

Tecniche di loss collection e self assessment per l'analisi dei rischi operativi

Fondamentale Interaziendale

Presentazione

Gli strumenti di loss collection e le tecniche di self assessment sono essenziali per le fasi di individuazione e analisi dei rischi operativi: conoscere e utilizzare tali metodologie è fondamentale per l'Operational risk manager incaricato di presidiare il processo di gestione dei rischi operativi. Il corso può far parte del percorso per formare l'Operational risk manager.

Obiettivi

Il partecipante sarà in grado di:

- ◆ individuare le variabili organizzative e di processo fondamentali per l'organizzazione della funzione di Operational risk management;
- ◆ identificare e utilizzare le tecniche per integrare il processo di misurazione dei rischi operativi con il processo di capital allocation;
- ◆ impostare il processo di loss collection ed effettuare un'analisi dei processi bancari in ottica di self assessment;
- ◆ identificare l'approccio e le tecniche per procedere al calcolo dell'operational VaR.

Target di riferimento

Neo-assunti destinati al ruolo di Operational risk manager. Addetti alla funzione di Controllo dei rischi operativi incaricati del monitoraggio delle posizioni di rischio. Addetti esperti delle funzioni Pianificazione e controllo o Internal audit interessati ad acquisire le metodologie di misurazione e controllo dei rischi operativi.

Prerequisiti

Competenze di base relative alla gestione dei rischi del business bancario e alle caratteristiche fondamentali dei principali rischi bancari.

Metodologia didattica

ESPOSIZIONE DEL DOCENTE		30%
STUDIO DI CASI		30%
ESERCITAZIONI DI GRUPPO E INDIVIDUALI		30%
SCAMBIO DI ESPERIENZE		10%

Durata

2 giorni

Prezzo

€ 1.300,00 + IVA
Iscrizione al percorso per l'Operational risk manager: € 3.500,00 + IVA (4 corsi)

Tecniche di loss collection e self assessment per l'analisi dei rischi operativi

Interaziendale | 2 giorni

Giorno 1

Il rischio operativo: obiettivi, processi, tecniche

- ◆ Aspetti normativi e regolamentari del rischio operativo: modelli di quantificazione previsti da Basilea e criteri di scelta per le banche
- ◆ Lo scaling nella quantificazione del rischio: sound practice e metodi di quantificazione non attuariali
- ◆ Aspetti organizzativi generali della funzione di Operational risk management: obiettivi, mission e processi di lavoro delle attività

Individuazione e analisi dei rischi operativi

- ◆ Self assessment: individuazione e analisi dei rischi operativi
- ◆ Self assessment: un approccio aziendale
- ◆ Integrazione della gestione del rischio operativo nei processi di capital allocation

Giorno 2

Le forme di loss collection

- ◆ Loss collection nell'approccio interbancario DIPO: architettura complessiva, dominio, tracciato record e flussi di ritorno
- ◆ Loss collection aziendali - Studio di casi

I processi di determinazione dell'operational VaR

- ◆ I processi di determinazione del VaR: aspetti statistico-matematici, raccolta e analisi dei dati storici, normalizzazione dei dati, costruzione degli istogrammi
- ◆ Tecniche per il mix dei dati interni ed esterni: scelta delle funzioni di severità e frequenza, aspetti introduttivi
- ◆ Determinazione dell'operational VaR: convoluzione e simulazione Monte Carlo
- ◆ Attività esercitativa sul modello di simulazione Monte Carlo: l'asimmetria informativa tra assicurazioni e banche