

Corso di Laurea in
Economia dei Mercati e degli Intermediari Finanziari

CREDIT PORTFOLIO MANAGEMENT

Docente: Gianluca Mattarocci

Descrizione corso

CARATTERISTICHE

- N° crediti formativi: 6
- Totale incontri didattica frontale: 18
- Corsi di laurea: CLEMIF
- Tipologia esame: Opzionale
- Propedeuticità: Nessuna



DIDATTICA



Periodo: 8/04/2024 – 14/05/2024

	Lunedì	Martedì	Mercoledì
Ore	13.00-15.00	13.00-15.00	13.00-15.00



1 Maggio



2 Maggio



TOR VERGATA
UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI ROMA

DOCENTI

Docente del corso:
Gianluca Mattarocci

Teaching assistant
Luca Giordano

Testimonianze



TOR VERGATA
UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI ROMA

SITO INTERNET

Tutte le informazioni sono pubblicate nella pagina del corso



Gli studenti sono invitati ad iscriversi alla newsletter del corso per ricevere gli aggiornamenti sul corso e (eventualmente) sul ricevimento studenti



TOR VERGATA
UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI ROMA

PROGRAMMA

Le tematiche affrontate durante il Corso sono le seguenti:

- Intermediari finanziari e la mappatura dei rischi
- Le informazioni utilizzate per la valutazione del merito creditizio
- L'istruttoria di fido: caratteristiche e fasi
- Probability of default e modelli di valutazione
- LGD e rischio del processo di recupero
- L'EAD e le caratteristiche del finanziamento
- Regolamentazione e vincoli di portafoglio
- I sistemi di rating interno e il processo di validazione
- L'attività di vigilanza nel contesto dell'Banking Union: aspetti istituzionali ed esperienze applicative
- I rating esterni e le agenzie di rating
- La forbearance del portafoglio crediti
- I crediti non performing e la cessione da parte delle banche
- La valutazione dell'investimento nei crediti non performing: analisi di casi studio
- Il monitoraggio e i sistemi di early warning
- I criteri ESG nella valutazione del merito creditizio
- IFRS 9 Framework
- I derivati per la gestione del rischio di credito
- La risoluzione delle banche e gli strumenti di intervento

RIFERIMENTI BIBLIOGRAFICI



Resti A. e Sironi A., Rischio e valore nelle banche, Egea, Milano (aggiornamento 2021)

+

Altri materiali in pdf disponibili sul sito



TOR VERGATA
UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI ROMA

APPELLO

L'esame consiste in un colloquio orale e si articola in alcune domande aperte e un esercizio.

Nel caso degli esercizi la struttura della prova sarà coerente con gli esempi presentati e discussi durante le lezioni del corso

La prenotazione all'esame è obbligatoria.

DATE APPELLI

Sessione estiva

	Sessione	Prova orale
1° appello	Estiva	23-05-2024
2° appello	Estiva	13-06-2024
3° appello	Estiva	03-07-2024



COIL

Criteri di valutazione

- 1 punto per la frequenza
- Da 0 a 1 punto per la qualità del lavoro di gruppo
- Da 0 a 1 punto per la qualità della presentazione

Requisito: Inglese livello B2

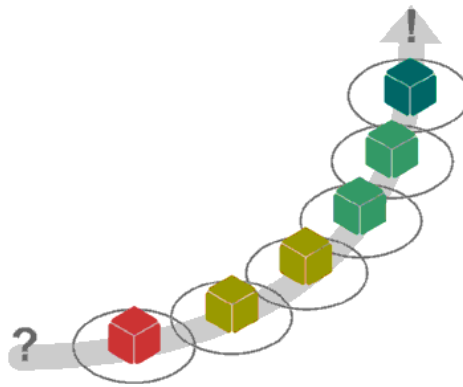


Data	Orario	Argomento
12 Aprile	12.00	Scadenza di registrazione
26 Aprile	13.30-15.30	Descrizione del caso studio e ice-breaking event
15 Maggio	12.00	Scadenza invio lavoro
17 Maggio	17.00-19.00	Presentazione dei lavori di gruppo



TOR VERGATA
UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI ROMA

TESI



Argomenti

Processo

Deadline



TOR VERGATA
UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI ROMA

Contatti

Gianluca Mattarocci

e-mail: gianluca.mattarocci@uniroma2.it

ID-Skype: [gianluca.mattarocci](https://www.skype.com/people/gianluca.mattarocci)

Office: Dipartimento di Management e Diritto

Stanza: 1B3/8

Ricevimento: Il ricevimento viene svolto via Skype e l'orario è pubblicato nella bacheca del corso

