

PROCEDURA VALUTATIVA AI SENSI DELL'ART. 24, COMMA 5, DELLA LEGGE N. 240/2010 AD UN POSTO DI PROFESSORE UNIVERSITARIO DI RUOLO DI SECONDA FASCIA, PRESSO IL DIPARTIMENTO DI ECONOMIA E FINANZA DELL'UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI ROMA "TOR VERGATA" PER IL SETTORE CONCORSUALE 13-D4 E SETTORE SCIENTIFICO DISCIPLINARE SECS-S06

VERBALE N. 2 – VALUTAZIONE

(nдр. con svolgimento della prova di idoneità didattica nello stesso giorno)

Il giorno 11 Marzo alle ore 12:00 si è riunita in via telematica la commissione di valutazione della procedura in oggetto per la valutazione dell'attività didattica, di didattica integrativa, di servizio agli studenti e delle attività di ricerca scientifica nonché delle pubblicazioni scientifiche eventualmente elaborate dal ricercatore successivamente alla data di scadenza del bando in base al quale ha conseguito l'abilitazione scientifica nazionale, sì da verificare la continuità della produzione scientifica.

La commissione prende atto che la candidata, Dott.ssa Katia Colaneri presa visione dei criteri di valutazione stabiliti dalla commissione nella prima seduta tenutasi in data 18 Febbraio 2022, ha comunicato l'accettazione dei suddetti criteri, come da nota dell'Ufficio Concorsi dell'Università.

Ciascuno dei Commissari dichiara, ai sensi dell'art.5, comma 2, del D.L.gs 1172/1948, di non avere un grado di parentela o affinità entro il quarto grado incluso con il candidato e che non sussistono situazioni di incompatibilità tra essi ed il ricercatore, ai sensi degli articoli 51 e 52 c.p.c.

La commissione, quindi, passa ad esaminare la documentazione presentata dalla Dott. Katia Colaneri e resa disponibile con modalità telematiche.

I commissari si impegnano a trattare la documentazione esclusivamente nell'ambito della presente procedura.

Dopo ampio esame collegiale (anche in base alle dichiarazioni espresse in proposito dai commissari coautori), la commissione si dichiara in grado di enucleare come segue il contributo personale del candidato in relazione alle pubblicazioni redatte in collaborazione con i commissari: coerenza con le tematiche sviluppate nel percorso scientifico.

Per quanto riguarda le pubblicazioni redatte in collaborazione con terzi, dopo ampio esame collegiale, la commissione ritiene di poter enucleare il contributo dato dalla candidata *tenuto conto dell'attività scientifica globale sviluppata* e decide di accettare tutti i lavori in parola ai fini della successiva valutazione di merito.

La commissione, terminata la fase di enucleazione dei contributi personali della candidata, esamina l'attività didattica, di didattica integrativa, di servizio agli studenti, le attività di ricerca scientifica, il curriculum e le pubblicazioni e, redatto un breve curriculum della candidata, formula il seguente giudizio collegiale:

Breve curriculum della candidata



La Dott.ssa Katia Colaneri ha conseguito nell'anno 2009, la Laurea Specialistica in Matematica presso l'Università degli Studi di Roma 3 con la votazione di 110 e Lode. Nell'anno 2013 ha conseguito il titolo di Dottore di Ricerca in Matematica presso l'Università di Chieti-Pescara, con menzione aggiuntiva di Doctor Europaeus.

E' stata titolare, dal 2014 al 2016, di un assegno di ricerca presso l'Università di Chieti-Pescara. Dal 2016 al 2017 è stata Ricercatrice a Tempo Determinato l. 240 lett. a), SSD SECS-S/06 presso l'Università degli Studi di Perugia. Da Novembre 2017 a Maggio 2019 è stata Lecturer in Financial and Actuarial Mathematics presso la School of Mathematics dell'Università di Leeds (UK). Dal Giugno 2019 alla data presente è assunta come Ricercatrice a Tempo Determinato l. 240 lett. b), settore concorsuale 13/D4, S.S.D. SECS-S/06, presso il Dipartimento di Economia e Finanza dell'Università degli Studi di Roma Tor Vergata. Ha conseguito, in data 20 Dicembre 2019, l'Abilitazione Scientifica Nazionale come professore di seconda fascia nel settore concorsuale 13/D4.

La sua attività di ricerca si focalizza sullo studio di problemi di ottimizzazione legati ad applicazioni in ambito finanziario e attuariale, con particolare riferimento al caso dell'informazione incompleta. Le sue tematiche di ricerca includono problemi di filtraggio e controllo stocastico in informazione completa e parziale; metodi per la valutazione e la copertura di derivati finanziari e contratti assicurativi, e ottimizzazione di portafoglio in mercati incompleti e in contesto di informazione parziale.

Ha partecipato come relatrice a numerosi convegni di carattere sia nazionale che internazionale.

Attività didattica, di didattica integrativa e di servizio agli studenti

Relativamente all'attività didattica, di didattica integrativa e di servizio agli studenti, la Dott.ssa Katia Colaneri ha svolto, nel triennio da RTDb, incarichi di insegnamento presso l'Università degli Studi di Roma Tor Vergata. In particolare,

Anno Accademico 2019/2020.

- Titolare del corso: Mathematics 1B (3CFU, 20 ore), Laurea Triennale "Business Administration and Economics", Università di Roma Tor Vergata
- Titolare del corso: Mathematics 2 (6CFU, 38 ore), Laurea Triennale "Business Administration and Economics", Università di Roma Tor Vergata
- Titolare del corso: Pricing and Hedging in complete and incomplete markets (3cfu, 20 ore), PhD in Economics and Finance, Università di Roma Tor Vergata

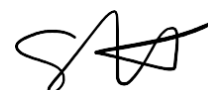
Anno Accademico 2020/2021.

- Titolare del corso: Mathematics 2 (6CFU, 42 ore), Laurea Triennale "Business Administration and Economics", Università di Roma Tor Vergata
- Titolare del corso: Pricing and Hedging in Complete and Incomplete Markets (3cfu, 20 ore), PhD in Economics and Finance, Università di Roma Tor Vergata
- Titolare del corso: Life Insurance (6CFU, 36 ore), Laurea Magistrale "Finance and Banking", Università di Roma Tor Vergata

Anno Accademico 2021/2022

- Titolare del corso: Mathematics 1 (6CFU, 36 ore), Laurea Triennale "Business Administration and Economics", Università di Roma Tor Vergata
- Titolare del corso: Pricing and Hedging in Complete and Incomplete Markets (3cfu, 20 ore), PhD in Economics and Finance, Università di Roma Tor Vergata
- Titolare del corso: Life Insurance (6CFU, 36 ore), Laurea Magistrale "Finance and Banking", Università di Roma Tor Vergata

La Dott.ssa Colaneri è stata membro di numerose commissioni di esame, nonché di commissioni di Laurea e di Laurea Magistrale. E' stata relatrice di due tesi di Laurea Magistrale "Finance and Banking". A partire dall'anno accademico 2020/2021 è membro del consiglio di corso di Dottorato



in Economics and Finance presso l'Università degli studi di Roma "Tor Vergata". Ha tenuto un corso di Dottorato presso l'Università di Firenze nel 2020.

Complessivamente l'attività didattica, di didattica integrativa e di servizio agli studenti della candidata è ampia e continua sin dalla presa di servizio. L'attività di relatrice di tesi e la partecipazione alle attività del consiglio di corso di Dottorato attestano poi il suo coinvolgimento nelle attività relative alla didattica di pertinenza del Dipartimento di Economia e Finanza.

Attività di ricerca

La candidata è stata principal investigator di due progetti finanziati da INdAM-GNAMPA e di un progetto parzialmente finanziato dall'Ateneo di Roma Tor Vergata, e ha partecipato a numerosi progetti di ricerca di cui un progetto PRIN.

Ha svolto diversi periodi di ricerca all'estero presso: Vienna University of Economics and Business, ETH Zurigo, Università di Parigi 6 Pierre et Marie Curie.

Durante il triennio 2019-2022 è stata relatrice a sei convegni di ottimo livello internazionale.

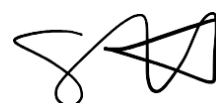
La partecipazione ai congressi, sia di carattere nazionale che internazionale, è continua nel tempo.

Dal 2019 è membro del TC7. E' stata organizzatrice dei seminari interni al dipartimento, guest editor per uno special issue della rivista Mathematics ed è stata membro del comitato organizzatore di un convegno AMASES.

Pubblicazioni

Relativamente alle pubblicazioni della Dott.ssa Katia Colaneri, nel periodo precedente al triennio di servizio in qualità di RTDb, risultano nove contributi: otto contributi su riviste scientifiche di livello internazionale con revisione paritaria di cui cinque in fascia A per il settore concorsuale 13/D4, e un contributo in volume capitoli di libro. Nel periodo relativo al triennio di servizio in qualità di RTDb (ovvero il triennio 03 Giugno 2019 - 02 Giugno 2022) la candidata ha pubblicato dieci contributi, tutti coautorati, su riviste scientifiche di livello internazionale con revisione paritaria di cui nove inserite nella fascia A per il settore concorsuale 13/D4. Tenuto conto dell'attività scientifica globale sviluppata, l'apporto della candidata è considerato paritario nei lavori in collaborazione. Complessivamente i prodotti della ricerca appaiono essere numerosi (con un'ottima continuità ed intensità temporale) e di ottimo livello (sia dal punto di vista dell'originalità, dell'innovatività, del rigore metodologico, della rilevanza scientifica della collocazione editoriale di ciascuna pubblicazione e della sua diffusione all'interno della comunità scientifica) come è dimostrato dalle collocazioni editoriali di alcune di essi: Siam Journal on Financial Mathematics, Stochastic Processes and Their Applications, Insurance: Mathematics and Economics, Electronic Journal of Probability. La produzione scientifica, che comprende lo studio di processi stocastici e problemi di filtraggio e controllo stocastico con informazione completa o parziale, valutazione e copertura di derivati finanziari e assicurativi in mercati incompleti ed in contesto di informazione completa o parziale, è valutata completamente congrua con il settore scientifico disciplinare di inquadramento (SECS-S/06) e con il relativo settore concorsuale (13/D4).

Complessivamente, le pubblicazioni risultano essere perfettamente congrue con il profilo di professore universitario di seconda fascia. L'impatto in termini di citazioni è discreto e promettente, essendo 7 il suo H-index e 97 il numero totale delle citazioni (incluse autocitazioni) ricevute dai suoi lavori.



La commissione valuta inoltre come perfettamente congruo con le esigenze di ricerca dell'ateneo il profilo scientifico della candidata. Inoltre valuta come perfettamente congrua con le esigenze di ricerca dell'ateneo la produzione scientifica elaborata dalla candidata successivamente alla data di scadenza del bando in base al quale ha conseguito l'abilitazione scientifica nazionale.

Successivamente, la commissione chiama la candidata, Dott.ssa Katia Colaneri, della quale viene accertata l'identità personale, come da foglio firma allegato al presente verbale, per la prova di idoneità didattica, che conformemente a quanto stabilito nella seduta preliminare, consiste in una lezione di argomento "Life Insurance Contracts" destinata a studenti di laurea magistrale e si svolge in inglese e online sulla piattaforma Microsoft Teams.

Terminata la prova, la candidata viene invitata a lasciare il collegamento.

La commissione formula il seguente giudizio collegiale in merito alla prova di idoneità didattica: la candidata mostra una ottima padronanza dell'argomento e lo espone con chiarezza e precisione.



Al termine dei lavori, la commissione con deliberazione assunta all'unanimità, sulla base dei giudizi collegiali espressi, dichiara che la Dott.ssa Katia Colaneri è valutata positivamente e quindi qualificata per ricoprire il posto di professore di ruolo di seconda fascia presso il Dipartimento di Economia e Finanza per il settore concorsuale 13/D4 e settore scientifico disciplinare SECS-S06.

Il presente Verbale è redatto in unico originale, siglato in ogni pagina e sottoscritto dal Prof. Herzel e corredato da dichiarazione di formale sottoscrizione per via telematica dagli altri componenti della commissione.

La commissione provvederà a consegnare il presente verbale al responsabile del procedimento Dott.ssa Annalisa De Cesare per i conseguenziali adempimenti.

Roma, 11-03-2022

Letto ed approvato (cfr. dichiarazioni delle Prof. Maria Elvira Mancino e Cecilia Mancini in collegamento telematico allegate al presente verbale), sottoscritto dal Prof. Stefano Herzel.

 
(STEFANO HERZEL)