

A TUTTE LE UNIVERSITA' E
ISTITUTI DI ISTRUZIONE UNIVERSITARIA
PER VIA TELEMATICA

INFORMAGIOVANI - PISA
PER VIA TELEMATICA

OGGETTO: comunicazione pubblicazione bando a scopo divulgativo.

Si rende noto che all'Albo ufficiale della Scuola Normale Superiore di Pisa - Piazza dei Cavalieri, 7 – è stato affisso il seguente bando (DD 300/2013):

Selezione pubblica, per titoli e colloquio, per il conferimento di un assegno di ricerca denominato “**Proprietà multivariate di lungo termine degli spread dei CDS**” presso la Classe Accademica di Scienze, mm. ff. nn. - Gruppo di Finanza Quantitativa, per la collaborazione al programma di ricerca generale “*Stabilità e coerenza con le aspettative del mercato degli scenari a lungo termine impiegati nella gestione dei rischi finanziari*”.

Argomenti del progetto sono l'analisi e lo sviluppo di modelli per la dinamica dei credit spread e della loro struttura di correlazione. Gli obiettivi del progetto sono due: a) l'analisi comparativa delle soluzioni adottate nell'ambito dell'industria e dell'accademia; b) lo sviluppo di un approccio originale capace sia di garantire coerenza con la teoria prevalente del pricing di derivati e sia di generare degli scenari estremi come richiesto dalle migliori pratiche di gestione del rischio. Il titolare dell'assegno dovrà svolgere attività di ricerca nell'ambito della finanza quantitativa e pertinenti con il programma di ricerca generale e particolare sopra indicato. Nello specifico, per la tipologia di ricerche previste, il candidato ideale dell'assegno dovrebbe avere una consolidata esperienza nell'analisi delle serie temporali finanziarie, nella modellizzazione mediante processi stocastici, nel pricing di prodotti derivati e/o conoscere gli elementi di base della microstruttura dei mercati finanziari, nonché le seguenti ulteriori esperienze/competenze specifiche: analisi econometrica di serie storiche con frequenza medio/bassa (giornaliera o inferiore) con riferimento ad aspetti sia di evoluzione temporale che cross-sectional; conoscenza dei principali risultati nell'ambito del pricing dei derivati; esperienza di tecniche numeriche, in particolare stocastiche (es. generazione di scenari Monte Carlo) in ambito finanziario.

Possono presentare domanda per il conferimento dell'assegno di cui sopra i candidati in possesso del titolo di dottore di ricerca, o di titolo equivalente, in Matematica, Fisica, Economia, Finanza, Ingegneria finanziaria. Potranno partecipare i candidati in possesso del suddetto titolo di studio indicato conseguito all'estero, riconosciuto equivalente ai suddetti titoli italiani. Ai soli fini dell'ammissione alla selezione l'equivalenza dei titoli stranieri con i suddetti titoli italiani potrà essere dichiarata dalla commissione giudicatrice di cui all'art.5.

Per l'espletamento dell'attività è altresì richiesta la conoscenza della lingua inglese.

Scadenza termine per la presentazione delle domande: 30 agosto 2013

Il bando di selezione è stato altresì reso pubblico sul sito <http://www.sns.it/servizi/job/> della Scuola.

Per informazioni rivolgersi al Servizio Personale (tel.050/509726).

Si ringrazia per la collaborazione.

Area Affari Generali
Servizio Personale
Il Responsabile
Dott.ssa Claudia Sabbatini

