

Procedura valutativa ai sensi dell'articolo 24 comma 6 della legge 30 dicembre 2010, n. 240 per la chiamata di un 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 -Metodi Matematici dell'economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie- e settore scientifico disciplinare SECS-S/06 - Metodi Matematici dell'economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie- (Riferimento n.1952)

Verbale n. 3 – Relazione finale

La commissione esaminatrice della procedura valutativa di cui in epigrafe, nominata dal Magnifico Rettore con Decreto rettorale n.2246 del 25/07/2022 e così costituita:

- Prof. Sergio Scarlatti
- Prof. Massimo Costabile
- Prof. Andrea Scozzari

avvalendosi di strumenti telematici di lavoro collegiale si è riunita:

- a) la prima volta in data 1/08/2022 alle ore 15.00 per la predeterminazione dei criteri di massima per la valutazione della candidata;
- b) la seconda volta in data 5/09/2022 alle ore 9.30 per la valutazione dei titoli, del curriculum e delle pubblicazioni scientifiche della candidata, per lo svolgimento della prova di idoneità didattica e per l'accertamento delle competenze linguistiche della candidata.

Prima seduta

In apertura di seduta, ognuno dei commissari ha reso le seguenti dichiarazioni:

- ai sensi dell'art. 5, comma 2, del D.lgs. n. 1172 del 1948, di non avere un grado di parentela o affinità, fino al quarto grado incluso, con gli altri componenti della commissione;
- l'inesistenza di situazioni di incompatibilità tra essi ai sensi degli articoli 51 e 52 del codice di procedura civile;
- di non aver riportato condanne penali, anche con sentenza non passata in giudicato, per i reati previsti nel capo I, titolo II, del libro secondo del codice penale.

Sono state, quindi, affidate le funzioni di Presidente al Prof. Sergio Scarlatti e le funzioni di Segretario al Prof. Andrea Scozzari.

Successivamente, la commissione:

- rilevata la piena legittimità ad operare secondo norma, essendo pervenuta all'Ateneo istanza di rinuncia alla ricusazione dei commissari da parte della candidata;
- presa visione della normativa, anche regolamentare, vigente nonché della *lex specialis* relative alla procedura valutativa di cui in epigrafe;
- preso atto che costituiscono oggetto della valutazione, che verrà espressa mediante un giudizio collegiale, i titoli e le pubblicazioni scientifiche, nonché l'accertamento dell'idoneità didattica e l'accertamento delle competenze linguistiche,

ha predeterminato i criteri di massima per la valutazione della candidata, riportati nell'allegato A), che costituisce parte integrante e sostanziale del presente verbale.

Seconda seduta

In apertura della seconda seduta, ognuno dei commissari, presa visione dell'elenco dei candidati, ha reso le seguenti dichiarazioni:

- ai sensi dell'art. 5, comma 2, del D.lgs. n. 1172 del 1948, di non avere un grado di parentela o affinità, fino al quarto grado incluso, con l'unica candidata;



- l'inesistenza di situazioni di incompatibilità tra ciascuno di essi e l'unica candidata ai sensi degli articoli 51 e 52 del codice di procedura civile.

La commissione, quindi, constatato di essere nelle condizioni di procedere alla valutazione secondo norma, essendo trascorso il termine di sette giorni dalla data di avvenuta pubblicazione dei criteri per la valutazione della candidata, senza che sia stata elevata alcuna istanza di ricusazione dei suddetti criteri, ha preso in esame la documentazione presentata telematicamente dalla candidata ai fini della partecipazione alla procedura, inviata dall'Ufficio Concorsi a ciascun commissario.

Come prima operazione la commissione ha accertato che la candidata Dott. ANNALISA FABRETTI non ha presentato un numero di pubblicazioni superiori al numero massimo previsto nel decreto rettorale di indizione della procedura, fissato in n. 10 pubblicazioni.

La commissione, quindi, è passata alla valutazione dei titoli, comprensivi dell'attività didattica, dell'attività scientifica e dei servizi prestati, del curriculum complessivo e delle pubblicazioni della candidata e, tenendo conto dei criteri di valutazione stabiliti nella riunione preliminare, dopo ampia discussione, ha formulato un motivato giudizio analitico collegiale, contenuto nelle schede di valutazione di cui all'allegato B), che costituisce parte integrante e sostanziale del presente verbale.

Successivamente, sono stati svolti la prova di idoneità didattica e l'accertamento delle competenze linguistiche, costituiti rispettivamente in una lezione di Matematica Generale riguardante il teorema fondamentale del calcolo integrale e in una lettura e comprensione di un testo scientifico in inglese svolti pubblicamente su piattaforma Microsoft Teams, come da avviso di convocazione debitamente pubblicato sul sito istituzionale dell'Ateneo.

La commissione, quindi:

- verificato il regolare funzionamento del collegamento telematico;
- effettuate le operazioni di appello;
- constatata la presenza della Dott.ssa ANNALISA FABRETTI, unica candidata iscritta alla procedura;
- reso noto che la prova di idoneità didattica e l'accertamento delle competenze linguistiche sono pubbliche;
- verificata l'identità personale della candidata prima dell'inizio della relativa prova e del relativo accertamento;

ha chiamato la candidata ed è stata svolta la prova di idoneità didattica e l'accertamento delle competenze linguistiche della candidata convocata.

Conclusi la prova e l'accertamento, la commissione esaminatrice, chiuso il collegamento pubblico, procedendo in via riservata, ha formulato un giudizio collegiale in merito alla prova di idoneità didattica e all'accertamento delle competenze linguistiche svolti, riportato nella scheda dell'allegato C), che costituisce parte integrante e sostanziale del presente verbale.

Quindi, dato atto del positivo esito della prova e dell'accertamento, la commissione è passata a riesaminare il giudizio collegiale espresso, ivi incluso il giudizio collegiale espresso per la valutazione dei titoli, del curriculum e delle pubblicazioni scientifiche, e, dopo attenta e approfondita discussione, all'esito della procedura ha individuato all'unanimità dei componenti la Dott.ssa ANNALISA FABRETTI quale **candidata qualificata** a svolgere le funzioni didattico-scientifiche per le quali è stato emanato il bando per le seguenti motivazioni:

La candidata ha partecipato attivamente a gruppi di ricerca nazionali ed internazionali; la candidata ha svolto attività didattica coerente con le tematiche del SSD oggetto della presente valutazione nell'ambito della laurea triennale, magistrale e del dottorato di ricerca; infine, buona è la partecipazione e l'organizzazione di congressi. La candidata ha svolto attività scientifica su tematiche di specifico interesse del SSD oggetto della presente valutazione, mostrando buona originalità, buon rigore metodologico. Buona la rilevanza scientifica della collocazione editoriale. La prova didattica del candidato è valutata all'unanimità più che positivamente e, pertanto, ritenuta superata con giudizio ottimo. Le argomentazioni ed i concetti sono stati illustrati in modo chiaro. Nell'accertamento delle competenze linguistiche la candidata ha dimostrato, a giudizio unanime,

padronanza linguistica nella lettura e nella comprensione.

Terminati i lavori, la commissione esaminatrice ha redatto il verbale n. 3 e la presente relazione finale dei lavori, ed ha provveduto a trasmettere gli atti e i relativi allegati al responsabile del procedimento per i consequenziali adempimenti.

La presente relazione finale e i rispettivi allegati letti, redatti, sottoscritti e siglati su ogni pagina dal Prof. Sergio Scarlatti, sono integrati dalle dichiarazioni di partecipazione e di concordanza con i relativi contenuti del Prof. Massimo Costabile e del Prof. Andrea Scozzari, di cui agli allegati D) e E), che costituiscono parte integrante e sostanziale del verbale cui si riferiscono.

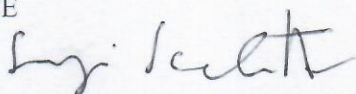
Data 05/09/2022

LA COMMISSIONE ESAMINATRICE

Prof. Sergio Scarlatti *Presidente*

Prof. Massimo Costabile *componente*

Prof. Andrea Scozzari *Segretario*



Procedura valutativa ai sensi dell'articolo 24 comma 6 della legge 30 dicembre 2010, n. 240 per la chiamata di un 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 -Metodi Matematici dell'economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie- e settore scientifico disciplinare SECS-S/06 - Metodi Matematici dell'economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie- (Riferimento n.1952)

La commissione esaminatrice della procedura valutativa di cui in epigrafe, coerentemente a quanto riportato nel decreto rettorale di indizione della procedura valutativa, determina i seguenti:

CRITERI DI VALUTAZIONE	
Titoli e pubblicazioni	
A) per quanto riguarda l'attività scientifica e didattica, nonché per i servizi prestati:	<p>I) l'attività di coordinamento e di organizzazione di gruppi di ricerca e la partecipazione ad essi;</p> <p>II) l'attività didattica frontale in corsi di laurea, di laurea magistrale, di dottorato di ricerca e di master universitari, presso università italiane e straniere, nonché il coordinamento di iniziative in campo didattico svolte in ambito nazionale e internazionale;</p> <p>III) l'organizzazione di congressi e/o workshop nazionali ed internazionali o la partecipazione ad essi</p>
B) ai fini della determinazione dell'apporto individuale del/della candidato/a nei lavori in collaborazione con i commissari e/o con i terzi:	<p>a) in mancanza di esplicita dichiarazione da parte degli autori si assume che il contributo sia paritetico</p>
C) per quanto riguarda la produzione scientifica del/della candidato/a, da effettuarsi previa individuazione dell'apporto individuale nei lavori in collaborazione:	<p>I) originalità e innovatività della produzione scientifica e rigore metodologico;</p> <p>II) congruenza dell'attività del candidato con le discipline comprese nel settore concorsuale e nel settore scientifico-disciplinare di cui alla procedura;</p> <p>III) rilevanza scientifica della collocazione editoriale delle pubblicazioni e loro diffusione all'interno della comunità scientifica;</p> <p>IV) continuità temporale della produzione scientifica, anche in relazione all'evoluzione delle conoscenze del settore scientifico disciplinare oggetto della procedura.</p>
Prova di idoneità didattica	

<i>a) conoscenza dell'argomento;</i>
<i>b) capacità di inquadramento sistematico;</i>
<i>c) ampiezza e qualità delle argomentazioni</i>
<i>d) chiarezza, completezza ed efficacia nell'esposizione</i>
Accertamento delle competenze linguistiche
<i>a) chiarezza ed efficacia nella lettura, nella comprensione e nell'esposizione</i>

Il presente allegato costituisce parte integrante e sostanziale del verbale cui si riferisce.

LA COMMISSIONE ESAMINATRICE

Prof. Sergio Scarlatti *Presidente*



Prof. Massimo Costabile *componente*

Prof. Andrea Scozzari *Segretario*

Procedura valutativa ai sensi dell'articolo 24 comma 6 della legge 30 dicembre 2010, n. 240 per la chiamata di un 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 -Metodi Matematici dell'economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie- e settore scientifico disciplinare SECS-S/06 - Metodi Matematici dell'economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie- (Riferimento n.1952)

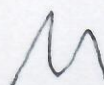
Valutazione dei titoli, del curriculum e delle pubblicazioni scientifiche

ANNALISA FABRETTI	
Titoli e curriculum	
I) <i>l'attività di coordinamento e di organizzazione a gruppi di ricerca e la partecipazione a essi;</i>	<p>La candidata ha partecipato a diversi gruppi di ricerca su tematiche inerenti il SSD in oggetto:</p> <p>-Partecipazione al PRIN 2017 "HIDEA econometrica avanzata per dati ad alta frequenza";</p> <p>-Gennaio 2009-Ottobre 2012, Partecipazione a programma di ricerca internazionale SIRP-MISTRA. (Sustainable Investment Research Platform);</p> <p>-Gennaio 2016 – Dicembre 2018, Partecipazione nel programma di ricerca internazionale "Incentives structure in the finance industry and the behavior of financial markets" coordinatore Martin Holmen, Goteborg University, Sweden ;</p> <p>-Marzo 2010 - Settembre 2012, PRIN 2008 "Modellizzazione e metodi numerici in finanza" coordinator Frittelli Marco, supervisore Baldi Paolo.</p>
II) <i>l'attività didattica frontale in corsi di laurea, di laurea magistrale, di dottorato di ricerca e di master universitari, presso università italiane e straniere, nonché il coordinamento di iniziative in campo didattico svolte in ambito nazionale ed internazionale</i>	<p>La candidata ha dichiarato numerose esperienze didattiche a livello accademico nel seguito riportate:</p> <p>AA 2019/2020 2020/21</p> <p>Matematica Finanziaria, Luiss University, Rome</p> <p>AA 2015/16 2017/2018 2018/2019 2019/2020 2020/21 2021/22</p> <p>Analisi Matematica:Concetti di base; per studenti di</p>

	<p>dottorato Facoltà di Economia, Università di Roma Tor Vergata</p> <p>AA 2017/18, 2018/2019, 2019/2020, 2020/2021</p> <p>Matematica Finanziaria (Triennale) Facoltà di Economia, Università di Roma Tor Vergata</p> <p>AA 2015/16 and 2016/2017</p> <p>Mathematics 2 (triennale in inglese) Facoltà di Economia, Università di Roma Tor Vergata</p> <p>AA 2013/14 and 2014/15</p> <p>Matematica per le applicazioni economiche (triennale) Facoltà di Economia, Università di Roma Tor Vergata</p> <p>AA 2011/12</p> <p>Metodi matematici per l'economia (magistrale) Facoltà di Economia, Università di Roma Tor Vergata</p> <p>Metodi di Ottimizzazione (magistrale) Facoltà di Economia, Università di Roma Tor Vergata</p> <p>AA 2009/10 and 2010/11</p> <p>Matematica Generale (triennale) Facoltà di Economia, Università di Roma Tor Vergata AA.YY. 2008/09 and 2007/08 and 2006/07 and 2005/06</p> <p>Matematica Generale (Triennale) Facoltà di Economia, Università di Roma Tor Vergata</p> <p>AA 2007-2008</p> <p>Complementi di Matematica per l'Economia e la Finanza (triennale) Università di Chieti e Pescara, Italia</p> <p>AA 2007-2008</p> <p>Precorso di Matematica per le applicazioni economiche (triennale) Università Cattolica del Sacro Cuore, Rome, Italia.</p> <p>AA 2007-2008</p> <p>Matematica per le applicazioni economiche (triennale) Università Cattolica del Sacro Cuore, Roma, Italia.</p>
--	---



	<p>AA 2005/06 2006/07</p> <p>Laboratorio di Modelli matematici per i mercati finanziari Dipartimento di Matematica, Facoltà di Scienze, Università di Roma 3, Italia.</p>
<p>III) l'organizzazione di congressi e/o workshop nazionali ed internazionali o la partecipazione ad essi</p>	<p>La candidata per quel che concerne l'organizzazione di congressi e/o workshop nazionali ed internazionali relativamente alle tematiche del settore oggetto di concorso presenta la seguente lista:</p> <ul style="list-style-type: none"> • WEHIA: 2019 City University London; 2018 Christian University Tokyo; 2011 University of Marche, Ancona, Italy • AMASES:2018 Naples, Italy, 2017 Cagliari, Italy, 2011 Pisa, Italy • Matlab Expo 2016 Milano, Italy • Artificial Economics: 2015 Porto, Portugal; 2017 Tianjin, China • Workshop in Quantitative Finance: 2020 Università Partenope di Napoli, Italia; 2019 ETH Zurich, Switzerland; 2016 Scuola Normale Superiore Pisa, Italy; 2015 University of Modena, Italy; 2010 Politecnico Palermo, Italy; 2008 University of Rome, Italy. • ESSA 2014: Universitat autonoma de Barcelona, Spain • MISTRA Conference 2012 Paris • World Finance Conference 2012 Rio De Janeiro, Brazil • EAERE: 2011 University of Rome, Italia • ECTS:2011 Villa Mondragone, Frascati ,Italia • PAAMS11 2011Colegio Fonseca Salamanca, Spain; • PAAMS16 2016 Sevilla, Spain; <p>PAAMS20 2020 L'Aquila, Italy (on line)</p> <ul style="list-style-type: none"> • EJF-JBE Special Issue Conference 2010 York University Toronto, Canada • 6th World Congress 2010 Bachelier Finance Society, Hilton Downtown Toronto, Canada. • Workshop on Sustainable Investment 2010, MISTRA, University of Rome Tor Vergata,Italia • XVIII International Tor Vergata Conference on Money, Banking, and Finance, 2009 University of Rome Tor Vergata, Italia • Sweden Annual Meeting of MISTRA 2009 University of Goteborg • Bad Honnef 2008, Germany



	<ul style="list-style-type: none"> • The Third Nikkei Econophysics Research Workshop and Symposium 'Practical Fruits of Econophysics': 2004 Tokyo, Japan. • Organizzatrice del Artificial Economics Conference 12th edition, 20-21 September 2016, CNR Piazzale Aldo Moro, Roma, Italia. • Organizzatrice del Workshop "Gender gap tra percezione e opportunità: prima, durante e dopo l'università" 13 October 2021, School of Economics University of Rome Tor Vergata, in Festival per lo sviluppo sostenibile (Asvis)
<u>Giudizio collegiale</u>	
La candidata ha partecipato attivamente a gruppi di ricerca nazionali ed internazionali; la candidata ha svolto attività didattica coerente con le tematiche del SSD oggetto della presente valutazione nell'ambito della laurea triennale, magistrale e del dottorato di ricerca; infine, buona è la partecipazione e l'organizzazione di congressi.	
*** **	
Pubblicazioni scientifiche	
Numero di pubblicazioni presentate dal candidato	La candidata ha presentato n. 10 pubblicazioni
Lavori in collaborazione con i commissari – enucleabilità e distinguibilità del contributo	La candidata non presenta pubblicazioni in comune con alcuno dei commissari
Lavori in collaborazione con i terzi – enucleabilità e distinguibilità del contributo	La candidata presenta n. 7 pubblicazioni in collaborazione con terzi (n.2,4,5,6,7,9,10). La commissione, tenuto conto di quanto stabilito in merito nella seduta preliminare, dichiara che il contributo del candidato risulta enucleabile sulla base del seguente criterio: contributo paritetico.
Ambito delle pubblicazioni	Le pubblicazioni vertono su tematiche del seguente tipo: (a) modelli agent-based (n.3,4,5,8) (b) gestioni di portafoglio delegate (n.7,10); (c) investimenti socialmente responsabili (n.6,9);

	(d) analisi delle dinamiche dei mercati finanziari (n.1) (e) tematiche statistiche (n.2)
Giudizio collegiale	
I) originalità e innovatività della produzione scientifica e rigore metodologico	buona
II) congruenza dell'attività del candidato con le discipline comprese nel settore concorsuale e nel settore scientifico-disciplinare di cui alla procedura	buona
III) rilevanza scientifica della collocazione editoriale delle pubblicazioni e loro diffusione all'interno della comunità scientifica	buona
IV) continuità temporale della produzione scientifica, anche in relazione all'evoluzione delle conoscenze del settore scientifico disciplinare oggetto della procedura	buona
La candidata ha svolto attività scientifica su tematiche di specifico interesse del SSD oggetto della presente valutazione, mostrando buona originalità, buon rigore metodologico. Buona la rilevanza scientifica della collocazione editoriale.	

*** **

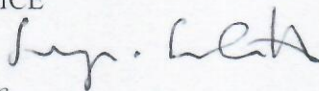
Il presente allegato costituisce parte integrante e sostanziale del verbale cui si riferisce.

LA COMMISSIONE ESAMINATRICE

Prof. Sergio Scarlatti *Presidente*

Prof. Massimo Costabile *componente*

Prof. Andrea Scozzari *Segretario*



Procedura valutativa ai sensi dell'articolo 24 comma 6 della legge 30 dicembre 2010, n. 240 per la chiamata di un 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 -Metodi Matematici dell'economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie- e settore scientifico disciplinare SECS-S/06 - Metodi Matematici dell'economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie- (Riferimento n.1952)

Accertamento della idoneità didattica e delle competenze linguistiche

ANNALISA FABRETTI	
<u>Prova di idoneità didattica</u>	
Argomento trattato: <i>Teorema fondamentale del calcolo integrale</i>	
<i>a) conoscenza del tema</i>	ottima
<i>b) capacità di inquadramento sistematico</i>	ottimo
<i>c) ampiezza e qualità delle argomentazioni</i>	ottima
<i>d) chiarezza, completezza ed efficacia nell'esposizione</i>	ottima
Giudizio collegiale	
La prova didattica del candidato è valutata all'unanimità più che positivamente e, pertanto, ritenuta superata con il seguente giudizio di idoneità :giudizio ottimo, argomentazioni e concetti illustrati in modo chiaro, la candidata è idonea.	
*** **	
<u>Accertamento delle competenze linguistiche</u>	
<i>a) chiarezza ed efficacia nella comprensione e nell'esposizione in lingua straniera</i>	molto buono
Giudizio collegiale	
L'accertamento delle competenze linguistiche del candidato ha avuto esito positivo per le seguenti motivazioni : la candidata dimostra, a giudizio unanime, padronanza linguistica nella lettura, nella comprensione.	

Il presente allegato costituisce parte integrante e sostanziale del verbale cui si riferisce.

LA COMMISSIONE ESAMINATRICE

Prof. Sergio Scarlatti *Presidente*

Prof. Massimo Costabile *componente*

Prof. Andrea Scozzari *Segretario*

Allegato D)

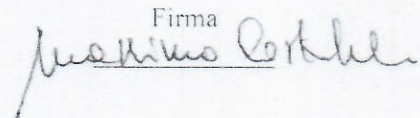
Procedura valutativa ai sensi dell'articolo 24 comma 6 della legge 30 dicembre 2010, n. 240 per la chiamata di un professore universitario di ruolo di seconda fascia presso il Dipartimento di Economia e Finanza dell'Università degli Studi di Roma "Tor Vergata", per il settore concorsuale 13/D4 -Metodi Matematici dell'economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie- e settore scientifico disciplinare SECS-S/06 - Metodi Matematici dell'economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie- (Riferimento n.1952)

Dichiarazione di partecipazione e di concordanza

Il sottoscritto Prof. Massimo Costabile, componente della commissione esaminatrice della procedura valutativa di cui in epigrafe, dichiara di aver partecipato in modalità telematica alla seduta per la redazione della relazione finale dei lavori e di concordare con quanto contenuto nel "*Verbale n. 3- Relazione finale*" e nei relativi allegati.

La presente dichiarazione costituisce parte integrante e sostanziale del verbale cui la stessa è allegata.

Data 5/09/2022

Firma


Allegato E)

Procedura valutativa ai sensi dell'articolo 24 comma 6 della legge 30 dicembre 2010, n. 240 per la chiamata di un 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 -Metodi Matematici dell'economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie- e settore scientifico disciplinare SECS-S/06 - Metodi Matematici dell'economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie- (Riferimento n.1952)

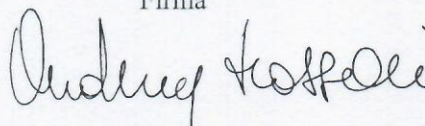
Dichiarazione di partecipazione e di concordanza

Il sottoscritto Prof. Andrea Scozzari, componente della commissione esaminatrice della procedura valutativa di cui in epigrafe, dichiara di aver partecipato in modalità telematica alla seduta n.3 per la redazione della relazione finale e di concordare con quanto contenuto nel "Verbale n. 3 - Relazione finale" e nei relativi allegati.

La presente dichiarazione costituisce parte integrante e sostanziale del verbale cui la stessa è allegata.

Roma, 05/09/2022

Firma

A handwritten signature in black ink, appearing to read 'Andrea Scozzari', written in a cursive style.