

INFORMAZIONI PERSONALI
COGNOME/NOME

Letizia Aldo

OCCUPAZIONE PER LA QUALE
SI CONCORRE

Docenza nell'ambito del Master in Banking and Finance a.a. 2022/2023

POSIZIONE RICOPERTA

Dirigente Banca Popolare Pugliese

TITOLO DI STUDIO

Laurea in Scienze Economiche e Bancarie - Università degli Studi di Siena

ESPERIENZA
PROFESSIONALE

-
- | | |
|------------------|---|
| dal 2002 | Responsabile Funzione Risk Management - Dirigente
Banca Popolare Pugliese – Credito |
| dal 2023 | Amministratore Unico - MetricsLab srl - Ricerca e sviluppo di modelli matematici per il risk management |
| dal 2018 al 2022 | Professore a contratto di “Metodi matematici per il risk management” - Dipartimento di Matematica e Fisica dell'Università del Salento |
| dal 2016 | Consulenza per lo sviluppo di modelli per la misurazione del rischio di mercato e per la valutazione dei crediti – presso vari datori di lavoro – settore banche e società di informatica |
| dal 2014 | Docente al Master in Banking and Finance - Università degli Studi di Roma “La Sapienza” |
| dal 2013 ad oggi | Docente - ABI – FORMAZIONE - Istituto di formazione dell'Associazione Bancaria Italiana |
| a.a. 2012-2013 | Docente di “Modelli per la valutazione degli strumenti finanziari complessi” - Dipartimento di Matematica e Fisica dell'Università del Salento |
| dal 1998 al 2001 | Responsabile Servizio di Private Banking - Banca Popolare Pugliese
Quadro direttivo – Credito |
| dal 1992 al 1997 | Responsabile Funzione Asset Management - Banca Popolare Pugliese
Quadro direttivo – Credito |

ISTRUZIONE E FORMAZIONE

Laurea in Scienze Economiche e Bancarie - Università degli Studi di Siena

ULTERIORI INFORMAZIONI

-
- | | |
|--------------|--|
| Publicazioni | <ul style="list-style-type: none">• Articolo - Il pricing degli strumenti esposti al rischio di credito, <i>Bancaria</i>, nr. 1, 2020• Articolo - La solvibilità delle banche valutata attraverso un approccio à la Merton, |
|--------------|--|

Bancaria, n.4, 2018

- Articolo - Evoluzione del framework di Credit Risk Management in banca tra IFRS 9 e Basilea 3, Bancaria, nr. 10, 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.

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".

Il sottoscritto 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