

## CORSO DI STUDIO “Economia e Amministrazione delle Aziende”

ANNO ACCADEMICO 2024-2025

DENOMINAZIONE DELL'INSEGNAMENTO **Financial risk management-6 CFU**

Principali informazioni sull'insegnamento	
Anno di corso	<i>Primo anno, secondo anno, terzo anno – insegnamento a scelta</i>
Periodo di erogazione	Il semestre- Dal 17 febbraio 2025 al 30 maggio 2025
Crediti formativi universitari (CFU/ETCS):	6 CFU
SSD	Economia degli intermediari finanziari SECS-P/11
Lingua di erogazione	<i>Inglese</i>
Modalità di frequenza	La frequenza del Corso è facoltativa ma raccomandata

Docente	
Nome e cognome	<i>Caterina Di Tommaso</i>
Indirizzo mail	<i>caterina.ditommaso@uniba.it</i>
Telefono	
Sede	Sede di Economia - Via Lago Maggiore, Taranto
Sede virtuale	Pagina Teams del Corso di Financial risk management Codice Teams: c47bjh1
Ricevimento	<p>Il ricevimento potrà tenersi sia in presenza presso lo studio del Prof.ssa Di Tommaso presso la sede di Economia di via Lago Maggiore a Taranto sia in modalità telematica (online) attraverso la pagina Teams dedicata all'insegnamento (Codice MT: c47bjh1), concordando preventivamente data e orario via e-mail con il docente.</p> <p>Durante il periodo del Corso il ricevimento si terrà in presenza il martedì e il mercoledì alle ore 11,00 presso lo studio del docente presso la sede di Economia di via Lago Maggiore a Taranto.</p>

Organizzazione della didattica			
Ore			
Totali	Didattica frontale	Pratica (laboratorio, campo, esercitazione, altro)	Studio individuale
150	48		102
CFU/ETCS			
6 CFU	6 CFU		

<b>Obiettivi formativi</b>	Il Corso di Financial Risk Management intende fornire le conoscenze utili per comprendere la natura dei rischi in ambito finanziario e i loro modelli di gestione. Nel Corso si approfondiranno i rischi di credito, di mercato e operativo e le metodologie di gestione e misurazione di questi rischi adottate dalle imprese di intermediazione finanziaria, attraverso un approccio sia teorico che empirico.
<b>Prerequisiti</b>	Conoscenze di base di Economia degli intermediari finanziari, funzionamento dei mercati finanziari e del concetto di rischio.

<b>Metodi didattici</b>	Il Corso è erogato principalmente attraverso lezioni frontali, esercitazioni pratiche, seminari e project work.
-------------------------	---

<b>Risultati di apprendimento previsti</b>	
--	--

<p><b>DD1 Conoscenza e capacità di comprensione</b></p> <p><b>DD2 Conoscenza e capacità di comprensione applicate</b></p> <p><b>DD3-5 Competenze trasversali</b></p>	<p><b>DD1 Conoscenza e capacità di comprensione</b> Il corso mira a fornire le basi per la comprensione del rischio e della sua gestione negli intermediari finanziari. Al termine del corso, lo studente dovrà aver acquisito: a) adeguata padronanza del linguaggio economico e finanziario; b) comprensione e capacità di valutazione critica dei principali metodi di gestione del rischio; c) capacità di proseguire in modo autonomo eventuali studi specialistici riguardanti la gestione del rischio.</p> <p><b>DD2 Conoscenza e capacità di comprensione applicate</b> Il corso di Financial risk management ha la finalità di illustrare i fondamenti del rischio e della sua gestione. Lo studente dovrà essere in grado di applicare i concetti necessari all'interpretazione critica delle dinamiche gestionali tipiche dell'attività di intermediazione finanziaria e alla comprensione delle problematiche e dei rischi che caratterizzano lo svolgimento di tale attività.</p> <p><b>DD3-5 Competenze trasversali</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Autonomia di giudizio</li> </ul> <p>Lo studente potrà migliorare la propria capacità critica attraverso l'analisi di casi studio. Lo scopo del corso è quello di fornire le conoscenze necessarie per poter riflettere sui fenomeni finanziari che riguardano i mercati e gli intermediari finanziari.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Abilità comunicative</li> </ul> <p>Il corso è disegnato per chi si accosta per la prima volta allo studio del rischio e si propone di far acquisire allo studente una terminologia di uso corrente nei mercati e intermediari finanziari. Al termine del corso, lo studente dovrà dimostrare di saper applicare la terminologia in modo appropriato e pertinente.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Capacità di apprendere in modo autonomo</li> <li>• Al termine del corso, lo studente sarà in grado di comprendere, identificare e quantificare i rischi bancari.</li> </ul>
<p><b>Contenuti di insegnamento (Programma)</b></p>	<p><b>PARTE I</b> Il modello del repricing gap Il modello del duration gap I modelli basati sul cash-flow mapping Il rischio di liquidità</p> <p><b>PARTE II</b> Il rischio di mercato Il rischio di credito Il rischio operativo</p>
<p><b>Testi di riferimento</b></p>	<p>- A. Resti, A. Sironi, Risk Management and Shareholders' Value in Banking, EGEA, 2008. (Capitolo 1, Capitolo 2, Capitolo 3, Capitolo 5, Capitolo 6 [6.1, 6.2, 6.4, 6.5], Capitolo 7, Capitolo 8 [8.1, 8.2., 8.2.1, 8.2.4, 8.3, 8.3.1, 8.3.3], Capitolo 11 [escluso 11.4], Capitolo 12 [12.2, 12.3], Capitolo 14, Capitolo 18) - Eventuali letture integrative finalizzate ad approfondire temi specifici saranno consigliate durante il corso.</p>

<b>Note ai testi di riferimento</b>	La preparazione completa del programma del Corso prevede lo studio congiunto dei capitoli indicati dei due testi di riferimento.
<b>Materiali didattici</b>	Il materiale didattico verrà caricato sulla piattaforma MT sulla pagina dedicata al Corso. Il materiale didattico sarà inoltre disponibile nella pagina dedicata su Teams del Corso per tre anni dopo la fine del Corso e, per lo stesso arco temporale, a richiesta dei singoli studenti sarà reso disponibile dal docente.

<b>Valutazione</b>	
Modalità di verifica dell'apprendimento	<p>La verifica dell'apprendimento avviene attraverso un esame orale sui diversi contenuti sviluppati durante il Corso precedentemente descritti. Nel colloquio orale, il docente accerta le conoscenze acquisite mediante domande aperte o esercizi opportunamente sviluppati durante il Corso. Durante l'esame il docente accerterà i risultati di apprendimento previsti e dettagliati analiticamente nella sezione "Contenuti di insegnamento" di questo Syllabus.</p> <p>La valutazione della preparazione dello studente, sempre individuale, ha luogo in condizioni che ne garantiscano l'approfondimento, l'obiettività e l'equità. L'accertamento mira a valutare la conoscenza e le capacità di comprensione e analisi critica degli argomenti oggetto dell'insegnamento, la metodologia utilizzata per lo studio della materia, la padronanza del linguaggio specifico dell'insegnamento, nonché la capacità di comprensione delle interconnessioni tra i diversi argomenti dell'insegnamento.</p>
Criteri di valutazione	<ul style="list-style-type: none"> <li>• <i>Conoscenza e capacità di comprensione:</i> Lo studente dovrà essere in grado di illustrare e comprendere il rischio degli intermediari finanziari utilizzando un linguaggio appropriato. Lo studente sarà in grado di comprendere tutte le dinamiche del rischio e della sua gestione.</li> <li>• <i>Conoscenza e capacità di comprensione applicate:</i> Lo studente dovrà essere in grado di: a) applicare le nozioni di base a contesti concreti e casi specifici; b) comprendere, identificare e quantificare i rischi bancari.</li> <li>• <i>Autonomia di giudizio:</i> Lo scopo del corso è quello di fornire le conoscenze necessarie per poter riflettere sui rischi e la loro gestione.</li> <li>• <i>Abilità comunicative:</i> Lo studente dovrà dimostrare di saper applicare la terminologia in modo appropriato e pertinente.</li> <li>• <i>Capacità di apprendere:</i> <ul style="list-style-type: none"> <li>○ Al termine del corso lo studente dovrà possedere le abilità di apprendimento necessarie per ambire ad ottenere uno sbocco occupazionale in ambito della gestione del rischio, oppure per continuare e approfondire gli studi in questo ambito con un alto grado di autonomia.</li> </ul> </li> </ul>
Criteri di misurazione dell'apprendimento e di attribuzione del voto finale	Il voto finale è attribuito in trentesimi. L'esame si intende superato quando il voto è maggiore o uguale a 18. La Lode viene attribuita qualora lo studente abbia maturato una conoscenza approfondita dell'argomento, mostri la padronanza del linguaggio specifico dell'insegnamento, nonché la capacità di comprensione delle interconnessioni tra i diversi argomenti dell'insegnamento.
<b>Altro</b>	