

Allegato 1 al Bando di cui al DR

DIPARTIMENTO DI ECONOMIA

Procedura pubblica di selezione per la sottoscrizione di un contratto di lavoro subordinato di ricercatore universitario a tempo determinato in tenure track (RTT), ai sensi dell'art. 24 della legge 30.12.2010, n. 240, riservata ai sensi dell'art. 24, comma 1-bis, L. 240/2010 – COD. RTT-1bis-2026-01:

Gruppo Scientifico Disciplinare	13/STA-04 – Metodi matematici dell'economia e delle scienze attuariali e finanziarie
Profilo: Settore Scientifico Disciplinare	STAT-04/A – Metodi matematici dell'economia e delle scienze attuariali e finanziarie
Durata contrattuale:	6 anni, non rinnovabile, in regime di tempo pieno
Sede di servizio:	Università degli Studi di Perugia – Dipartimento di Economia
Docente Referente	Prof.ssa Gianna Figà-Talamanca
Lingua straniera richiesta:	Inglese
Numero massimo pubblicazioni:	12

Il contratto è finalizzato allo svolgimento delle seguenti attività di ricerca, di didattica, di didattica integrativa e di servizio agli studenti:

- **Attività di ricerca:** avrà come oggetto *“Strategie integrate per misurare e coprire i rischi di prodotti finanziari e assicurativi, con applicazioni a mercati e asset non convenzionali” (“Integrated strategies for measuring and hedging the risks of financial and insurance products, with applications to non traditional markets and assets”)*.

Descrizione sintetica: Il progetto intende sviluppare metodologie matematiche e statistiche per la misurazione, modellazione e copertura del rischio in prodotti finanziari e assicurativi, estendendo l'analisi a mercati e asset non convenzionali. Il progetto verte sullo studio di modelli stocastici non lineari e dinamiche a multiscale per rappresentare code pesanti, salti e dipendenze complesse fra rischi di mercato e attuariali, integrando componenti di contagio e regime switching. Verranno proposte tecniche di inferenza e calibrazione robuste e algoritmi numerici per pricing e riserva tecnica (schemi Monte Carlo avanzati, metodi basati su PDE/OP, approcci deep learning). La ricerca verte inoltre su problemi di hedging in presenza di frizioni di mercato e vincoli regolamentari, valutando soluzioni di copertura dinamica. L'attività prevede la validazione su dati reali, analisi di sensitività e scenari stress, e produzione di strumenti replicabili.

- **Attività didattica, didattica integrativa e servizio agli studenti:** 350 ore annue (regime a tempo pieno) prevalentemente nell'ambito del settore scientifico disciplinare STAT-04/A, di cui non più di 150 ore per attività di didattica ufficiale.

Requisiti di ammissione richiesti per la partecipazione alla procedura selettiva:

1. Titolo di Dottore di ricerca o titolo equivalente.
2. Per almeno trentasei mesi, anche cumulativamente, aver frequentato corsi di dottorato di ricerca o svolto attività di ricerca sulla base di formale attribuzione di incarichi, escluse le attività a titolo gratuito, presso università o istituti di ricerca, italiani o stranieri, diversi dall'Università degli Studi di Perugia.

Calendario discussione e relativi avvisi.

Il giorno 4.8.2026 verrà pubblicato, nel sito web dell'Ateneo (www.unipg.it) selezionando in sequenza le voci "Ateneo" - "Concorsi" – "Personale docente" - "Procedure selettive Ricercatori a tempo determinato in tenure track (RTT)", **un Avviso dirigenziale con il quale si renderà noto:**

- **la data in cui verrà pubblicato l'Avviso dirigenziale con il quale saranno comunicati l'elenco dei candidati ammessi alla discussione e il diario e la modalità di espletamento della discussione stessa;**
- **l'eventuale rinvio di pubblicazione del suddetto Avviso, ovvero ogni altra eventuale comunicazione concernente la presente procedura selettiva.**

