



**ALMA MATER STUDIORUM
UNIVERSITÀ DI BOLOGNA**

PROCEDURA VALUTATIVA AI SENSI DELL'ART. 24 COMMA 5 DELLA L. 240/2010 DEL DOTT. LUCA TRAPIN, RTD B) DEL DIPARTIMENTO DI SCIENZE STATISTICHE "PAOLO FORTUNATI"

VERBALE

Alle ore 10.30 del giorno 4/7/2022 i seguenti Professori:

- Prof. Gianluca Cubadda - Professore presso l'Università di Roma "Tor Vergata"
- Prof. Claudio Lupi - Professore presso l'Università del Molise
- Prof. Mario Mazzocchi - Professore presso l'Università di Bologna

componenti della Commissione nominata con D.R. n. 961/2022 del 18/6/2022, si riuniscono avvalendosi degli strumenti telematici di lavoro collegiali, previsti dall'art.8 comma 11 del Regolamento emanato con D.R. 977/2013.

Ognuno dei componenti dichiara di non avere relazioni di parentela ed affinità entro il 4° grado incluso con gli altri commissari e con il candidato che non sussistono le cause di astensione di cui all'art. 51 c.p.c.

La Commissione procede alla nomina del Presidente nella persona del Prof. Gianluca Cubadda e del Segretario nella persona del Prof. Mario Mazzocchi.

La Commissione, esaminati gli atti normativi e regolamentari che disciplinano lo svolgimento delle procedure valutative (Legge 240/2010; D.M. 344/2011; il D.R. 977/2013) prende atto degli standard qualitativi e dei criteri di valutazione delle pubblicazioni stabiliti dal dipartimento.

Nel rispetto dei punteggi massimi previsti, la Commissione dettaglia e specifica i punteggi attribuibili agli elementi appartenenti a ciascuna categoria di standard, come da allegata tabella (allegato 1).

La Commissione definisce inoltre che la valutazione avrà esito positivo qualora il candidato uguagli o superi il punteggio complessivo di 65/100 (o altro punteggio più elevato di 65 – minimo regolamentare previsto).

La Commissione prende visione della documentazione resa disponibile con modalità telematiche relativa al candidato, dott. Luca Trapin, ai fini della valutazione.

I Commissari si impegnano a trattare le pubblicazioni del candidato esclusivamente nell'ambito della presente procedura valutativa.

La Commissione avvia la fase di valutazione, compilando la scheda di valutazione allegata al presente verbale (allegato 2).

Al termine della valutazione il candidato ha ottenuto il punteggio di 83,5/100 e pertanto la Commissione, all'unanimità, specifica che la valutazione ha avuto esito positivo.

Il segretario verbalizzante rilegge il verbale della riunione telematica ai colleghi della Commissione e, alle ore 11.05, la Commissione considera conclusi i lavori. Il presente verbale è integrato dalle dichiarazioni d'adesione e dal documento d'identità fatti pervenire dai singoli componenti della commissione di valutazione.

Il verbale originale, controfirmato dal segretario verbalizzante e corredato delle dichiarazioni di adesione e dai documenti d'identità degli altri commissari, unitamente alla documentazione del candidato ed al materiale d'uso del concorso, è reso al Responsabile del procedimento concorsuale presso l'Ufficio Ricercatori a tempo determinato per la successiva approvazione degli atti.

Prof. Mario Mazzocchi

Collegato telematicamente Prof. Gianluca Cubadda

Collegato telematicamente Prof. Claudio Lupi

Allegato 1 – scheda di attribuzione punteggi agli standard

Attività didattica - (Punti attribuibili max 30)

ATTIVITA'	PUNTI MAX 30
<p>Attività didattica. Sono valutati il volume e la continuità delle attività con particolare riferimento agli insegnamenti e ai moduli di cui si è assunta la responsabilità, negli ultimi 6 anni <i>Si assegna 1 punto per ogni 30 ore di moduli didattici/insegnamenti svolti</i></p>	13
<p>Attività didattica integrativa e di servizio agli studenti. Sono valutate le attività di tutorato delle tesi di laurea, di laurea magistrale e delle tesi di dottorato di cui i candidati risultano essere i relatori, nonché i seminari, le esercitazioni e il tutoraggio degli studenti, negli ultimi 6 anni <i>3 punti per ogni supervisione di tesi di dottorato in qualità di relatore negli ultimi 6 anni</i> <i>2 punti per ogni supervisione di tesi di laurea magistrale in qualità di relatore negli ultimi 6 anni</i> <i>1 punto per ogni supervisione di tesi di laurea triennale in qualità di relatore o tesi di laurea magistrale in qualità di correlatore negli ultimi 6 anni</i> <i>Max 0.5 punti per ciascuna attività di seminari, esercitazioni e tutoraggio studenti documentata nel CV</i></p>	13
<p>Esiti delle valutazioni degli studenti. Solo per gli anni accademici precedenti il 2020/21, sono valutati i seguenti elementi dei moduli o degli insegnamenti tenuti: presenza, puntualità, chiarezza, capacità di stimolare l'interesse verso la disciplina e soddisfazione complessiva. Ai fini della valutazione gli Organi di Ateneo hanno stabilito che i risultati dell'indagine delle opinioni studenti per gli AA.AA. 20/21 e 21/22 non possono essere utilizzati ai fini delle procedure valutative individuali dei docenti (passaggi di carriera e gli scatti stipendiali). <i>0.5 punti per ogni modulo in cui puntualità (quesito 5 del questionario) e presenza (quesito 13) superano entrambe il 90%</i> <i>0.5 punti per ogni modulo in cui la capacità di stimolare l'interesse verso la disciplina (quesito 6) è superiore all'80%</i> <i>1 punto per ogni modulo in cui la soddisfazione complessiva per l'insegnamento (quesito 12) è superiore all'80%</i></p>	4

Attività di ricerca e pubblicazioni – (Punti attribuibili max 65)

Tabella A - Attività di ricerca (max 30 punti)

ATTIVITA'	PUNTI MAX 30
<p>Progetti di ricerca. 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, negli ultimi 6 anni; <i>5 punti per organizzazione, direzione e coordinamento di centri o gruppi di ricerca internazionali negli ultimi 6 anni</i> <i>3 punti per organizzazione, direzione e coordinamento di centri o gruppi di ricerca nazionali negli ultimi 6 anni</i> <i>2 punti per partecipazione a centri o gruppi di ricerca internazionali negli ultimi 6 anni</i> <i>1 punto per partecipazione a centri o gruppi di ricerca nazionali negli ultimi 6 anni;</i></p>	10

<i>2 punti altre attività di ricerca quali la direzione o la partecipazione a comitati editoriali di riviste;</i>	
Premi e riconoscimenti. Conseguimento di premi e riconoscimenti nazionali e internazionali per attività di ricerca negli ultimi 6 anni. <i>2 punti per conseguimento di premi e riconoscimenti internazionali per attività di ricerca;</i> <i>1 punto per conseguimento di premi e riconoscimenti nazionali per attività di ricerca</i>	5
Relazioni a congressi. Partecipazioni in qualità di relatore a congressi e convegni di interesse internazionale negli ultimi 6 anni <i>2 punti per relazioni invitate a congressi di interesse internazionale</i> <i>1 punto per relazioni spontanee a congressi di interesse internazionale</i>	5
Produzione scientifica. E' valutata la consistenza complessiva della produzione scientifica del candidato, l'intensità e la continuità temporale della stessa, fatti salvi i periodi, adeguatamente documentati, di sospensione del rapporto di lavoro e altri periodi di congedo o di aspettativa stabiliti dalle leggi vigenti e diversi da quelli previsti per motivi di studio, negli ultimi 6 anni	10

Tabella B - Pubblicazioni negli ultimi sei anni (**max 35 punti**)

Per ogni singola pubblicazione degli ultimi sei anni, sulla base dei 4 criteri seguenti viene assegnato un punteggio da 0 a 6 punti sulla base del seguente schema:

- originalità, innovatività, rigore metodologico e rilevanza di ciascuna pubblicazione (punteggio da 0 a 3);
- congruenza di ciascuna pubblicazione con gli elementi di ulteriore qualificazione di cui all'art. 2 comma 5 lett. b) oppure con tematiche interdisciplinari ad esso strettamente correlate (punteggio da 0 a 1, dove 1=piena coerenza; 0.8=buona coerenza; 0.5 sufficiente coerenza; 0.2=scarsa coerenza);
- rilevanza scientifica della collocazione editoriale di ciascuna pubblicazione e sua diffusione all'interno della comunità scientifica (punteggio da 0 a 3);
- determinazione analitica, anche sulla base di criteri riconosciuti presso la comunità scientifica internazionale di riferimento, dell'apporto individuale del ricercatore nel caso di partecipazione del medesimo a lavori in collaborazione; in particolare, l'apporto individuale del candidato nel caso di partecipazione del medesimo a lavori in collaborazione sarà determinato come segue: autocertificazione relativa alla suddivisione delle parti o in assenza di tale autocertificazione attribuzione del contributo in modo paritetico tra gli autori (punteggio tra 0 e 1, il punteggio massimo=1 è assegnato solo a lavori con un massimo di tre autori e con contributo almeno paritetico, per i lavori da 4 a 6 autori il punteggio massimo è 0.75, per i lavori con più di 6 autori il punteggio massimo è 0.5).

Il punteggio complessivo sarà dato da $(a + c) * b * d$ (**max 6 punti** per pubblicazione, fino ad un massimo di 35 punti). Al termine della valutazione, qualora il candidato superasse, nella somma dei punti assegnati alle singole pubblicazioni, il valore di 35, si procederà assegnando al candidato 35 punti.

Totale punti attività di ricerca e pubblicazioni (tabella A+ tabella B) = 65

Attività istituzionali (**max 5 punti**)

E' valutato il volume e la continuità delle attività svolte, con particolare riferimento a incarichi di gestione e a impegni assunti in organi collegiali e commissioni, presso rilevanti enti pubblici e privati e organizzazioni scientifiche e culturali ovvero presso l'Ateneo e/o altri Atenei nazionali ed esteri, negli ultimi 6 anni.

Allegato 2 - Scheda di valutazione dott. Luca Trapin

Attività didattica - (Punti attribuibili max 30)

ATTIVITA'	PUNTI ASSEGNATI
Attività didattica. Il dott. Trapin ha svolto tra il 2018/19 e il 2021/22 attività di docenza in 12 moduli e insegnamenti di econometria, statistica e statistica economica, per un totale complessivo di 360 ore	12
Attività didattica integrativa e di servizio agli studenti. Il dott. Trapin riporta nel curriculum la supervisione di 21 tesi di laurea triennale in qualità di relatore tra il 2019/20 e il 2020/21. Ha inoltre svolto attività di esercitazione nel corso di Mathematics I presso l'Università Tor Vergata	13
Esiti delle valutazioni degli studenti. Ai fini della presente valutazione possono essere considerati solo i moduli di Basic Analytics e Analisi di Mercato dell'anno accademico 2018/19. In entrambi i moduli il candidato ha ottenuto il 100% di giudizio positivi per puntualità e presenza (1 punto). Per il modulo Basic Analytics la capacità di stimolare l'interesse verso la disciplina ha superato il 70% (0.5 punti).	1.5
TOTALE	26.5

Attività di ricerca e pubblicazioni – (Punti attribuibili max 65)

Tabella A - Attività di ricerca (max 30 punti)

ATTIVITA'	PUNTI ASSEGNATI
Progetti di ricerca. Dichiara di essere responsabile del progetto "On the determinants of time-varying tail risk" finanziato da UniCredit Foundation attraverso il Modigliani Research Grant (9th edition), finanziato attraverso bando competitivo per giovani ricercatori europei (3 punti). Partecipa ad un working group COST Action (2 punti) e ad un progetto SIR come membro del gruppo di ricerca (1 punto). E' stato co-Editor in Co-editor per uno special issue della rivista Risks.	7
Premi e riconoscimenti. Non indica premi e riconoscimenti nazionali e internazionali per attività di ricerca negli ultimi 6 anni.	0
Relazioni a congressi. Dichiara la partecipazione con relazioni spontanee a 13 congressi internazionali e 4 inviti a seminari in istituzioni di ricerca	5
Produzione scientifica Nel periodo 2016-2021 ha prodotto 16 pubblicazioni su rivista, di cui 14 in riviste collocate in classe A nella classificazione ASN – Area 13. La produttività è eccellente	10
TOTALE	22

Tabella B - Pubblicazioni negli ultimi sei anni (max 35 punti)

Il dott. Luca Trapin ha presentato le seguenti pubblicazioni relative agli ultimi sei anni di attività (2016-2022, sono esclusi i lavori in revisione, working paper, abstract):

1. Marco Bee, Julien Hambuckers, Luca Trapin (2021). Estimating large losses in insurance analytics and operational risk using the g-and-h distribution. *Quantitative Finance*, 21, 1207 - 1221.
2. Giuseppe Buccheri, Davide Pirino, Luca Trapin (2021). Managing liquidity with portfolio staleness. *Decisions in Economics and Finance*, 44, 215-239.
3. Marco Bee, Julien Hambuckers, Flavio Santi, Luca Trapin (2021). Testing a parameter restriction on the boundary for the g-and-h distribution: a simulated approach. *Computational Statistics*, 36, 2177-2200.
4. Debbie J. Dupuis, Luca Trapin (2020). Structural change to the persistence of the urban heat island. *Environmental Research Letters*, 15:104076.

5. Marco Bee, Debbie J. Dupuis, Luca Trapin (2019). Realized peaks over threshold: A time-varying extreme value approach with high-frequency based measures. *Journal of Financial Econometrics*, 17(2), 254-283.
6. Debbie J. Dupuis, Luca Trapin (2019). Ground-level ozone: Evidence of increasing serial dependence in the extremes. *Annals of Applied Statistics*, 13(1), 34-59.
7. Marco Bee, Julien Hambuckers, Luca Trapin (2019). Estimating Value-at-Risk for the g-and-h distribution: an indirect inference approach. *Quantitative Finance*, 19(8), 1255-1266.
8. Fulvio Corsi, Fabrizio Lillo, Davide Pirino, Luca Trapin (2018). Measuring the propagation of financial distress with Granger-causality tail risk networks. *Journal of Financial Stability*, 38, 18-36.
9. Marco Bee, Debbie J. Dupuis, Luca Trapin (2018). Realized extreme quantile: A joint model for conditional quantiles and measures of volatility with EVT refinements. *Journal of Applied Econometrics*, 33(3), 398-415.
10. Luca Trapin (2018). Can volatility models explain extreme events? *Journal of Financial Econometrics*, 16(2), 297-315.
11. Marco Bee, Luca Trapin (2018). Estimating and forecasting conditional risk measures with Extreme Value Theory: A review. *Risks*, 6(2), 45.
12. Marco Bee, Massimo Riccaboni, Luca Trapin (2017). An extreme value analysis of the last century crises across industries in the US economy. *Journal of Economic Dynamics and Control*, 81, 65-78.
13. Marco Bee, Luca Trapin (2017). A characteristic function based approach to Approximate Maximum Likelihood estimation. *Communications in Statistics, Theory and Methods*, 47(13), 3138-3160.
14. Marco Bee, Debbie J. Dupuis, Luca Trapin (2016). Realizing the extremes: Estimation of tail-risk measures from a high-frequency perspective. *Journal of Empirical Finance*, 36, 86-99.
15. Marco Bee, Debbie J. Dupuis, Luca Trapin (2016). U.S. stock returns: Are there seasons of excesses? *Quantitative Finance*, 16(9), 1453-1464.
16. Marco Bee, Luca Trapin (2016). A simple approach to the estimation of Tukey's gh distribution. *Journal of Statistical Computation and Simulation*, 86(16), 3287-3302.

La valutazione è la seguente:

Publicazioni	(a) Originalità, innovatività, rigore metodologico e rilevanza (0-3)	(b) Congruenza (0-1)	(c) Rilevanza scientifica della collocazione editoriale (0-3)	(d) Apporto del candidato nei lavori in collaborazione (0-1)	Punti totali (a+c) x (b) x (d) (0-6)
Pubb. 1	3	1	3	1	6
Pubb. 2	3	1	2	1	5
Pubb. 3	3	1	3	0.75	4.5
Pubb. 4	2.5	0.5	2	1	2.25
Pubb. 5	3	1	3	1	6
Pubb. 6	3	0.5	3	1	3
Pubb. 7	3	1	3	1	6
Pubb. 8	3	1	3	0.75	4.5
Pubb. 9	3	1	3	1	6
Pubb. 10	3	1	3	1	6
Pubb. 11	2	1	1	1	3
Pubb. 12	3	1	3	1	6
Pubb. 13	2.5	1	2	1	4.5
Pubb. 14	3	1	3	1	6
Pubb. 15	3	1	3	1	6
Pubb. 16	3	1	3	1	6
Totale punteggio pubblicazioni					80.75

In conformità ai criteri delineati nell'Allegato 1, si assegnano al candidato **35 punti** con riferimento alla valutazione delle pubblicazioni.

Totale punti attività di ricerca e pubblicazioni (tabella A + tabella B) = 57

Attività di servizio all'Ateneo, istituzionali e organizzative – (Punti attribuibili max 5)

Nel curriculum presentato dal Dott. Trapin non vengono indicate attività di servizio all'Ateneo e organizzative.

Punti attribuiti 0

TOTALE PUNTI ASSEGNATI:

Attività didattica	26.5
Attività di ricerca	57
Attività di servizio all'Ateneo, istituzionali e organizzative	0
TOTALE	83.5

Digitally signed
by: Mario Mazzocchi,
on: 4 luglio 2022



Dichiarazione da allegare alla Versione Telematica

PROCEDURA VALUTATIVA AI SENSI DELL'ART. 24 COMMA 5 DELLA L. 240/2010 DEL DOTT. LUCA TRAPIN, RTD B) DEL DIPARTIMENTO DI SCIENZE STATISTICHE

DICHIARAZIONE

Il/La sottoscritto/a Prof./ssa Gianluca Cubadda, componente della Commissione Giudicatrice della procedura valutativa sopracitata, dichiara con la presente di aver partecipato, in via telematica, allo svolgimento dei lavori della Commissione giudicatrice e di concordare con il verbale della seduta medesima, redatto a firma del Prof. Mario Mazzocchi e che sarà trasmesso all'Ufficio Ricercatori a tempo determinato per i provvedimenti di competenza.

In fede

Data 04/07/2022

Prof G Cubadda

Allegare copia documento di riconoscimento

Dichiarazione da allegare alla Versione Telematica

PROCEDURA VALUTATIVA AI SENSI DELL'ART. 24 COMMA 5 DELLA L. 240/2010 DEL DOTT. LUCA TRAPIN, RTD B) DEL DIPARTIMENTO DI SCIENZE STATISTICHE "PAOLO FORTUNATI"

DICHIARAZIONE

Il sottoscritto Prof. Claudio Lupi, componente della Commissione Giudicatrice della procedura valutativa sopracitata, dichiara con la presente di aver partecipato, in via telematica, allo svolgimento dei lavori della Commissione giudicatrice e di concordare con il verbale della seduta medesima, redatto a firma del Prof. Mario Mazzocchi e che sarà trasmesso all'Ufficio Ricercatori a tempo determinato per i provvedimenti di competenza.

In fede

Data 4/7/2022

Allegare copia documento di riconoscimento

Prof Claudio Lupi
