

Percorso interaziendale

# DATA DRIVEN PER IL SISTEMA DEI CONTROLLI INTERNI: LE DECLINAZIONI OPERATIVE PER LE FUNZIONI DI CONTROLLO

1° MODULO • 8 giugno 2022 • Aula virtuale

2° MODULO • 13 e 14 giugno 2022 • Aula virtuale

3° MODULO • 20 giugno 2022 • Aula virtuale

1° MODULO • 8 giugno

## LE COMPETENZE MATEMATICO-STATISTICHE PER OPERARE CON I DATI

- ▶ **Elementi introduttivi per l'elaborazione dei dati**
  - Rilevazione e analisi dei dati sperimentali
  - Distribuzioni di frequenza
  - Rappresentazioni grafiche
- ▶ **Statistica descrittiva univariata**
  - Indici di posizione: media, moda, mediana
  - Indici di variabilità: varianza e deviazione standard
- ▶ **Statistica descrittiva bivariata**
  - Costruzione e interpretazione di tabelle a doppia entrata
  - Misure di dipendenza tra due variabili: connessione e correlazione
  - Regressione lineare
- ▶ **Gli approcci metodologici matematico-statistici per la gestione del rischio**
  - Approcci metodologici innovativi: l'oggettivazione delle misurazioni
  - Nuovi parametri per l'oggettivazione della valutazione di rischio lordo
  - La costruzione di modelli di stime potenziali

2° MODULO • 13 e 14 giugno

## INTRODUZIONE AL DATA MANAGEMENT PER LE FUNZIONI AZIENDALI DI CONTROLLO

Prima giornata

- ▶ **Perché le FAC hanno bisogno di un approccio data driven**
  - Il processo di gestione dei rischi nell'approccio guidato dai dati
- ▶ **Decisione, rischio, futuro e complessità**
  - Analisi dei dati a supporto del processo di gestione del rischio
  - Modelli di previsione e processo decisionale nella complessità
  - Data Science: il vocabolario
- ▶ **Come scegliere i dati e dove trovarli**
  - I modelli organizzativi della banca data driven: il framework normativo
  - Il ciclo di vita del dato
  - L'ownership del dato: ruoli e responsabilità dal Chief Data Officer al data owner
  - Il concetto di «Qualità» del dato: metriche di misurazione della qualità
- ▶ **Come gestire i dati aziendali**
  - Architettura e processi di risk data aggregation
  - Principali strumenti e processi di data governance: dictionary, controlli, ecc.
  - Interazione con IT Risk e Data quality risk

## Seconda giornata

- ▶ **Le tecnologie-chiave a supporto dell’approccio data driven per le FAC**
  - Intelligenza artificiale, machine learning, Robotic Process Automation: quali possibilità di efficientamento del processo di gestione del rischio
  - Data analytics: come estrarre valore dai dati per alimentare la tecnologia
  - Come scegliere e applicare le tecnologie
- ▶ **Gli obiettivi di data management per le funzioni di controllo**
  - Il nuovo operating model
  - Il transformation journey verso le FAC del futuro
- ▶ **Come disegnare un processo data driven di gestione del rischio**
  - Scomporre e analizzare un processo di risk management
  - Individuare le possibilità di adozione di un approccio data driven
- ▶ **Come realizzare un progetto data driven per le funzioni di controllo**
  - Gli ambiti da monitorare
  - I ruoli e le responsabilità da definire

## 3° MODULO • 20 giugno

# METODI DI ANALISI APPLICATI ALLE ESIGENZE DELLE FUNZIONI AZIENDALI DI CONTROLLO

- ▶ **I dati a uso delle Funzioni Compliance, Risk management, Internal audit**
  - Strumenti per la gestione evoluta dei dati per ciascuna funzione di controllo
  - Le applicazioni di machine learning e intelligenza artificiale
  - Algoritmi e modelli di applicazione per ciascuna funzione
- ▶ **L’uso dei dati per tipologia di rischio**
  - Focus-on compliance risk
  - Focus-on credit risk e financial risk
  - Focus-on operational risk
- ▶ **Use case applicativi per ogni Funzione Aziendale di Controllo**
  - Analisi di specifici casi d’uso
  - Testimonianze aziendali