

UNIVERSITA' DEGLI STUDI DI PADOVA

Procedura valutativa per la chiamata di un Professore di seconda fascia presso il Dipartimento di Scienze Statistiche per il settore concorsuale 13/D2 Statistica Economica (profilo: settore scientifico disciplinare SECS-S/03 Statistica Economica), ai sensi dell'art. 24, comma 5, Legge 30 dicembre 2010, n. 240 - 2021PA506 - Avviso n. 9109 del 20 gennaio 2021

VERBALE N. 2

Il giorno 4 Maggio 2021 alle ore 10:00 la Commissione giudicatrice della procedura valutativa di cui sopra composta da:

La Commissione giudicatrice nominata con D.R. n. 887 del 09/03/2021 composta da:

Prof. Massimiliano Caporin professore di prima fascia presso l'Università degli Studi di Padova

Prof.ssa Rossella Berni professoressa di prima fascia presso l'Università degli Studi di Firenze

Prof. Matteo Maria Pelagatti professore di prima fascia presso l'Università degli Studi di Milano-Bicocca

si riunisce con modalità telematica tramite videoconferenza attraverso la piattaforma Zoom ed utilizzo delle email istituzionali massimiliano.caporin@unipd.it, rossella.berni@unifi.it, matteo.pelagatti@unimib.it come previsto dall'art. 11, comma 9 del vigente regolamento di Ateneo, per procedere, in conformità ai criteri formulati nel verbale n. 1, all'esame dei documenti, dei titoli e delle pubblicazioni scientifiche presentati dal candidato Dott. Mauro Bernardi relativi al periodo di contratto a tempo determinato di cui alla lettera b) della legge 30 dicembre 2010, n. 240 dal 3 Agosto 2018 al 2 Agosto 2021.

Constatato che sono trascorsi almeno 7 giorni dalla pubblicizzazione dei criteri, la Commissione può legittimamente proseguire i lavori.

La commissione entra all'interno della Piattaforma informatica 'Pica' nella sezione riservata alla Commissione e visualizza la documentazione presentata per la valutazione del triennio sopra-indicato ai fini dell'immissione nella fascia dei professori associati.

Per i lavori in collaborazione la commissione rileva quanto segue:

Il prof. Massimiliano Caporin dichiara di avere i seguenti lavori in comune con il candidato ed in particolare il lavoro "Volatility Forecasting in a Data Rich Environment" pagg. 127-160, Springer International Publishing.

La Commissione sulla scorta delle dichiarazioni del prof. Massimiliano Caporin delibera di ammettere all'unanimità la pubblicazione in questione alla successiva fase del giudizio di merito.

Per i lavori in collaborazione con terzi la Commissione che i contributi scientifici del candidato sono enucleabili e distinguibili e unanimemente delibera di ammettere alla successiva valutazione di merito i seguenti lavori:

1. Bernardi, M., Cerqueti, R., and Palestini, A. (2020). The skew normal multivariate risk measurement framework. *Computational Management Science*, 17(1):105–119.
2. Bernardi, M., Bonaccollo, G., Caporin, M., and Costola, M. (2020). Volatility Forecasting in a Data Rich Environment, pages 127–160. Springer International Publishing.
3. Bernardi, M. and Lisi, F. (2020). Point and interval forecasting of zonal electricity prices and demand using heteroscedastic models: The ipex case. *Energies*, 13(23).
4. Bernardi, M., Cerqueti, R., and Palestini, A. (2019). Allocation of risk capital in a cost cooperative game induced by a modified expected shortfall. *Journal of the Operational Research Society*, 0(0):1–14.
5. Bernardi, M. and Catania, L. (2019). Switching generalized autoregressive score copula models with application to systemic risk. *Journal of Applied Econometrics*, 34(1):43–65.
6. Salvadori, G., Durante, F., De Michele, C., and Bernardi, M. (2018). Hazard assessment under multivariate distributional change-points: Guidelines and a flood case study. *Water*, 10(6):751.
7. Stolfi, P., Bernardi, M., and Petrella, L. (2018). The sparse method of simulated quantiles: An application to portfolio optimization. *Statistica Neerlandica*, 72(3):375–398.
8. Bernardi, M., Durante, F., Jaworski, P., Petrella, L., and Salvadori, G. (2018). Conditional risk based on multivariate hazard scenarios. *Stochastic Environmental Research and Risk Assessment*, 32(1):203–211.
9. Bernardi, M. and Catania, L. (2018). Portfolio optimisation under flexible dynamic dependence modelling. *Journal of Empirical Finance*, 48:1–18.
10. Bernardi, M., Bottone, M., and Petrella, L. (2018). Bayesian quantile regression using the skew exponential power distribution. *Computational Statistics & Data Analysis*, 126:92–111.
11. Bernardi, M., Bignozzi, V., and Petrella, L. (2017). On the lp-quantiles for the student t distribution. *Statistics & Probability Letters*, 128:77–83.
12. Bernardi, M., Catania, L., and Petrella, L. (2017). Are news important to predict the value-at-risk? *The European Journal of Finance*, 23(6):535–572.
13. Bernardi, M., Maruotti, A., and Petrella, L. (2017). Multiple risk measures for multivariate dynamic heavy-tailed models. *Journal of Empirical Finance*, 43:1–32.
14. Bernardi, M., Durante, F., and Jaworski, P. (2017). Covar of families of copulas. *Statistics & Probability Letters*, 120:8–17.
15. Salvadori, G., Durante, F., De Michele, C., Bernardi, M., and Petrella, L. (2016). A multivariate copula-based framework for dealing with hazard scenarios and failure probabilities. *Water Resources Research*, 52(5):3701–3721.
16. Bernardi, M. and Catania, L. (2016). Comparison of value-at-risk models using the mcs approach. *Computational Statistics*, 31(2):579–608.

17. Migliore, A., Bizzi, E., Egan, C. G., Bernardi, M., and Petrella, L. (2015). Efficacy of biological agents administered as monotherapy in rheumatoid arthritis: a bayesian mixed- treatment comparison analysis. *Therapeutics and clinical risk management*, 11:1325–1335.
18. Bernardi, M. and Petrella, L. (2015). Multiple seasonal cycles forecasting model: the italian electricity demand. *Statistical Methods & Applications*, 24(4):671–695.
19. Bernardi, M. and Petrella, L. (2015). Interconnected risk contributions: A heavy-tail approach to analyze u.s. financial sectors. *Journal of Risk and Financial Management*, 8(2):198–226.
20. Bernardi, M., Gayraud, G., and Petrella, L. (2015). Bayesian tail risk interdependence using quantile regression. *Bayesian Analysis*, 10(3):553–603.
21. Belloc, F., Bernardi, M., Maruotti, A., and Petrella, L. (2013). A dynamic hurdle model for zeroinflated panel count data. *Applied Economics Letters*, 20(9):837–841.
22. Bernardi, M. (2013). Risk measures for skew normal mixtures. *Statistics and Probability Letters*, 83:1819–1824.
23. Bernardi, M., Maruotti, A., and Petrella, L. (2012). Skew mixture models for loss distributions: A bayesian approach. *Insurance: Mathematics and Economics*, 51(3):617–623.
24. Bernardi, M., Corte, G. D., and Proietti, T. (10 May. 2011). Extracting the cyclical component in hours worked. *Studies in Nonlinear Dynamics & Econometrics*, 15(3).

Sulla base dell'esame analitico delle pubblicazioni scientifiche, del curriculum, dell'attività didattica, di didattica integrativa e di servizio agli studenti e di ricerca relative al triennio di contratto a tempo determinato di cui alla lettera b) della legge 30 dicembre 2010, n. 240 la commissione esprime per il candidato un motivato giudizio, che viene allegato al presente verbale quale parte integrante (Allegato B).

Il Presidente invita quindi ciascun commissario ad esprimere un giudizio relativo al triennio sopra-citato.

I giudizi sono espressi in forma palese.

	MAURO BERNARDI
Prof. Massimiliano Caporin	<i>Positivo</i>
Prof. Rossella Berni	<i>Positivo</i>
Prof. Matteo Maria Pelagatti	<i>Positivo</i>

La Commissione ritiene all'unanimità che l'attività di ricerca e di didattica, didattica integrativa e di servizio agli studenti svolte dal Dott. Mauro Bernardi durante il contratto triennale di ricercatore a tempo determinato di cui all'articolo 24, comma 3, lettera b) della Legge 30 dicembre 2010, n. 240 3 Agosto 2018 al 2 Agosto 2021 presso il Dipartimento di Scienze Statistiche siano adeguati alle necessità del Dipartimento e dà esito positivo alla immissione nel ruolo dei Professori di seconda fascia per le motivazioni riportate nella conclusione di cui all'Allegato B.

Il Prof. Massimiliano Caporin Presidente della presente Commissione si impegna a consegnare tutti gli atti concorsuali all'Ufficio Personale docente.

Letto approvato e sottoscritto seduta stante.

La Commissione viene sciolta alle ore 10:30.

Padova, 4 Maggio 2021

LA COMMISSIONE

Prof. Massimiliano Caporin professore di prima fascia presso l'Università degli Studi di Padova (Firmato digitalmente ai sensi del D.Lgs. n. 82/2005)