

**FORMATO EUROPEO
PER IL CURRICULUM
VITAE**



INFORMAZIONI PERSONALI

Nome
Indirizzo
Telefono
E-mail

Nazionalità
Data di nascita

PROTTI PAOLO
VIALE GOLGI 64, 27100 PAVIA
339 5951279
paoloprotti@hotmail.com

Italiana

25/02/1973

ESPERIENZA LAVORATIVA

Financial Risk Management

Marzo 2021-Oggi

Financial Risk Management

- Nome e indirizzo del datore di lavoro
- Tipo di azienda o settore
 - Tipo di impiego
 - Principali mansioni e responsabilità

Eurizon Capital S.g.r., Piazzetta Giordano dell'Amore, 3 20121 Milano.

Società di Gestione del Risparmio

Contratto a tempo indeterminato, Quadro direttivo

Analisi del rischio, backtesting modelli, stress test, pricing titoli e derivati, sviluppo modelli, supporto sviluppo nuovi prodotti.

Giugno 2010-Marzo 2021

Financial Risk Management

- Nome e indirizzo del datore di lavoro
- Tipo di azienda o settore
 - Tipo di impiego
 - Principali mansioni e responsabilità

Ubi Pramerica S.g.r., Via Monte di Pietà, 3 Milano

Società di Gestione del Risparmio

Contratto a tempo indeterminato, Quadro direttivo

Responsabile Sviluppo e Implementazione Piattaforma di Risk Analysis

Analisi del rischio, backtesting modelli, stress test, pricing titoli e derivati, sviluppo modelli, analisi e implementazione normativa UCTS 4.

Membro del gruppo di lavoro Assogestioni, Investment Compliance Rischio e Classificazione UCITS IV.

Dicembre 2002- Giugno 2010

Financial Risk Management

- Nome e indirizzo del datore di lavoro
- Tipo di azienda o settore
 - Tipo di impiego

Eurizon Capital S.g.r., P.za Cadorna 3 Milano

Società di Gestione del Risparmio

Contratto a tempo indeterminato, Quadro direttivo

- Principali mansioni e responsabilità

– Responsabile Definizione e Implementazione modello Stress test e Scenario Analysis per la piattaforma di rischio proprietaria SpiderWeb.

– Responsabile Definizione e Implementazione modello Back testing per la piattaforma di rischio proprietaria SpiderWeb.

– Analisi del rischio dei portafogli della gamma prodotti con particolare focus su absolute return, pricing fondi a formula e prodotti garantiti.

– Pricing di titoli strutturati illiquidi e strumenti derivati.

– Definizione metodologie pricing, profilo di rischio, orizzonte temporale e scenari

probabilistici prodotti della casa (normativa Consob).

- Studio ed implementazione di un modello relativo alla valutazione del rischio di credito in un portafoglio obbligazionario WMCR. I risultati sono stati presentati al convegno Risk Europe, Londra 2003.
- Studio ed implementazione di un modello per l'analisi di scenario ("Shark") volto a verificare l'impatto di shock di fattori macroeconomici esogeni su performance e rischio di portafogli obbligazionari e azionari. I risultati sono stati presentati al convegno "Risk Management nelle società di gestione" organizzato da MF Milano Finanza (2005) e nel convegno annuale Aifirm 2005.
- Studio ed implementazione di un modello per il calcolo del Value at Risk per un portafoglio di tipo absolute return in cui vi sia una marcata presenza di strumenti derivati non lineari;
- Attività di docenza presso la scuola di Alta Formazione in Finanza presso l'Università di Bologna.

Gennaio 2001- Novembre 2002

- Nome e indirizzo del datore di lavoro
- Tipo di azienda o settore
- Tipo di impiego
- Principali mansioni e responsabilità

Analista Quantitativo

F.M.R. Consulting S.r.l., Via Scarabelli 63, Voghera (PV)

Informatico Finanziario

Contratto a tempo indeterminato, Impiegato

- Studio e implementazione di funzioni di pricing per titoli obbligazionari plain vanilla e strutturati.
- Corsi di Formazione alla clientela inerenti finanza matematica e modellistica finanziaria.
- Attività di docenza al corso organizzato da "Il Sole 24 Ore" dal titolo "Costruzione e Valutazione dei Titoli Strutturati";
- Attività di docenza per Trading Lab Banca su tematiche riguardanti la finanza quantitativa.

ISTRUZIONE E FORMAZIONE

- 1998-1999
- Nome e tipo di istituto di istruzione o formazione
- Principali materie / abilità professionali oggetto dello studio

Università degli Studi di Pavia, Facoltà di Economia e Commercio

DIPARTIMENTO DI STATISTICA ED ECONOMIA POLITICA.

Statistica 1 e 2, Statistica Economica, Statistica Bayesiana, Calcolo delle Probabilità, Teoria delle Decisioni e dei Giochi, Econometria, Matematica Finanziaria 1 e 2, Matematica per l'Economia, Metodi e Modelli per le Decisioni Economiche.

Titolo della tesi: "Disegno di esperimenti sequenziali mediante processi d'urna". In tale tesi si sono messi a confronto alcune modalità di assegnazione dei pazienti a diversi trattamenti nell'ambito di test su farmaci, identificando un modello ottimale ed etico di somministrazione dei farmaci nei clinical trials e delle regole di optimal stopping per la sospensione della sperimentazione senza inficiare la bontà delle stime dei risultati dei test.

- Qualifica conseguita
- Votazione

Laurea

110/110 e lode.

1992

Liceo Scientifico T. Taramelli, Pavia

- Qualifica conseguita
- Votazione

Maturità Scientifica

55/60

CAPACITÀ E COMPETENZE PERSONALI

MADRELINGUA

ITALIANA

ALTRE LINGUA

INGLESE

- Capacità di lettura
- Capacità di scrittura
- Capacità di espressione orale

ECCELLENTE

ECCELLENTE

ECCELLENTE

CAPACITÀ E COMPETENZE
RELAZIONALI

SONO NATURALMENTE PORTATO A LAVORARE IN TEAM. QUESTA CAPACITÀ DERIVA ANCHE DA PRECEDENTI ESPERIENZE SPORTIVE COME GIOCATORE, ALLENATORE E DIRIGENTE RESPONSABILE SETTORE BASKET U.S. SANMAURENSE PAVIA E PRESIDENTE ASSOCIAZIONE CULTURALE CAMERAPV.

CAPACITÀ E COMPETENZE
ORGANIZZATIVE

HO CAPACITÀ DI GESTIONE DEL LAVORO SIA IN AUTONOMIA CHE COME ORGANIZZATORE DI TEAM, GESTIONE DI PROGETTO IN GENERE NELLE SUE VARIE DI SVILUPPO (DALLA DEFINIZIONE DEI REQUISITI, ALL'IMPLEMENTAZIONE FINO AL RILASCIO IN PRODUZIONE).

CAPACITÀ E COMPETENZE
TECNICHE

OTTIMA CONOSCENZA DI TUTTI I PACCHETTI MICROSOFT OFFICE, IN PARTICOLARE EXCEL, ACCESS
OTTIMA CONOSCENZA BLOOMBERG (API E INTEGRAZIONE VBA), MATLAB
LINGUAGGI DI PROGRAMMAZIONE: VISUAL BASIC, MATLAB, CENNI DI C++ E C#, SQL
SOLIDA PREPARAZIONE NELL'AMBITO DELLA STATISTICA E FINANZA QUANTITATIVA ED IN PARTICOLARE NEL PRICING ED ANALISI DEL RISCHIO DI TUTTI GLI STRUMENTI DEL REDDITO FISSO
FREQUENZA SEGUENTI CORSI EXECUTIVE:

- 2009: STRESS TEST, ISIDE, GIORNATA DI APPROFONDIMENTO
- 2008: LIQUIDITY RISK, ISIDE, GIORNATA DI APPROFONDIMENTO
- 2007: STRESS TESTING AND SCENARIO ANALYSIS, MARCUS EVANS LONDON
- 2006: VALUTAZIONE DI TITOLI STRUTTURATI, SDA BOCCONI
- 2004: CORSO ABI RISK MANAGEMENT
- 2004: CORSO MICROSOFT ACCESS AVANZATO
- 2003: CORSO MICROSOFT EXCEL VBA
- 2002: CORSO "MOC 1016 MS VISUAL BASIC 6.0 SVILUPPO APPLICAZIONI DISTRIBUITE" PRESSO EF COMPUTER SPA;
- 2001: CORSO "PROGRAMMING IN ANSI C++" PRESSO MONDADORI INFORMATICA;

CAPACITÀ E COMPETENZE
ARTISTICHE

Musica, scrittura, disegno ecc.

DIPLOMA DI TEORIA E SOLFEGGIO CONSEGUITO PRESSO IL CONSERVATORIO "A. VIVALDI" DI ALESSANDRIA .

PIANOFORTE: FREQUENZA CIVICO ISTITUTO MUSICALE "F. VITTADINI" (PAVIA) DALL'1982 AL 1992.

MASTER FOTOGRAFIA, ISTITUTO EUROPEO DI FOTOGRAFIA, FEBBRAIO 2021

INTERERESSI PERSONALI

LETTURA, FOTOFRAFIA, CINEMA, TEATRO, MUSICA, ARTE MODERNA.

DIPLOMA DI ALLIEVO ALLENATORE CONSEGUITO NEL 1994 PRESSO FEDERAZIONE ITALIANA PALLACANESTRO.

Cofondatore e Presidente Associazione CameraPv, associazione volta a promuovere la fotografia in tutte le sue espressioni.

PATENTE O PATENTI

B