

PROCEDURA VALUTATIVA AI SENSI DELL'ART. 24, COMMA 5 DELLA LEGGE 30 DICEMBRE 2010 N. 240 PER LA CHIAMATA DI UN PROFESSORE UNIVERSITARIO 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 e prova didattica

La commissione esaminatrice della procedura valutativa di cui in epigrafe, nominata dal Magnifico Rettore con Decreto rettorale n. 2230/2022 del 22/07/2022 avvalendosi di strumenti telematici di lavoro collegiale, si riunisce per la seconda volta il giorno 2/09/2022 alle ore 16:00 per procedere:

(1) alla valutazione dell'attività didattica, di didattica integrativa, di servizio agli studenti e dell'attività di ricerca scientifica, svolte dal ricercatore nell'ambito del contratto ex art. 24, comma 3, lettera b) della legge n. 240 del 2010, delle pubblicazioni scientifiche elaborate dal ricercatore nell'ambito del contratto, nonché, ai fini di verificare la continuità della produzione scientifica, delle pubblicazioni eventualmente elaborate dal ricercatore successivamente alla data di scadenza del bando in base al quale ha conseguito l'abilitazione scientifica nazionale, ove siano state presentate dal candidato ai fini della valutazione;

(2) e allo svolgimento della prova di idoneità didattica.

La commissione constata che il candidato da sottoporre a valutazione è il Dott. Paolo Pigato.

Quindi, ognuno dei commissari rende 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 il candidato;
- l'inesistenza di situazioni di incompatibilità tra ciascuno di essi e il candidato ai sensi degli articoli 51 e 52 del codice di procedura civile

La commissione constata che sono trascorsi sette giorni dalla data di avvenuta pubblicazione sul sito istituzionale dell'Università degli Studi di Roma "Tor Vergata" dei criteri per la valutazione del candidato, senza che sia stata elevata alcuna istanza di ricusazione dei suddetti criteri e che è, quindi, nelle condizioni di procedere alla valutazione secondo norma.

La commissione, quindi, passa ad esaminare la documentazione presentata dal Dott. Pigato e resa disponibile con modalità telematiche, impegnandosi a trattare la suddetta documentazione esclusivamente nell'ambito della presente procedura.

La commissione constata che il candidato non ha prodotto pubblicazioni redatte in collaborazione con i componenti della commissione.

Vengono, quindi, prese in considerazione le pubblicazioni redatte in collaborazione con i terzi e procede all'analisi dei suddetti lavori in collaborazione.

Dopo ampio esame collegiale, la commissione ritiene di poter enucleare il contributo dato dal candidato sulla base del seguente criterio: coerenza con le tematiche sviluppate nel percorso scientifico del candidato, e decide di accettare tutti i lavori suddetti ai fini della successiva valutazione di merito.

La commissione, quindi, passa ad esaminare l'attività didattica, di didattica integrativa, di servizio agli studenti, l'attività di ricerca scientifica, il curriculum e le pubblicazioni del candidato e, tenendo conto dei criteri di valutazione stabiliti nella riunione preliminare, formula un motivato giudizio analitico collegiale, di cui all'allegato A) che costituisce parte integrante e sostanziale del presente verbale.

Si procede, quindi, allo svolgimento della prova di idoneità didattica, che, conformemente a quanto stabilito nella seduta preliminare, consiste in *argomenti generali del settore* e si svolge pubblicamente su



piattaforma Microsoft Teams, come da avviso di convocazione debitamente pubblicato sul sito istituzionale dell'Ateneo.

Verificato il regolare funzionamento del collegamento telematico, la commissione esaminatrice procede alle operazioni di appello e constata che il Dott. Pigato è presente.

I commissari procedono all'accertamento dell'identità personale del candidato presente mediante presa visione del relativo documento di identità, la cui copia digitale viene inviata telematicamente dal candidato per la relativa acquisizione agli atti della procedura.

Il Dott. Pigato viene invitato a sostenere la prova didattica.

Terminata la prova, la commissione esaminatrice chiude il collegamento e procede in via riservata.

La commissione formula il seguente giudizio collegiale in merito alla prova di idoneità didattica:

Il candidato dimostra una eccellente capacità didattica.

Al termine dei lavori, la commissione, dopo ampia discussione e sulla base dei giudizi collegiali espressi, dopo ampia discussione, con deliberazione assunta all'unanimità, dichiara che il Dott. Paolo Pigato è valutato positivamente e che è, quindi, qualificato a 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.

Terminati i lavori, la commissione esaminatrice redige e provvede a trasmettere il presente verbale e i relativi allegati al responsabile del procedimento per i consequenziali adempimenti.

La seduta è tolta alle ore 17:00

Il presente verbale, letto, redatto, sottoscritto e siglato su ogni pagina, unitamente all'allegato A), dal Prof. Stefano Herzel è integrato dalle dichiarazioni di partecipazione e di concordanza con il suo contenuto del/della Prof. Sergio Scarlatti e del/della Prof. Fabio Bellini di cui agli allegati B) e C), che costituiscono parte integrante e sostanziale del presente verbale.

Data 2/9/2022

LA COMMISSIONE ESAMINATRICE

Prof. Stefano Herzel *Presidente*

Prof. Fabio Bellini *componente*

Prof. Sergio Scarlatti *Segretario*



PROCEDURA VALUTATIVA AI SENSI DELL'ART. 24, COMMA 5 DELLA LEGGE 30 DICEMBRE 2010 N. 240 PER LA CHIAMATA DI UN PROFESSORE UNIVERSITARIO 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

Valutazione dell'attività didattica, di didattica integrativa, di servizio agli studenti

<i>Paolo Pigato</i>
Attività didattica, di didattica integrativa, di servizio agli studenti
<p>Inserire una breve descrizione anche basandosi sui criteri indicati nel verbale di seduta preliminare:</p> <p>a) numero dei moduli/corsi tenuti e continuità della tenuta degli stessi; Anno Accademico 2019/20.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Titolare del corso Fractional Brownian motion and non-Markovian modeling (10 ore) al dottorato in Matematica, Università di Roma Tor Vergata • mini-corso An introduction to mathematical option pricing, alla Winter School "Primer on Data Science 2020", Università di Trento <p>Anno Accademico 2020/21.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Titolare del corso Matematica Generale (12CFU, 72 ore), Corso di Laurea in Economia e Finanza, Università di Roma Tor Vergata • Titolare del corso Rough stochastic volatility models (2 cfu, 10 ore) al dottorato in Economics and Finance, Università di Roma Tor Vergata <p>Anno Accademico 2021/22.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Titolare del corso Matematica Generale (12CFU, 72 ore), Corso di Laurea in Economia e Finanza, Università di Roma Tor Vergata • Titolare del corso Rough stochastic volatility models (2 cfu, 10 ore) al dottorato in Economics and Finance, Università di Roma Tor Vergata <p>Anno Accademico 2022/23 (in programma)</p> <p>Titolare del corso Matematica Generale (12CFU, 72 ore), Corso di Laurea in Economia e Finanza, Università di Roma Tor Vergata</p> <p>b) esiti della valutazione da parte degli studenti, con gli strumenti predisposti dall'ateneo, dei moduli/corsi tenuti;</p>



Gli esiti delle valutazioni degli studenti relativi ai corsi tenuti sono in generale molto positive.

c) partecipazione alle commissioni istituite per gli esami di profitto;

Ha partecipato regolarmente, come Presidente, alla commissione di esame per il corso di Matematica Generale di cui è titolare, e come membro alla commissione di altri corsi simili (Matematica Generale, Mathematics).

Il 07/09/2021 ha partecipato come commissario alle prove di ammissione TOLC-E per i corsi di laurea laurea triennale CLEF e CLEM.

d) 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

Ha svolto il ricevimento studenti per il corso di Matematica Generale.

Ha svolto il ricevimento studenti per i corsi di dottorato sia durante il corso, sia dopo il corso come supporto alla preparazione del progetto d'esame.

Supervisione e supporto dottorandi

Sta co-supervisionando Giacomo Giorgio, dottorando in Matematica di Tor Vergata, nella sua tesi in probabilità e matematica per la finanza.

Sta lavorando regolarmente con Federico Giorgi, dottorando in Economics and Finance di Tor Vergata (advisor Stefano Herzel), per la sua tesi in Machine learning per la finanza.

Ha supportato Elena Dal Torrione, studentessa di dottorato in Economics and Finance, su alcuni aspetti matematici del suo lavoro di ricerca (con Tiziano Arduini).

Giudizio

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

*** **



Attività di ricerca scientifica

Il dott. Pigato ha tenuto le seguenti relazioni a congressi e convegni nazionali e internazionali:

2022 - Workshop A journey through complex systems: from interacting particles to games, l'Aquila (invited, forthcoming)

2022 - Third Italian Meeting on Probability and Mathematical Statistics, Università di Bologna.

2022 - Rough Volatility workshop, Imperial College London (invited)

2021 - SIAM Conference on Financial Mathematics and Engineering, Philadelphia, FM21 (invited, virtual)

2021 - 14th Oxford-Berlin Young Researchers Meeting on Applied Stochastic Analysis, Oxford (virtual).

2021 - Seminar on Stochastic methods and Finance of CERMICS - École des Ponts - Inria (invited, virtual)

2021 - Paris Bachelier Seminar on Mathematical Finance (invited, virtual)

(nel 2020 non ci sono state presentazioni a causa della chiusura dovuta alla pandemia di Covid19).

Ha contribuito all'organizzazione dei seguenti congressi:

Marzo 2022: XXIII Workshop on Quantitative Finance (QFW2022) (Università di Roma – Tor Vergata)


Giugno 2022: Third Italian Meeting on Probability and Mathematical Statistics (Università di Bologna).

E' il principal investigator per un Progetto di Ricerca finanziato nel 2022 sui Fondi di Ricerca Scientifica d'Ateneo presso l'Università di Tor Vergata.

Ha svolto attività di referee per numerosi e importanti riviste nel settore.

Giudizio

L'attività di ricerca scientifica svolta nel triennio, anche tenuto conto delle limitazioni dovute alla pandemia, è di ottimo livello.



*** **
Pubblicazioni
<p>Dal 28/11/2019 ha pubblicato otto lavori, tra i quali uno a nome singolo, tutti su riviste di ottimo livello internazionale. Ha anche tre preprints in corso di pubblicazione.</p> <p>Gli ambiti principali di studio riguardano la “Rough Volatility”, il “Machine Learning” e i modelli “Regime-Switching” per le serie finanziarie.</p> <p>Tra la pubblicazione di maggior valore citiamo il lavoro a nome singolo</p> <p>[P. Pigato (2022) Density estimates and short-time asymptotics for a hypoelliptic diffusion process. <i>Stochastic Processes and Their Applications</i>.</p> <p>che propone un metodo di prezzaggio per derivati finanziari valutati sulla base di un prezzo “medio” su un certo periodo di tempo (spesso usati nei mercati dell’energia), per cui la non-markovianità risiede nel fatto che il valore dell’opzione dipende dalla traiettoria passata.</p>
Giudizio
<p>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).</p>

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

LA COMMISSIONE ESAMINATRICE

Prof. Stefano Herzel *Presidente*

Prof. Fabio Bellini *componente*

Prof. Sergio Scarlatti *Segretario*

