

INFORMAZIONI PERSONALI Mario Pace

Senior Manager

Profile: Team leader di analisti funzionali, analisti ed ingegneri finanziari, sviluppatore di processi di business e *project manager* con esperienza nel mondo del Financial Services presso i principali gruppi bancari italiani. Ha partecipato a diversi seminari ABI in qualità di relatore, tra i principali:

- 1. Shaping the future of Risk&Finance:** the strategic Risk and the Risk aware CFO – Giugno 2019 (Roma);
- 2. The new era of capital markets and securitizations:** regulatory challenges and business needs – Dicembre 2018 (Milano);
- 3. Le nuove frontiere del Regtech in ambito FRTB:** Adjoint Algorithmic Differentiation & Machine Learning - Giugno 2017 (Milano)

POSIZIONE RICOPERTA

Le *skills* riguardano il *Risk Management* con focus nella gestione e nel monitoraggio del rischio di mercato e controparte, del rischio di tasso di interesse, del rischio di liquidità, rischio di credito sul portafoglio finanziario, del rischio di commodity, rischi operativi e del pricing di strumenti derivati. Conoscenza approfondita della normativa Basilea II, Basilea III sui rischi di mercato e controparte, del nuovo framework FRTB e CVA, IRRBB, nuovo framework securitisation (SEC- ERBA, SEC-SA, SEC-IRBA), IFRS 9 e dei principali processi operativi e policy inerenti l'area di Capital Markets, Trading, Treasury e del processo tipico del Risk Management di definizione del RAF, ICAAP, ILAAP e predisposizione dei limiti operativi anche in ambito IFRS9. Competenza in ambito di *deal-shaping* per l'analisi della profittabilità delle operazioni di *M&A* e redazione di *business plan*. Docente del corso di **Risk Management e Teoria del Rischio: CVA e FRTB** del Master BA.FI 2019/2020.

Reference:

ESPERIENZA
PROFESSIONALE

Period: 01/2013 – today

Company: Reply Advantage

Position held: Senior Manager

Project title:

Programma Resource

Customer:

Primaria istituzione bancaria italiana (Tier 1)

Project goals:

Realizzazione di una piattaforma proprietaria utilizzata dalle differenti aree della banca (Capital Markets, Treasury, Collateral Management, Risk Management, Financial Control, Product Control, Accounting) sia per esigenze di business che per esigenze di natura regolamentare (es. Business,

Description:

Team leader (circa 30 risorse) in materia di ingegneria finanziaria, analisi funzionale, disegno di processi, definizione di policy e work-flow per i seguenti ambiti:

1. XVA: framework finalizzata al calcolo dei principali fair value adjustment (CVA, DVA, FVA, KVA);
2. RWA: framework che consente il calcolo degli assorbimenti patrimoniali a fronte dei rischi intrapresi e la valutazione degli economics;
3. Collateral Optimization: framework che consente di ottimizzare la gestione del collateral a fronte delle chiamate margini;
4. Initial Margin: procedure finalizzate al calcolo dell'initial margin spot e prospettico;
5. SIMM: framework che consente il calcolo del nuovo standard initial margin method per l'operatività bilaterale un-cleared;
6. FRTB: framework finalizzata al calcolo dei requisiti patrimoniali a fronte del rischio di mercato (FRTB);
7. Portfolio analysis: procedure che consentono di definire strategie di hedging per mitigare il tail risk;
8. Trading: framework utilizzato a supporto dei desk di trading con algoritmi finalizzati ad ottimizzare l'asset allocation dei desk di front office

Supporto finanziario nella realizzazione del business case per il processo interno di approvazione con i C-level

Period: 09/2017 – 12/2019

Company: Reply Advantage

Position held: Manager

Project title:

Definizione limiti operativi

Customer:

Primarie istituzioni bancarie italiane (Tier 3)

Project goals:

Realizzazione del modello finanziario e delle policy, regolamento finanza e regolamento risk management per la definizione dei limiti operativi, di primo e

secondo livello per i portafogli HTCS, HTC, HTS

Description:

Team leader (circa 10 risorse) nella definizione delle policy, regolamento finanza, regolamento limiti, realizzazione della modellistica finanziarie ed individuazione delle metriche di rischio oggetto di monitoraggio per il front office

Period: 9/2012 – 12/2012

Company: Reply Advantage

Position held: Senior Consultant

Project title:

Nuovo framework FRTB

Customer:

Reply

Project goals:

Analisi degli impatti del nuovo FRTB sui processi di business, modelli organizzativo, modelli matematici

Description:

A partire dalla pubblicazione del primo paper di BIS "FRTB" partecipazione ad un gdl internazionale con Avantage Reply Uk, Avantage Reply Belgium, Avantage Reply France, Avantage Reply Holland finalizzato ad individuare gli impatti della nuova normativa in termini di processi, capitale, modelli di calcolo e soluzioni architetture IT al fine di effettuare una survey sulle più grandi banche europee, dei workshop per le banche clienti ed un linea di offering a livello europeo.

Period: 4/2011 – 7/2012

Company: KPMG Position held: Consultant

Project title:

Programma rischio di tasso di interesse e liquidità

Customer:

Primaria istituzione bancaria italiana (Tier 2)

Project goals:

Implementazione della suite Algorithmics "RiskWatch" di IBM per il monitoraggio del rischio di tasso di interesse e liquidità

Description:

Supporto all'unità di Risk Management per la definizione delle specifiche funzionali per l'implementazione del nuovo sistema ed analisi funzionali per il calcolo dei nuovi ratio di Basilea 3 (LCR, NSFR). Attività di project

management per l'implementazione dell'applicativo e predisposizione della documentazione tecnica presentata all'organismo di vigilanza. Definizione delle policy e del nuovo regolamento finanza

Period: 1/2011 - 4/2011

Company: KPMG

Position held: Consultant

Project title:

Validazione modello interno IRC sul rischio specifico di mercato

Customer:

Primaria istituzione bancaria italiana (Tier 1)

Project goals:

Validazione modello interno IRC per il rischio specifico

Description:

Validazione del modello IRC mediante l'analisi dei seguenti aspetti:

- Processi (market data, pricing, reportistica)
- Sistemi IT
- Modello di calcolo

Requisiti patrimoniali

Predisposta la documentazione tecnica presentata all'organismo di vigilanza per la richiesta di validazione del modello ottenuta da Maggio 2011.

Definizione delle policy, del RAF e del nuovo regolamento finanza.

Period: 10/2010 - 08/2012

Company: KPMG

Position held: Consultant

Project title:

Academy

Customer:

KPMG

Project goals:

Update normative Basilea 2 e Basilea 3

Description:

Analisi della normative (CRD IV, Circ. 263 e 285 Banca d'Italia, framework Basilea 2 e Basilea 3) con focus sul market risk, counterparty risk, liquidity risk ed interest rate risk

ISTRUZIONE E FORMAZIONE

2010

Master in Metodi quantitativi ed applicazioni informatiche per il risk management

IPE - Napoli Project Work: Interest rate risk models

2009

Laurea specialistica in Scienze economiche e finanziarie - Università di Palermo Tesi: I rischi connessi ai nuovi strumenti finanziari – 107/110

2007

Laurea 1° livello in Economia e Finanza – Università di Palermo - 108/110
Tesi: La competizione e l'importanza degli standard nei settori ICT: il caso Apple

COMPETENZE PERSONALI

Lingua madre italiano

Altre lingue

Sostituire con la lingua

COMPRESIONE		PARLATO		PRODUZIONE SCRITTA
Ascolto	Lettura	Interazione	Produzione orale	
good	good	good	good	good

Livelli: A1/A2: Utente base - B1/B2: Utente intermedio - C1/C2: Utente avanzato
Quadro Comune Europeo di Riferimento delle Lingue

Competenze professionali

Functional Skills:
 Financial models
 Framework FRTB
 Framework CVA
 Business plan Risk Management
 MiFid and Basel 2 regulations (streams market risk, interest rate risk) Basel 3 regulations (streams liquidity risk and market risk)
 Basel 3 ratio estimation Models market risk
 Processi audit, validazione e risk management Behavioural model of Prepayment
 Asset and Liability Management

Methodologies: Level:
 PM Advanced
 Business plan Advanced
 Functional Analysis Advanced
 Design of process Advanced
 Validation models Advanced
 Development Intermediate
 IT Architecture Intermediate

Competenze digitali

PROGRAMMING LANGUAGES	LEVEL
SQL	INTERMEDIATE
VBA	INTERMEDIATE
PYTHON	INTERMEDIATE
TECHNICAL LANGUAGES	LEVEL
XSD / XML	ADVANCED
SOFTWARE	LEVEL
MS OFFICE	ADVANCED
MATLAB	INTERMEDIATE
R	INTERMEDIATE
GRETL	ADVANCED
METASTOCK	INTERMEDIATE
MUREX	ADVANCED
KONDOR+	INTERMEDIATE
RISKWATCH	INTERMEDIATE
BLOOMBERG	INTERMEDIATE
ERMAS	INTERMEDIATE

Altre competenze

Specializations

	Year	Duration	Corporation
Project Management	2011	1 dd	KPMG
ALM	2011	1 dd	KPMG

Market risk	2011	1 dd	KPMG
framework	2011	1 dd	KPMG
Basel 2	2011	1 dd	KPMG
Liquidity risk	2011	1 dd	KPMG
Framework	2013	2 dd	REPLY
Basel 3	2015	5 dd	REPLY
Hedge	2015	5 dd	REPLY
Accounting	2018	8 dd	REPLY
Public speaking			
People management			
Problem solving management			
Management Program			

Dati personali Autorizzo il trattamento dei miei dati personali ai sensi del Decreto Legislativo 30 giugno 2003, n. 196 "Codice in materia di protezione dei dati personali".

ULTERIORI INFORMAZIONI

I sottoscritt dichiara di essere consapevole che il presente *curriculum vitae* sarà pubblicato sul sito istituzionale dell'Ateneo, nella Sezione "Amministrazione trasparente", nelle modalità e per la durata prevista dal d.lgs. n. 33/2013, art. 15.

Data

f.to