

**Walter Vecchiato**  
***CURRICULUM VITAE***

**Occupazione**

- Assunzione in Veneto Banca S.c.p.a.r.l. avvenuta il 01 Settembre 2003 quale Direttore del Servizio Risk Management di Gruppo

Qualifica aziendale: Dirigente

Mansione: Direttore Risk Management

- Assunto in CARIPLO S.p.A. il 12 Novembre 1997 e successivamente presso Banca Intesa fino al 31 Agosto 2003 presso il Servizio Risk Management Piazza P. Ferrari 1 20121 Milano.
- Da Settembre 2001 al 31 Agosto 2003 Responsabile Funzione *Credit Derivatives Analysis* all'interno della Direzione Risk Management di Banca Intesa con funzioni di supporto quantitativo all'attività di trading in derivati di credito svolta dalla Direzione Affari e Finanza prima nella Banca Commerciale Italiana e poi in Banca Intesa.

Ruolo ricoperto di Responsabile Analisi, Monitoraggio e Controllo dell'attività di trading attinente ai derivati di credito (team di cinque collaboratori oltre il sottoscritto) e ai prodotti finanziari strutturati.

**Istruzione**

15 Luglio 1994 - **Laurea** in Scienze Statistiche ed Economiche conseguita presso l'Università degli studi di Padova con votazione 110 / 110 e Lode

Tesi di Laurea in Econometria dei Mercati Finanziari : “*Stima efficiente di un modello a volatilità stocastica con un'applicazione ai tassi di cambio*”

Relatore : Ch. Prof. N. Cappuccio (Professore Associato di Econometria)

1996-97 - **Visiting Researcher** presso University of California at San Diego Dept. of Economics (La Jolla, Ca U.S.A.) per attività di ricerca nell'ambito della modellazione delle

serie storiche finanziarie ad alta frequenza in collaborazione con il prof. R. F. Engle (Professor of Economics Premio Nobel per l'Economia 2003).

Seminari scientifici tenuti presso il Dept. of Economics UCSD, Dept. of Finance University of Alberta, Edmonton Canada, Wells Fargo Bank San Francisco U.S.A e Barclay's Global Investor San Francisco U.S.A. .

*Attività di consulenza in portfolio management e asset allocation con Barclay's Global Investor Pension Funds (Feb.- Ott. 1996).*

22 Maggio 1998 - **Dottore di Ricerca** in Statistica Applicata alle Scienze Economiche e Sociali

Tesi di dottorato: “*Analisi di serie storiche finanziarie ad alta frequenza: problemi, metodi, modelli e applicazioni*”

### **Pubblicazioni recenti**

- Vecchiato W. (1999) “New models for irregularly spaced time series analysis with applications to high frequency financial data” *Proceedings of the VIII° Symposium in Applied Stochastic Models and Data Analysis*
- Meneguzzo D. – Vecchiato W. (2002) “Improvements on Value at Risk Measures by combining conditional autoregressive and extreme value approaches” *Review in International Business and Finance (RIBF)* , April 2002, vol. 16, cap. 12, Elsevier Science Ltd.
- Cazzulani L. – Meneguzzo D. – Vecchiato W. (2001) – “Copulas: a statistical perspective with empirical applications” *Intesa Bank Risk Management Dept. Working paper*
- Ceci V. – Manganelli S. – Vecchiato W. (2002) “Sensitivity Analysis of Volatility: A new tool for Risk Management” Working paper *European Central Bank Research Dept. Frankfurt Germany #194*
- Vecchiato W. (2003) “Italy” Contribution to *European Fixed Income Markets and Their Derivatives*, Eds. Batten J. – Fetherston T. – Szilàgyi P. , J. Wiley & Sons.

- Meneguzzo D. – Vecchiato W. (2004) “Copula Sensitivity in Collateralized Debt Obligations and Basket Default Swaps” *The Journal of Future Markets* January 2004 n°1 : 37-70.
- Cherubini U. – Luciano E. – Vecchiato W. (2004) “Copula Methods in Finance” J. Wiley & Sons, Series in Finance.

### **Esperienze didattiche**

Anno Accademico 1999/2000 – Professore a contratto di Statistica Economica presso l’Università degli studi di Pavia Facoltà di Scienze Politiche

Anni Accademici 2001/2002, 2002/2003, 2003/2004 – Professore a contratto di Matematica Finanziaria presso il Master in Gestione del Rischio in Finanza e Compagnie Assicurative presso l’Università degli studi di Bologna

Anni 2003 e 2004 – Docente in Credit Derivatives presso MA.RISK – Università Bocconi Milano

Settembre 2004 – Docente presso la Summer School of Finance Università degli studi di Bologna

Feb/Mar 2005 e 2006 – Docente di “Financial Market Microstructure” all’Università Ca’ Foscari Venezia (Venice International University – Isola San Servolo Venezia)

Maggio 2005: Docente all’IPE corso in Finanza Avanzata, Napoli sul tema del “Risk Management in Banca”

**Referee** per International Review of Financial Analysis, Risk Magazine, Journal of Business and Finance, JBES, JEF, Wiley and Sons, Elsevier Science.

15 Luglio 2006