



# **Risk Data management, rettifiche e tracciabilità**

*Un modello centralizzato e metadata driven*

Milano, 12 novembre 2019



# Risk Data Management

Rettifiche del dato – contesto iniziale e richieste del Risk Management

## Contesto iniziale

Motori di calcolo delle principali misure di rischio (c.d. **calcolatrici**) **indipendenti** ed **attestati** su **componenti applicativi / tecnologie dedicati**

**Approcci disomogenei e non completamente governati** al **Risk Data Management**, con particolare riferimento alla rettifica del dato

## Criticità

- **Mancata tracciabilità** delle operazioni di rettifica
- Rischi di **mancata compliance alle normative** previste dal Supervisore (es. BCBS239)
- **Governance** dei dati di rischio **poco robusta**
- Elevato **onere manutentivo**
- Difficoltà nella **ri-applicazione delle rettifiche** su periodi temporali differenti

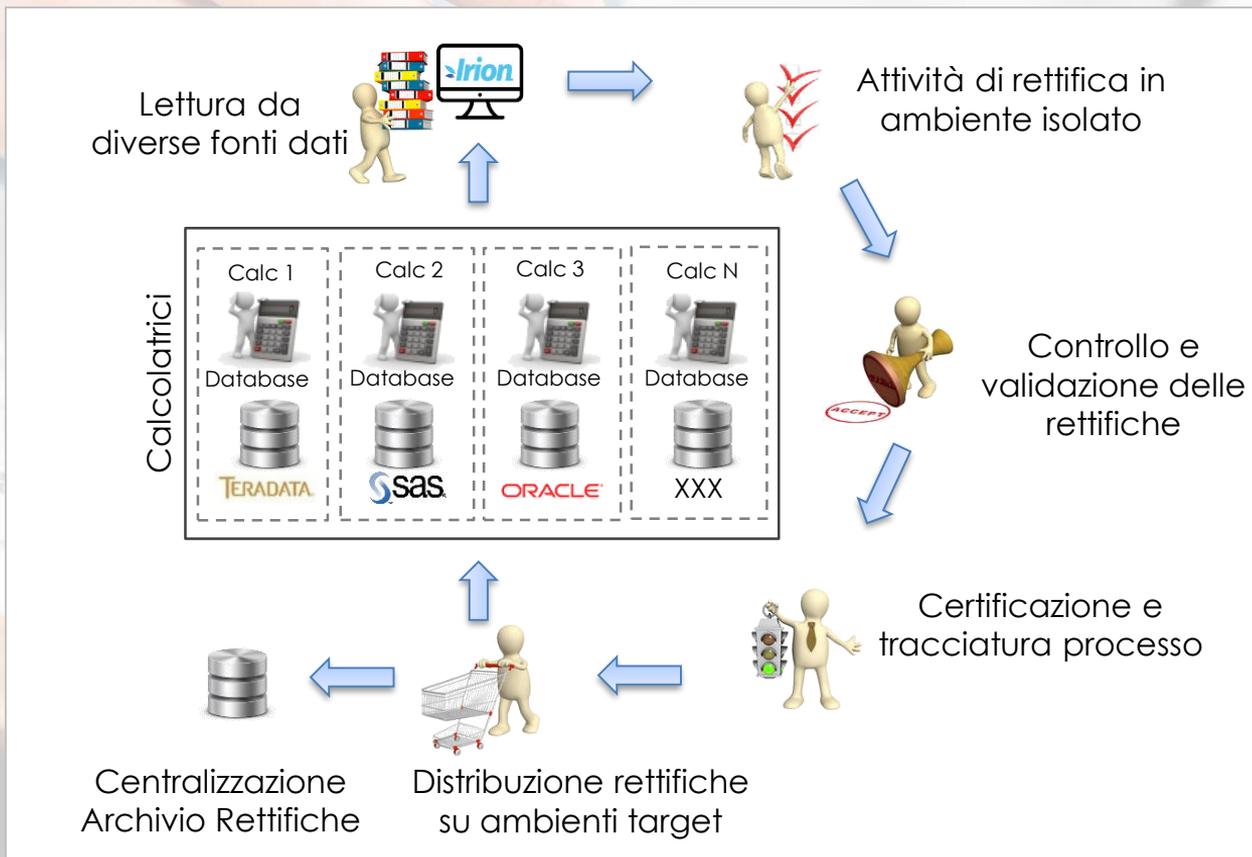
## Richieste

Definire un nuovo processo / strumento di gestione delle rettifiche, **centralizzato e applicabile a tutte le calcolatrici**, che:

- **Uniformi i processi** di Risk Data Management
- Garantisca **«documentabilità» e tracciabilità** delle rettifiche applicate
- Consentisca un adeguato **livello di flessibilità** nella gestione delle rettifiche, abilitando rettifiche sia puntuali che massive

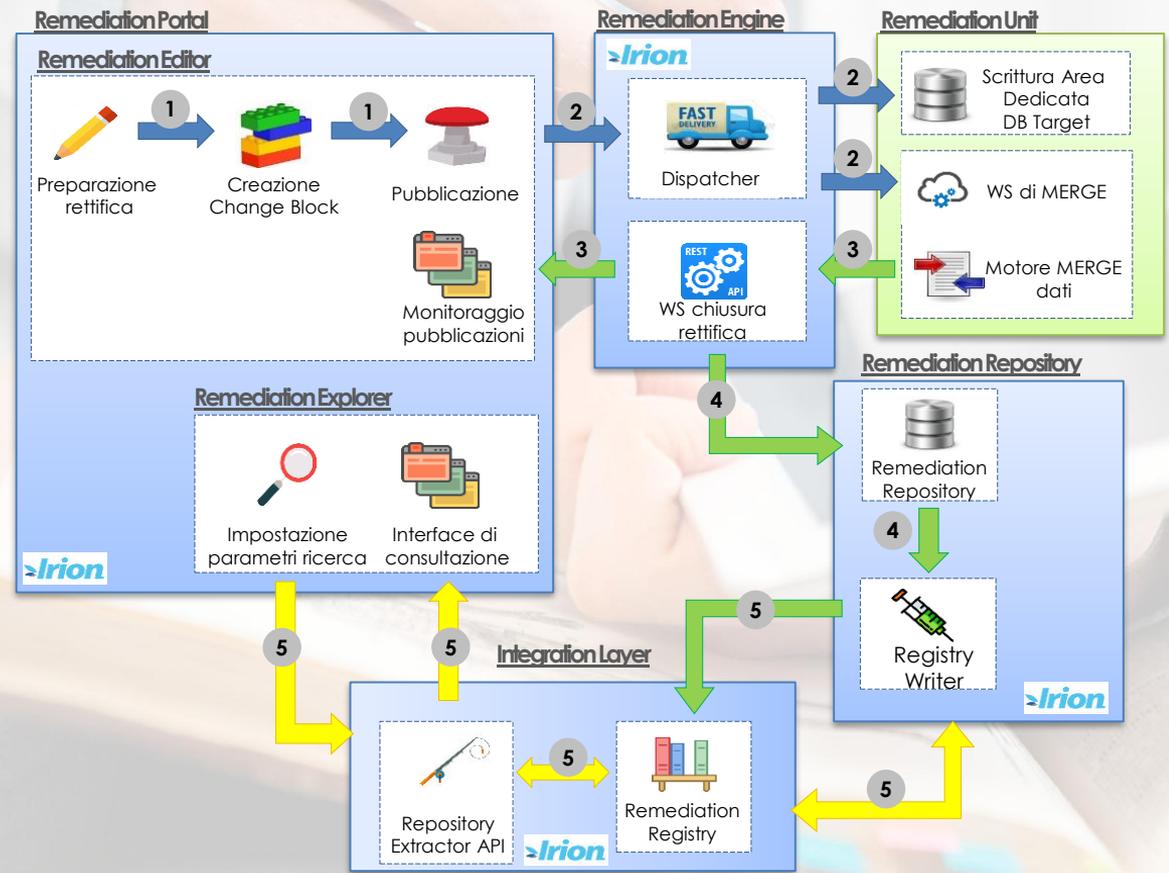
# Risk Data Management

Flusso di Lavoro



# Risk Data Management

## Architettura di riferimento



- 1 L'utente accede al Remediation Editor, effettua («virtualmente») la rettifica sulla tabella desiderata e conferma l'operazione pubblicandola.
- 2 Il Remediation Engine prende in carico la rettifica e la riversa su un'area dedicata del DB di destinazione. Il dispatcher invoca quindi il WS atto a scatenare la procedura di MERGE delle rettifiche sul sistema target.
- 3 Il motore di MERGE attua le rettifiche in ambiente produttivo. Ogni fase del processo di rettifica (dalla pubblicazione alla sua effettiva applicazione sul sistema target) è monitorabile real-time dall'utente mediante apposito quadro di controllo.
- 4 Il WS di chiusura attiva il Registry Writer che archivia sul Remediation Repository i dati oggetto di rettifica e i metadati tecnici e funzionali, utili ad agevolarne la successiva ricerca (per es. a fini audit.)
- 5 L'utente accede al Remediation Explorer ed effettua la ricerca di una rettifica. La API di estrazione restituisce alla consultazione:
  - tutti i dati inseriti, cancellati o aggiornati (in quest'ultimo caso, con possibilità di confronto tra la versione corrente e quella modificata.)
  - i metadati significativi che caratterizzano la rettifica (autore, data e ora della richiesta, eventuale giustificativo, ecc.)

# Risk Data Management

Risultati raggiunti e Prossimi Obiettivi

## Risultati Raggiunti

- Ottobre '18 → Remediation Repository attivo
- Dicembre '18 → Remediation Engine attivo
- Luglio '19 → Remediation Explorer attivo
- Settembre 2019 → Prima calcolatrice Risk Attivata (CRP2)

68 tab

> 500 tab

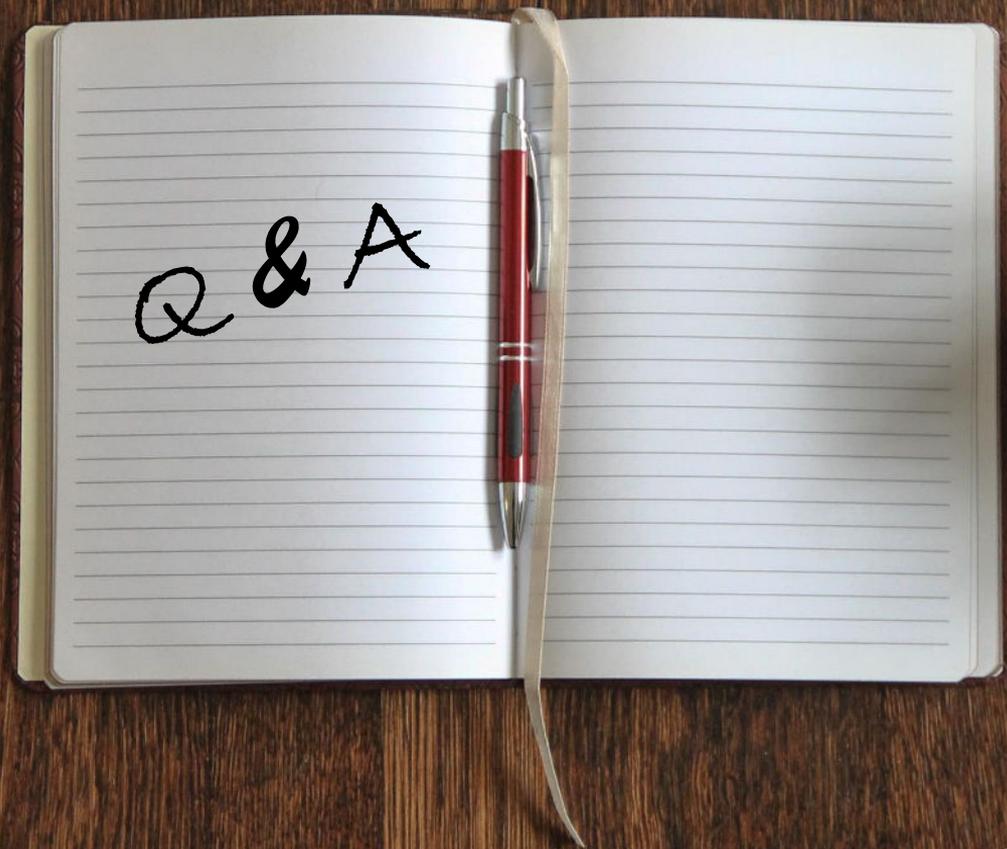
**Tempi medi elaborazione E2E**  
 (da pubblicazione, ad archiviazione sul Remediation Registry): **20' - 40'** per tabelle da **8 milioni di record**

## Prossimi Obiettivi

- 2019 → Calcolatrici CRMS HF e RRM attive
- 2020 → Calcolatrici ECAP e Stress test attive in produzione

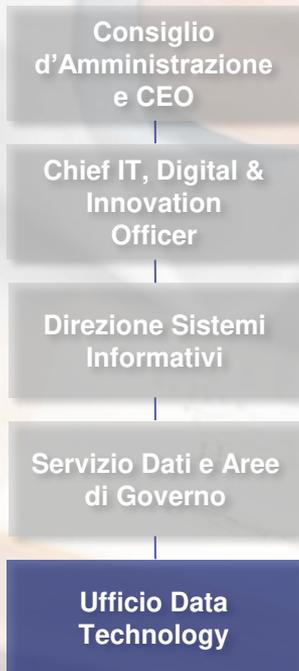
..... E sempre nel 2020 ...

**Estensione** della piattaforma di Rettifica centralizzata **ad altre realtà extra Risk Management: Rettifiche Big Financial Data**



# Lo speaker

## Ruolo in ISP & Riferimenti



### Silvia Caffi

**Mansione in ISP**

Resp. Uff. Data Technology (dal 2017)

**mobile**

(+39) 333 9305739

**email**

[silvia.caffi@intesasanpaolo.com](mailto:silvia.caffi@intesasanpaolo.com)

**LinkedIn**

<http://linkedin.com/in/silvia-caffi-236887150>

**address**

Corso Savona, 58 - 10024 Moncalieri (TO)