Economia finanza e assicurazioni (LM16)

(Lecce - Università degli Studi)

Insegnamento RISK MANAGEMENT

GenCod A002302

Docente titolare Simona COSMA

Insegnamento RISK MANAGEMENT

Anno di corso 1

Insegnamento in inglese RISK MANAGEMENT

Lingua ITALIANO

Settore disciplinare SECS-P/11

Percorso PERCORSO COMUNE

Corso di studi di riferimento Economia finanza e assicurazioni

Tipo corso di studi Laurea Magistrale

Sede Lecce

Crediti 6.0

Periodo Secondo Semestre

Ripartizione oraria Ore Attività frontale: 48.0

Tipo esame Scritto e Orale Congiunti

Per immatricolati nel 2017/2018

Valutazione Voto Finale

Erogato nel 2017/2018

Orario dell'insegnamento https://easyroom.unisalento.it/Orario

BREVE DESCRIZIONE DEL CORSO

Il rischio di interesse del banking book
il rischio di liquidità
il rischio di mercato
il rischio di credito
il rischio operativo
La gestione del capitale
La regolamentazione del capitale

PREREQUISITI

Nessuno

OBIETTIVI FORMATIVI

Il corso mira a fornire le conoscenze quantitative per la misurazione del rischio negli intermediari finanziari e le modalità con cui usare le misure ottenute per finalità di gestione e creazione di valore. Alla fine del corso lo studente saprà leggere in chiave critica l'informativa sul rischio e valutare l'adeguatezza patrimoniale.

METODI DIDATTICI	Il corso adotta un approccio quantitativo che, pur senza comportare eccessivi appesantimenti tecnici, consenta allo studente di comprendere a fondo la logica e i risultati dei diversi modelli grazie a precisi riscontri numerici (e eventualmente grafici) e nel contempo lo alleni al ragionamento quantitativo. Alla didattica frontale vengono associati strumenti didattici interattivi, come sessioni al personal computer, lavori di gruppo e in generale momenti di verifica e partecipazione attiva da parte degli studenti, che li costringano a verificare il proprio grado di comprensione con largo anticipo sull'esame e a darsi un metodo di lavoro "per progetti" che possa essere trasferito con efficacia nel mondo del lavoro. Gli studenti, divisi in gruppi da 4-5 persone analizzano l'adeguatezza patrimoniale di gruppi bancari in base ai requisiti richiesti da Basilea 2 e 3, lo stadio di sviluppo delle tecniche di misurazione e gestione dei rischi, i piani strategici individuati e presentano le loro conclusioni attraverso varie modalità di comunicazione, slides, filmati, ecc. Il corso prevede lo svolgimento di esercitazioni guidate dal docente e homeworks
MODALITA' D'ESAME	Prova scritta
TESTI DI RIFERIMENTO	Sironi A., Resti A., Rischio e valore nelle banche, EGEA, 2008