

CV

Profile

Job Title: 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)

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*.

Professional Experiences

Period: 07/2020 – today

Company: Reply Advantage

Position held: Senior Manager

Project title:

Validazione Modelli Pricing

Customer:

Istituzione bancaria italiana (Tier 3)

Project goals:

Validazione dei modelli di pricing di strumenti finanziari sulla base delle linee guida della BCE e del framework dell'ufficio di convalida della banca

Description:

Supporto nella stesura dei report di validazione ed esecuzione della seguente **check list**:

1. Analisi dei dati di input e procedure di calibrazione
2. Analisi e verifica del modello teorico di pricing
3. Verifica adeguatezza del modello adottato
4. Benchmarking del modello di pricing
5. Repricing

Period: 06/2020 – today

Company: Reply Advantage

Position held: Senior Manager

Project title:

FRTB – Studio di fattibilità

Customer:

Istituzione bancaria italiana (Tier 2)

Project goals:

Definizione del modello di risk management e della soluzione applicativa target

Description:

Supporto nella stesura di un'analisi di fattibilità finalizzata a:

1. Definire il modello di *risk management target* (sia regolamentare che gestionale)
2. Analizzare gli impatti di business e dei sistemi informativi
3. Effettuare una *gap analysis* tra i requisiti target e l'as-is
4. Svolgere un'analisi di scenario per la definizione della soluzione applicativa target

Period: 01/2017 – today

Company: Reply Advantage

Position held: Senior Manager

Project title:

Implementazione FRTB

Customer:

Istituzione bancaria italiana (Tier 1)

Project goals:

Implementazione del nuovo framework FRTB per l'operatività di FO e di Risk Management

Description:

Supporto nell'implementazione del nuovo standard FRTB in termini di:

1. Processi e policy
2. Modelli di calcolo (IMA e Standard)
3. Processo giornaliero di P&L attribution
4. Sviluppo applicazione software per il front office

Period: 09/2017 – 02/2019

Company: Reply Avantage

Position held: Manager

Project title:

Progetto Drive

Customer:

Primaria istituzione bancaria italiana (Tier 1)

Project goals:

Realizzazione di una JV tra l'istituzione bancaria ed una primaria istituzione finanziaria mondiale finalizzata a commercializzare su scala mondiale un software di proprietà della banca

Description:

Supporto di *project governance* strutturato nei seguenti *stream* progettuali

1. **Transaction structuring:** strutturazione del deal con la controparte
2. **Service Model:** definizione del modello di servizio della nuova *legal entity JV*
3. **Go To Market Strategy:** predisposizione della strategia di marketing e di mercato della nuova JV per la commercializzazione del prodotto
4. **Legal & Tax:** definizione di tutta la contrattualistica, incorporation della JV, definizione dell'assetto societario ed analisi degli impatti di natura fiscale;
5. **Business plan:** stesura del business plan della JV

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 Avantage

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

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

Technical Skills

Programming Languages

SQL
VBA
Python

Level

Intermediate
Intermediate
Intermediate

Technical Languages

XSD / XML

Level

Advanced

Software

MS Office
Matlab
R
Gretl
Metastock
Murex
Kondor+
Riskwatch
Bloomberg
Ermas

Level

Advanced
Intermediate
Intermediate
Advanced
Intermediate
Advanced
Intermediate
Intermediate
Intermediate
Intermediate

Foreign Languages

English

Written level

Good

Spoken level

Good

Education & Training

Educational Qualification

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

Specializations

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

Firma