



### SEMINARIO PUBBLICO 10 APRILE 2025 – VALERIA BIGNOZZI

Avviso seminario pubblico della prof.ssa Valeria BIGNOZZI ai sensi dell'art. 11, comma 1, lett. k) dello Statuto per la proposta di chiamata a Professore di ruolo di II Fascia per il GSD 13/STAT-01 (EX SC 13/D1) – Settore scientifico-disciplinare STAT-01/A (EX SSD SECS-S/01) - presso il Dipartimento di Metodi e modelli per l'economia il territorio e la finanza - Facoltà di Economia – codice concorso 2024PAE012.

Le risorse per la chiamata della prof.ssa Valeria Bignozzi in qualità di professore di ruolo di II fascia all'esito della procedura selettiva, ai sensi e con le modalità previste dall'art.24 comma 5 della Legge 240/2010 riservata ai professori di ruolo di II Fascia, sono state inserite nella Programmazione di fabbisogno triennale di personale docente anno 2023, biennio 2023-2024 approvata dal Consiglio di Amministrazione con delibera n. 80/24 del 19.03.2024 (come da comunicazione dell'Area Supporto Strategico e Comunicazione).

Sul portale Trasparenza del sito di "Sapienza" Università di Roma, è stato pubblicato il verbale della Commissione giudicatrice della procedura selettiva di chiamata a professore di II fascia, ai sensi dall'art.24 comma 5 della Legge 240/2010, per il GSD 13/STAT-01 (EX SC 13/D1) – Settore scientifico-disciplinare STAT-01/A (EX SSD SECS-S/01) - presso il Dipartimento di Metodi e modelli per l'economia il territorio e la finanza - Facoltà di Economia – codice concorso 2024PAE012. Pertanto si comunica che, dall'approvazione atti della Commissione Giudicatrice della procedura in oggetto è stata dichiarata vincitrice la prof.ssa Valeria Bignozzi, come da D.R. n. 884/2025 del 18/03/2025, consultabile sul Portale di Ateneo al link: [https://web.uniroma1.it/trasparenza/dettaglio\\_bando\\_albo/223005](https://web.uniroma1.it/trasparenza/dettaglio_bando_albo/223005), la quale **il giorno 10 aprile 2025 alle ore 09.30** terrà, presso l'**Auletta Cristina Di Fresco del Dipartimento** (RM019-P05L068), il seminario ai sensi dell'art. 11, comma 1, lett. k) dello Statuto sull'attività di ricerca svolte e in corso di svolgimento.

#### **Titolo del seminario: Valutazione equa in condizioni di incertezza dei parametri**

Nell'intenso dibattito sulle proprietà delle misure di rischio, grande attenzione è stata rivolta recentemente dedicato all'elicitabilità. Una funzionalità statistica è elicetabile, se può essere scritto come il minimizzatore di una funzione di perdita attesa; la media, il quantile e l'espettorale sono esempi importanti. L'elicitabilità è anche correlata all'idea di regressione, infatti la funzione di perdita può essere utilizzata per misurare la "distanza" tra una data variabile Y e una funzione di regressione. Questi sono stati impiegati concetti per una valutazione equa nella matematica attuariale, dove la funzione di perdita attesa viene utilizzata per trovare un portafoglio che sia il più vicino possibile possibile ad una responsabilità assicurativa, pur avendo un rischio residuo pari a zero. In questo lavoro utilizziamo l'elicitabilità per trovare lo stimatore del rischio che approssima meglio una perdita finanziaria in un contesto di incertezza del modello. Quando la probabilità la distribuzione della perdita è sconosciuta, la misura del rischio è stimata sulla base di (storico) e assume valori diversi a seconda della realizzazione di il campione utilizzato. Il nostro obiettivo è trovare il miglior stimatore di strategia/misura del rischio che riflette anche la rischiosità derivante dall'incertezza della distribuzione. In particolare, concentrandoci sulla famiglia delle distribuzioni di scala di localizzazione, consideriamo misure di rischio elicetabili e diversi stimatori, studiamo le loro proprietà



e valutarne l'accuratezza. Basato su un lavoro congiunto di Salvatore Scognamiglio e Andreas Tsanakas.

Il seminario potrà essere seguito anche a distanza accedendo al seguente link:

<https://meet.google.com/ndv-wcju-vyw>

Roma, 31 marzo 2025

Il Direttore del Dipartimento  
Prof.ssa Donatella Strangio