

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 n.301/2013):

Selezione pubblica, per titoli e colloquio, per il conferimento di un assegno di ricerca denominato ***“Impatto della liquidità del mercato sulla dinamica dei prezzi in un contesto multi-asset”*** 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”*.

Argomento del progetto è lo studio degli effetti sul valore di un portafoglio finanziario dovuti all'impatto di mercato, inteso come movimento medio del prezzo di mercato dei beni in portafoglio indotto dall'operatività in acquisto/vendita da parte del gestore. Di interesse rilevante è la comprensione degli effetti di tale operatività in condizioni di stress del mercato, che richiede preliminarmente l'analisi dell'evoluzione endogena delle correlazioni/dipendenze tra i fattori di mercato. Obiettivo è lo sviluppo di un modello teorico per la descrizione dell'impatto di mercato nell'ambito della teoria del portafoglio e di un approccio che integri tecniche proprie della finanza ad alta frequenza, della microstruttura di mercato, in congiunzione con le analisi delle strategie di investimento prevalenti tra gli investitori istituzionali. 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: conoscenza di concetti fondamentali di microstruttura del mercato, analisi multivariata, analisi di serie storiche ad altissima frequenza, competenze in ambito di metodi 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

