

MODULI SPECIALISTICI PER IL RISK MANAGEMENT IN BANCA

1° MODULO • Rischio di credito: le evoluzioni normative, metodologiche, di processo (27 e 28 giugno 2023)

2° MODULO • Rischi di mercato, di tasso e di liquidità: evoluzioni normative, metodologiche, di processo (11 e 12 luglio 2023)

Aula virtuale



1° MODULO • 27 e 28 giugno 2023

RISCHIO DI CREDITO: LE EVOLUZIONI NORMATIVE, METODOLOGICHE, DI PROCESSO

Prima giornata

- Il pricing dei crediti all'origine
- La valutazione dei crediti performing
- La valutazione dei crediti non performing
- Il controllo dell'azione di recupero

Seconda giornata

- I modelli strutturali per l'analisi del rischio di credito
- I modelli di portafoglio per calcolo del Credit Var e per lo stress-test sul credito
- I modelli di simulazione a supporto della NPL Strategy

2° MODULO • 11 e 12 luglio 2023

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

Prima giornata

- L'interazione tra rischio di tasso, liquidità e rischio di spread nelle banche
- 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

Seconda giornata

- Il rischio di spread
- Modelli stocastici per la misurazione del rischio di tasso
- Integrazione del rischio di spread nel framework di misurazione dell' IRRBB
- Il controllo della liquidità nelle banche