



PERCORSO DATA DRIVEN PER I CONTROLLI INTERNI: DALL'ANALISI DEI DATI ALLE INFORMAZIONI

1° MODULO • 22 e 23 settembre 2020

2° MODULO • 6 e 7 ottobre 2020

PROGRAMMA

▶ 1° MODULO • L'APPROCCIO "DATA DRIVEN" PER LE FUNZIONI AZIENDALI DI CONTROLLO

22 e 23 settembre 2020

- ▶ **Introduzione al percorso**
- ▶ **Perché le FAC hanno bisogno un approccio Data driven al processo di gestione dei rischi?**
- ▶ **Principi di Data driven banking**
 - Perché dato = valore?
 - Decidere nella complessità attraverso i dati
- ▶ **Casi applicativi di Data driven banking tra IA, machine learning, RPA**
- ▶ **I basic della data science per le FAC**
 - Il glossario della banca Data driven
 - Il concetto di "dato"
 - Tipologie di dati
 - La distinzione tra dati qualitativi e dati quantitativi
 - La nozione di big data e di small data
 - Il concetto di "grandezza"
- ▶ **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
- ▶ **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

▶ 2° MODULO • LE CONOSCENZE STATISTICO-MATEMATICHE APPLICATE ALLE ESIGENZE DELLE FUNZIONI DI CONTROLLO

6 e 7 ottobre 2020

▶ Le competenze matematico – statistiche: i must-have per le funzioni di controllo

▶ 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

▶ 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
- Analisi statistiche con Excel

▶ La realizzazione di un sistema di KRI Data driven

▶ 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