



Percorso

## **DATA DRIVEN FAC: DALL'ANALISI DEI DATI ALLE INFORMAZIONI**

---

1° MODULO • 28 e 29 settembre 2021

2° MODULO • 12 e 13 ottobre 2021

---

## PROGRAMMA

1° MODULO • 28 e 29 settembre 2021

### INTRODUZIONE AL DATA MANAGEMENT PER LE FUNZIONI AZIENDALI DI CONTROLLO

#### ▶ Primo giorno • 28 settembre 2021

- ▶ **Perché le FAC hanno bisogno di un approccio Data driven al processo di gestione dei rischi?**
- ▶ **Decisione, rischio, futuro e complessità**
  - Analisi dei dati a supporto del processo di gestione del rischio
  - Modelli di previsione e processo decisionale nella complessità
- ▶ **Data Science: il vocabolario**
  - Definizione del concetto di «dato»
- ▶ **Elementi introduttivi**
  - Rilevazione e analisi dei dati sperimentali
  - Distribuzioni di frequenza
  - Rappresentazioni grafiche
- ▶ **Statistica descrittiva univariata**
  - Indici di posizione: media, moda, mediana
  - Indici di variabilità: varianza e deviazione standard

#### ▶ Secondo giorno • 29 settembre 2021

- ▶ **Gli obiettivi di Data management per le FAC**
  - Il nuovo Operating Model
  - Il Transformation Journey verso le FAC del Futuro
- ▶ **La realizzazione di un progetto Data driven**
  - Gli obiettivi nel breve e lungo termine
  - Gli step progettuali
- ▶ **Use case applicativi**
  - Product Governance
  - Controlli e Reporting
  - Trasparenza e Usura
  - Anti Financial Crime
  - Digital Platform
- ▶ **Come scegliere i dati e dove trovarli**
  - Il ciclo di vita del dato
  - I modelli organizzativi della banca data driven: il framework normativo di riferimento
  - L'ownership del dato: ruoli e responsabilità dal chief data officer al Data owner
  - Il concetto di «Qualità» del dato
  - Metriche di misurazione della qualità dei dati
  - Stato dell'arte in merito all'architettura e ai processi di risk data aggregation
  - Principali tools e processi di data governance (dictionary, controlli, ecc.)
  - Interazione con IT risk e data quality risk

2° MODULO • 12 e 13 ottobre 2021

## INTRODUZIONE AL DATA MANAGEMENT PER LE FUNZIONI AZIENDALI DI CONTROLLO

### ▶ Primo giorno • 12 ottobre 2021

- ▶ **Le competenze matematico-statistiche: i must-have per le funzioni di controllo**
- ▶ **Statistica descrittiva bivariata**
  - Costruzione e interpretazione di tabelle a doppia entrata
  - Misure di dipendenza tra due variabili: connessione e correlazione
  - Regressione lineare
- ▶ **Distribuzioni di probabilità**
  - Definizione di variabile casuale
  - La Distribuzione Normale
- ▶ **Come scegliere un modello di controllo statistico:**
  - Dal Risk Assessment al modello statistico dei controlli
  - Process mining: controllo nel continuo e ricerca delle eccezioni
  - Life-Cycle di un sistema automatico di controllo
- ▶ **La realizzazione di un sistema di KRI data driven**

### ▶ Secondo giorno • 13 ottobre 2021

- ▶ **I dati a uso delle FAC**
- ▶ **La gestione evoluta dei dati: Machine Learning**
  - Obiettivi del Machine Learning
  - Metodi e algoritmi di Classificazione, Clustering, Previsione
  - Il processo di analisi dei dati mediante strumenti di Machine Learning
- ▶ **Strumenti di Intelligenza Artificiale per la gestione evoluta dei dati**
  - Reti Neurali Artificiali
  - Percettroni multistrato: Apprendimento Supervisionato
  - Mappe di Kohonen: Apprendimento Non Supervisionato
- ▶ **Metodi di Classificazione**
  - Classificazione per categorie
  - Individuazione degli «outliers» nella base dati
  - Esercitazione
- ▶ **Metodi di Clustering**
  - Analisi di dati non classificati
  - Individuazione di cluster
  - Esercitazione
- ▶ **Metodi di Previsione**
  - Simulazione di funzioni
  - Serie storiche
  - Esercitazione
- ▶ **Analisi del testo**
  - Principi di analisi del linguaggio naturale
  - Analisi morfologica e verifica delle similitudini
  - Sentiment Analysis