

UNIVERSITA' DEGLI STUDI DI SIENA

PROCEDURA VALUTATIVA PER LA COPERTURA DI UN POSTO DI PROFESSORE
UNIVERSITARIO DI RUOLO

FASCIA DEGLI ASSOCIATI - D.R. N. 831/2016 PROT. N. 22781 DEL 16 GIUGNO 2016

Dipartimento:

ECONOMIA POLITICA E STATISTICA

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)

SECONDA RIUNIONE

Il giorno 30 settembre 2016 alle ore 16:45 si riunisce la Commissione di valutazione della procedura valutativa per la per la copertura di un posto di professore universitario di ruolo, fascia degli associati, settore concorsuale 13/D4 (Metodi matematici dell'economia e delle scienze attuariali e finanziarie), settore scientifico disciplinare SECS/S06 (Metodi matematici dell'economia e delle scienze attuariali e finanziarie), bandita con D.R. n. 831/2016 prot. n. 22781 del 16 giugno 2016.

Sono presenti:

Prof. Marco LI CALZI (Università Ca' Foscari Venezia)
Prof.ssa Maria Elvira MANCINO (Università di Firenze)
Prof. Roberto RENÒ (Università di Verona)

RR

La Commissione prende atto che sono stati ammessi alla procedura i candidati:

- Giancarlo BIGI;
- Salvatore FEDERICO;
- Yeliz YOLCU OKUR.

RM

La commissione sorteggia la lettera "H" sulla base della quale stabilisce il seguente ordine di presentazione per la prova didattica:

- Yeliz YOLCU OKUR;
- Giancarlo BIGI;
- Salvatore FEDERICO.

ll

Alle ore 17:00 la Commissione constata che risultano presenti i candidati:

- Salvatore FEDERICO;
- Yeliz YOLCU OKUR;

e prende atto che il candidato Giancarlo Bigi risulta escluso dalla procedura in oggetto.

La Commissione, dopo aver accertato l'identità dei candidati presenti, procede alla prova orale secondo il calendario stabilito. Le prove si svolgono regolarmente e terminano alle 18:50. Al termine delle prove orali, la Commissione stende i seguenti giudizi sui titoli e le pubblicazioni per ciascuno dei candidati presenti.

Salvatore FEDERICO

L'attività di ricerca del candidato si inquadra principalmente nei filoni della programmazione dinamica e della finanza matematica (49Lxx e 91Gxx, MSC 2010).

La produzione scientifica è ampia, originale e rivela una solida preparazione matematica. Con riferimento all'elenco dei lavori scientifici presentati e numerati dal candidato, si segnalano per rilevanza i nn. 2, 9, 10, 11. La dimensione internazionale di ricerca del candidato, arricchita dalla varietà delle sue collaborazioni, è molto apprezzabile. La collocazione editoriale delle pubblicazioni è ottima. Complessivamente, la produzione scientifica appare ottima per qualità e per quantità ed è molto ben allineata agli standard internazionali dell'area disciplinare.

L'attività didattica inizia nel 2011 ed è svolta principalmente a livello di laurea triennale in corsi di matematica generale, in lingua sia italiana sia inglese. Il candidato ha tenuto un breve corso post-graduate presso l'università di York. E' stato relatore di una tesi di laurea magistrale e di una tesi di dottorato. Il giudizio complessivo sull'attività didattica è che essa sia stata limitata in estensione ma adeguata al ruolo.

La reputazione esterna del candidato trova riscontro nell'attività di *peer review* per numerose riviste di prestigio e nell'intensa partecipazione attiva a convegni scientifici e seminari. Relativamente all'esame dei dati bibliometrici, si evidenziano quattro lavori con un buon numero di citazioni. Il profilo bibliometrico complessivo è coerente con gli standard internazionali dell'area disciplinare.

L'attività organizzativa è limitata. E' stato membro di commissione di dottorato e di selezione di assegni di ricerca.

Yeliz YOLCU OKUR

L'attività di ricerca della candidata si inquadra principalmente nei filoni della finanza matematica e dell'analisi stocastica (91Gxx e 60Hxx, MSC 2010).

La produzione scientifica, ancorché limitata, è originale e rivela una solida preparazione matematica. La dimensione internazionale di ricerca della candidata è attestata da frequenti periodi di ricerca all'estero. La collocazione editoriale delle pubblicazioni è discreta. Complessivamente, la produzione scientifica appare discreta per qualità e per quantità ed è allineata agli standard internazionali dell'area disciplinare.

L'attività di insegnamento è intensa e svolta con continuità a livello sia triennale sia magistrale, principalmente in lingua inglese. E' stata relatrice di numerose tesi di laurea magistrale ed è attualmente relatrice di due tesi di dottorato. Il giudizio complessivo sull'attività didattica è molto buono.

RR

HOI

lll

La reputazione esterna della candidata ha riscontro nell'attività di *peer review* per numerose riviste di media rilevanza, nonché in un'intensa partecipazione attiva a convegni scientifici e seminari. Relativamente all'esame dei dati bibliometrici, non si evidenziano lavori con un significativo numero di citazioni. Il profilo bibliometrico complessivo rientra negli standard internazionali dell'area disciplinare. Ha preso parte a numerosi progetti di ricerca a livello nazionale.

L'attività organizzativa è ampia.

Alle ore 20:00 il Presidente aggiorna la seduta e invita la Commissione a riunirsi il giorno successivo alle ore 9:00 nei locali del Dipartimento di Economia Politica e Statistica.

Alle ore 9:00 dell'1 ottobre 2016 la Commissione riprende la seduta e stende i giudizi sulla prova orale per ciascuno dei candidati presenti.

Salvatore FEDERICO

Nella prova orale, svolta in inglese, il candidato propone un seminario didattico sul modello di Black e Scholes, collocabile in un corso di laurea magistrale. Il candidato espone in maniera chiara e tecnicamente corretta. Relativamente agli argomenti della lezione, la padronanza del candidato è ottima sugli aspetti matematici e sufficiente sugli aspetti finanziari. Risponde alle domande in maniera appropriata. Complessivamente, l'efficacia didattica della lezione per studenti di una laurea magistrale delle classi economica, finanziaria e aziendale è sufficiente.

Yeliz YOLCU OKUR

Nella prova orale, svolta in inglese, la candidata propone un seminario didattico sul modello di Black e Scholes, collocabile in un corso di laurea magistrale. La candidata espone l'argomento in maniera non del tutto chiara, anche se la lezione appare corretta dal punto di vista tecnico. Relativamente agli argomenti della lezione, la padronanza della candidata è buona sugli aspetti matematici e lacunosa sugli aspetti finanziari. Risponde alle domande in maniera non del tutto convincente. Complessivamente, l'efficacia didattica della lezione per studenti di una laurea magistrale delle classi economica, finanziaria e aziendale non è ritenuta sufficiente.

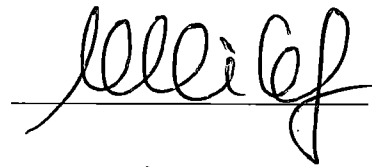
La Commissione, sulla base dei giudizi sopra riportati, esclude dalla graduatoria di merito la candidata Yeliz Yolcu Okur. Successivamente, la Commissione formula la seguente graduatoria di merito:

1) Salvatore FEDERICO.

Alle ore 10:40, null'altro essendovi da trattare, la seduta è tolta.

Il presente verbale è redatto, letto e sottoscritto seduta stante per l'approvazione e l'invio al responsabile del procedimento per la pubblicazione nella pagina web dedicata alla procedura concorsuale.

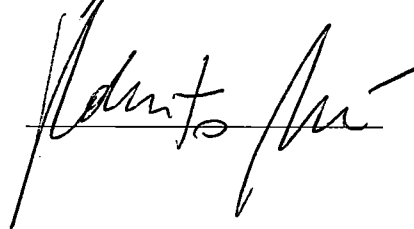
Prof. Marco Li Calzi (Presidente)

Handwritten signature of Marco Li Calzi in cursive script, written over a horizontal line.

Prof.ssa Maria Elvira Mancino (Componente)

Handwritten signature of Maria Elvira Mancino in cursive script, written over a horizontal line.

Prof. Roberto Renò (Segretario)

Handwritten signature of Roberto Renò in cursive script, written over a horizontal line.