

OGGETTO: Procedura di valutazione scientifico-didattica per il reclutamento di n. 1 professore universitario di ruolo di seconda fascia, per il 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 presso la Facoltà di Scienze bancarie, finanziarie e assicurative dell'Università Cattolica del Sacro Cuore, da effettuare mediante chiamata, ai sensi dell'articolo 18 della legge 30 dicembre 2010, n. 240, bandita con decreto rettorale n. 8583 del 4 maggio 2022.

#### VERBALE n.4

#### ESTRAZIONE TEMI PROVA DIDATTICA

La Commissione esaminatrice per la valutazione scientifico-didattica di n. 1 professore di ruolo di seconda fascia per il 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 presso la Facoltà di Scienze bancarie, finanziarie e assicurative risulta composta come di seguito indicato:

Prof.ssa Anna Rita BACINELLO professore di prima fascia – Università degli Studi di Trieste - settore concorsuale 13/D4 METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCIENZE ATTUARIALI E FINANZIARIE;

Prof. Andrea CONSIGLIO professore di prima fascia – Università degli Studi di Palermo - settore concorsuale 13/D4 METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCIENZE ATTUARIALI E FINANZIARIE;

Prof.ssa Rita Laura D'ECCLESIA professore di prima fascia – Università degli Studi di Roma "La Sapienza" - settore concorsuale 13/D4 METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCIENZE ATTUARIALI E FINANZIARIE;

Prof. Antonio MELE professore di Finanza – Università della Svizzera Italiana USI;

Prof. Nino SAVELLI professore di prima fascia – Università Cattolica del Sacro Cuore - settore concorsuale 13/D4 METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCIENZE ATTUARIALI E FINANZIARIE.

ac AB RH 1 SE

si è riunita per la quarta volta il giorno 9 Gennaio 2023 alle ore 13.00 per l'estrazione dei temi della prova didattica. La riunione si è tenuta in presenza presso l'Ufficio Concorsi dell'Università Cattolica del Sacro Cuore in Milano, Largo Gemelli n.1. Sono presenti tutti i componenti della Commissione, ad eccezione del prof. Antonio Mele a causa di una indisposizione.

In primo luogo, la Commissione prende atto della rinuncia a partecipare alla procedura di selezione presentata dalla candidata Francesca Grasseti, comunicata alla Commissione dall'Ufficio Concorsi con email del 15 dicembre 2022.

Per quanto concerne i temi oggetto della prova didattica, la Commissione, nella sua interezza, ha condiviso via email i seguenti 5 temi:

- Tema n.1 - Il CAPM: costruzione teorica ed evidenza empirica;
- Tema n.2 – Il modello Media-Varianza e il modello di Markowitz;
- Tema n.3 – Il modello di Black & Scholes;
- Tema n.4 – Struttura per scadenza dei tassi di interesse;
- Tema n.5 – Immunizzazione finanziaria.

Gli stessi sono inseriti rispettivamente in n. 5 buste numerate, contraddistinte dalla sigla del presidente della Commissione.

La Commissione, quindi, invita l'unico candidato, dott. Andrea Tarelli, ad entrare nella stanza ed estrarre n.3 buste delle 5 buste disponibili. Il candidato estrae le buste n.1, 3 e 5 e dopo averne letto il contenuto sceglie il tema n.5 "Immunizzazione finanziaria".

Da ultimo, il candidato illustra il suo percorso formativo e di ricerca.

L'adunanza viene sciolta alle ore 13.45 e la Commissione si riconvoca per il giorno 10 Gennaio 2023 alle ore 14.00 in modalità mista, per lo svolgimento della prova didattica.

Milano, 9 Gennaio 2023

Letto, approvato e sottoscritto

prof. Nino Savelli

(Presidente)

prof. Andrea Consiglio

(Segretario)

prof.ssa Anna Rita Bacinello (Membro)

prof.ssa Rita D'Ecclesia

(Membro)