

## ALDO LETIZIA CV aggiornato a maggio 2019

### DATI ANAGRAFICI

Nome e Cognome	Aldo LETIZIA
Data e luogo di nascita	Matino (Lecce), 9 agosto 1959
Residenza	Corso Italia 96 - Gallipoli (Lecce)
Nazionalità	Italiana
Madre lingua	Italiana
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) 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 Titolare del 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) Titolare 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. Responsabile del ciclo formativo "Modelli per il risk management con Excel e VBA", organizzato da Informa S.r.l. - Milano

### PUBBLICAZIONI

"Evoluzione del framework di Credit Risk Management in banca tra IFRS 9 e Basilea 3", A. Letizia, P. Porretta, *Bancaria*, n.10, 2018

---

*"La solvibilità delle banche valutata attraverso un approccio à la Merton",* Bancaria, n.4, 2018.

---

*"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

---

*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

---