

Finanza e controllo dei rischi finanziari

Didattica interattiva con Excel®

Modelli per il controllo del rischio di tasso di interesse e del rischio di spread

1

Date: lun. 19, ven. 23, lun. 26 **febbraio** 2024 + ven. 1 **marzo** 2024 (*n.4 mattine*)

Orari: dalle ore 10.00 alle 13.00 (*3 h. ogni mattina*)

*Il presente corso dal taglio molto pratico e operativo tiene conto del **44-esimo aggiornamento della Circolare n. 285 del 17 dicembre 2013 "Disposizioni di vigilanza per le banche" - Modifica della disciplina sul rischio di tasso e di credit spread sul portafoglio bancario (IRRBB e CSRBB)***

Didattica

I modelli trattati durante il corso sono realizzati dal docente, su foglio di lavoro, e distribuiti ai partecipanti come materiale didattico per la revisione dei contenuti del corso e per lo studio successivo.

Le esercitazioni sui modelli di ALM dinamica saranno effettuate mediante il software **Dynamic IRBBB** per l'analisi del delta-EVE e del NII. A tal fine, ai partecipanti sarà fornita una demo del software valida per 6 mesi.

*Progetto e docenza: **Aldo LETIZIA***

Obiettivi

Il corso fornisce le competenze necessarie per l'analisi dei rischi e per la costruzione, la convalida e l'utilizzo di modelli avanzati per la misurazione del rischio di tasso d'interesse e per la misurazione del rischio di spread.

Destinatari

Responsabili e specialisti dei seguenti ambiti: risk management, pianificazione, internal audit e convalida di modelli interni.

Programma

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

- Metodologie per la misurazione del rischio di tasso di interesse nel banking book.
- Calcolo del delta EVE e del delta NII.
- Il Supervisory Outlier Test.
- Gli scenari di shock standardizzati.
- La valutazione del rischio di spread nel banking book.

I modelli per la misurazione del rischio di tasso nel banking book

- Funzionamento dei sistemi di asset and liability management.
- I modelli per il calcolo del delta valore.
- Metodologie per il calcolo del margine di interesse atteso.

Il rischio di spread

- Differenza tra rischio di tasso e rischio di spread.
- Tecniche avanzate di Discounted Cash Flow Analysis.
- Misure di sensitivity alle oscillazioni degli spread.

Modelli stocastici per la misurazione del rischio di tasso

- Modeling di processi Normali e Log-normali.
- Processi di diffusione dei tassi d'interesse.
- Modelli per la simulazione di tassi negativi.

Intergrazione del rischio di spread nel framework di misurazione dell'IRRBB

- Metodologia di simulazione del singolo scenario di tasso.
- La distribuzione del delta-valore del banking book.

Docente: Aldo LETIZIA

- Responsabile Risk Management, Banca Popolare Pugliese
- Docente al Master in Banking e Finance – Università La Sapienza
- Docente di Metodi Matematici per il Risk Management (2018-2022) – Dipartimento di Matematica e Fisica dell'Università del Salento.

Quota di partecipazione al corso:

**“Modelli per il controllo del rischio di tasso di interesse e
del rischio di spread”**

Euro 1.500 + 22% IVA

3

Per iscrizioni e ulteriori informazioni

Tel. 02.36577120 - email: informa@informabanca.it