

FACOLTÀ	ECONOMIA
ANNO ACCADEMICO	2014-2015
CORSO DI LAUREA (o LAUREA MAGISTRALE)	SCIENZE ECONOMICHE E FINANZIARIE (CLASSE LM/56)
INSEGNAMENTO	RISK MANAGEMENT
TIPO DI ATTIVITÀ	CARATTERIZZANTE
AMBITO DISCIPLINARE	SCIENZE ECONOMICHE
CODICE INSEGNAMENTO	
ARTICOLAZIONE IN MODULI	NO
NUMERO MODULI	
SETTORI SCIENTIFICO DISCIPLINARI	SECS-P/11
DOCENTE RESPONSABILE (MODULO 1)	ENZO SCANNELLA RICERCATORE Università degli Studi di Palermo
DOCENTE COINVOLTO (MODULO 2)	Nome e Cognome Qualifica Università di appartenenza
DOCENTE COINVOLTO (MODULO 3)	Nome e Cognome Qualifica Università di appartenenza
CFU	6
NUMERO DI ORE RISERVATE ALLO STUDIO PERSONALE	150
NUMERO DI ORE RISERVATE ALLE ATTIVITÀ DIDATTICHE ASSISTITE	24 ore lezioni 12 ore esercitazioni
PROPEDEUTICITÀ	
ANNO DI CORSO	SECONDO
SEDE DI SVOLGIMENTO DELLE LEZIONI	Aula Seminari – Edificio n.19
ORGANIZZAZIONE DELLA DIDATTICA	Lezioni frontali, Esercitazioni in aula.
MODALITÀ DI FREQUENZA	Facoltativa
METODI DI VALUTAZIONE	Prova scritta
TIPO DI VALUTAZIONE	Voto in trentesimi.
PERIODO DELLE LEZIONI	Secondo semestre.
CALENDARIO DELLE ATTIVITÀ DIDATTICHE	Martedì 17-19; Giovedì 15-17
ORARIO DI RICEVIMENTO DEGLI STUDENTI	Martedì, 9.00-13.00

<p>RISULTATI DI APPRENDIMENTO ATTESI</p> <p>Conoscenza e capacità di comprensione Acquisizione delle conoscenze e competenze di <i>risk management</i> nell'economia degli intermediari finanziari, con particolare riguardo alla comprensione delle metodologie e degli strumenti con i quali gli intermediari finanziari misurano, valutano e gestiscono i rischi di mercato, di credito e operativo.</p> <p>Capacità di applicare conoscenza e comprensione Capacità di applicare conoscenza e comprensione nel risolvere problemi connessi alle scelte di gestione dei rischi finanziari propri delle banche e delle altre istituzioni finanziarie.</p>
--

Autonomia di giudizio

Capacità di integrare le conoscenze acquisite sul funzionamento e valutazione degli strumenti di misurazione e gestione dei rischi, sulle principali strategie attuabili con gli strumenti di gestione dei rischi e sulla gestione integrata dei rischi nell'economia degli intermediari finanziari.

Abilità comunicative

Capacità di esporre i risultati degli studi sul risk management delle istituzioni finanziarie anche ad un pubblico non esperto. Essere in grado di sostenere l'importanza della misurazione e gestione integrata dei rischi finanziari, della valutazione e funzionamento dei principali strumenti di gestione dei rischi, nonché il ruolo della regolamentazione nelle scelte di gestione dei rischi.

Capacità d'apprendimento

Capacità d'apprendimento per studiare in modo autonomo o auto-diretto le metodologie di misurazione e di gestione dei rischi finanziari, di valutazione degli strumenti finanziari di gestione dei rischi, di formulazione di strategie per la gestione integrata dei rischi. Capacità di seguire seminari di approfondimento, master di secondo livello e corsi di dottorato.

OBIETTIVI FORMATIVI DEL MODULO

Obiettivo del modulo è approfondire le principali tematiche di *risk management* nell'economia degli intermediari finanziari, con particolare riguardo alla comprensione delle metodologie e degli strumenti con le quali gli intermediari finanziari misurano, valutano e gestiscono i rischi di mercato, di credito e operativo.

Le singole tematiche sono proposte con l'intento di fornire un approccio metodologico di analisi, utile allo studente per apprendere i fondamenti delle scelte di risk management, in una prospettiva di crescente innovazione finanziaria e di rapidi cambiamenti del contesto istituzionale e competitivo.

Saranno studiate l'articolazione dei rischi nell'economia degli intermediari finanziari, le problematiche di misurazione dei rischi di mercato, di credito e operativi, il funzionamento e valutazione degli strumenti finanziari derivati, le principali strategie attuabili per la gestione integrata dei rischi, il ruolo della regolamentazione.

MODULO	DENOMINAZIONE DEL MODULO
ORE FRONTALI	LEZIONI FRONTALI
2	I rischi nell'economia delle istituzioni finanziarie
2	Misurazione e valutazione rischi di mercato
4	Misurazione e valutazione rischi di credito
2	Misurazione e valutazione rischi operativi
4	Strumenti di gestione dei rischi
4	Funzionamento e valutazione degli strumenti finanziari derivati
2	Principali strategie attuabili con gli strumenti di gestione dei rischi
4	La regolamentazione finanziaria e i riflessi sul risk management delle istituzioni finanziarie
	ESERCITAZIONI
4	Misurazione e valutazione dei rischi: esercitazione guidata in aula
4	Valutazione strumenti finanziari derivati: esercitazione guidata in aula
4	Strategie di gestione dei rischi finanziari: esercitazione guidata in aula
TESTI CONSIGLIATI	J. HULL, <i>Risk management and financial institutions</i> , Wiley, 2012, capitoli n. 1, 2, 5, 6, 8, 9, 10, 11, 12, 13, 14, 15, 16, 20. Scannella E., <i>La catena del valore dell'intermediazione creditizia nell'economia delle imprese bancarie</i> , Franco Angeli, 2011, capitoli 4, 5. Tutino F., Birindelli G., Ferretti P. (a cura di), <i>Basilea 3. Gli impatti sulle banche</i> , Egea, Milano, 2011, capitoli 1, 12. Tutino F. (a cura di), <i>La gestione della liquidità nella banca</i> , Il Mulino, 2012 (capitoli 1, 2, 3) Materiale didattico ad uso degli studenti fornito durante il corso di lezioni.

