

**FORMATO EUROPEO
PER IL CURRICULUM
VITAE**



INFORMAZIONI PERSONALI

Nome
Nazionalità

LETIZIA ALDO

ESPERIENZA LAVORATIVA

- Date (da – a) dal 2002

• Nome e indirizzo del datore di lavoro Banca Popolare Pugliese

 - Tipo di azienda o settore Credito
 - Tipo di impiego Dirigente

• Principali mansioni e responsabilità Responsabile Funzione Risk Management

- Date (da – a) dal 1998 al 2001

• Nome e indirizzo del datore di lavoro Banca Popolare Pugliese

 - Tipo di azienda o settore Credito
 - Tipo di impiego Quadro direttivo

• Principali mansioni e responsabilità Responsabile Servizio di Private Banking

- Date (da – a) dal 1992 al 1997

• Nome e indirizzo del datore di lavoro Banca Popolare Pugliese

 - Tipo di azienda o settore Credito
 - Tipo di impiego Quadro direttivo

• Principali mansioni e responsabilità Responsabile Funzione Asset Management

- Date (da – a) dal 2013 ad oggi

• Nome e indirizzo del datore di lavoro ABI - FORMAZIONE

 - Tipo di azienda o settore Istituto di formazione dell'Associazione Bancaria Italiana
 - Tipo di impiego Docente

- Date (da – a) dal 2014

• Nome e indirizzo del datore di lavoro Università degli Studi di Roma "La Sapienza"

 - Tipo di azienda o settore Università
 - Tipo di impiego Docente al Master in Banking and Finance

- Date (da – a) a.a. 2012-2013

• Nome e indirizzo del datore di lavoro Dipartimento di Matematica e Fisica dell'Università del Salento

 - Tipo di azienda o settore Università
 - Tipo di impiego Docente di "Modelli per la valutazione degli strumenti finanziari complessi"

- Date (da – a) dal 2018 al 2022

• Nome e indirizzo del datore di lavoro Dipartimento di Matematica e Fisica dell'Università del Salento

 - Tipo di azienda o settore Università
 - Tipo di impiego Professore a contratto di "Metodi matematici per il risk management"

- Date (da – a) dal 2016

• Nome e indirizzo del datore di lavoro Vari

 - Tipo di azienda o settore Banche e società di informatica

- Tipo di impiego Consulenza per lo sviluppo di modelli per la misurazione del rischio di mercato e per la valutazione dei crediti.
- Date (da – a) dal 2023
- Nome e indirizzo del datore di lavoro MetricsLab srl
- Tipo di azienda o settore Ricerca e sviluppo di modelli matematici per il risk management
- Tipo di impiego Amministratore Unico

ISTRUZIONE E FORMAZIONE

- Istituto di istruzione o formazione Università degli Studi di Siena
- Principali materie Scienze Economiche e Bancarie
- Qualifica conseguita Laurea in Scienze Economiche e Bancarie

PUBBLICAZIONI SCIENTIFICHE

- Articolo Il pricing degli strumenti esposti al rischio di credito, Bancaria, nr. 1, 2020
- Articolo Evoluzione del framework di Credit Risk Management in banca tra IFRS 9 e Basilea 3, Bancaria, nr. 10, 2018
- Articolo La solvibilità delle banche valutata attraverso un approccio à la Merton, Bancaria, n.4, 2018
- Working paper A stochastic approach to the measurement of interest rate in the banking book, 2017, <https://ssrn.com/abstract=3059537>
- Contributo. 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
- Articolo La verifica del monitoraggio del credito in ambito risk management: aggravio di costi o leva per la creazione di valore, Bancaria, n.12, 2013
- Articolo La gestione della liquidità nelle banche: un esame della materia oltre il filtro della normativa attuale, Newsletter AIFIRM, 2012.
- Working paper Credit Spread Risk and its Effects on Banks' Economic Capital, <http://ssrn.com/abstract=1800584>, 2011.
- Articolo 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>).
- Contributo 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
- Working paper Credit spread widening risk in portfolios: pricing techniques and sensitivity measures, <http://ssrn.com/abstract=1088965>, 2008.

CONSENSO AL TRATTAMENTO DEI DATI PERSONALI

Autorizzo il trattamento dei miei dati personali ai sensi del Dlgs 196 del 30 giugno 2003 e dell'art. 13 GDPR (Regolamento UE 2016/679)

Gallipoli 27/09/2023