

UNIVERSITA' DEGLI STUDI DI PADOVA

Procedura valutativa 2019PA243 - allegato 10 per la chiamata di n. 1 posto di Professore di seconda fascia presso il Dipartimento di Matematica "Tullio Levi-Civita" - DM per il settore concorsuale 13/D4 – METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCIENZE ATTUARIALI E FINANZIARIE (profilo: settore scientifico disciplinare SECS-S/06 – METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCIENZE ATTUARIALI E FINANZIARIE), ai sensi dell'art. 24, comma 6, Legge 30 dicembre 2010, n. 240, bandita con Decreto Rettorale n. 4061 del 26 novembre 2019.

**Allegato al Verbale n. 4**

**PUNTEGGI e GIUDIZI**

**Candidato Callegaro Giorgia**

Publicazioni scientifiche:

1	Aid, Basei, Callegaro, Campi, Vargiolu, Nonzero-Sum Stochastic Differential Games with Impulse Controls: A Verification Theorem with Applications, Math. Oper. Res. (2019)	
	Originalità	3
	Congruenza	70%
	Rilevanza rivista	3
	Apporto individuale	60%
	Valutazione	<b>2,52</b>
2	Callegaro, Fiorin, Grasselli, Quantization meets Fourier: a new technology for pricing options, Ann. Oper. Res. (2019)	
	Originalità	3
	Congruenza	100%
	Rilevanza rivista	3
	Apporto individuale	90%
	Valutazione	<b>5,40</b>
3	Bormetti, Callegaro, Livieri, Pallavicini, A backward Monte Carlo approach to exotic option pricing, European J. Appl. Math. (2018)	
	Originalità	3
	Congruenza	100%
	Rilevanza rivista	2
	Apporto individuale	70%
	Valutazione	<b>3,50</b>
4	Callegaro, Campi, Giusto, Vargiolu, Utility indifference pricing and hedging for structured contracts in energy markets, Math. Methods Oper. Res. (2017)	
	Originalità	3
	Congruenza	100%
	Rilevanza rivista	3
	Apporto individuale	70%
	Valutazione	<b>4,20</b>

5	Callegaro, Fiorin, Grasselli, Pricing via recursive quantization in stochastic volatility models, Quant. Finance (2017)	
	Originalità	3
	Congruenza	100%
	Rilevanza rivista	3
	Apporto individuale	90%
	Valutazione	<b>5,40</b>
6	Callegaro, Gaigi, Scotti, Sgarra, Optimal investment in markets with over and under-reaction to information, Math. Financ. Economics (2017)	
	Originalità	3
	Congruenza	100%
	Rilevanza rivista	3
	Apporto individuale	70%
	Valutazione	<b>4,20</b>
7	Callegaro Jeanblanc, Zargari, Carthaginian enlargement of filtrations, ESAIM: Prob. & Stat. (2013)	
	Originalità	3
	Congruenza	70%
	Rilevanza rivista	2
	Apporto individuale	90%
	Valutazione	<b>3,15</b>
8	Callegaro, Sagna, An application to credit risk of a hybrid Monte Carlo–optimal quantization method , J. Comput. Finance (2013)	
	Originalità	3
	Congruenza	100%
	Rilevanza rivista	3
	Apporto individuale	100%
	Valutazione	<b>6,00</b>
9	Callegaro, Optimal consumption problems in discontinuous markets, Optimization (2013)	
	Originalità	3
	Congruenza	100%
	Rilevanza rivista	2
	Apporto individuale	100%
	Valutazione	<b>5,00</b>
10	Callegaro, Jeanblanc, Runggaldier, Portfolio optimization in a defaultable market under incomplete information, Decis. Econ. Finance (2012)	
	Originalità	3
	Congruenza	100%
	Rilevanza rivista	3
	Apporto individuale	90%
	Valutazione	<b>5,40</b>

Totale punti pubblicazioni scientifiche: (arrotondamento di 44,77) **45**



Attività didattica, didattica integrativa e servizio agli studenti

<p>Per il volume e la continuità degli insegnamenti e dei moduli di cui si è assunta la responsabilità. Insegnamenti a.a. 2016-2017, 2017-2018, 2018-2019:</p> <p>Finanza Matematica (Laurea in Matematica) Statistica (Laurea Biologia Molecolare, 3 edizioni) Probability and stochastic calculus (Master MathFinRisk, Bocconi, 3 ed.) Advanced Mathematics for Statistics – Probability Theory (PhD, 2 ed.) Analytical and stochastic math. Methods for Engineering (Laurea Magistrale in Mathematical Engineering, 3 ed.) Matematica Finanziaria (Laurea in Economia) Option pricing: from Monte Carlo to Quantization (PhD, Politecnico di Milano)</p>	<p>Punti <b>20</b></p>
<p>Per il volume e la continuità dell'attività didattica integrativa e di servizio agli studenti.</p> <p>- supervisione di 1 tesi dottorato Matematica Comput. e 2 in corso: punti 3 - relazione 20 tesi triennali e 14 magistrali, Matematica, Stat. Econ. Finanza, Ing. Mat., Ing. Elettr.: punti 3</p>	<p>Punti <b>6</b></p>
<p>Per le valutazioni degli studenti ove presenti per tutti i candidati</p> <p>- assenti</p>	<p>Punti <b>0</b></p>

Totale punti attività didattica, didattica integrativa e servizio agli studenti: 26

Curriculum comprensivo di attività di ricerca, attività istituzionali, organizzative, gestionali, di servizio e di terza missione, in quanto pertinenti al ruolo

<p>Per organizzazione, direzione e coordinamento di centri o gruppi di ricerca nazionali e internazionali o partecipazione agli stessi e altre attività di ricerca quali la direzione o la partecipazione a comitati editoriali di riviste. La valutazione terrà conto della pertinenza al settore 13/D4. Responsabile di diversi progetti di ricerca italiani – Università di Padova - e internazionali – European Science Foundation, CREST, Institut Europlace de Finance.</p>	<p>Punti <b>3</b></p>
---	-----------------------



Per conseguimento di premi e riconoscimenti nazionali e internazionali per attività di ricerca. La valutazione terrà conto della pertinenza al settore 13/D4.	Punti 0
Per partecipazioni in qualità di relatore a congressi e convegni di interesse nazionale e internazionale. La valutazione terrà conto della pertinenza al settore 13/D4.  Ha partecipato in qualità di relatrice invitata a diverse conferenze nazionali e internazionali.	Punti 4
Per la consistenza complessiva della produzione scientifica del candidato. La valutazione terrà conto della pertinenza al settore 13/D4.  Dichiara 14 lavori su riviste "peer-reviewed" distribuite tra il 2006 e il 2019, con diversi coautori e tutti pertinenti al settore 13/D4.	Punti 3
Per attività istituzionali, organizzative e di servizio, pertinenti al ruolo, in relazione al grado di responsabilità delle funzioni svolte, della loro durata e continuità. La valutazione terrà conto della pertinenza al settore 13/D4.	Punti 0

Totale punti Curriculum.....: 10

**Punteggio totale (comprensivo dei punteggi attribuiti a pubblicazioni, attività didattica, curriculum, attività assistenziale se prevista da bando): 81**

Giudizio sull'accertamento dell'adeguata conoscenza della lingua inglese e sull'accertamento della qualificazione scientifica: **positivo**.

La Commissione individua quale candidato vincitore CALLEGARO GIORGIA per le seguenti motivazioni:

giudizio sulle pubblicazioni scientifiche: **molto buono**;  
giudizio sul curriculum comprensivo di attività di ricerca, attività istituzionali, organizzative, gestionali, di servizio e di terza missione: **rilevante**;  
giudizio sull'attività didattica, didattica integrativa e servizio agli studenti: **ottimo**;  
accertamento dell'adeguata conoscenza della lingua inglese e della qualificazione scientifica: **positivo**.



Padova, 3 marzo 2020

LA COMMISSIONE

Prof.ssa Laura Gardini, professore di prima fascia presso l'Università degli Studi di Urbino  
Carlo Bo

Prof.ssa Francesca Perla, professore di prima fascia presso l'Università degli Studi di Napoli  
Parthenope

Prof. Bruno Viscolani, professore di prima fascia presso l'Università degli Studi di  
Padova

A handwritten signature in black ink, consisting of a large, stylized 'B' followed by a horizontal line and a small flourish.

UNIVERSITA' DEGLI STUDI DI PADOVA

Procedura valutativa 2019PA243 - allegato 10 per la chiamata di n. 1 posto di Professore di seconda fascia presso il Dipartimento di Matematica "Tullio Levi-Civita" - DM per il settore concorsuale 13/D4 - METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCIENZE ATTUARIALI E FINANZIARIE (profilo: settore scientifico disciplinare SECS-S/06 - METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCIENZE ATTUARIALI E FINANZIARIE), ai sensi dell'art. 24, comma 6, Legge 30 dicembre 2010, n. 240, bandita con Decreto Rettorale n. 4061 del 26 novembre 2019.

**Allegato al verbale n. 4**

**DICHIARAZIONE DI CONFORMITA'**

Il sottoscritto Prof. LAURA GARDINI membro della Commissione giudicatrice della procedura sopra indicata.

dichiara

con la presente di aver partecipato, per via telematica a mezzo bruno.viscolani@unipd.it, alla stesura del verbale n. 4 e di concordare con quanto scritto nel medesimo a firma del Prof. Bruno Viscolani, Presidente della Commissione giudicatrice, che sarà presentato agli Uffici dell'Ateneo di Padova per i provvedimenti di competenza.

Data 3 marzo 2020

Le flini  
firma

## UNIVERSITA' DEGLI STUDI DI PADOVA

Procedura valutativa 2019PA243 - allegato 10 per la chiamata di n. 1 posto di Professore di seconda fascia presso il Dipartimento di Matematica "Tullio Levi-Civita" - DM per il settore concorsuale 13/D4 - METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCIENZE ATTUARIALI E FINANZIARIE (profilo: settore scientifico disciplinare SECS-S/06 - METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCIENZE ATTUARIALI E FINANZIARIE), ai sensi dell'art. 24, comma 6, Legge 30 dicembre 2010, n. 240, bandita con Decreto Rettorale n. 4061 del 26 novembre 2019.

### Allegato al verbale n. 4

### DICHIARAZIONE DI CONFORMITA'

La sottoscritta Prof.ssa Francesca Perla membro della Commissione giudicatrice della procedura sopra indicata.

dichiara

con la presente di aver partecipato, per via telematica a mezzo mail all'indirizzo francesca.perla@uniparthenope.it, alla stesura del verbale n. 4 e di concordare con quanto scritto nel medesimo a firma del Prof. Bruno Viscolani, Presidente della Commissione giudicatrice, che sarà presentato agli Uffici dell'Ateneo di Padova per i provvedimenti di competenza.

Data 3 marzo 2020



firma