

**PROCEDURA SELETTIVA PER LA COPERTURA DI N 1 POSTO DI
PROFESSORE DI SECONDA FASCIA AI SENSI DELL'ART. 18, COMMA 1,
DELLA LEGGE 240/2010 PRESSO IL DIPARTIMENTO DI MATEMATICA
"FEDERIGO ENRIQUES", UNIVERSITA' DI MILANO
SETTORE CONCURSALE 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
CODICE CONCORSO 5383**

**VERBALE N. 3
Assegnazione argomenti lezione**

La Commissione giudicatrice della procedura selettiva a n 1 posto di professore universitario di seconda fascia ai sensi dell'art. 18, comma 1, della Legge 30.12.2010 n. 240 per il settore concorsuale 13/D4, settore scientifico-disciplinare SECS-S/06 presso il Dipartimento di MATEMATICA, composta dai:

Prof. FRITTELLI Marco dell'Università degli Studi di Milano
Prof. FUSAI Gianluca dell'Università degli Studi del Piemonte Orientale
Prof.ssa MASTROGIACOMO Elisa dell'Università degli Studi dell'Insubria

si riunisce il giorno 19 dicembre 2023 alle ore 14:00 in modalità telematica mediante la piattaforma Google Meet per formulare gli argomenti sui quali verterà la lezione dei candidati Dott. Carlo Alberto De Bernardi, Dott.ssa Daria Ghilli, Dott. Paolo Leonetti, inerenti a temi generali e metodologici del settore oggetto del bando.

Ad ogni singolo candidato verranno proposti tre temi. All'atto della comunicazione il candidato sceglie tra i tre argomenti quello che sarà oggetto della sua lezione e, contestualmente a tale scelta, comunica alla Commissione l'argomento per la prova didattica.

La Commissione tenuto conto del numero dei candidati, formula collegialmente i seguenti 4 gruppi di tre temi:

Gruppo A

- 1) Prezzo di indifferenza per la valutazione di derivati in mercati incompleti
- 2) Il modello di Heath-Jarrow-Morton per la struttura a termine dei tassi
- 3) Applicazioni del controllo ottimo stocastico in finanza

Gruppo B

- 1) Applicazioni delle equazioni differenziali stocastiche retrograde (BSDE) in finanza
- 2) Valutazione di opzioni americane in mercati completi
- 3) Modelli dinamici non Gaussiani e loro applicazioni in finanza

Gruppo C

- 1) Modelli a volatilità stocastica per il pricing di derivati
- 2) Misure di rischio convesse condizionali
- 3) Simulazione Monte Carlo e valutazione di derivati esotici

Gruppo D

- 1) Il controllo ottimo stocastico ed il problema di Merton
- 2) Misure di rischio e equazioni differenziali stocastiche retrograde (BSDE)
- 3) Valutazione di opzioni americane in mercati incompleti

Dopo l'attivazione del collegamento audio/video il Segretario, verificato che i candidati che devono sostenere la prova didattica siano tutti presenti, provvede alla loro identificazione mediante esibizione di un documento d'identità, i cui estremi vengono riportati nel foglio presenze allegato.

Risultano presenti i candidati sotto indicati dei quali viene accertata l'identità personale.

- 1) Carlo Alberto De Bernardi
- 2) Daria Ghilli
- 3) Paolo Leonetti

Per stabilire il primo candidato che selezionerà la busta, viene casualmente estratto il nominativo della Dott.ssa Daria Ghilli. I rimanenti candidati saranno chiamati in ordine alfabetico.

Alle ore 14:05 la Dott.ssa Daria Ghilli seleziona il Gruppo A. La candidata sceglie immediatamente il tema n° 3 e precisamente: "Applicazioni del controllo ottimo stocastico in finanza".

Alle ore 14:10 il Dott. Paolo Leonetti seleziona il Gruppo B. Il candidato sceglie immediatamente il tema n° 2 e precisamente: "Valutazioni di opzioni americane in mercati completi".

Alle ore 14:15 il Dott. Carlo Alberto De Bernardi seleziona il Gruppo D. Il candidato sceglie immediatamente il tema n° 3 e precisamente: "Valutazione di opzioni americane in mercati incompleti".

Al termine della seduta la Commissione si riconvoca in modalità telematica per le ore 15:00 del giorno 20 dicembre 2023 per lo svolgimento della lezione e la prova avente per oggetto la presentazione dell'attività scientifica del candidato e la discussione dei titoli dallo stesso presentati.

La seduta è tolta alle ore 14:25

Si allegano al presente verbale:

- file pdf dei documenti d'identità trasmessi dai candidati
- lista dei presenti generata dalla piattaforma con i dati di connessione/disconnessione di tutti i partecipanti.

Letto, approvato e sottoscritto.

LA COMMISSIONE:

Prof. FRITTELLI Marco dell'Università degli Studi di Milano

Prof. FUSAI Gianluca dell'Università degli Studi del Piemonte Orientale

Prof.ssa MASTROGIACOMO Elisa dell'Università degli Studi dell'Insubria