

Sede

Università degli Studi di Parma
Dipartimento di Economia
Via J.F. Kennedy, 6
43100 PARMA - Italia

Comitato organizzatore

Tiziano Bellini, Università degli Studi di Parma
tiziano.bellini@unipr.it
Silvia Figini, Università degli Studi di Pavia
silvia.figini@unipv.it
Fabrizio Laurini, Università degli Studi di Parma
fabrizio.laurini@unipr.it

Tel + 39 0521 902466

Fax + 39 0521 902375

Website <http://economia.unipr.it/risks>



<http://www.unipr.it>

Università degli Studi di Parma



<http://www.unipv.it>

Università degli Studi di Pavia



<http://www.sis-statistica.it>

Società Italiana di Statistica



CLADAG

<http://www.sis-statistica.it>

Classification and Data
Analysis Group

Tyche

Associazione laureati, amici, docenti, di finanza, banche e assicurazioni dell'Università di Parma
<http://www.associazionetyche.org/>
Associazione laureati, amici, docenti, di
finanza banche assicurazioni
dell'Università di Parma



<http://www.aifirm.it>

Associazione Italiana Financial
Industry Risk Managers



<http://economia.unipr.it/de>

Dipartimento di Economia,
Università di Parma

Workshop

*Tendenze evolutive nella misurazione e
nella gestione integrata dei rischi nel
sistema finanziario*



**Università degli Studi di Parma
Dipartimento di Economia**

3 Febbraio 2012

Workshop

Tendenze evolutive nella misurazione e nella gestione integrata dei rischi nel sistema finanziario

Comitato scientifico

Andrea Cerioli – Università degli Studi di Parma

Gino Gandolfi - Università degli Studi di Parma

Paolo Giudici – Università degli Studi di Pavia

Luigi Grossi – Università degli Studi di Verona

Paola Modesti - Università degli Studi di Parma

Marco Riani - Università degli Studi di Parma

Paola Schwizer – Università degli Studi di Parma

Obiettivi e topics

La giornata di studio è organizzata dalle Sezioni di Statistica e Finanza, Banche e Assicurazioni dell'Università di Parma congiuntamente Dipartimento di Scienze Economiche e Aziendali dell'Università di Pavia. Alla luce delle recenti evoluzioni normative e considerando le problematiche che attualmente investono il sistema finanziario internazionale, verranno presentate le più innovative soluzioni operative in tema di misurazione e gestione dei rischi nelle istituzioni finanziarie ponendo particolare enfasi sulla loro integrazione e sui relativi impatti in termini di pianificazione ed allocazione del capitale. Il workshop ha un contenuto particolarmente orientato alle applicazioni ed in esso sarà dato ampio spazio alla interattività. Destinatari sono gli addetti ed i responsabili delle funzioni risk management, pianificazione, organizzazione di istituti finanziari, ricercatori, dottorandi e laureati interessati alle tematiche del risk management.

Outline

9.00-9.30 Saluto iniziale e presentazione dei lavori
G. Ferretti (Magnifico Rettore dell'Università di Parma)
P. Andrei (Direttore del Dipartimento di Economia dell'Università di Parma)
M. Riani, G. Gandolfi, P. Schwizer (Comitato Scientifico)

Prima sessione – Chairman Marco Riani

9.30-9.50 **Il ruolo della UE nella gestione dei rischi del sistema finanziario** *Sintesi dei principali filoni di ricerca dalla UE in merito alla gestione dei rischi del sistema finanziario e stato dell'arte degli interventi per la gestione dell'attuale crisi sistemica*
A. Pagano - Commissione Europea JRC di ISPRA

9.50-10.10 **L'evoluzione del risk management nell'ottica dell'organo di vigilanza Banca d'Italia** *Percorso del risk management nel sistema bancario italiano dal "big-bang" della finanza ai giorni nostri. Prospettive ed evoluzioni: la centralità dell'integrazione dei rischi*
M. Bignami - Banca d'Italia

10.10-10.30 **Modelli e strumenti statistici al servizio del risk management** *L'attività del risk manager quale punto d'incontro tra esperienze aziendalistiche e competenze matematico-statistiche. Tendenze evolutive, metodi e strumenti per la gestione della dei rischi nelle banche*
P. Giudici – Università degli Studi di Pavia

10.30-10.50 **Coffee break**

Seconda sessione – Chairman Gino Gandolfi

10.50-11.10 **Sfide e prospettive nel risk management a livello internazionale** *La "filiera" del rischio nella prospettiva di un gruppo bancario internazionale: criticità nell'integrazione di modelli e sistemi gestionali*
G. Albanese - Chief Risk Officer Italy - Unicredit

11.10-11.30 **Il ruolo dell'integrazione dei rischi nelle banche "global player"** *Rischi di mercato, di credito ed operativi: il peso dei rischi di primo pilastro (Basilea II) rispetto al sistema complessivo dei rischi aziendali: sviluppi teorici e soluzioni praticate*
B. Picca - Chief Risk Officer Intesa Sanpaolo

11.30-11.50 **Modelli statistici per l'integrazione dei rischi** *Punti di forza e criticità degli approcci top-down e bottom-up per l'integrazione dei rischi nelle banche. Innovazione metodologica e soluzioni di frontiera per l'allocazione del capitale*
T. Bellini - Università degli Studi di Parma

11.50-12.10 **Il rischio di credito tra passato, presente e futuro** *Il rischio di credito ed il capital management tra Basilea II e III. Nuovi approcci e tendenze evolutive*
R. Maino - AIFIRM

12.10-12.30 **Modelli statistici per il rischio di credito secondo l'approccio Bayesiano** *Il ruolo della statistica Bayesiana nel credit risk management*
S. Figini – Università degli Studi di Pavia

12.30-14.15 **Lunch**

Terza sessione – Chairman Paola Schwizer

14.30-14.50 **Il sistema dei controlli: un quadro di sintesi** *Il sistema dei controlli aziendali: il ruolo del risk management. Evoluzione normativa ed inquadramento nella teoria economica*
M. Ziliotti – Università degli Studi di Parma

14.50-15.10 **Diversificazione dei rischi e robustezza** *Scelte robuste nella gestione del portafoglio attraverso la minimizzazione di misure di rischio coerenti* - F. Laurini – Università degli Studi di Parma

15.10-15.30 **Basilea III: gli impatti sul capital planning nelle banche** *Il capitale economico quale paradigma ovvero semplice ingrediente del meccanismo di pianificazione del capitale nelle banche. Modelli e prassi operativa al servizio dell'efficiente allocazione delle risorse aziendali*
B. Cord'homme - Chief Risk Officer Cariparma

15.30-16.00 **Tavola rotonda**

Date importanti ed informazioni

Registrazione

Entro 31 Gennaio 2012

E-mail fabrizio.laurini@unipr.it

Website <http://economia.unipr.it/risks>

Data workshop

3 Febbraio 2012

Partecipazione gratuita