

18 ottobre 2012

---

# Risk Management le sfide metodologiche e le domande che dovremmo farci

---

Paolo Casati

# La definizione di rischio

---

Rischi  
puri

vs.

Rischi/  
Opportunità

Strategie:

- Minimizzare

Strategie:

- Minimizzare
- Evitare
- Condividere
- Accettare

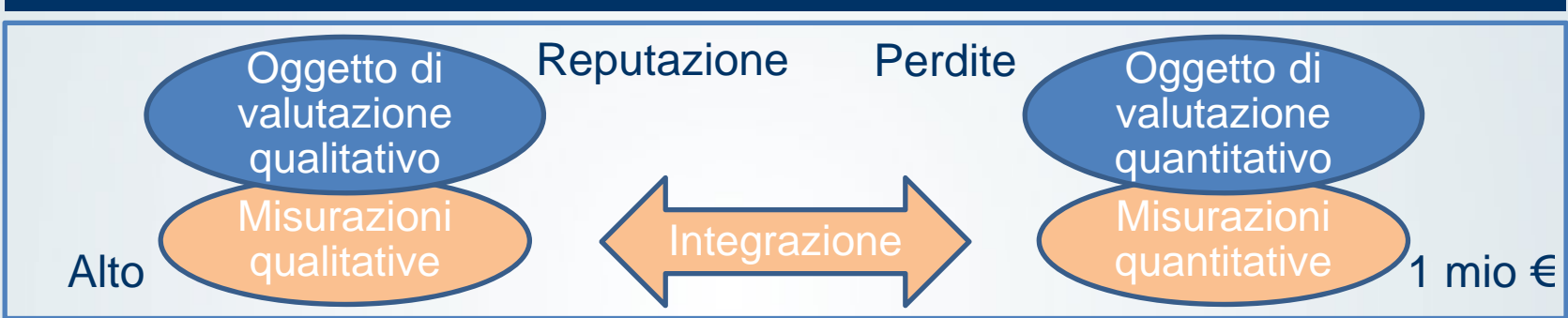
Quale accezione di rischio adottiamo?  
E' quello che vuole l'azienda?

# Le tassonomie



La scelta della tassonomia è coerente con le finalità strategiche del Risk Management?  
La tassonomia è in grado di discriminare efficacemente tra i fenomeni che deve classificare?  
La tassonomia è completa?

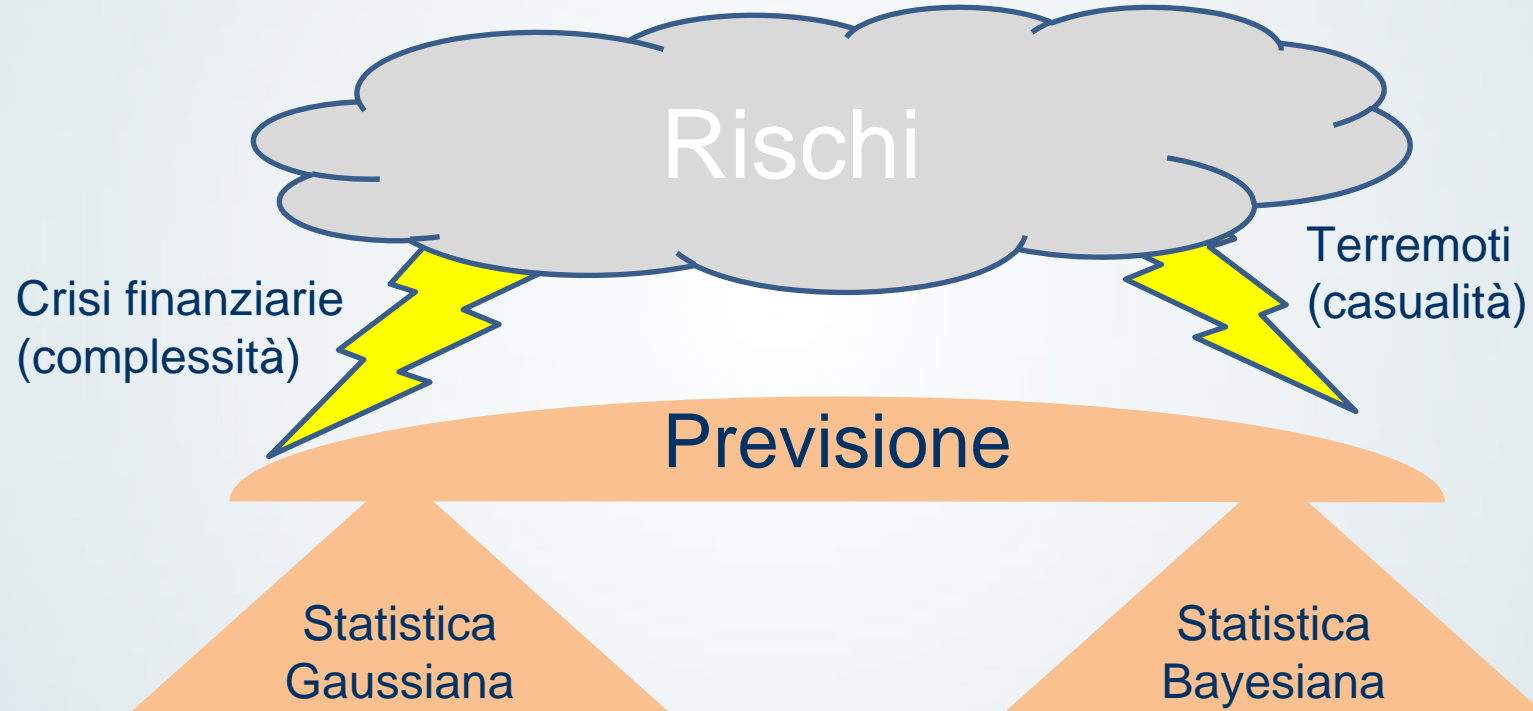
# Valutazioni qualitative o quantitative



Sappiano misurare tutti i rischi?  
 Sappiamo come integrare le diverse misure utilizzate? Siamo in grado di articolare le misure in funzione delle esigenze e dei costi della misura?

# Imprevedibilità e Incertezza

---

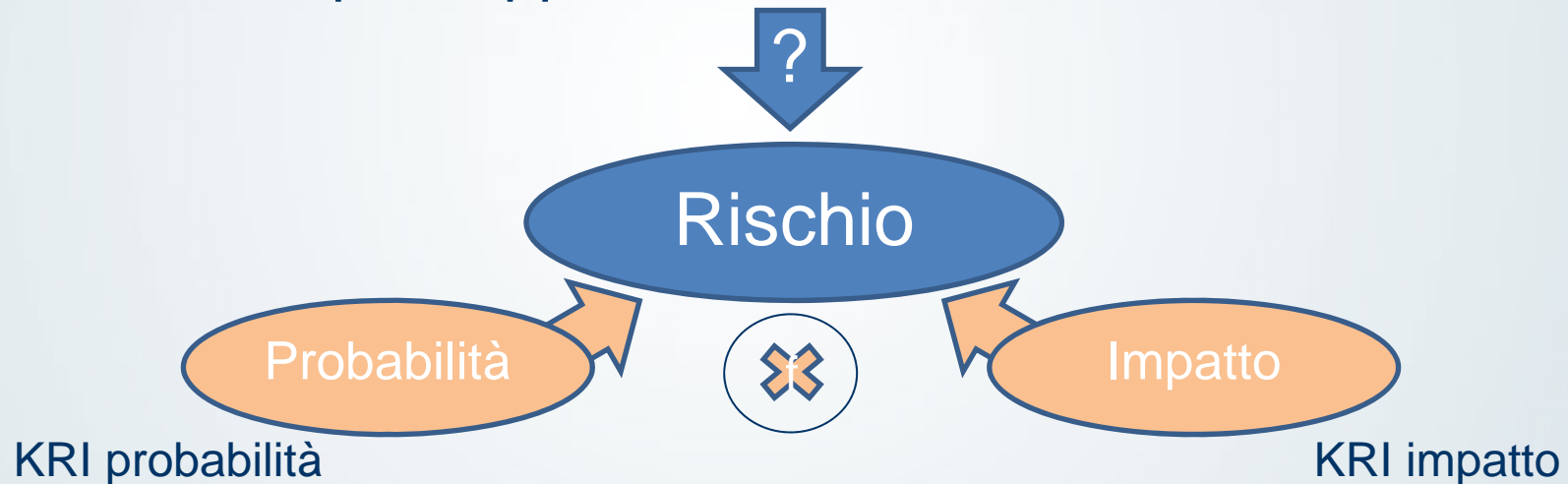


Sappiamo quantificare i rischi incerti e quelli imprevedibili?  
Sappiamo integrare le diverse misure?

# Probabilità, impatti e KRI

---

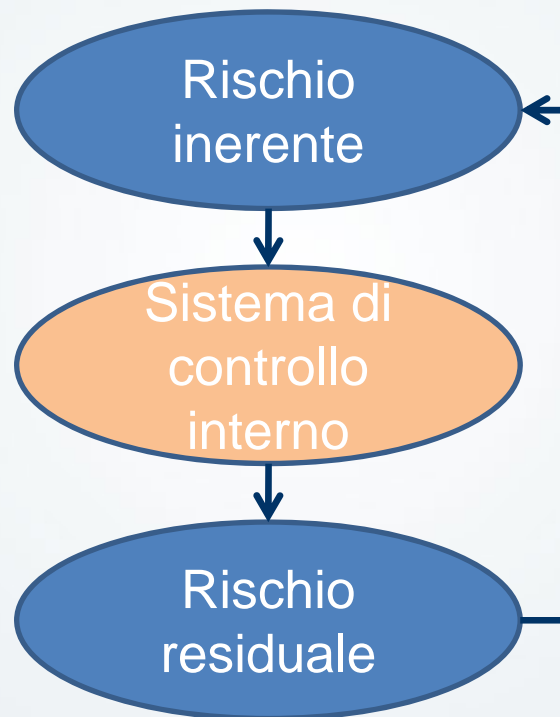
**Key Risk Indicator**  
per l'approssimazione del rischio



Abbiamo a disposizione dei KRI?  
Che cosa misurano?

# Rischi inerenti e Rischi residui

Difficoltà di misurazione diretta



Osservazione delle frequenze come stima delle probabilità

Misure di rischi e dei controlli non commensurabili



Frequenze:

- statisticamente dipendenti dallo SCI
- non rappresentative dei casi rari

Che cosa misura il nostro sistema di Risk Management?  
Le misure supportano le strategie di gestione del rischio economicamente sostenibili?

# Interdipendenza sistemica



Siamo in grado di identificare le ricadute sistemiche degli eventi di rischio?

Siamo in grado di misurare l'estensione delle ricadute e la loro evoluzione nel tempo?