto “twinning:-mathematical modelling for the economics of large complex systems” con Marek Lampart (Technical University of Ostrava, Repubblica Ceca), Carlo Lucheroni (University of Camerino), Emil Adámek (PRIGO University, Repubblica Ceca),</li> </ul> |

|   |  |
|---|--|
| <p><u>b) partecipazione in qualità di relatore a congressi e convegni nazionali e internazionali</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>Il candidato ha tenuto relazioni a diversi convegni, per la maggior parte dei quali la finalità scientifica non sempre rientra nel perimetro della declaratoria del SC 13/D4.</p> <p><u>c) conseguimento di premi e riconoscimenti nazionali e internazionali per attività di ricerca</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>Il candidato ha ricevuto ai primordi del suo</p> | <p>Martin Murín (PRIGO University, Repubblica Ceca), Veronika Nálepová (PRIGO University, Repubblica Ceca), Monika Koepl-Turyna (Eco Austria, Austria)</p> <p><u>Direzione o partecipazione a comitati editoriali di riviste scientifiche</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Associate editor della rivista Mathematical Methods of Operations Research<br/><a href="https://www.springer.com/journal/186/editors">https://www.springer.com/journal/186/editors</a></li> <li>- Member of the editorial board of the Journal of Mathematical Modeling<br/><a href="https://jmm.guilan.ac.ir/journal/editorial.board#edb340">https://jmm.guilan.ac.ir/journal/editorial.board#edb340</a></li> <li>- Member of the editorial board of the Administrative Sciences <a href="https://www.mdpi.com/journal/admsci">https://www.mdpi.com/journal/admsci</a></li> </ul> <p><u>Direzione o partecipazione a comitati scientifici o organizzatori di conferenze rilevanti per il settore</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Membro del comitato organizzatore ITISE 2023 (9th International conference on Time Series and Forecasting), Gran Canaria (Spain), Luglio 12-14, 2023</li> <li>- Membro del comitato organizzatore (invited session organizer) of the 8th annual conference of the Society for Economic Measurement (SEM), Giugno 29-Luglio 1, 2023 at the University of Milano Bicocca, Milano, Italy.</li> <li>- Membro del comitato organizzatore ITISE 2022 (8th International conference on Time Series and Forecasting), Gran Canaria (Spain), from 27th-30th Luglio, 2022.</li> <li>- Membro del comitato organizzatore Euro-Asian Symposium on Economic Theory EASET-2022 Institute of Economics UB RAS X -Ekaterinburg (Russia) 29-30 Giugno 2022</li> </ul> <p>Il candidato dall'anno 2003 è stato relatore a 16 Convegni nazionali ed internazionali in qualità di Speaker ufficiale.</p> <p>Premio "De Finetti" per la Tesi di laurea dell'Accademia Nazionale dei Lincei in Matematica applicata all'Economia conseguito nel 1998.</p> |
|---|--|

|   |  |
|---|--|
| <p>cursus honorem un premio per gli studi contenuti nella sua dissertazione di laurea.</p> <p><u>d) rilevanza dell'attività di ricerca globalmente svolta desumibile dall'analisi curricolare</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>Dall'analisi curricolare emerge che il candidato ha svolto un'attività di ricerca parzialmente centrata sugli interessi del SC 13/D4. Il giudizio della Commissione è pertanto appena sufficiente.</p> |  |
|---|--|

| PUBBLICAZIONI SCIENTIFICHE  | TITOLI VALUTABILI   |
|---|---|
| <p><u>a) coerenza con le tematiche del settore concorsuale o con tematiche interdisciplinari ad esso pertinenti;</u></p> <p><u>b) qualità della produzione scientifica, valutata all'interno del panorama nazionale e internazionale della ricerca, sulla base dell'originalità, del rigore metodologico e del carattere innovativo;</u></p> <p><u>c) collocazione editoriale dei prodotti scientifici presso editori, collane o riviste di rilievo nazionale o internazionale che utilizzino procedure trasparenti di valutazione della qualità del prodotto da pubblicare;</u></p> <p><u>d) numero e il tipo delle pubblicazioni presentate nonché la continuità della produzione scientifica sotto il profilo temporale;</u></p> <p><u>e) rilevanza delle pubblicazioni all'interno del settore concorsuale, tenuto conto delle specifiche caratteristiche dello stesso e dei settori scientifico-disciplinari ricompresi.</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>Il candidato sottopone a valutazione 12 pubblicazioni, di cui 11 collocate in riviste di classe A secondo la classificazione ANVUR e 1 su rivista scientifica. La produzione scientifica del candidato sottoposta a valutazione riguarda prevalentemente l'ambito statistico ed econometrico. Nelle pubblicazioni 1, 5, 6, 9 tecniche di tipo statistico/econometrico sono utilizzate per il trattamento di serie storiche, con applicazioni a serie</p> | <p>[1] GIUSEPPE ORLANDO, MICHELE BUFALO, RUEDI STOOP (2022). FINANCIAL MARKETS' DETERMINISTIC ASPECTS MODELED BY A LOW-DIMENSIONAL EQUATION. SCIENTIFIC REPORTS, P. 1-13, ISSN: 2045-2322, DOI: 10.1038/S41598-022-05765-Z</p> <p>[2] Bufalo M., Liseo B., Orlando G. (2022). Forecasting portfolio returns with skew-geometric Brownian motions. APPLIED STOCHASTIC MODELS IN BUSINESS AND INDUSTRY, ISSN: 1524-1904, doi: 10.1002/asmb.2678</p> <p>[3] Marek Lampart, Al( z)b( e))ta Lampartov('a), Giuseppe Orlando (2022). On extensive dynamics of a Cournot heterogeneous model with optimal response. CHAOS, vol. 32, ISSN: 1054-1500, doi: 10.1063/5.0082439</p> <p>[4] Ruedi Stoop, Giuseppe Orlando, Michele Bufalo, Fabio Della Rossa (2022). Exploiting deterministic features in apparently stochastic data. SCIENTIFIC REPORTS, vol. 12, ISSN: 2045-2322, doi: 10.1038/s41598-022-23212-x</p> <p>[5] Orlando G., Zimatore G. (2020). Recurrence quantification analysis on a Kaldorian business cycle model. NONLINEAR DYNAMICS, ISSN: 0924-090X, doi: 10.1007/s11071-020-05511-y</p> <p>[6] Orlando G., Zimatore G. (2018). Recurrence quantification analysis of business cycles. CHAOS, SOLITONS AND FRACTALS, vol. 110, p. 82-94, ISSN: 0960-0779, doi: 10.1016/j.chaos.2018.02.032</p> <p>[7] Orlando G., Tagliatela G. (2021). On the approximation of the Black and Scholes call function. JOURNAL OF COMPUTATIONAL AND APPLIED MATHEMATICS, vol. 384, ISSN: 0377-0427, doi: 10.1016/j.cam.2020.113154</p> |

|  |  |
|--|--|
| <p>di dati finanziari; le pubblicazioni 3 e 4 forniscono un contributo di natura economica al modello di Cournot; la pubblicazione 2 tratta della distribuzione di probabilità dei return di portafoglio. Nei suddetti lavori il contributo non sempre è riconducibile al settore concorsuale. Nelle pubblicazioni 7, 8, 10 e 11 sono proposte varianti a metodi classici in letteratura di valutazione del prezzo o della volatilità di opzioni. Nelle pubblicazioni 1, 2, 3, 4, 5, 6, 9, se pur alcune applicazioni all'economia e alla finanza possano essere di qualche interesse per il SC 13/D4, l'approccio e i contributi forniti non sono riconducibili al settore a concorso in quanto la strumentazione utilizzata e i risultati originali ottenuti si riferiscono a tematiche più proprie della Statistica e dell'Econometria. Nelle pubblicazioni 7, 8, 10 e 11 il rigore metodologico, l'originalità e il carattere innovativo in relazione al panorama nazionale e internazionale di riferimento per il settore concorsuale 13/D4 sono di livello sufficiente. Il lavoro 12 non è pienamente pertinente al settore concorsuale. In conclusione la produzione scientifica non è tutta pertinente al SC 13/D4. Nei lavori eseguiti in collaborazione l'apporto individuale del candidato è desumibile dal suo percorso formativo e dalla produzione complessiva. La continuità temporale e l'intensità della produzione scientifica sono buone.</p> | <p>[8] Mininni, Michele, Orlando, Giuseppe, Tagliatalata, Giovanni (2021). Challenges in approximating the Black and Scholes call formula with hyperbolic tangents. DECISIONS IN ECONOMICS AND FINANCE, vol. 44, p. 73-100, ISSN:1593-8883, doi: 10.1007/s10203-020-00305-8</p> <p>[9] Orlando G., Zimatore G. (2020). Business cycle modeling between financial crises and black swans: Ornstein-Uhlenbeck stochastic process vs Kaldor deterministic chaotic model. CHAOS, vol. 30, ISSN: 1054-1500, doi: 10.1063/5.0015916</p> <p>[10] Bufalo M., Orlando G. (2022). An improved Barone-Adesi Whaley formula for turbulent markets. JOURNAL OF COMPUTATIONAL AND APPLIED MATHEMATICS, vol. 406, ISSN: 0377-0427, doi: 10.1016/j.cam.2021.113993</p> <p>[11] G. Ascione, F. Mehrdoust, G. Orlando, O. Samimi (2022) "Foreign exchange options on Heston-CIR model under Levy process framework" with, Applied Mathematics and Computation, Applied Mathematics and Computation, doi: 10.1016/j.amc.2023.127851</p> <p>[12] Julio Guerrero, Giuseppe Orlando (2022). Stochastic local volatility models and the Wei-Norman factorization method. DISCRETE AND CONTINUOUS DYNAMICAL SYSTEMS. SERIES S, vol. 0, ISSN: 1937-1632, doi: 10.3934/dcdss.2022026</p> |
|--|--|

| ATTIVITÀ DIDATTICA   | TITOLI VALUTABILI   |
|--|---|
| <p><u>a) numero dei moduli/corsi tenuti e continuità della tenuta degli stessi</u></p> <p><u>b) partecipazione alle commissioni istituite per gli esami di profitto</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>Il profilo curricolare del candidato per quanto attiene all'attività didattica si caratterizza per una particolare impronta internazionale. Per quanto attiene l'attività didattica svolta dal candidato presso Università italiane si rileva che è tutta su corsi avanzati, non si rileva attività didattica su corsi di base e non ha svolto attività didattica in Corsi di</p> | <p>Presso l'Università di Bari ha avuto la titolarità a contratto dei seguenti insegnamenti:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Mathematical Economics, 2020/1 e 2021/2 (in italiano)</li> <li>- Mathematical Models Applied to Finance and Insurance, 2021/2 (in italiano)</li> <li>- Stochastic Processes, 2020/1 e 2021/2 (in italiano)</li> <li>- Financial Markets, 2021/2 (in italiano)</li> <li>- Financial &amp; Actuarial Mathematics, da 2013/4 a 2020/1 (in italiano)</li> <li>- Insurance Techniques, 2013/4 (in italiano)</li> </ul> <p><u>Attività Didattica in Corsi di Dottorato di Ricerca</u></p> |

|   |   |
|---|---|
| <p>Dottorato. Il giudizio complessivo della Commissione per tanto è sufficiente.</p>  | <p>Non risulta attività didattica in Corsi di Dottorato di Ricerca</p> <p><u>Attività didattica ufficiale presso Università straniere</u></p> <p>Presso l’HSE University - Saint Petersburg:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Strategies in Financial Markets and Derivatives, 2022/3</li> <li>- Strategic Financial Management, 2022/3</li> </ul> <p>Presso l’University of Jaén:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Mathematical Analysis, 2022/3</li> <li>- Mathematics I, 2020/1 e 2022/3</li> <li>- Analysis and Numerical Methods, 2020/1</li> </ul> <p>Presso la Warsaw University:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Computational Finance (VBA and R), 2018/9</li> <li>- Credit Ratings, Country Risk/CCPs, 2018/9</li> </ul> <p>Presso la Wroclaw University:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Financial Mathematics, 2018/9</li> <li>- Portfolio Management, 2018/9</li> <li>- Analysis of Financial Time Series, 2018/9</li> </ul> |
| <p><u>c) quantità e qualità dell’attività di tipo seminariale, di quella mirata alle esercitazioni e al tutoraggio degli studenti, ivi inclusa quella relativa alla predisposizione delle tesi di laurea, di laurea magistrale e delle tesi di dottorato</u></p> <p><u>Giudizio:</u></p> <p>L’attività di tipo seminariale, di quella mirata alle esercitazioni e al tutoraggio degli studenti, ivi inclusa quella relativa alla predisposizione delle tesi di laurea, di laurea magistrale e delle tesi di dottorato si enuclea limitatamente alla supervisione di una sola tesi di dottorato. Il giudizio della Commissione è pertanto insufficiente.</p> | <p>Supervisor di tesi di dottorato di ricerca (n° 01 tesi).</p>   |

| ATTIVITÀ ISTITUZIONALI   | TITOLI VALUTABILI                                 |
|--|---|
| <p><u>volume e continuità delle attività svolte con particolare riferimento agli incarichi di gestione e agli impegni assunti in organi collegiali, commissioni e consulte dipartimentali, di Ateneo, del Ministero dell’Università e della Ricerca ed eventuali attività inquadrabili nella terza missione.</u></p> | <p>Non risulta alcuna attività istituzionale.</p> |

Giudizio:

Il candidato non ha svolto alcuna attività inquadrabile nella terza missione o di tipo istituzionale. Il giudizio della Commissione è pertanto insufficiente.