Piano formativo

del Corso[*] di Alta Formazione in:

RISK MANAGEMENT & INTERNAL RISK GOVERNANCE PER LE BANCHE

Anno Accademico	2022/2023
Dipartimento	Management
Data Delibera approvazione di attivazione del corso in Dipartimento	03/05/2023
Direttore del Corso	Prof. Fabrizio Santoboni
Numero minimo di ammessi	5
Numero massimo di ammessi	30
Requisiti di ammissione	*Possono partecipare al Corso, senza limitazioni di età e cittadinanza, coloro che sono in possesso di un titolo universitario appartenente ad una delle seguenti classi di laurea:* *DENOMINAZIONE CLASSE DI LAUREA NUMERO CLASSE DI LAUREA* *- Scienze Giuridiche/Giurisprudenza 31+22/S - LMG/01* *- Finanza 19/S - LM-16* *- Modellistica matematico-fisica per l'ingegneria 50/S - LM-44* *- Statistica economica, finanziaria ed attuariale/Scienze statistiche attuariali e finanziarie 91/S - LM-83* *- Statistica per la ricerca sperimentale/Scienze statistiche 92/S/LM-82* *- Ingegneria gestionale 34/S - LM-31*

[*] Art. 1 punto 4 del Regolamento in Materia di Corsi di Master, Corsi di Alta Formazione, Corsi di Formazione, Corsi Intensivi D.R. 915/2018

- per Corso di Alta Formazione (CAF) il corso post - lauream professionalizzante di perfezionamento o approfondimento specialistico istituito in base alla L. 341/1990 art. 6. Vi si accede con la laurea, ha durata inferiore all'anno, consente l'acquisizione di massimo 20 Cfu e alla sua conclusione è rilasciato un attestato di frequenza;
- per Corso di Formazione (CF), il corso di aggiornamento professionale di durata inferiore all'anno che conferisce fino a un massimo di 10 Cfu. Vi si accede anche con il solo diploma di scuola media superiore e alla sua conclusione è rilasciato un attestato di frequenza;
- per Corsi Intensivi Summer/Winter School) i corsi, di norma residenziali, destinati a soggetti in possesso dei requisiti di cui all'art. 29 del presente regolamento, della durata da una a quattro settimane, connotati internazionalmente che conferiscono fino a un massimo di 10 Cfu e si concludono con il rilascio di un attestato di frequenza

	- Statistica per la ricerca sperimentale - Scienze statistiche 92/S - LM-82 *- Scienze dell'economia 64/S - LM-56* *- Scienze economico-aziendali 84/S - LM-77* *- Matematica 45/S - LM-40* *Possono altresì accedere al Corso anche i possessori di una Laurea conseguita in Italia in base al sistema previgente alla riforma universitaria del D.M. 509/99 equiparata ad una delle classi suindicate, come da tabella ministeriale https://www.cun.it/uploads/3852/par_2009_04_23.pdf?v=).* *Possono accedere, altresì, al Corso studenti in possesso di titoli accademici rilasciati da Università straniere, preventivamente riconosciuti equipollenti dal Settore Alta Formazione di Sapienza al solo fine dell'ammissione al corso e/o nell'ambito di accordi inter-universitari di cooperazione e mobilità.*
Obiettivi formativi	Il Corso di Alta Formazione in "Risk Management & Internal Risk Governance per le Banche" è rivolto a professionisti che intendono operare nella finanza dei mercati e nella corporate finance, con un orientamento specialistico alla misurazione e gestione dei rischi finanziari. Coerentemente con la propria finalità, il corso intende sviluppare le seguenti competenze: - conoscere il framework di vigilanza prudenziale in materia di rischi e capitale, la sua evoluzione futura e gli impatti operativi per gli intermediari bancari; - comprendere e misurare le principali tipologie di rischio degli intermediari finanziari (anche cyber risk e misconduct risk); - valutare la suitability dell'internal governance; - comprendere i meccanismi di gestione del capitale e della liquidità, il processo intergrato ICAAP_ILAAP e le logiche di funzionamento dei momenti della supervisione bancaria nell'ambito del MUV (Meccanismo Unico di Vigilanza); - conoscere gli impatti operativi dei rischi finanziari e non finanziari.
Risultati di apprendimento attesi	*Conoscenza e comprensione* *Al termine del Corso i partecipanti avranno una conoscenza teorica e pratica sulle tecniche di misurazione dei rischi associati alla operatività quotidiana di una banca, producendo parametri sintetici di rischio e comprendendone le logiche e le determinanti.* *Capacità di applicare conoscenza e comprensione* *Al termine del Corso i partecipanti saranno in grado di utilizzare concretamente le conoscenze*

	acquisite per una valutazione dell'esposizione al rischio di una banca, per manovrare le leve utili e adottare le azioni opportune per la relativa gestione, quantificando il risultato atteso e le possibili perdite inattese.
Data di inizio delle lezioni	18/09/2023
Calendario didattico	Allegare o linkare
Stage	Non previsto
Modalità di erogazione della didattica	mista
CFU assegnati	8
Docenti Sapienza responsabili degli insegnamenti e relativi curricula brevi (max mezza pagina)	Docenti Sapienza titolari di attività formative nel master: - Prof. Fabrizio SANTOBONI - Prof.ssa Marina BROGI - Prof.ssa Pasqualina PORRETTA - Prof. Valerio PESIC Curriculum Prof. Fabrizio SANTOBONI Attuale posizione accademica presso l'Università degli Studi di Roma 'La Sapienza': • Professore Associato di Economia degli Intermediari Finanziari (SECS-P/11) da gennaio 2018 • Docente di: - Economia e Management delle Imprese di Assicurazione - Economia degli Intermediari Finanziari • Referente del CdS di Scienze Aziendali nell'ambito del Servizio di Tutorato presso la Facoltà di Economia – "Sapienza" - Università di Roma – Da Febbraio 2018 • Membro del Consiglio Didattico Scientifico del "Master in Banking and Finance" presso il Dipartimento "Management - Facoltà di Economia – "Sapienza" - Università di Roma - Da ottobre 2014 Principali precedenti posizioni accademiche presso l'Università degli Studi di Roma 'La Sapienza': • Anni 2011–2017 - Ricercatore Universitario

	Confermato presso la Facoltà di Economia della “Sapienza” - Università di Roma - Sede di Roma -. Settore scientifico-disciplinare SECS-P/11. • Anni 2008–2011 - Ricercatore Universitario presso la Facoltà di Economia della “Sapienza” - Università di Roma - Sede di Roma -. Settore scientifico-disciplinare SECS-P/11. • Anni 2009–2017 - Professore Aggregato di “Economia e Gestione delle Aziende di Assicurazione” • Membro del Collegio dei Docenti 2011 del Dottorato di Ricerca in Gestione Bancaria e Finanziaria presso la Facoltà di Economia – “Sapienza” - Università di Roma. Anno accademico di inizio: 2011 - Ciclo: XXVII - Durata: 3 anni • Componente del Collegio dei Docenti 2011 del Dottorato di Ricerca Internazionale in “Sistemi Finanziari, Gestione e Regolazione dei Rischi” – (Phd Course in Financial Systems, Risk Management and Regulation) - Università degli Studi Guglielmo Marconi. Anno accademico di inizio: 2011 - Ciclo: XXVII - Durata: 3 anni • Anni 2002-2018 - Referente Scientifico del “Master Banking & Finance” (BA.FI.) (già “Master in Gestione Finanziaria Banche, Assicurazioni e Intermediari” e “Master in Gestione Finanziaria dell’Attività Bancaria ed Assicurativa”) presso il Dipartimento di “Management” - Facoltà di Economia – “Sapienza” - Università di Roma. Curriculum Prof.ssa Marina BROGI Attuale posizione accademica presso l'Università degli Studi di Roma ‘La Sapienza’: • Professore Ordinario di Economia degli intermediari finanziari. Dipartimento di Management, Facoltà di Economia, Sapienza Università di Roma • Titolarità degli insegnamenti: - International banking and capital markets, Laurea Magistrale in Intermediari, finanza internazionale e risk management - Bank Corporate Governance, Laurea Magistrale in Intermediari, finanza internazionale e risk management - Corporate governance of financial intermediaries, Dottorato di Ricerca in Management, banking and commodity sciences - Intelligence e sicurezza delle informazioni in ambito economico-finanziario nell'ambito del Master di II livello “Sicurezza delle informazioni e informazione strategica”, Dipartimento di Ingegneria Informatica - Corporate Governance, Executive Master in Finance, SDA Bocconi

	• Componente del Collegio dei docenti del Dottorato in Management, Banking and Commodity Sciences, Sapienza Università di Roma • Presidente del Comitato Tecnico Scientifico dell'Associazione Italiana dei Financial Industry Risk Managers (AIFIRM) • Presidente della Commissione per l'Abilitazione Scientifica Nazionale Settore Concorsuale Area 13 Settore B4 Principali precedenti posizioni accademiche presso l'Università degli Studi di Roma 'La Sapienza': • 2011-2017: Vicepreside della Facoltà di Economia, Sapienza Università di Roma • 2015-2016: Visiting Professor, Finance Department, Università Commerciale L. Bocconi • 2015-2016: Visiting Professor, Finance Department, London Business School • Titolarità di insegnamenti: - Private equity and venture capital, Laurea Magistrale in Intermediari, finanza internazionale e risk management - Disclosure, governance and capital markets, Laurea Magistrale in Business Management - Derivatives and financial innovation, Dottorato di Ricerca in Gestione bancaria e finanziaria - Capital Markets, Corso Undergraduate per studenti Erasmus - Componente del Collegio dei docenti del Dottorato in Gestione Bancaria e Finanziaria, Sapienza Università di Roma Curriculum Prof.ssa Pasqualina PORRETTA Attuale posizione accademica presso l'Università degli Studi di Roma 'La Sapienza': • Professore Associato (SECS-P/11) dal novembre 2016 • Docente di: - Risk Management delle banche dall'a.a. 2009-2010; - Strumenti Derivati dall'a.a. 2012-2013; • Componente della Giunta di Facoltà di Economia, Sapienza Università di Roma; • Componente della Giunta del Dipartimento di Management, Sapienza Università di Roma; • Membro del Collegio dei docenti del Dottorato di Ricerca in Management, Banking and Commodity Sciences, Dipartimento di Management, Facoltà di Economia; • Dall'anno 2013 è membro del consiglio direttivo ADEIMF (Associazione Docenti Economia Intermediari Mercati Finanziari);

	Principali precedenti posizioni accademiche presso l'Università degli Studi di Roma 'La Sapienza' • Anni 2008–2016 - Ricercatore Universitario Confermato presso la Facoltà di Economia della "Sapienza" - Università di Roma - Sede di Roma -. Settore scientifico-disciplinare SECS-P/11 • Anni 2013-2016 - Membro della Giunta di Dipartimento, (Dipartimento di Management) • Anni 2013-2016 - Membro della Giunta di Facoltà; • Nell'A.A 2008-2009 - Docente del modulo di Economia degli Intermediari finanziari, CdL Scienze della Moda e del Costume; Curriculum Prof. Valerio PESIC Attuale posizione accademica presso l'Università degli Studi di Roma 'La Sapienza': • Professore Ordinario (SECS-P/11) da aprile 2022 • Docente di Corporate & Investment Banking dall'A.A. 2017-2018 • Coordinatore Accademico della Mobilità internazionale (CAM) della Facoltà di Economia dell'Università degli Studi di Roma "La Sapienza", dall'A.A. 2016-2017 • Responsabile Accademico della Mobilità internazionale (RAM) della Facoltà di Economia dell'Università degli Studi di Roma "La Sapienza", dall'A.A. 2015-2016 • Membro del Collegio dei Docenti del Dottorato di Ricerca in Gestione Bancaria e Finanziaria, dall'A.A. 2010-2011 • Responsabile della "Commissione di Qualità per il Rapporto di Riesame per il Corso di Laurea di Intermediari, Finanza Internazionale e Risk Management", dall'A.A. 2012-2013 Principali precedenti posizioni accademiche presso l'Università degli Studi di Roma 'La Sapienza': • Professore Associato (SECS-P/11) da gennaio 2018 a mazro 2022; - Membro della "Commissione di Valutazione della Qualità per il Corso di Laurea di BAM Banche Assicurazioni e Mercati", dall'A.A. 2008-2009 all'A.A. 2010-2011 • Membro della Giunta di Facoltà di Economia, dall'A.A. 2015-2016 all'A.A. 2017-2018 • Membro della Giunta del Dipartimento di Management, dall'A.A. 2010-2011 all'A.A. 2012-2013, e dall'A.A. 2015-2016 all'A.A. 2016-2017 • Membro della "Commissione di Valutazione della Qualità per il Corso di Laurea di BAM Banche Assicurazioni e Mercati", dall'A.A. 2008-

	2009 all'A.A. 2010-2011 • Membro della Commissione di Facoltà di Economia "SOrT Servizio Orientamento Tutoraggio e Placement e Sapienza&Lavoro", dall'A.A. 2008-2009 all'A.A. 2010-2011
Eventuali partner convenzionati	Da definire
Sede di svolgimento Sapienza o sedi esterne (obbligo di Convenzione)	Dipartimento di Management, III piano, Via del Castro Laurenziano 9, 00161 Roma
Quota di iscrizione prevista ripartita massimo in due rate	€ 2.200
Eventuali quote di esenzioni parziali o totali dal pagamento della parte di quota di pertinenza del Dipartimento espresse in percentuali rispetto alla quota di iscrizione (max due tipi di esenzioni)	n.d.
Contatti di Segreteria	**Dipartimento di Management, IV piano, Via del Castro Laurenziano 9, 00161 Roma Dott.ssa Anna Mallamaci masterbafi@uniroma1.it 0649766989**

DIPARTIMENTO
DI MANAGEMENT

SAPIENZA
UNIVERSITÀ DI ROMA

Piano delle Attività Formative

Denominazione attività formativa	Responsabile insegnamento	Settore scientifico disciplinare	CFU	Ore	Tipologia	Lingua
Attività I: **Internal risk governance nelle banche** Corporate e internal governance nelle banche. Ruolo degli Organi di governo societario nel Sistema dei Controlli Interni e attività di controllo. Funzione di compliance. La funzione di Internal Audit. Funzione Antiriciclaggio. Le relazioni tra le funzioni di controllo. Gli intermediari non bancari. Il processo autorizzativo per la costituzione di una banca/intermediario finanziario. Elementi su alcune normative significative: AML/KYC, 231, 262, normativa anti usura, trasparenza, market abuse. Normative specifiche per i serizi di investimento. L'uso di advanced analytics e tecnologia avanzate nelle funzioni di controllo (regtech)	Prof.ssa Marina Brogi Prof. Valerio Pesic	SECS-P/11	2	50	Lezioni, testimonianze, laboratorio e studio individuale	Italiano
Attività II: **Risk Management, regolamentazione prudenziale e supervisione nella Banking Union** 1. Il ruolo del risk management in banca. 2. Il MVU: caratteristiche, attori, compiti. 3. La regolamentazione prudenziale: fondi propri e requisiti di capitale. I rischi di Primo Pilastro: approcci standard e approcci avanzati (cenni sul rischio di credito che viene affrontato in un modulo specifico). Pillar2: ICAAP e ILAAP e relazioni con	Prof. Fabrizio Santoboni Prof.ssa Pasqualina Porretta	SECS-P/11	5	125	Lezioni, testimonianze, laboratorio e studio individuale	Italiano

pianificazione e budgeting. Il funding plan. Le innovazioni di Basilea IV. 4. La supervisione: lo SREP. 5. La gestione delle crisi e la risoluzione delle banche: Recovery plan, Resolution Plan, i requisiti TLAC e MREL. Il processo di risoluzione delle banche. 6. L'IFRS9: confronto tra normativa contabile e regolamentare						
Prova finale		SSD non previsto	1	25	Elaborato finale	

TOTALE CFU	**8**