

A.A.2014-2015
Corso di Laurea Magistrale in Economia , Diritto e Finanza di Impresa
CLEDIFI (L-77)
Finanza, Mercati e Intermediari Finanziari
Modelli di Risk Management
ECO0122

[Giovanna Redaelli](#)

CFU	SSD	Lezioni (ore)	Anno	Lingua
6	SEC-S/06	40	1/2	Italiano

Obiettivi dell'insegnamento e risultati di apprendimento attesi

Obiettivo del corso è acquisire le conoscenze metodologiche e gli strumenti quantitativi per il Financial Risk Management. Si approfondiranno le tematiche relative alla governance dei rischi, alla misurazione dell'esposizione ai rischi, la definizione della Risk Tolerance in linea con la regolamentazione del settore bancario e assicurativo.

Prerequisiti

Specificare ove richiesti

Contenuti e programma del corso

1. La gestione del rischio finanziario :
 - a. Il processo di risk management;
 - b. La governance del rischio negli intermediari bancari e assicurativi.

2. Il rischio finanziario:
 - a. Definizione e identificazione dei rischi finanziari;
 - b. Strumenti e modelli di misurazione dei rischi finanziari.

3. Il profilo di rischio:
 - a. Definizione e calcolo del profilo di rischio;
 - b. Definizione e calcolo della Risk Tolerance;
 - c. Impatti sulla gestione finanziaria.

Tipologia delle attività didattiche

Lezioni frontali di illustrazione della teoria, applicazioni pratiche / case studies eventualmente in laboratorio di informatica.

Testi e materiale didattico

- John Hull, Opzioni Futures e Altri Derivati, Pearson Prentice Hall
- EIOPA, Solvency II
- Dispense ed articoli indicati dal docente e a disposizione sul sito del docente

Modalità di verifica dell'apprendimento

Elaborazione e discussione di una tesina predisposta dagli studenti sulla base di case studies forniti dalla Docente.

Orario di ricevimento

Il ricevimento studenti si svolgerà con frequenza settimanale presso l'ufficio del docente, negli orari indicati sulla pagina web del docente e sul sito dell'Università.

A.Y. 2014/2015
Master Degree in Economia, Diritto e Finanza d'Impresa
(Economics, Law and Corporate Finance)

Risk Management
ECO0122

[Giovanna Redaelli](#)

CFU/ Credits	SSD Subject Code	Lectures (hours)	Year	Teaching Language
6	SEC-s/06	40	1/2	Italian

Goals and Learning outcomes

The course aims at providing the methodological knowledges and technical skills for Financial Risk Management. The main topics relative to risk governance, measurement, management and control of financial risks will be dealt with; definition of risk tolerance in line with banking and insurance supervisory rules and its impact on risk governance will be described and dealt.

Prerequisites

Specificare ove richiesti

Course Content

1. Financial risk management:
 - a. Risk management process;
 - b. Risk governance in banking and insurance intermediaries.

2. Financial Risks:
 - a. Definition and identification of financial risks;
 - b. Modeling and measurements of financial risks.

3. Risk Profile:
 - a. Definition and measurement of risk profile;
 - b. Definition and measurement of Risk Tolerance;
 - c. Impact on portfolio management.

Mode of Delivery

Frontal lessons.

Recommended reading list (Bibliography)

- John Hull, Opzioni Futures e Altri Derivati, Pearson Prentice Hall
- EIOPA, Solvency II, Papers from the web site
- Papers suggested by the teacher and available on the website of the teacher

Assessment

Drafting and discussion of a written thesis on some case studies provided by the teacher, aiming at verifying the degree of knowledge of the topics dealt in the course.