

CV Davide Maspero

1. Name and Surname

Davide Maspero

Born in Milan on 12/06/1962

2. Degrees

Degree in Economics (Economia Politica) 1987 – Università Bocconi

Grade 110/110 cum laude

3. Current employment position

Associate Professor in the Department of Finance – Università Bocconi

4. Previous employment positions

Researcher at Università Bocconi

Associate professor at Università del Molise

I also taught courses at Università del Piemonte Orientale and Università di Milano Bicocca

5. Main articles

- 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 Working papers/unpublished papers

- "Investable hedge fund indices: how expensive is liquidity?" Newfin Working Paper, December 2006;
- "Measuring ex-ante Relative Risk for Asset Management Portfolios" (with F. Saita), presented at FMA Paris 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

- "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

Courses taught in the past: Economia degli intermediari Finanziari, Strumenti Derivati, Mercati Finanziari Internazionali, Derivatives, Portfolio and Risk Management

Courses currently taught: Asset Management, Derivatives (Mafinrisk).

9. Institutional roles and services in Bocconi

Former director and current coordinator of MAFINRISK – Master of Quantitative Finance and Risk Management

10. Professional activity

Founding partner of Benchmark and Style srl, a company involved in the design and deployment of asset management tools for portfolio construction and fund selection, in turn partner of Quantalys, a French fintech web company providing financial information and analysis on asset management products.

Technical expert for large international banks, among which Deutsche Bank, Nomura, Merrill Lynch, JP Morgan, Citibank, UBS in derivatives litigation issues (both commercial and criminal).