



## UNIVERSITÀ DI PISA RISK MANAGEMENT

---

**GIUSEPPE D'ONZA**

Anno accademico  
CdS

2018/19  
STRATEGIA, MANAGEMENT E  
CONTROLLO

Codice  
CFU

279PP  
6

Moduli	Settore/i	Tipo	Ore	Docente/i
RISK MANAGEMENT	SECS-P/07	LEZIONI	42	GIUSEPPE D'ONZA

### Obiettivi di apprendimento

#### *Conoscenze*

Il corso approfondisce la tematica del risk management in aziende non finanziarie.

Obiettivo del corso è quello di analizzare i principi e le logiche della gestione del rischio, identificare le fasi del processo di risk management, esaminare le principali tecniche di valutazione e i principali strumenti di fronteggiamento dei rischi aziendali.

Particolare attenzione è rivolta alle componenti dei modelli di Enterprise Risk Management (ERM) e ai sistemi di gestione del rischio definiti dallo standard UNI:ISO 31000:2009. Tra gli argomenti affrontati nel corso rientra l'analisi dei casi aziendali nei quali trovano applicazione le tecniche di Control risk self assessment, la relazione tra rischio e costo del capitale ed alla comunicazione dei rischi nell'informativa esterna.

#### *Modalità di verifica delle conoscenze*

Prova scritta (orale facoltativo) con voto in trentesimi

#### *Capacità*

Analizzare la capacità degli studenti di applicare le metodologie e gli strumenti di risk management nelle aziende industriali e di servizi

#### *Modalità di verifica delle capacità*

Prova scritta (orale facoltativo) con voto in trentesimi

#### *Comportamenti*

Analizzare la capacità degli studenti di applicare le metodologie e gli strumenti di risk management nelle aziende industriali e di servizi

#### *Modalità di verifica dei comportamenti*

Prova scritta (orale facoltativo) con voto in trentesimi

#### *Prerequisiti (conoscenze iniziali)*

Aver acquisiti le conoscenze dell'economia aziendale e del bilancio

#### *Programma (contenuti dell'insegnamento)*

Il rischio nel sistema d'azienda

Le possibili classificazioni dei rischi aziendali

I modelli di gestione del rischio

Gli attori del risk management

Le tecniche di individuazione dei rischi

Le metodologie e gli strumenti di risk assessment

Approfondimento sulle tecniche di valutazione quantitativa: i modelli VAR e di stress testing

Le modalità di fronteggiamento del rischio

Gli strumenti di financial risk management (swap, option, future): cenni

La comunicazione interna dei rischi

Il Control risk self assessment

Il sistema di gestione del rischio secondo lo standard UNI:ISO 31000:2009



## UNIVERSITÀ DI PISA

---

La relazione fra rischio e capitale economico  
Modelli di valutazione delle performance risk-based  
Il reporting esterno dei rischi  
Analisi di casi aziendali

### Modalità d'esame

Prova scritta (orale facoltativo) con voto in trentesimi

*Ultimo aggiornamento 04/10/2018 15:22*