SCUOLA
NORMALE
SUPERIORE

AAG/SP/CS

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.302/2013):

Selezione pubblica, per titoli e colloquio, per il conferimento di un assegno di ricerca denominato ***"Dinamica dei rating impliciti di mercato per gli emittenti di debito sovrano"*** 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"*.

Secondo il formalismo dei sistemi dinamici, il progetto intende integrare la dinamica di variabili finanziarie, quali tassi e spread di mercato, con quella di variabili di natura macroeconomica caratterizzate da una scala di evoluzione temporale più lenta, per lo sviluppo di un modello di attribuzione del merito di credito. Obiettivo del progetto è sviluppare un quadro teorico nel quale, tramite l'analisi delle variabili veloci e secondo lo scenario macroeconomico prevalente, si possa valutare a) la probabilità che si instaurino fenomeni di instabilità endogene al mercato e b) si possano risolvere le contraddizioni nell'attribuzione di rating che spesso emergono in conseguenza dell'utilizzo di metodologie standard. 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); conoscenza dei principali risultati nell'ambito del pricing di derivati; nozioni di base della teoria dei sistemi dinamici, metodi numerici per la simulazione di sistemi dinamici e delle serie temporali.

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

Claudia Sabbatini

Documento firmato digitalmente ai sensi dell'articolo 21, secondo comma, del D.lgs. 7 marzo 2005, n. 82