

CV Davide Maspero

1. Nome Cognome

Davide Maspero

Nato a Milano il 12/06/1962

2. Degrees / Formazione

Laurea in Economia politica conseguita nel settembre 1987 – Università Bocconi

Punteggio 110/110 e lode

3. Current employment position / Posizione ricoperta attualmente

Professore associato presso il Dipartimento di Finanza – Università Bocconi

4. Previous employment positions / Esperienze professionali pregresse

Ricercatore presso Università Bocconi

Professore associato presso l'Università del Molise

Professore a contratto presso l'Università del Piemonte Orientale e l'Università di Milano Bicocca

5. Main articles / Principali articoli

"Profilatura del cliente, costruzione dei portafogli e verifica di adeguatezza: sfide ancora aperte", Carluccio, Emanuele; Cucurachi, Paolo; Maspero, Davide; Pomante, Ugo; *Bancaria*, 11/2022

Maspero D. and F. Saita (2005), "Risk Measurement for Asset Managers: A Test of Relative VaR", in *Journal of Asset Management*

"Un confronto tra modelli VaR alternativi su posizioni in valuta durante la crisi del Sistema Monetario Europeo", in A. Sironi, M. Marsella, *La misurazione e la gestione dei rischi di mercato, Bologna*, il Mulino, 1997;

"I modelli VaR basati sulle simulazioni", in A. Sironi, M. Marsella, *La misurazione e la gestione dei rischi di mercato, Bologna*, il Mulino, 1997;

"L'uso degli strumenti derivati nella gestione del rischio di cambio in un portafoglio diversificato per valuta", in *Gli strumenti derivati e le tecniche innovative nella gestione di portafogli obbligazionari*, Ricerca NEWFIN, Milano, 1995;

"Contabilità a valori di mercato e crisi bancarie" in R. Ruozi (a cura di) *Le crisi bancarie*, Milano, EGEA, 1995;

"Il Sistema Monetario Europeo" in C. Demattè e P. de Sury (a cura di), *I mercati finanziari internazionali*, Milano, EGEA, 1992.

6. Working papers/non-published papers

"Investable hedge fund indices: how expensive is liquidity?" Newfin Working Paper, December 2006;

"Measuring ex-ante Relative Risk for Asset Management Portfolios" (con F. Saita), paper presentato al convegno europeo della Financial Management Association, Parigi 2001;

"Risk Management Integration Issues in Large Italian Banks", Working Paper NEWFIN, Milano 2000;

"External assessment of trading activities' market and credit risk", Working Paper Newfin, Milano, 1999;

7. Books / Libri

"L'attività in derivati delle banche: rischi e informazione integrativa di bilancio", Roma, Bancaria, 2000;

"Le applicazioni dell'intelligenza artificiale negli intermediari finanziari" (a cura di, con C. Rossignoli), Roma, Bancaria, 2000

8. Main Bocconi teaching activities / Principali impegni didattici in Bocconi

Corsi tenuti in passato: Economia degli intermediari Finanziari, Strumenti Derivati (quadriennale), Mercati Finanziari Internazionali, Derivatives (Biennio), Portfolio e Risk Management

Corsi insegnati attualmente: Asset Management (opzionale biennio), Derivatives (Mafinrisk)

9. Institutional roles and services in Bocconi / Ruoli istituzionali e di servizio in Bocconi

Ex direttore e ora coordinatore del MAFINRISK – Master of Quantitative Finance and Risk Management

10. Professional activity / Attività professionale

Socio Fondatore di Benchmark and Style srl e VWAP srl, società attive nella consulenza in tema di risparmio gestito, sviluppo di software per gestione di portafoglio, pricing, valutazione e risk management di strumenti derivati.

Consulente tecnico di numerose banche internazionali, tra cui Deutsche Bank, Nomura, Merrill Lynch, JP Morgan, Citibank, UBS in tema di litigation sia civile che penale su tematiche inerenti strumenti derivati.