



LA MISURAZIONE DEL RISCHIO DI TASSO DI INTERESSE SUL BANKING BOOK

9 aprile 2021

WEBINAR

Tutte le nostre iniziative del 2021 saranno **erogate esclusivamente in modalità videoconferenza**. Attestati di partecipazione e materiale didattico saranno inviati telematicamente e completamente a disposizione nel corso dell'iniziativa. Sarà possibile interagire con il docente e gli altri colleghi partecipanti comodamente dalla propria postazione

- ✚ Processo di controllo prudenziale (ICAAP)
- ✚ Esposizione al rischio di tasso di interesse
- ✚ Misurazione del rischio di tasso di interesse

DESTINATARI

Responsabili e addetti Area:

- Risk Management
- Segnalazioni di Vigilanza
- Audit, Controlli e Compliance

OBIETTIVI

Con il 32° aggiornamento della Circolare n. 285/13 della Banca d'Italia pubblicato il 21 aprile 2020, che riguarda principalmente la disciplina in materia di processo di controllo prudenziale (ICAAP), sono stati recepiti gli **orientamenti EBA in materia di gestione del rischio di tasso di interesse** derivante da attività diverse dalla negoziazione ("*Interest Rate Risk arising from the Banking Book*" o "*IRRBB*" - EBA/GL/2018/02).

Le modifiche introdotte riguardano principalmente:

- la rivisitazione della metodologia semplificata per il calcolo dell'**esposizione al rischio di tasso di interesse in termini di variazione del valore economico**
- l'applicazione degli **scenari di shock standardizzati** come definiti negli orientamenti EBA
- la **misurazione del rischio di tasso di interesse dal punto di vista degli utili**

Il corso, la cui finalità è quella di analizzare le modifiche introdotte dal richiamato 32° aggiornamento, prevederà anche la disamina delle implicazioni operative per la misurazione del rischio di tasso di interesse del *banking book*

CONTENUTI

9 aprile 2021 - ore 10:00/13:00

Alberico Francesco MANDRILLO

Partner

MACO PARTNERS

MISURAZIONE TASSO D'INTERESSE

- L'evoluzione normativa in materia di rischio di tasso di interesse del *banking book*
- Il processo di controllo prudenziale: l'applicazione del principio di proporzionalità ed il *supervisory outlier test*
- Le nozioni di "*duration finanziaria*" e di "*duration modificata*"
- La misurazione del capitale interno a fronte del rischio di tasso sul portafoglio bancario in termini di variazione del valore economico
- Gli scenari di shock standardizzati
- La misurazione dell'esposizione al rischio di tasso di interesse sul portafoglio bancario in termini di variazione del margine d'interesse



ORARIO

10:00 – 13:00

QUOTA

€ 490 + IVA

ADVANCED BOOKING

per iscrizioni entro il **15/03/2021**
applichiamo le seguenti riduzioni:

- **10%** di sconto per singola iscrizione
- **20%** di sconto per iscrizioni multiple,
da 2 a 4 partecipanti

Agevolazioni non cumulabili fra loro

Tutte le nostre iniziative 2021 saranno erogate **esclusivamente in modalità videoconferenza**. Attestati di partecipazione e materiale didattico saranno inviati telematicamente e completamente a disposizione nel corso dell'iniziativa. Sarà possibile interagire con il docente e gli altri colleghi partecipanti comodamente dalla propria postazione