



Percorso

DATA DRIVEN FAC: DALL'ANALISI DEI DATI ALLE INFORMAZIONI

1° MODULO • 21 e 22 giugno 2021

2° MODULO • 1 e 2 luglio 2021

PROGRAMMA

1° MODULO • 21 e 22 giugno 2021

INTRODUZIONE AL DATA MANAGEMENT PER LE FUNZIONI AZIENDALI DI CONTROLLO

▶ Primo giorno • 21 giugno 2021

- ▶ **Perché le FAC hanno bisogno di un approccio Data driven al processo di gestione dei rischi?**
- ▶ **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**
 - Definizione del concetto di «dato»
- ▶ **Elementi introduttivi**
 - 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

▶ Secondo giorno • 22 giugno 2021

- ▶ **Gli obiettivi di Data management per le FAC**
 - Il nuovo Operating Model
 - Il Transformation Journey verso le FAC del Futuro
- ▶ **La realizzazione di un progetto Data driven**
 - Gli obiettivi nel breve e lungo termine
 - Gli step progettuali
- ▶ **Use case applicativi**
 - Product Governance
 - Controlli e Reporting
 - Trasparenza e Usura
 - Anti Financial Crime
 - Digital Platform
- ▶ **Come scegliere i dati e dove trovarli**
 - Il ciclo di vita del dato
 - I modelli organizzativi della banca data driven: il framework normativo di riferimento
 - 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 dei dati
 - Stato dell'arte in merito all'architettura e ai processi di risk data aggregation
 - Principali tools e processi di data governance (dictionary, controlli, ecc.)
 - Interazione con IT risk e data quality risk

2° MODULO • 1 e 2 luglio 2021

INTRODUZIONE AL DATA MANAGEMENT PER LE FUNZIONI AZIENDALI DI CONTROLLO

▶ Primo giorno • 1 luglio 2021

- ▶ **Le competenze matematico-statistiche: i must-have per le funzioni di controllo**
- ▶ **Statistica descrittiva bivariata**
 - Costruzione e interpretazione di tabelle a doppia entrata
 - Misure di dipendenza tra due variabili: connessione e correlazione
 - Regressione lineare
- ▶ **Distribuzioni di probabilità**
 - Definizione di variabile casuale
 - La Distribuzione Normale
- ▶ **Come scegliere un modello di controllo statistico:**
 - Dal Risk Assessment al modello statistico dei controlli
 - Process mining: controllo nel continuo e ricerca delle eccezioni
 - Life-Cycle di un sistema automatico di controllo
- ▶ **La realizzazione di un sistema di KRI data driven**

▶ Secondo giorno • 2 luglio 2021

- ▶ **I dati a uso delle FAC**
- ▶ **La gestione evoluta dei dati: Machine Learning**
 - Obiettivi del Machine Learning
 - Metodi e algoritmi di Classificazione, Clustering, Previsione
 - Il processo di analisi dei dati mediante strumenti di Machine Learning
- ▶ **Strumenti di Intelligenza Artificiale per la gestione evoluta dei dati**
 - Reti Neurali Artificiali
 - Percettroni multistrato: Apprendimento Supervisionato
 - Mappe di Kohonen: Apprendimento Non Supervisionato
- ▶ **Metodi di Classificazione**
 - Classificazione per categorie
 - Individuazione degli «outliers» nella base dati
 - Esercitazione
- ▶ **Metodi di Clustering**
 - Analisi di dati non classificati
 - Individuazione di cluster
 - Esercitazione
- ▶ **Metodi di Previsione**
 - Simulazione di funzioni
 - Serie storiche
 - Esercitazione
- ▶ **Analisi del testo**
 - Principi di analisi del linguaggio naturale
 - Analisi morfologica e verifica delle similitudini
 - Sentiment Analysis