

A.A.2013-2014
Corso di studio
Compliance e Gestione dei Rischi
Docente: Carlo Arlotta

CFU	SSD	Lezioni (ore)	Esercitazioni (ore)	Laboratorio (ore)	[inserire voce: es. attività di campo; seminari; uscite;...] (ore)	Anno	Lingua
6	SECS- P/11	40				I	italiano

Obiettivi dell'insegnamento e risultati di apprendimento attesi

Il corso si propone di far acquisire allo studente le competenze fondamentali in tema di gestione dei rischi aziendali, nell'ottica di metodologie e *practise* di gestione sviluppate essenzialmente dagli intermediari finanziari e dalle imprese industriali. Nell'ambito dei cambiamenti di regolamentazione, che interessano soprattutto gli intermediari, ed in considerazione della maggiore consapevolezza sviluppata anche dalle imprese industriali nell'ambito delle tematiche di gestione integrata dei rischi, il corso intende approfondire alcune metodologie di individuazione, analisi, valutazione, gestione, monitoraggio e *reporting* dei rischi d'impresa, analizzando modelli di *enterprise risk management* nella gestione dei rischi strategici, puri, finanziari ed operativi. In particolare, durante il corso saranno approfonditi essenzialmente alcuni aspetti e modelli operativi di gestione dei rischi di credito, dei rischi di mercato e dei rischi operativi.

Prerequisiti

Non previsti

Contenuti e programma del corso

1. Scenario di riferimento
2. Definizione e classificazione dei rischi.
3. Il modello integrato di gestione dei rischi: dal *risk management all'enterprise risk management*.
4. Il modello di organizzazione, gestione e controllo dei rischi ai sensi del D.Lgs 231/2001.
5. Il sistema di controllo interno, la gestione dei rischi ed il *risk assessment*.
6. L'applicazione di metodologie di gestione dei rischi di credito.
7. I modelli applicativi per la gestione dei rischi di mercato.
8. La gestione dei rischi operativi.
9. La mitigazione dei rischi: i modelli di gestione e gli strumenti derivati.
10. Gli effetti dell'applicazione dei principi contabili internazionali nel reporting dei rischi finanziari.
11. Evoluzione e sviluppo di nuovi modelli di *risk management*.

Tipologia delle attività didattiche

Le lezioni saranno affiancate da esercitazioni e incontri seminariali con docenti universitari ed operatori, riguardanti parti specifiche del programma del corso. Nel corso delle lezioni, delle esercitazioni e dei seminari verrà messo a disposizione degli studenti frequentanti materiale didattico di supporto utile ai fini della preparazione dell'esame, anche se non sostitutivo dei testi indicati nel programma di esame.

Testi e materiale didattico

Il docente segnalerà nel corso delle lezioni e mediante avvisi le “*Lecture scelte*” utili ai fini del sostenimento dell’esame.

Modalità di verifica dell’apprendimento

L’esame consiste in una prova scritta.

Orario di ricevimento

giorno di lezione dalle 13 alle 13,30

Indirizzo di posta elettronica ed altri recapiti:

carlo.arlotta@fastwebnet.it e pagina web: <http://eco.uninsubria.it/webdocenti/carlotta/>

Calendario delle attività didattiche

http://www3.uninsubria.it/pls/uninsubria/consultazione.mostra_pagina?id_pagina=6606

Appelli d'esame

http://www3.uninsubria.it/pls/uninsubria/consultazione.mostra_pagina?id_pagina=6605

A.A.2013-2014
Bachelor Degree- Master Degree
Compliance and risk management

Lecturer: Carlo Arlotta

CFU/ Credits	SSD Subje ct Code	Lectures (hours)	Tutorials (hours)	Lab (hours)	Seminars (hours)	Year	Teaching Language
6	SECS- P/11	40				I	italiano

Goals and Learning outcomes

The course has the aim to give to the students the fundamentals competence on risk management and related practise and methodologies applicable both to banks and in particular to corporate. In accordance with the evolution of law and regulation applicable to banks, also the corporate industry has started to develop more awareness on integrated risk management framework. In particular, the course intend to analyze for corporate industry mythologies regarding the definition, classification, measurement evaluation, management and control of risks, also with specific reference to the implementation of enterprise risk management framework, and in particular of strategic, operational financial and insurance risk. The course will analyse in a specific way some aspects and operative model of credit, market and operational risks.

Prerequisites

Not applicable

Course Content

1. Description of the Framework scenario
2. Definition and classification of risks
3. The integrated framework: from risk management to Enterprise Risk Management
4. The organizational, management and control model of risks ex D.Lgs 231/2001.
5. Internal control system, risk management and *risk assessment*.
6. The application methodologies on credit risk management
7. Market risk model
8. Operative risk framework.
9. Mitigation of risks: risk management and derivative instruments
10. The application of International financial accounting principle and the reporting on financial risks and instruments.
11. Evolution of *risk management*.

Mode of Delivery

Lessons will be delivered also with some hours of tutorial and seminars made by experts and specialist in the matter of risk management. Books and articles will be distributed by the teacher and the experts during the lessons, tutorials and seminars.

Recommended reading list (Bibliography)

Books and articles will be distributed by the teacher during the lessons.

Assessment

Written examination.

Office hours

During the lesson day from 13 to 13,30.

Mail and web address

carlo.arlotta@fastwebnet.it and webpage: <http://eco.uninsubria.it/webdocenti/carlotta/>

Academic Timetable

http://www3.uninsubria.it/pls/uninsubria/consultazione.mostra_pagina?id_pagina=6606

Exam sessions

http://www3.uninsubria.it/pls/uninsubria/consultazione.mostra_pagina?id_pagina=6605