

ALDO LETIZIA CV aggiornato a luglio 2022

DATI ANAGRAFICI	
Nome e Cognome	Aldo LETIZIA
Data e luogo di nascita	
Residenza	
Nazionalità	
Madre lingua	
Altre lingue	Inglese
LAUREA	
Università di Siena	Scienze Economiche e Bancarie
POSIZIONE PROFESSIONALE ATTUALE	
Banca Popolare Pugliese	Chief risk officer (dal 2002)
ESPERIENZE PRECEDENTI	
Banco di Roma	Filiale di Milano (1986-1987)
Banca Popolare Pugliese	Responsabile del servizio di private banking (1998-2001)
Banca Popolare Pugliese	Responsabile del servizio di asset management (1992-1997)
ALTRE ATTIVITA'	
Consulenza	Consulenza a banche in tema di: strategia di gestione del credito deteriorato, modelli di valutazione dei crediti performing e non-performing, pricing dei crediti all'origine, processi di controllo del rischio di credito. Consulenza tecnica indipendente alla magistratura per la valutazione di strumenti finanziari complessi e strumenti derivati.
Docenza	Professore a contratto di Metodi Matematici per il Risk Management, Laurea Magistrale in Matematica, Università del Salento - Dipartimento di Matematica e Fisica. Docente ABI-Formazione Docente al modulo di Credit Risk Management del Master Universitario in Banking e Finance - Università degli Studi di Roma "La Sapienza" (a.a. 2014-2015, 2015-2016, 2016-2017) Docente del corso semestrale: "Modelli per la valutazione degli strumenti finanziari complessi" nell'ambito della Laurea Magistrale in Matematica, Dipartimento di Matematica e Fisica dell'Università del Salento, a.a. 2012-2013. Ciclo di seminari: "Metodi matematici per la finanza e il risk management" nell'ambito della Laurea Magistrale in Matematica, Dipartimento di Matematica e Fisica dell'Università del Salento, a.a. 2015-2016.
PUBBLICAZIONI	
	<i>"Il pricing degli strumenti esposti al rischio di credito", Bancaria, nr. 1, 2020</i>
	<i>"Evoluzione del framework di Credit Risk Management in banca tra IFRS 9 e Basilea 3", A. Letizia, P. Porretta , Bancaria, n.10, 2018</i>
	<i>"La solvibilità delle banche valutata attraverso un approccio à la Merton", Bancaria, n.4, 2018.</i>
	<i>"Tecniche per il controllo della redditività del portafoglio crediti: i vantaggi di un approccio risk-based ", in "Il governo dei rischi in banca. Nuove tendenze e nuove sfide." a cura di P. Leone, P. Porretta, F. Tutino, CEDAM, 2016</i>

La misurazione del rischio di tasso: approccio stocastico al modeling degli spostamenti della curva ed estensione al rischio di spread, Newsletter AIFIRM, 2014.

La verifica del monitoraggio del credito in ambito risk management: aggravio di costi o leva per la creazione di valore, Bancaria, n.12, 2013

La gestione della liquidità nelle banche: un esame della materia oltre il filtro della normativa attuale, Newsletter AIFIRM, 2012.

Credit Spread Risk and its Effects on Banks' Economic Capital, <http://ssrn.com/abstract=1800584>, 2011.

"*Gli elementi di novità nella regolamentazione sulla Compliance*", in "Governo del Rischio Compliance e Presidio della Reputazione in Banca" a cura dell'Associazione Nazionale delle Banche Popolari Italiane, Edicred, 2011

Il controllo dei rischi nelle fasi di allargamento degli spread creditizi, Credito Popolare, 2010.

Vulnerability of risk management systems in credit spread widening scenarios, Journal of Financial Risk Management, IUP Indian University Press, Università di Hyderabad, India, set 2010 – (<http://ssrn.com/abstract=1577570>).

La misurazione del rischio di spread nel trading book, Newsletter AIFIRM, 2010.

L'allargamento dei credit spread: impatto sul valore e sui sistemi di controllo del rischio, in Banche e Banchieri, 2009.

"*Il rischio di concentrazione nel portafoglio crediti*", in "Guida pratica al Secondo Pilastro di Basilea 2" a cura di Pogliaghi P. e Vandali W. , Bancaria Editrice, 2008

Credit spread widening risk in portfolios: pricing techniques and sensitivity measures, <http://ssrn.com/abstract=1088965>, 2008.

I finanziamenti destinati all'acquisto di titoli: rischi effettivi per il risparmiatore, AF – Analisi Finanziaria n.25, IFAF Milano, 2003.

La manovra del rischio di tasso nella gestione di patrimoni mobiliari, AF – Analisi Finanziaria n. 49, IFAF Milano, 1993.

PARTECIPAZIONE A BOARD E COMMISSIONI

Membro del Consiglio di Amministrazione dell'Associazione Italiana Financial Industry Risk Managers (AIFIRM)

Componente del Gruppo di gestione e assicurazione della qualità dei corsi di Laurea in Matematica - Dipartimento di Matematica e Fisica dell'Università del Salento

Componente del Comitato di Redazione della rivista AIFIRM News
