

SCHEDA DELL'INSEGNAMENTO DI: GESTIONE E CONTROLLO DEI RISCHI DELL'INTERMEDIAZIONE FINANZIARIA

Corso di studio
ECONOMIA E COMMERCIO

Titolo insegnamento in inglese
FINANCIAL RISK MANAGEMENT

Laurea/LM/LMcu
Laurea

A.A. 2017/2018

Docente:
Rosa COCOZZA

Tel.: 081 675083

email: rosa.cocozza@unina.it

SSD
SECS-P/11

CFU
10

Anno di corso
3°

Semestre
1°

Insegnamenti propedeutici previsti: ECONOMIA DEI MERCATI E DEGLI INTERMEDIARI FINANZIARI

RISULTATI DI APPRENDIMENTO ATTESI

Conoscenza e capacità di comprensione

Il percorso formativo del corso intende fornire agli studenti le conoscenze su tecniche di gestione di portafoglio azionari e obbligazionari di sole attività e successivamente con riferimento a portafogli di intermediazione propriamente detti (attivi/passivi) in una logica di gestione aziendale e di conformità al contesto regolamentare e normativo domestico ed internazionale.

Conoscenza e capacità di comprensione applicate

Lo studente dovrà essere in grado di conoscere e riconoscere le diverse tipologie di rischi, le tecniche di copertura, le politiche di gestione, le strategie di ottimizzazione degli indicatori di rischio e di rendimento, la gestione del capitale regolamentare, la gestione delle singole fenomenologie di rischio aziendale tipiche degli intermediari finanziari ed i relativi profili di conformità contabile e normativa in tema di rilevazione periodica e risultati e di segnalazioni di vigilanza.

Eventuali ulteriori risultati di apprendimento attesi, relativamente a:

- **Autonomia di giudizio:** Lo studente dovrà essere in grado di dimostrare competenza e non solo conoscenza su strumenti e gestione.
- **Abilità comunicative:** Lo studente dovrà essere in grado di spiegare, anche a persone non esperte, i concetti appresi e le competenze maturate.
- **Capacità di apprendimento:** Il Corso fornisce allo studente gli strumenti, le indicazioni e le informazioni per poter approfondire in modo autonomo singoli aspetti di riferimento. Il corso, accreditato dall'AIFIRM, fornisce allo studente che lo ha in carriera il *label* AIFIRM.

PROGRAMMA

Il Corso fornisce gli elementi di fondo e avanzati del financial risk management:

- L'intermediazione finanziaria: funzioni, ruolo e finalità degli intermediari.
- Portafogli di attività finanziarie e portafogli di intermediazione finanziaria.
- Valutazione delle attività finanziarie e dei portafogli di intermediazione.
- Misure di rischio e fattori di rischio con specifico riferimento a portafogli trading.
- Fondamenti logici del processo di risk management: identificazione, misurazione, gestione e copertura.
- Il sistema dei rischi degli intermediari (approcci tradizionali ed approcci conseguenti alla crisi),
- Figure di rischio.
- Politiche, tecniche e strumenti di gestione dei rischi.
- Tipologie di contratti derivati e tecnica delle coperture
- Rappresentazioni contabili e valutazioni extracontabili
- Modalità istituzionali di controllo:
- Risk management e creazione di valore.

Il programma dettagliato è disponibile sul sito docenti.

CONTENTS

The course provides the fundamentals and specifications of financial risk management:

- Financial Intermediaries.
- Financial portfolios and intermediation portfolios.
- Evaluation of financial assets.
- Risk and return in trading portfolios.
- Financial risk management (fundamentals).
- Financial Intermediation risk system.
- Financial risks.
- Risk management techniques and instruments.
- Derivatives and hedging.
- Financial statement and accountability
- Regulation and supervision. Compliance.
- Risk management and value creation.

The detailed program is available on the site: <https://www.docenti.unina.it>

SCHEDA DELL'INSEGNAMENTO DI: **GESTIONE E CONTROLLO DEI RISCHI DELL'INTERMEDIAZIONE FINANZIARIA**

Corso di studio ECONOMIA E COMMERCIO	Titolo insegnamento in inglese FINANCIAL RISK MANAGEMENT	Laurea/LM/LMcU Laurea	A.A. 2017/2018
Docente: Rosa COCOZZA	Tel.: 081 675083	email: rosa.cocozza@unina.it	
SSD SECS-P/11	CFU 10	Anno di corso 3°	Semestre 1°

Insegnamenti propedeutici previsti: ECONOMIA DEI MERCATI E DEGLI INTERMEDIARI FINANZIARI

MATERIALE DIDATTICO

- A. Saunders, M.M. Cornett, M. Anolli, B. Alemanni (2011), *Economia degli intermediari finanziari, III ed.*, McGrawHill Italia, Capp. 10, 13, 14, e 15.
- P.L. Fabrizi (a cura di), *L'economia del mercato mobiliare*, Milano, Egea, 2016, VI ed., capp.da 9 a 14 e 16 e 17.
- A. Saunders e M.M. Cornett (2013), *Financial Institutions Management. A Risk Management Approach*, McGraw-Hill International, 8 ed., Capp. da 8 a 25 oppure A. Sironi, *Rischio e valore nelle banche*, Milano, Egea, II ed., 2008, Capp. da 1 a 6, da 10 a 16, da 18 a 25.

FINALITA' E MODALITA' PER LA VERIFICA DI APPRENDIMENTO

a) Risultati di apprendimento che si intende verificare:

L'esame mira a verificare l'attitudine al ragionamento e la capacità di applicare le competenze acquisite.

- b) L'esame si articola in prova:** Scritta e orale Solo scritta Solo orale
- Discussione di elaborato progettuale:
- Altro (*specificare*):

In caso di prova scritta, i quesiti sono*: A risposta multipla A risposta libera Esercizi numerici
(* possibili più risposte)