

# RISK MANAGEMENT & ANALYTICS

INTENSIVE PROGRAM

Edizione 2022



# IN BREVE

## **Durata**

27 maggio - 30 luglio 2022

2 mesi

## **Struttura**

- Formula weekend
- 100 ore di lezione (online)
- Stage

## **Docenti**

- Esperti CRIF
- Professionisti qualificati (tra cui Banca d'Italia, THOT, BIDCOMPANY)
- Docenti universitari (tra cui Unibo, Unimc, EDHEC)

# PRESENTAZIONE

L'obiettivo del percorso intensivo in Risk Management & Analytics è di formare professionisti a 360° nella gestione dei rischi degli intermediari finanziari in grado di ideare strategie di gestione dei rischi di mercato, credito e liquidità, orientarsi all'interno della normativa finanziaria e analizzare l'andamento dei mercati finanziari in qualità di esperti.

Ciascun insegnamento prevede una parte teorica e una parte di esplorazione delle possibili applicazioni nell'ambito finanziario-creditizio.

# REQUISITI DI ACCESSO

Il corso è rivolto a laureandi/e e neolaureati/e magistrali in economia, statistica, matematica, ingegneria.

Sono accettate anche altre lauree purché con solide basi quantitative.

Grazie al percorso formativo il candidato si qualificherà come esperto nella misura e gestione dei rischi di mercato, di credito e di liquidità (Risk Manager).

## INSEGNAMENTI

- **ESG & Climate Risk (10 ore)**

Introduzione generale sui criteri ESG e loro applicazione pratica tramite casi studio ed esercitazioni

- **Credit Scoring (10 ore)**

Spiegazione dei principali modelli di credit scoring (regressione logistica, discriminante, alberi di classificazione, ecc.) e loro applicazioni pratiche tramite casi studio ed esercitazioni

- **Financial Econometrics (5 ore)**

Principali modelli econometrici (random walk, return distributions, asset pricing, ecc.) e loro applicazioni pratiche tramite casi studio ed esercitazioni

- **Credit Risk (10 ore)**

Breve introduzione teorica sui modelli di rischio che verrà seguita da una parte pratica e di applicazione tramite casi studio ed esercitazioni

- **Financial Intermediation (10 ore)**

Introduzione teorica sull'intermediazione finanziaria (What, How, Why, schema bilancio banche, identificazione e gestione dei principali rischi per le banche ecc.) e applicazione pratica tramite casi studio ed esercitazioni

- **Financial Regulation (10 ore)**

Introduzione teorica (Bank Recovery & Resolution Directive, regolamentazione bancaria e finanziaria: punti aperti ecc.) seguita da applicazioni pratiche tramite casi studio ed esercitazioni

- **Data Visualization (5 ore)**

Applicazione pratica su Data Analysis e Data Visualization

- **Big Data Analytics: Python (15 ore)**

Applicazione pratica con linguaggio Python, applicazione di sistemi di supervised learning e tecniche di machine learning

- **Programming in SAS (10 ore)**

Applicazione pratica con SAS

- **Programming in R (10 ore)**

Applicazione pratica con R

- **Insurance (5 ore)**

Caso pratico su tema insurance: analisi dei dati in supporto alla gestione dei rischi

# ISCRIZIONE E COSTI

La quota di partecipazione al percorso è 2.000€.

# CALENDARIO

**Inizio lezioni:** 27 maggio 2022

**Le lezioni si svolgeranno il venerdì pomeriggio dalle 13:00 alle 18:00 e sabato mattina dalle 9:00 alle 14:00. Per un totale di 10 ore a weekend.**