

## ALDO LETIZIA CV aggiornato a luglio 2022

<b>DATI ANAGRAFICI</b>	
Nome e Cognome	Aldo LETIZIA
Data e luogo di nascita	
Residenza	
Nazionalità	
Madre lingua	
Altre lingue	Inglese
<b>LAUREA</b>	
Università di Siena	Scienze Economiche e Bancarie
<b>POSIZIONE PROFESSIONALE ATTUALE</b>	
Banca Popolare Pugliese	Chief risk officer (dal 2002)
<b>ESPERIENZE PRECEDENTI</b>	
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)
<b>ALTRE ATTIVITA'</b>	
Consulenza	<p>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.</p> <p>Consulenza tecnica indipendente alla magistratura per la valutazione di strumenti finanziari complessi e strumenti derivati.</p>
Docenza	<p>Professore a contratto di Metodi Matematici per il Risk Management, Laurea Magistrale in Matematica, Università del Salento - Dipartimento di Matematica e Fisica.</p> <p>Docente ABI-Formazione</p> <p>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)</p> <p>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.</p> <p>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.</p>
<b>PUBBLICAZIONI</b>	
	<p><i>"Il pricing degli strumenti esposti al rischio di credito", Bancaria, nr. 1, 2020</i></p> <p><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></p> <p><i>"La solvibilità delle banche valutata attraverso un approccio à la Merton", Bancaria, n.4, 2018.</i></p> <p><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></p>

*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

---