

IX Convention AIFIRM

Il «marchio di conformità» Aifirm

Andrea Resti, università Bocconi



twitter

andrearesti

Il marchio di conformità Aifirm

- Cosa (non) è
- Come viene assegnato
- A che punto siamo

Cosa (non) è

- La prospettiva dell'accademia
 - argomento in divenire, contenuti didattici eterogenei e articolati, iniziative avanzate
- La prospettiva dell'industria
 - disporre di laureati con esperienze/nozioni sufficientemente omogenee e riconoscibili
- Il ruolo di Aifirm
 - offrire ai Docenti un sillabo-tipo cui gli Associati riconoscono un valore "segnaletico", anche in fase di selezione dei collaboratori
 - NON un marchio di qualità
 - MA una carta d'identità

Cosa è: il sillabo-tipo

Aree tematiche		Unità didattiche	
Unità	Tematica	N.	Contenuti
1	Introduzione al corso	1	La crisi del 2007 e i fallimenti del risk management
6	Rischio di mercato	2	Definizione, VaR parametrico e stima empirica di varianze e covarianze
		3	Simulazione Monte Carlo, simulazione storica
		4	Stress testing
		5	Backtesting
		6	I limiti del VaR e l'expected shortfall
		7	Esercitazione
6	Rischio di credito	8	Definizione e componenti. Stima della PD con modelli statistici
		9	Stima della PD con modelli basati su dati di mercato
		10	Rischio di recupero e di esposizione. Stima di LGD e EAD
		11	Modelli di portafoglio e Credit VaR
		12	Utilizzo del rating nella gestione. Sistemi di pricing. Stima del rendimento corretto per il rischio.
		13	Esercitazione
4	Altri rischi	14	Rischio di tasso sul banking book
		15	Rischio di liquidità e tassi interni di trasferimento
		16	Rischio di controparte
		17	Rischio operativo
4	Regolamentazione dei rischi	18	Introduzione alla regolamentazione. Ruolo del Comitato di Basilea e dell'Unione Europea. Il capitale regolamentare
		19	Il sistema di Basilea 2
		20	I limiti di Basilea 2 e della vigilanza sui rischi
		21	Basilea 3 come risposta alla crisi del 2007
2	Gestione del capitale	22	Le diverse definizioni di capitale. Il costo del capitale.
		23	L'allocazione del capitale. RAPM e creazione di valore
1	Conclusione del corso	24	Revisione e simulazione di esame

Come viene assegnato il marchio di conformità



Verifica della conformità

- Mappatura dei punti di contatto
 - per ognuna delle 24 sessioni, i relativi argomenti del syllabo Aifirm sono adeguatamente presenti nel syllabo del corso?
 - Almeno 19 punti di contatto = 10 punti
 - Tra 16 e 18: 6-9 punti
 - Meno di 15 punti di contatto = 0 punti
- Verifica requisiti qualitativi
 - utilizzo di esempi quantitativi e di metodologie didattiche interattive
 - Da 1 a 3 punti extra
- Punteggio almeno pari a 9

A che punto siamo?

- Assegnata d'iniziativa a 17 corsi e 19 docenti
- Può essere richiesta a aifirm.label@gmail.com
- Possibili sviluppi, ma soprattutto gestione e manutenzione del progetto

Corso conforme
agli standard

AIFIRM



Elisabetta D'Apolito

Enzo Scannella

Giudici - Rocca

Nicoletta Marinelli

Andrea Sironi

Franco Fiordelisi

Paola Schwizer

Mario Anolli

D'Arcangelis - Gianni

Paola De Vincentiis

Simona Cosma

Rosa Cocozza

Mario Valletta

Domenico Curcio

Porzio - Starita

Pier Franco Giorgi

Cosa ci manca?

MARCHIO DI CONFORMITÀ AIFIRM

Il prof. Paolino Paperino

riceve dall'Associazione Italiana Financial Industry Risk Managers (AIFIRM) il presente attestato, che certifica la conformità tra i contenuti formativi standard definiti dall'Associazione e il syllabo del corso denominato

ANALISI DEI RISCHI A PAPEROPOLI

da lui tenuto, nel corrente Anno Accademico, presso l'Università di Topolinia



CONFERITO DA:

Davide Alfonsi, presidente Aifirm

OGGI,

25 ottobre 2013

IX Convention AIFIRM

Il «marchio di conformità» Aifirm

Andrea Resti, università Bocconi



twitter

andrearesti