

Corso sulla Misurazione e Gestione dei Rischi Finanziari

Relatore: Dott.sa Francesca Pucci

Programma delle lezioni

LEZIONE	DATA	ARGOMENTO	MATERIALE DI RIFERIMENTO
1	Mercoledì 27/02/2019	Presentazione del corso	
2	Lunedì 4/03/2019	Scenario e contesto di riferimento	Slide
3	Mercoledì 6/03/2019	I rischi caratteristici dell'attività bancaria e il ruolo del capitale.	Slide
4	Lunedì 11/03/2019	Il rischio di interesse - Repricing / Duration Gap	Slide + "Resti - Sironi" capitoli 1 e 2
5	Lunedì 18/03/2019	Seminario - "La gestione del rischio di tasso di interesse (ALM) nell'ambito dell'evoluzione del mercato bancario" Relatore Dott. Giuseppe Leombroni - UBI Banca	
6	Mercoledì 20/03/2019	Il rischio di interesse - Duration, Cash Flow Mapping.	Slide + "Resti - Sironi" capitoli 1 e 2
7	Lunedì 25/03/2019	Il rischio di interesse - TIT, esercitazione.	Slide + "Resti - Sironi" capitoli 1 e 2
8	Mercoledì 27/03/2019	Il Rischio di liquidità: Funding e Liquidity Risk	Slide + "Resti - Sironi" capitolo 5
9	Lunedì 01/04/2019	Il Rischio di Credito: introduzione, scenario, definizione	Slide
10	Mercoledì 03/04/2019	Il Rischio di Credito: i modelli di scoring e i modelli fondati sul mercato dei capitali	Slide + "Resti - Sironi" capitoli 11 e 12
11	Lunedì 08/04/2019	Seminario - "Servizi di investimento e prodotti finanziari: regole di comportamento per gli intermediari". Relatore Dott. Avv. Lorenzo Macchia - Studio legale Zitiello e Associati - Milano.	
12	Lunedì 08/04/2019	Esercitazione - Il Rischio di credito: l'affidamento bancario dal punto di vista della banca.	Slide
13	Mercoledì 10/04/2019	Il Rischio di Credito : le componenti - LGD, EAD, PD, M, perdita inattesa	Slide + "Resti - Sironi" capitolo 13
14	Lunedì 15/04/2019	Il Rischio di Credito : i sistemi di rating e i modelli di portafoglio. Il rating nel Gruppo ISP	Slide + "Resti - Sironi" capitoli 14 e 15
15	Mercoledì 17/04/2019	Il Rischio di Mercato: parte prima	Slide + "Resti - Sironi" capitoli 6, 7 e 8
16	Lunedì 06/05/2019	Il Rischio di Mercato: parte seconda	Slide + "Resti - Sironi" capitoli 9 e 10
17	Mercoledì 08/05/2019	Seminario - "Il sistema dei controlli dell'impresa bancaria" Relatore Dott. Prof. Ermando Bozza - Studio Bozza & Associati - Lanciano (CH).	
18	Mercoledì 08/05/2019	Il Rischio di Mercato: parte terza	Slide + "Resti - Sironi" capitoli 9 e 10
19	Lunedì 13/05/2019	Il Rischio Operativo: definizione, misurazione, gestione.	Slide + "Resti - Sironi" capitolo 18
20	Mercoledì 15/05/2019	Il Rischio Operativo: i principi del Comitato di Basilea.	Slide + "Resti - Sironi" capitolo 18
21	Lunedì 20/05/2019	Seminario - "La Vigilanza della Banca d'Italia nella gestione dei rischi bancari: il controllo prudenziale tramite l'ICAAP". Relatore Dott. Giuseppe Leombroni - UBI Banca	
22	Lunedì 20/05/2019	La regolamentazione sul capitale delle banche : Parte I	Slide + "Resti - Sironi" capitoli 19 e 21
23	Mercoledì 22/05/2019	La regolamentazione sul capitale delle banche: Parte II	Slide + "Resti - Sironi" capitoli 19, 21, 23 + lettura di approfondimento
24	Lunedì 27/05/2019	Conclusioni del corso	