

VERBALI DELLA COMMISSIONE GIUDICATRICE DELLA SELEZIONE PUBBLICA MEDIANTE VALUTAZIONE COMPARATIVA PER IL RECLUTAMENTO DI UN RICERCATORE A TEMPO DETERMINATO AI SENSI ART. 24, COMMA 3, LETTERA A) L. 240/10 PER IL SETTORE CONCORSUALE 13/D4 METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCIENZE ATTUARIALI E FINANZIARIE PRESSO IL DIPARTIMENTO DI SCIENZE ECONOMICHE E STATISTICHE DELL'UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI UDINE, BANDITA CON D.R. N. 881 DEL 12/11/2019, IL CUI AVVISO È PUBBLICATO NELLA G.U. N. 91 DEL 19/11/2019

La Commissione giudicatrice, terminati i lavori della selezione in oggetto, formula la seguente

RELAZIONE FINALE

La Commissione giudicatrice, costituita in base al D.R. N. 64 del 31/01/2020, si è riunita in prima seduta il giorno 27/02/2020, alle ore 9.00, in modalità telematica, ed ha designato quale Presidente il Prof. Marcellino Gaudenzi e quale Segretario il Prof. Pietro Millosovich; in tale seduta ha preso atto dei criteri per la selezione dei candidati.

La Commissione giudicatrice si è riunita il giorno 5/3/2020 alle ore 12.00, in modalità telematica, per la valutazione preliminare comparativa; in tale seduta ha proceduto a prendere visione dei candidati ammessi. Dopo aver verificato che un solo candidato ha presentato domanda ed è stato ammesso alla selezione, la commissione ha provveduto all'esame del curriculum e della produzione scientifica. La commissione ha espresso un giudizio "molto buono" sulla produzione scientifica e sui titoli presentati, ed ha quindi ammesso il candidato Andrea Molent alla discussione orale.

La Commissione giudicatrice si è riunita il giorno 19/3/2020 alle ore 9.15 in modalità di videoconferenza, ai sensi del Decreto Rettorale n. 133 del 11/03/2020 "Modalità di svolgimento delle riunioni delle commissioni giudicatrici e della discussione titoli e pubblicazioni scientifiche nel periodo di emergenza epidemiologica da COVID-19", per lo svolgimento della discussione pubblica dei titoli e della produzione scientifica del candidato.

La commissione ha preso atto che il candidato Andrea Molent è stato informato della nuova modalità di svolgimento della discussione e che lo stesso ha comunicato l'indirizzo Skype per il collegamento.

La commissione si è collegata via Skype alle 9.30 con il candidato Andrea Molent ed ha accertato la sua identità mediante l'esibizione da parte del medesimo del seguente documento di identità: carta d'identità n. **OMISSIS** rilasciata dal **OMISSIS** (ata 22/08/2011), corrispondente al documento di identità allegato alla domanda di partecipazione alla procedura selettiva in oggetto. La commissione ha proceduto alla discussione dei titoli e della produzione scientifica presentati dal candidato. Viene accertata la conoscenza della lingua inglese con esito positivo.

Alle ore 10.05 la commissione termina il collegamento col candidato e procede a un nuovo collegamento tra i membri della commissione. La commissione procede all'attribuzione dei punteggi ai titoli ed alle singole pubblicazioni.

La commissione, con deliberazione assunta all'unanimità dei componenti, dichiara vincitore della presente selezione il sottoindicato candidato:

Molent Andrea Punteggio 81/100

Alla presente relazione finale sono annessi tutti gli allegati delle singole fasi della procedura, che ne fanno parte integrante.

Ciascun commissario sigla in ogni pagina e sottoscrive la propria copia della relazione finale; successivamente genera un file in formato PDF di tale documento, della nota di trasmissione e del proprio documento di identità e li trasmette al Responsabile del Procedimento di questo ateneo all'indirizzo concorsidoc@uniud.it.

Data, 19/3/2020

Prof. Marcellino Gaudenzi
Prof. Silvia Muzzioli
Prof. Pietro Millossovich

Presidente
Componente
Segretario

Two handwritten signatures in black ink. The first signature is on the left and the second is on the right, both appearing to be cursive and somewhat stylized.

VERBALI DELLA COMMISSIONE GIUDICATRICE DELLA SELEZIONE PUBBLICA MEDIANTE VALUTAZIONE COMPARATIVA PER IL RECLUTAMENTO DI UN RICERCATORE A TEMPO DETERMINATO AI SENSI ART. 24, COMMA 3, LETTERA A) L. 240/10 PER IL SETTORE CONCORSUALE 13/D4 METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCIENZE ATTUARIALI E FINANZIARIE PRESSO IL DIPARTIMENTO DI SCIENZE ECONOMICHE E STATISTICHE DELL'UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI UDINE, BANDITA CON D.R. N. 881 DEL 12/11/2019, IL CUI AVVISO È PUBBLICATO NELLA G.U. N. 91 DEL 19/11/2019

ALLEGATO 1) al Verbale 1

CRITERI DI VALUTAZIONE

La Commissione giudicatrice della selezione in oggetto prende atto dei criteri di valutazione previsti dal bando.

La selezione avviene mediante valutazione preliminare dei candidati con motivato giudizio analitico sui titoli, sul curriculum e sulla produzione scientifica, ivi compresa la tesi di dottorato.

La commissione giudicatrice effettua una motivata valutazione seguita da una valutazione comparativa, facendo riferimento allo specifico settore concorsuale e al profilo indicato nell' art. 1 del bando e del curriculum e dei seguenti titoli, debitamente documentati, dei candidati:

- a) dottorato di ricerca o equipollenti, ovvero, per i settori interessati, il diploma di specializzazione medica o equivalente, conseguito in Italia o all'estero;
- b) eventuale attività didattica a livello universitario in Italia o all'estero;
- c) documentata attività di formazione o di ricerca presso qualificati istituti italiani o stranieri;
- d) documentata attività in campo clinico relativamente ai settori concorsuali nei quali sono richieste tali specifiche competenze;
- e) realizzazione di attività progettuale relativamente ai settori concorsuali nei quali è prevista;
- f) organizzazione, direzione e coordinamento di gruppi di ricerca nazionali e internazionali, o partecipazione agli stessi;
- g) titolarità di brevetti relativamente ai settori concorsuali nei quali è prevista;
- h) relatore a congressi e convegni nazionali e internazionali;
- i) premi e riconoscimenti nazionali e internazionali per attività di ricerca;
- j) diploma di specializzazione europea riconosciuto da Board internazionali, relativamente a quei settori concorsuali nei quali è prevista.

La valutazione di ciascun titolo è effettuata considerando specificamente la significatività che esso assume in ordine alla qualità e quantità dell'attività di ricerca svolta dal singolo candidato.

La commissione giudicatrice effettua la valutazione comparativa delle pubblicazioni di cui all'art. 4 del bando sulla base dei seguenti criteri:

- a) originalità, innovatività, rigore metodologico e rilevanza di ciascuna pubblicazione scientifica;
- b) congruenza di ciascuna pubblicazione con il settore concorsuale per il quale è bandita la procedura e col profilo eventualmente indicato nell' art. 1 del bando (*verificare se art. 1 del bando contiene la voce "Profilo"*), ovvero con tematiche interdisciplinari ad essi correlate;
- c) rilevanza scientifica della collocazione editoriale di ciascuna pubblicazione e sua diffusione all'interno della comunità scientifica;
- d) determinazione analitica, anche sulla base di criteri riconosciuti nella comunità scientifica internazionale di riferimento, dell'apporto individuale del candidato nel caso di partecipazione del medesimo a lavori in collaborazione.

La commissione giudicatrice valuta altresì la consistenza complessiva della produzione scientifica del candidato, l'intensità e la continuità temporale della stessa, fatti salvi i periodi, adeguatamente documentati, di allontanamento non volontario dall'attività di ricerca, con particolare riferimento alle funzioni genitoriali.

La commissione, nel valutare le pubblicazioni, si avvale anche dei seguenti indicatori:

- a) numero totale delle citazioni;
- b) numero medio di citazioni per pubblicazione;

- c) "impact factor" totale;
- d) "impact factor" medio per pubblicazione;
- e) combinazioni dei precedenti parametri atte a valorizzare l'impatto della produzione scientifica del candidato (indice di Hirsch o simili).

La commissione prende atto che il bando prevede che i candidati possano presentare le pubblicazioni nel numero massimo di 12.

Qualora il candidato presenti un numero di pubblicazioni superiore al limite indicato, la commissione giudicatrice procederà alla valutazione delle stesse in numero pari al limite di cui sopra e nell'ordine riportato nell' "Elenco delle pubblicazioni presentate" dal candidato. Nel caso in cui il candidato non presenti tale elenco, in numero pari al limite di cui sopra, prendendo in considerazione le più recenti come data di pubblicazione.

A seguito della valutazione preliminare i candidati comparativamente più meritevoli, in regola con i requisiti di cui all'art. 2, primo comma, del bando, e con gli eventuali requisiti ulteriori indicati nel medesimo articolo, saranno ammessi, in misura compresa tra il 10 e il 20 per cento del numero degli stessi e comunque non inferiore a sei unità, alla discussione pubblica con la commissione dei titoli e della produzione scientifica. Saranno tutti ammessi alla discussione qualora il loro numero sia pari o inferiore a sei.

L'esito della valutazione preliminare verrà pubblicato all'Albo on-line di Ateneo e nel sito web dell'Ateneo.

Contestualmente alla discussione dei titoli e delle pubblicazioni la commissione accerterà, con apposita prova orale, la adeguata conoscenza della lingua inglese.

A seguito della discussione la commissione giudicatrice attribuirà un punteggio ai titoli e a ciascuna delle pubblicazioni presentate dai candidati ammessi.

Il punteggio massimo attribuibile a titoli e pubblicazioni è pari a 100 ed è così ripartito:

- titoli 40 punti
- pubblicazioni 60 punti

Letto, approvato e sottoscritto.

In data 27/02/2020

Prof. Presidente
Prof. Componente
Prof. Segretario



ALLEGATO A al Verbale 2
Valutazione dei titoli, del curriculum e della produzione scientifica

- **Candidato:** *Molent Andrea*

Tipologie di titoli	Titoli presentati dal candidato e valutati
Dottorato di ricerca o equipollenti*, ovvero, per i settori interessati, il diploma di specializzazione medica o equivalente, conseguito in Italia o all'estero	Dottorato di Ricerca in "Assicurazione e Finanza: Matematica e Gestione" conseguito presso l'università di Trieste.
Eventuale attività didattica a livello universitario in Italia o all'estero	Collaborazioni didattiche per Matematica Finanziaria, Matematica Generale e Matematica Applicata presso Università di Udine, e per Teoria del Portafoglio e Modelli Matematici per i Mercati Finanziari presso l'Università Politecnica delle Marche in Ancona.
Documentata attività di formazione o di ricerca presso qualificati istituti italiani o stranieri	Master M2 "Mathematique et Applications, parcours Finance", 2014 presso l'Università Parigi Est Marne la Vallée. Due assegni di ricerca: un assegno di ricerca biennale presso l'Università Politecnica delle Marche, in Ancona; un assegno di ricerca annuale presso l'Università degli Studi di Udine.
Documentata attività in campo clinico relativamente ai settori concorsuali nei quali sono richieste tali specifiche competenze	
Realizzazione di attività progettuale relativamente ai settori concorsuali nei quali è prevista	
Organizzazione, direzione e coordinamento di gruppi di ricerca nazionali e internazionali, o partecipazione agli stessi	
Titolarità di brevetti relativamente ai settori concorsuali nei quali è prevista	
Relatore a congressi e convegni nazionali e internazionali	Interventi in qualità di oratore in 4 conferenze internazionali. 5 seminari in Italia e Francia.
Premi e riconoscimenti nazionali e internazionali per attività di ricerca	
Diploma di specializzazione europea riconosciuto da Board internazionali, relativamente a quei settori concorsuali nei quali è prevista	

*(i titoli privi di attestato di equipollenza al dottorato di ricerca potranno essere valutati collocandoli tra altre tipologie di titoli)

Publicazioni presentate dal candidato e valutate: (riportare gli estremi di ciascuna pubblicazione rispettando il limite previsto dal bando)
<i>Goudenège L. – Molent A. – Zanette A., "Pricing and Hedging GLWB in the Heston and in the Black-Scholes with Stochastic Interest Rate Models", Insurance: Mathematics and Economics (2016), 70, 38-57.</i>
<i>Goudenège L. – Molent A. – Zanette A., "Pricing and Hedging GMWB in the Heston and in the Black-Scholes with Stochastic Interest Rate Models", Computational Management Science, 3.4 (2018): 1-10</i>
<i>Goudenège L. – Molent A. – Wei X. - Zanette A. "Fourier-Cosine Method for Pricing and Hedging Insurance Derivatives", Theoretical Economics Letters 8.03 (2018): 282.</i>
<i>Goudenège L. – Molent A. – Zanette A., "Variable Annuities: New Solution to Long-Term Investment Problem", Journal Global Policy and Governance 5.2 (2016): 35-49</i>
<i>Goudenège L. – Molent A. – Zanette A., "Computing Credit Valuation Adjustment solving coupled PIDEs in the Bates model", accettato per la pubblicazione dalla rivista Computational Management Science.</i>
<i>Goudenège L. – Molent A. – Zanette A., 6. "Machine Learning for Pricing American Options in High-Dimensional Markovian and non-Markovian models", accettato per la pubblicazione dalla rivista Quantitative Finance.</i>

Giudizio collegiale:

La commissione esprime il seguente giudizio analitico sui titoli, sul curriculum e sulla produzione scientifica del candidato.

Il candidato ha conseguito la laurea triennale in Matematica con lode e la laurea magistrale in Matematica con lode.



Ha conseguito il Dottorato di Ricerca in “Assicurazione e Finanza: Matematica e Gestione” presso l’università di Trieste. Ha conseguito il Master M2 “Mathematique et Applications, parcours Finance”, 2014 presso l’Università Parigi Est, Marne la Vallée.
Sia il Dottorato di ricerca che il Master sono perfettamente congruenti con il settore scientifico disciplinare oggetto del bando.

E’ stato titolare di assegni di ricerca: per 2 anni presso l’Università Politecnica delle Marche in Ancona, per un anno presso l’Università degli Studi di Udine. Entrambi gli assegni di ricerca riguardavano tematiche perfettamente congruenti con il settore scientifico disciplinare oggetto del bando.

Presenta collaborazioni didattiche per Matematica Finanziaria, Matematica Generale e Matematica Applicata presso Università di Udine, e per Teoria del Portafoglio e Modelli Matematici per i Mercati Finanziari presso l’Università Politecnica delle Marche in Ancona. Interventi in qualità di oratore in 4 conferenze internazionali. Seminari in Italia e Francia.

Tutte le pubblicazioni valutate (dalla 1 alla 6) sono significative per qualità, rigore metodologico e originalità. Il candidato presenta 5 articoli pubblicati su riviste con impact factor, il numero totale di citazioni è 4, l’impact factor totale delle riviste è 7,409 e l’indice di Hirsch è 1. (ISI Web of Science)

La qualità è anche testimoniata dall’importanza internazionale delle riviste scientifiche che ospitano le pubblicazioni del candidato. L’intensità della produzione è più che buona così come la continuità temporale.

In assenza di dichiarazione sul contributo individuale in ogni singola pubblicazione, la commissione valuta paritario il contributo del candidato rispetto a quello di ogni singolo coautore.

Nel complesso esprime un giudizio molto buono sulla produzione scientifica e sui titoli presentati.

Data 5/3/2020

Prof.	Marcellino Gaudenzi	Presidente
Prof.ssa	Silvia Muzzioli	Componente
Prof.	Pietro Millosovich	Segretario



**ALLEGATO A al Verbale 3
Punteggi**

- Candidato: Molent Andrea

Titoli	punti	35
Publicazioni (riportare gli estremi di ciascuna pubblicazione valutata)		
<i>Goudenège L. – Molent A. –Zanette A., "Pricing and Hedging GLWB in the Heston and in the Black-Scholes with Stochastic Interest Rate Models", Insurance: Mathematics and Economics (2016), 70, 38-57.</i>	punti	8
<i>Goudenège L. – Molent A. –Zanette A., "Pricing and Hedging GMWB in the Heston and in the Black-Scholes with Stochastic Interest Rate Models", Computational Management Science, 3.4 (2018): 1-10</i>	punti	8
<i>Goudenège L. – Molent A. – Wei X. - Zanette A. "Fourier-Cosine Method for Pricing and Hedging Insurance Derivatives", Theoretical Economics Letters 8.03 (2018): 282.</i>	punti	8
<i>Goudenège L. – Molent A. –Zanette A., "Variable Annuities: New Solution to Long-Term Investment Problem", Journal Global Policy and Governance 5.2 (2016): 35-49</i>	punti	6
<i>Goudenège L. – Molent A. –Zanette A., "Computing Credit Valuation Adjustment solving coupled PIDEs in the Bates model", accettato per la pubblicazione dalla rivista Computational Management Science.</i>	punti	8
<i>Goudenège L. – Molent A. –Zanette A., 6. "Machine Learning far Pricing American Options in High-Dimensional Markovian and non-Markovian models", accettato per la pubblicazione dalla rivista Quantitative Finance.</i>	punti	8
Totale pubblicazioni	punti	46
TOTALE		
Adeguate conoscenza lingua straniera	Punti SI	81

Data, 19/3/2020

Prof. Marcellino Gaudenzi	Presidente
Prof. Silvia Muzzioli	Componente
Prof. Pietro Millosovich	Segretario