MODULI SPECIALISTICI PER IL RISK MANAGEMENT IN BANCA

RISCHI DI MERCATO, TASSO E SPREAD: EVOLUZIONI NORMATIVE, METODOLOGICHE, DI PROCESSO

11 e 12 luglio 2023 • Aula virtuale

Prima giornata • 11 luglio 2023

- **Le Linee Guida EBA per il controllo del rischio di tasso nel banking book**
- **I modelli per la misurazione del rischio di tasso nel banking book**
- **Il rischio di spread**
  - I differenti effetti del rischio di tasso e del rischio di spread.
  - Tecniche avanzate di Discounted Cash Flow Analysys
  - Misure di sensitivity alle oscillazioni degli spread
- **Integrazione del rischio di spread nel framework di misurazione dell' IRRBB**
  - Determinanti del rischio di spread del banking book
  - Le Linee Guida EBA per il controllo del rischio di spread
  - Effetti delle oscillazioni degli spread sul delta EVE e sul NII

Seconda giornata • 12 luglio 2023

- **Il controllo della liquidità nelle banche: framework, governance e processi**
- **Metriche regolamentari e modelli interni per la misurazione del rischio di liquidità**
- **Modelli stocastici per la misurazione del rischio di tasso**
  - Modelling di processi Normali e Log-normali
  - Processi di diffusione dei tassi d'interesse
  - Modelli per la simulazione di tassi negativi
  - Calcolo della distribuzione del delta EVE
  - Calcolo della distribuzione del NII su un orizzonte definito
- **L'interazione tra rischio di tasso, liquidità e rischio di spread nelle banche**
  - Market liquidity risk e funding liquidity risk in un contesto di rialzo dei tassi di mercato
  - La spirale tra rialzo dei tassi, liquidità e funding spread alla base delle crisi bancarie recenti
  - Strumenti per il presidio congiunto delle tre classi di rischio

Copyright © ABISERVIZI SpA. Tutti i diritti riservati. È proibita la riproduzione, anche parziale, in qualsiasi forma senza espresso permesso scritto di ABISERVIZI SpA. - Divisione ABIFormazione. Il ricevente è tenuto ad utilizzare il documento esclusivamente per esigenze di documentazione personale nell'ambito delle proprie esigenze lavorative; non può in alcun modo ridistribuire o comunicare a terzi le informazioni in esso presenti.