



Convegno AIFIRM

L'Intelligenza artificiale nel Risk Management

Presentazione dei risultati della Commissione AIFIRM

11 Aprile 2019

Sede del Convegno: Uffici Accenture – Via M. Quadrio 17 - Milano

Il Convegno, **organizzato da AIFIRM in collaborazione con Accenture**, propone una giornata di discussione sulle applicazioni dell'Intelligenza Artificiale e del Machine Learning nel Risk Management.

I temi di riflessione e approfondimento sono numerosi e riguardano tra gli altri:

- l'approfondimento delle tecniche di Machine Learning necessarie per l'analisi della grande mole di dati in possesso degli istituti bancari, che rappresentano una grande opportunità per la valutazione dei principali rischi aziendali (Credito, Mercato, Operativo);
- la rappresentazione di sintesi dello stato dell'arte del Risk Management bancario italiano individuando le possibili best practices di mercato;
- i potenziali campi di applicazione all'interno del Risk Management, valutando sia le tecniche di apprendimento supervisionato sia quelle di apprendimento non supervisionato;
- l'approfondimento della comprensione degli aspetti chiave legati all'utilizzo di tali metodologie statistiche, nonché coglierne le principali sfide implementative alla luce della complessità di scenario e del contesto normativo in evoluzione.

Durante la giornata saranno presentati i lavori del position paper AIFIRM numero 14 "Intelligenza Artificiale: L'applicazione di Machine Learning e Predictive Analytics nel Risk Management" ricerca condotta da AIFIRM.

Ai partecipanti soci Aifirm verranno riconosciuti 6 crediti formativi

Si ringrazia





Programma

Introduzione Maurizio Vallino (Direttore responsabile Risk Management Magazine e Banca Carige)

Moderatore Paolo Giudici (Università di Pavia)

15.30 - 16.00 **Presentazione dei risultati della survey**
Stefano Bonini (Accenture)
Giuliana Caivano (Accenture)

16.00 - 16.30 **Metodologie di Machine Learning in applicazione al Rischio di Credito**
Stefano Bonini (Accenture)
Giuliana Caivano (Accenture)

16.30 - 17.00 **Metodologie di Machine Learning in applicazione al Rischio di Mercato**
Arianna Agosto (Università di Pavia)
Pier Giuseppe Giribone (Banca CARIGE e Università di Genova)

17.00 - 17.30 **Metodologie di Machine Learning in applicazione al Rischio Operativo**
Paola Cerchiello (Università di Pavia)

17.30 - 18.00 **La Validazione dei modelli di Machine Learning**
Emanuela Raffinetti (Università statale di Milano)

18.00 - 18.30 **Conclusioni**
Paolo Giudici (Università di Pavia)
Bonini-Caivano-Cerchiello-Giribone (Coordinatori della commissione sul Machine Learning)