

Audit su risk management e processo ICAAP

Approfondimento

Interaziendale

Presentazione

Le banche e i gruppi bancari investono sempre più tempo e risorse nelle attività di gestione dei rischi, sia in ottica di identificazione e valutazione dei differenti rischi sottesi al business, sia in funzione della necessaria verifica dell'adeguatezza di capitale. Pertanto appare ormai irrinunciabile in banca un programma strutturato e sistematico di verifica delle attività di risk management. Il corso, in particolare, considera e definisce le modalità di revisione da parte dell'Internal audit del processo ICAAP di auto-valutazione dell'adeguatezza del capitale interno, che Banca d'Italia richiede alle banche di compiere annualmente a partire dal 2009.

Il partecipante sarà in grado di:

Obiettivi

- ◆ identificare i punti salienti delle fonti normative e regolamentari che introducono l'obbligo o la facoltà di istituzione della funzione Controllo dei rischi (o Risk management);
- ◆ definire, in relazione alla normativa vigente, la missione della funzione Controllo dei rischi e le principali fasi che compongono il processo operativo di gestione dei rischi;
- ◆ descrivere, in ottica del nuovo sistema dei controlli interni, i ruoli e i compiti della funzione Internal audit, nonché i processi di interazione tra le diverse funzioni di controllo;
- ◆ identificare le principali disposizioni regolamentari e di vigilanza relative al processo di valutazione interna dell'adeguatezza di capitale (ICAAP);
- ◆ applicare le metodologie, le tecniche e gli strumenti di analisi di internal auditing maggiormente adatti alla verifica dei processi di gestione del rischio in carico alla funzione Controllo dei rischi, con particolare riferimento al processo ICAAP.

Target di riferimento

Addetti con esperienza destinati allo specifico ruolo di internal auditor delle funzioni di controllo. Addetti di altre aree da inserire nella funzione Internal audit. Addetti che operano nell'ambito del più ampio sistema del monitoraggio e della gestione dei rischi.

Prerequisiti

Competenze di base di internal auditing in banca e conoscenza delle principali caratteristiche delle attività di gestione dei rischi.

Metodologia didattica

ESPOSIZIONE DEL DOCENTE		40%
STUDIO DI CASI		30%
ESERCITAZIONI DI GRUPPO E INDIVIDUALI		20%
SCAMBIO DI ESPERIENZE		10%

Durata

2 giorni

Prezzo

€ 1.300,00 + IVA