

**PROGRAMMA DEL CORSO DI RISK MANAGEMENT
ANNO ACCADEMICO 2016 - 2017**

PROFESSOR EUGENIO VIRGUTI

VENERDI' 7 APRILE 2017

Ore 15.00 – 18.00

GLI ASPETTI ORGANIZZATIVI DEL RISK MANAGEMENT E LA LORO APPLICAZIONE AL MONDO BANCARIO E DELLE IMPRESE. IL RUOLO DEL CHIEF RISK OFFICER

LUNEDI' 10 APRILE 2017

ORE. 15.00-18.00

IL RISCHIO DI MERCATO: I MODELLI PER LA DETERMINAZIONE DEL REQUISITO PATRIMONIALE A FRONTE DEI RISCHI DI MERCATO

VENERDI' 14 APRILE 2017

ORE 15.00-18.00

IL RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE: APPROCCI PER LA DETERMINAZIONE DEL CAPITALE ECONOMICO

(con la collaborazione di Gianfranco Giordano, di OASI Diagram)

MARTEDI' 18 APRILE 2017

ORE 15.00- 18.00

LE INTERAZIONI TRA RISK MANAGEMENT, CONTROLLO DI GESTIONE E VIGILANZA NELLE AZIENDE BANCARIE . IL RISCHIO OPERATIVO E GLI ALTRI RISCHI DEL SECONDO PILASTRO

VENERDI' 28 APRILE 2017

ORE 08.00-18.00

VISITA ALLA STRUTTURA DI UNA BANCA LOCALE

MARTEDI' 2 MAGGIO 2017

ORE 15:00 – 18:00

LA MITIGAZIONE DEI RISCHI. DETERMINAZIONE DEL PATRIMONIO DI VIGILANZA E DEL CAPITALE ECONOMICO. GLI INDICATORI PATRIMONIALI DI RISCHIO (CORE TIER I, TIER II, ECC.)

LUNEDI' 8 MAGGIO 2017

ORE 15:00 – 17:00

ESERCITAZIONE FINALE

PROGRAMMA:

1. I concetti di base del *risk management*.
2. Interazione tra il *risk management* e la misurazione delle performance di una azienda bancaria.
3. Il rischio di credito e di controparte. Definizione e aspetti operativi.
4. Il rischio di mercato. Gli strumenti per la determinazione dei rischi degli strumenti finanziari. Aspetti teorici e pratici.
5. Il rischio operativo e gli altri rischi aziendali.
6. L'evoluzione della normativa di Basilea. I requisiti patrimoniali e la determinazione del patrimonio di vigilanza. Gli indicatori patrimoniali corretti per il rischio.
7. Il resoconto ICAAP: modalità di elaborazione e significato. La normativa prudenziale di Banca d'Italia: aspetti teorici e operativi.

NOTA BENE: Eventuali variazioni al programma saranno comunicate agli studenti durante il corso.