

INFORMAZIONI PERSONALI **Simone Ligato**

Sesso Maschio | Data di nascita 13 Agosto 1973 | Nazionalità Italiana

ESPERIENZE LAVORATIVE

Agosto 2017 – Oggi**Chef Risk Officer (Banca di credito P. Azzoaglio S.p.A.)**

Con il ruolo di CRO sono responsabile della definizione, misurazione e gestione dei rischi della Banca riportando regolarmente al Comitato Esecutivo ed al Consiglio di Amministrazione. In questo ruolo sono anche responsabile della conduzione degli stress test e della valutazione di modelli utilizzati all'interno della Banca.

Ottobre 2014 – Luglio 2017**Engineering and pricing office (Banca Carige s.p.a.- Genova)**

Con il ruolo di responsabile del desk "Analysis and pricing" ho avuto la responsabilità della valutazione dei derivati OTC ed degli strumenti strutturati. In questo ruolo sono stato anche responsabile delle analisi di strategie e di reporting sia dal lato finanziario che di risk management che di contabilità (IAS compliance) effettuate per aiutare e supportare le decisioni del direttore della struttura finanza. Sono stato inoltre referente per il progetto IFRS 9 lato finanza ed ho partecipato agli stress test richiesti dalla BCE.

Aprile 2003 – Ottobre 2014**Analista quantitativo finanziario Senior (Banca Carige s.p.a.- Genova)**

Inizialmente ho seguito il processo di valutazione delle obbligazioni, in seguito mi sono occupato del processo di valutazione di derivati e del controllo dei rischi per il dipartimento di finanza ed inoltre ho partecipato al programma di Covered Bond.

In questo ruolo ho collaborato all'organizzazione del progetto relativo alla creazione di un sistema front to back per la gestione e la valutazione di titoli e derivati (Kondor + e KSP - Kondor + Structured Products). All'interno di questo progetto sono stato architectural designer dei templates relativi ai derivati strutturati ed ho collaborato con il team di Reuters allo sviluppo dei modelli di pricing. Al termine del progetto sono stato responsabile dei test relativi alle librerie di valutazione dei derivati sviluppate in house e dei modelli di calcolo del CVA/DVA integrati nel sistema Kondor + / KSP.

Questa attività mi ha permesso di ottenere conoscenze di:

- CVA/DVA
- Mercati finanziari
- Modelli di valutazione finanziari
- Principi contabili
- Budgeting
- Collateral Management
- Processi bancari
- Project Management.

Aprile 2002 – Marzo 2003**Operatore Unico (BCC di Caraglio del cuneese e della Riviera dei Fiori- Caraglio)**

Con il ruolo di operatore unico mi sono occupato di attività di cassa, di vendita dei prodotti bancari e di sviluppo di clientela. Ho ottenuto esperienza e conoscenze in

- Gestione della clientela.
- processi di filiale.

Aprile 2000 – Marzo 2002**Ricercatore (Facoltà di economia e metodi quantitativi dell'università di Genova)**

Con questo ruolo mi sono occupato di ricerche relative all'analisi tecnica dei mercati finanziari ed all'analisi e sperimentazione di indicatori tecnici innovativi

ALTRI INCARICHI

Anno 2018

ESBG (European Savings and Retail Bank Group) (Bruxelles)

- Delegato alle riunioni periodiche del gruppo di lavoro per le tematiche di accounting e di risk management.
- Delegato al meeting presso la Banca Centrale Europea relativamente allo Srep ed all'applicazione dell'IFRS 9 per le banche LSI
- Partecipazione alla task force a livello europeo relativa al Macro Hedge

2016 - 2018

Capitalmonitor S.r.L. (Genova)

Membro del Consiglio di Amministrazione

DOCENZE

Giugno 2017- Giugno 2018

Università di Genova

Relatore all'interno dei corsi:

- "Analisti Finanziari 1". Corso di preparazione per l'ottenimento del diploma internazionale CIIA.
- "Analisti Finanziari 2". Corso di preparazione per l'ottenimento del diploma internazionale CIIA.
- "Risk Management"

Giugno 2016- Giugno 2017

Università di Genova

Relatore al corso di "Analisti Finanziari". Corso di preparazione per l'ottenimento del certificato internazionale CIIA

Febbraio 2017

Confindustria - Genova

Relatore al convegno "I nuovi principi contabili – aspetti pratici e operativi legati alla prima applicazione dei nuovi OIC"

Maggio 2016

ABI (Associazione Bancaria Italiana) - Roma

Relatore al convegno nazionale "IFRS 9 First Time Adoption"

Settembre 2015

Università di Genova

Correlatore alla tesi "Tassi di interesse negativi : effetti sulla valutazione delle opzioni"

Dic 2013 – Dic 2015

Università di Genova

Relatore al corso di "Analisi Tecnica dei mercati finanziari"

Novembre 2010

SDA Bocconi School of Management

Collaborazione con la SDA Bocconi per la quale sono stato relatore all'interno del corso "Prodotti Strutturati: rischio, gestione e valutazione"

EDUCAZIONE FORMAZIONE
CERTIFICATI

Sett 2018- Dic 2018

Corso di specializzazione presso ABI Formazione (Milano)

Percorso Avanzato: L' Integrated Risk Management

Novembre 2014

CIIA

Certificato Internazionale di analista di investimenti

Giugno 2012

Corso di specializzazione presso la Borsa di Milano

"Inflation_Linked Securities" tenuto da by Jeroen Kerkhof, Director VAR Strategies BVBA

- Novembre 2006** **Corso di specializzazione presso la Borsa di Milano**
"Prodotti strutturati e tecniche di Hedging" tenuto da R.Rebonato e F.Mercurio
- Novembre 2005** **Corso di specializzazione presso la SDA Bocconi, Milano**
"Strumenti derivati tradizionali ed innovativi"
- Marzo 2004** **Corso di specializzazione presso Analysis S.p.A.**
"Analisi, controllo e pricing di strumenti derivati, prodotti strutturati e Bond convertibili"
- Aprile 2000** **Università di Genova**
Laurea in Economia (Scienze Bancarie) discutendo una tesi intitolata "Sperimentazione sul campo di sistemi di trading", scritta in collaborazione con la società "EOS software engineering S.r.l." Mondovi (CN).

PUBBLICAZIONI

- Novembre 2018** **International Journal of Financial Engineering (Vol.5 ,n°4)**
"Combining robust Dynamic Neural Networks with traditional technical indicators for generating mechanic trading signals" - Autori: P.G.Giribone, S. Ligato, F.Penone
- Marzo 2017** **International Journal of Financial Engineering (Vol.4 ,n°1)**
"The effects of negative interest rates on the estimation of option sensitivities: the impact of switching from a log-normal to a normal model" - Autori: P.G.Giribone, S. Ligato, M. Mulas
- Settembre 2016** **AIFIRM Magazine - (Associazione Italiana Financial Industry Risk Managers) (Vol.11 ,n°3)**
"Implementazione della Fuzzy Logic per la gestione ottimale del portafoglio: la modellizzazione dell'avversione al rischio di un investitore attraverso tecniche di soft-computing" – Autori: P. G.Giribone, O. Caligaris, S. Fioribello, S. Ligato
- Agosto 2016** **International Journal of Financial Engineering (Vol.3 ,n°2)**
"Flexible-Forward pricing through Leisen-Reimer trees: implementation and performance comparison with traditional Markov chains" - Autori: P.G.Giribone, S. Ligato
- Giugno 2016** **AIFIRM Magazine - (Associazione Italiana Financial Industry Risk Managers) (Vol.11 ,n°2)**
"Progettazione di una calibrazione robusta per l'albero stocastico di Hull-White mediante l'implementazione di euristiche globali di ricerca" – Autori: P. G. Giribone, S. Fioribello, S. Ligato
- Giugno 2016** **AIAF Rivista Online (Associazione Italiana degli Analisti Finanziari) – 2016, n° 99**
Considerazioni sullo stato attuale della valorizzazione delle opzioni cap e floor aventi come parametro di riferimento il tasso EURIBOR" - Autori: P.G.Giribone, S. Ligato
- Giugno 2015** **AIFIRM Magazine - (Associazione Italiana Financial Industry Risk Managers) (Vol.10 ,n°2)**
"Applicazione delle reti neurali feed-forward per la ricostruzione di superfici di volatilità" – Autori: P. G. Giribone, S. Ligato, O. Caligaris
- Maggio 2015** **International Journal of Financial Engineering (Vol.2, n°2)**
"Option pricing via Radial Basis Functions: Performance comparison with traditional numerical integration scheme and parameters choice for a reliable pricing" – Autori: P. G. Giribone, S. Ligato
- Dicembre 2014** **AIFIRM Magazine - (Associazione Italiana Financial Industry Risk Managers) (Vol.9, n°4)**
"Proposta e validazione di una nuova euristica di ottimizzazione applicata alla calibrazione di alberi stocastici sui tassi d'interesse: l'Attraction Force Optimization (AFO)" – Autori: P. G. Giribone, S. Ligato, S. Fioribello
- Novembre 2014** **MATLAB EXPO (Milano) - Conference Proceedings, session: Technical Computing**
"MATLAB in Banca Carige: determinazione del Credit and Debt Valuation Adjustment (CVA/DVA)" – Autori: P. Raviola, P. G. Giribone, S. Ligato

- Giugno 2014** **ASSIOM Forex Journal (The Financial Markets Association)**
 "Studio ed implementazione della metodologia Credit Value Adjustment in un framework di pricing automatico" – Autori: P. G. Giribone, S. Ligato, P. Raviola
- Giugno 2014** **AIFIRM Magazine -Financial Industry Risk Managers Association (Vol.9, n°1)**
 "Progettazione di un controllo affidabile sull'errore commesso dall'introduzione di sequenze a bassa discrepanza in un framework di pricing Monte Carlo" – Autori: P. G. Giribone, S. Ligato
- Luglio 2013** **Mathworks – User Story**
 "Carige Bank integrates a MATLAB based valuation library with its enterprise pricing and risk platform - Case Study" – Autori: P. G. Giribone, S. Ligato, P. Raviola
- Giugno 2013** **AIFIRM Magazine -Financial Industry Risk Managers Association (Vol. 8, n°2)**
 "Metodologie per migliorare la velocità di convergenza nei simulatori Monte Carlo: Analisi delle tecniche ed implementazione in un framework di pricing" – Autori: P. G. Giribone, S. Ligato
- Giugno 2012** **AIFIRM Magazine -Financial Industry Risk Managers Association (Vol.7, n°2)**
 "La correzione del bias di simulazione mediante la tecnica del Monte Carlo condizionato: Analisi ed implementazione in un sistema automatizzato di pricing" - Autori: P. G. Giribone, S. Ligato, S. Ventura
- December 2011** **AIFIRM Magazine -Financial Industry Risk Managers Association (Vol. 6, n°4)**
 "Analisi critica delle metodologie di generazione di matrici di correlazione valide: Teoria e confronti nei sistemi di pricing basati sulla metodologia Monte Carlo" – Autori: P. G. Giribone, S. Ligato
- Dicembre 2010** **CAREFIN Bocconi , Working Paper Series, 2010**
 "Libor Market Model ad un fattore utilizzando le simulazioni montecarlo: un'indagine empirica", Autori: Alonso Pena, A. Di Sabatino, S. Ligato, S. Ventura, A. Bertagna
- Aprile 2000** **Facoltà di Economia e Metodi Quantitativi dell'Università di Genova**
 "Analisi tecnica: strumenti tradizionali e metodi innovativi" edito sulla rivista "Prospettive dell'Economia" Parte 2 Aprile- Giugno 2000, Autore: S. Ligato
- Gennaio 2000** **Facoltà di Economia e Metodi Quantitativi dell'Università di Genova**
 "Analisi tecnica: strumenti tradizionali e metodi innovativi" edito sulla rivista "Prospettive dell'Economia" Parte 1 Gennaio – Marzo 2000. Autore: S. Ligato

COMPETENZE PERSONALI

Prima Lingua Italiano

Altre Lingue

	COMPRESIONE		ESPRESSIONE		SCRITTURA
	Ascolto	Lettura	Interazione	Produzione orale	
Inglese	B2	B2	B2	B2	B2
Francese	A1	A1	A1	A1	

Common European Framework of Reference (CEFR) level

ALTRE COMPETENZE

- Information Technology: Internet and Applications :

Ottima conoscenza :

- Internet network;
- Microsoft Office program suite;

Buona conoscenza in software Finanziari:

- FMR 3000, FMR 4000,
- Monis;
- FinCad;
- NumeriX;
- Kondor + e KSP (suite Misys per la gestione e la valutazione di derivati);
- Matlab;

Ottima conoscenza in Financial Infoproviders:

- Bloomberg Financial System;
- Reuters (Eikon);

- Capacità Comunicative

Attitudine sia al lavoro di squadra che individuale maturata durante le mie esperienze professionali ed ottime capacità di relazione e di comunicazione.

- Competenze Organizzative e Gestionali

Ben organizzato ed orientato al raggiungimento degli obiettivi con una buona inclinazione alla leadership ottenuta durante le mie esperienze lavorative.

Elenco Pubblicazioni Simone Ligato

- Novembre 2018** **International Journal of Financial Engineering (Vol.5 ,n°4)**
"Combining robust Dynamic Neural Networks with traditional technical indicators for generating mechanic trading signals" - Autori: P.G.Giribone, S. Ligato, F.Penone
- Marzo 2017** **International Journal of Financial Engineering (Vol.4 ,n°1)**
"The effects of negative interest rates on the estimation of option sensitivities: the impact of switching from a log-normal to a normal model" - Autori: P.G.Giribone, S. Ligato, M. Mulas
- Settembre 2016** **AIFIRM Magazine - (Associazione Italiana Financial Industry Risk Managers) (Vol.11 ,n°3)**
"Implementazione della Fuzzy Logic per la gestione ottimale del portafoglio: la modellizzazione dell'avversione al rischio di un investitore attraverso tecniche di soft-computing" - Autori: P. G. Giribone, O. Caligaris, S. Fioribello, S. Ligato
- Agosto 2016** **International Journal of Financial Engineering (Vol.3 ,n°2)**
"Flexible-Forward pricing through Leisen-Reimer trees: implementation and performance comparison with traditional Markov chains" - Autori: P.G.Giribone, S. Ligato
- Giugno 2016** **AIFIRM Magazine - (Associazione Italiana Financial Industry Risk Managers) (Vol.11 ,n°2)**
"Progettazione di una calibrazione robusta per l'albero stocastico di Hull-White mediante l'implementazione di euristiche globali di ricerca" - Autori: P. G. Giribone, S. Fioribello, S. Ligato
- Giugno 2016** **AIAF Rivista Online (Associazione Italiana degli Analisti Finanziari) - 2016, n° 99**
Considerazioni sullo stato attuale della valorizzazione delle opzioni cap e floor avanti come parametro di riferimento il tasso EURIBOR" - Autori: P.G.Giribone, S. Ligato
- Giugno 2015** **AIFIRM Magazine - (Associazione Italiana Financial Industry Risk Managers) (Vol.10 ,n°2)**
"Applicazione delle reti neurali feed-forward per la ricostruzione di superfici di volatilità" - Autori: P. G. Giribone, S. Ligato, O. Caligaris
- Maggio 2015** **International Journal of Financial Engineering (Vol.2, n°2)**
"Option pricing via Radial Basis Functions: Performance comparison with traditional numerical integration scheme and parameters choice for a reliable pricing" - Autori: P. G. Giribone, S. Ligato
- Dicembre 2014** **AIFIRM Magazine - (Associazione Italiana Financial Industry Risk Managers) (Vol.9, n°4)**
"Proposta e validazione di una nuova euristica di ottimizzazione applicata alla calibrazione di alberi stocastici sui tassi d'interesse: l'Attraction Force Optimization (AFO)" - Autori: P. G. Giribone, S. Ligato, S. Fioribello
- Novembre 2014** **MATLAB EXPO (Milano) - Conference Proceedings, session: Technical Computing**
"MATLAB in Banca Carige: determinazione del Credit and Debt Valuation Adjustment (CVA/DVA)" - Autori: P. Raviola, P. G. Giribone, S. Ligato
- Giugno 2014** **ASSIOM Forex Journal (The Financial Markets Association)**
"Studio ed implementazione della metodologia Credit Value Adjustment in un framework di pricing automatico" - Autori: P. G. Giribone, S. Ligato, P. Raviola
- Giugno 2014** **AIFIRM Magazine -Financial Industry Risk Managers Association (Vol.9, n°1)**
"Progettazione di un controllo affidabile sull'errore commesso dall'introduzione di sequenze a bassa discrepanza in un framework di pricing Monte Carlo" - Autori: P. G. Giribone, S. Ligato
- Luglio 2013** **Mathworks - User Story**
"Carige Bank integrates a MATLAB based valuation library with its enterprise pricing and risk platform - Case Study" - Autori: P. G. Giribone, S. Ligato, P. Raviola
- Giugno 2013** **AIFIRM Magazine -Financial Industry Risk Managers Association (Vol. 8, n°2)**
"Metodologie per migliorare la velocità di convergenza nei simulatori Monte Carlo: Analisi delle tecniche ed implementazione in un framework di pricing" - Autori: P. G. Giribone, S. Ligato
- Giugno 2012** **AIFIRM Magazine -Financial Industry Risk Managers Association (Vol.7, n°2)**
"La correzione del bias di simulazione mediante la tecnica del Monte Carlo condizionato: Analisi ed implementazione in un sistema automatizzato di pricing" - Autori: P. G. Giribone, S. Ligato, S. Ventura
- December 2011** **AIFIRM Magazine -Financial Industry Risk Managers Association (Vol. 6, n°4)**
"Analisi critica delle metodologie di generazione di matrici di correlazione valide: Teoria e confronti nei sistemi di pricing basati sulla metodologia Monte Carlo" - Autori: P. G. Giribone, S. Ligato
- Dicembre 2010** **CAREFIN Bocconi, Working Paper Series, 2010**
"Libor Market Model ad un fattore utilizzando le simulazioni montecarlo: un'indagine empirica". Autori: Alonso Pena, A. Di Sabatino, S. Ligato, S. Ventura, A. Bertagna
- Aprile 2000** **Facoltà di Economia e Metodi Quantitativi dell'Università di Genova**
"Analisi tecnica: strumenti tradizionali e metodi innovativi" edito sulla rivista "Prospettive dell'Economia" Parte 2 Aprile- Giugno 2000. Autore: S. Ligato
- Gennaio 2000** **Facoltà di Economia e Metodi Quantitativi dell'Università di Genova**
"Analisi tecnica: strumenti tradizionali e metodi innovativi" edito sulla rivista "Prospettive dell'Economia" Parte 1 Gennaio - Marzo 2000. Autore: S. Ligato