

Prof. Alessandro Gnoatto PhD

Indirizzo
Università di Verona - Department of Economics
via Cantarane, 24 37129 - Verona

E-mail
alessandro.gnoatto@univr.it
Sito
www.alessandrognoatto.com

Nazionalità
Italian
Data di nascita
04.04.1983

Esperienza lavorativa

-
- 03.2018 - oggi
Deparmento di Scienze Economiche
Settore: educazione superiore
Posizione: Professore Associato

Attività: Corsi "Financial Risk Management" per la laurea magistrale in Banca e Finanza "Matematica Finanziaria" per la laurea in Matematica Applicata.
- 09.2015 - 02.2018
BayernLB
Settore: investment banking
Posizione: assistant vice president - Interest Rate Derivatives Trading and xVA

Attività: calcolo dell'xVA per derivati OTC tramite modelli ibridi con approccio Monte Carlo. Responsabile per la tenuta del sistema di pricing da un punto di vista quantitativo e IT. Studi concettuali e sviluppo iniziale di una libreria proprietaria di pricing nel linguaggio Java.
- 03.2012 - 08.2015
Mathematisches Institut der LMU München
Settore: educazione superiore
Posizione: ricercatore post-doc

Attività: ricerca su modelli avanzati di asset pricing basati su processi affini matriciali. Applicazione alla valutazione di opzioni FX, modelli multi curva per tassi, long-term yield, opzioni su basket, prodotti di volatilità.
- 09.2011 - 02.2012
Prometeia Spa
Settore: consulting
Posizione: junior analyst

Attività: produzione della matrice di varianze e covarianze RiskSize (www.risksize.com) secondo la metodologia Riskmetrics. Sviluppo di un framework di pricing basato sulla FFT per il modello Variance Gamma.
- 03.2008 - 08.2008
Fondiarria-Sai Spa
Settore: assicurazioni
Posizione: stage nel desk front office derivati.

Attività: call overwriting, hedging di partecipazioni azionarie, creazione di posizioni su forward variance swap, analisi di prodotti index-linked, basis trading (CDS), stock lending. Creazione di report sull'attività del desk.