

Roma
30 settembre 2011
Prot. AF/001853

Associati ABI

LORO SEDI

Alla cortese attenzione dei Responsabili delle aree o funzioni: Risk Management, Rischi e Controlli Interni, Tesoreria e ALM, Pianificazione e Controllo, Studi, Formazione.

Seminario

“TIT LIQUIDITY RISK E PREMI DI LIQUIDITÀ: LE NUOVE REGOLE E LE IMPLICAZIONI GESTIONALI”

**Milano, 18 ottobre 2011
ABI, Via Olona, 2**

Con gli aggiornamenti della Circolare n. 263/1996, la Banca d'Italia ha diffusamente modificato le prescrizioni in tema di gestione del rischio di liquidità da parte delle banche e dei gruppi bancari, prefigurando un sistema organico di principi e di obblighi volto ad orientare gli intermediari a un maggiore rigore nella gestione di tale rischio.

Nei mesi scorsi l'ABI ha elaborato un *paper*, curato dall'Ufficio Analisi e Gestione dei Rischi di ABI in collaborazione con Prometeia e con il Gruppo di Lavoro interbancario 'Liquidity TIT', finalizzato a illustrare le metodologie di determinazione dei TIT (Tassi Interni di Trasferimento) che i risk manager delle Banche sono chiamati a conoscere e utilizzare per rispondere efficacemente alle nuove richieste regolamentari. In particolare, il documento tratta la definizione dei TIT delle poste "comportamentali", la relazione tra TIT e pricing dei prodotti bancari, la relazione fra funzioni aziendali coinvolte nella definizione del modello dei TIT, il nucleo minimo di principi che un sistema di TIT deve soddisfare anche in una banca di piccole dimensioni.

A partire dal documento metodologico ABI, il seminario del 18 ottobre 2011 è finalizzato a presentare **la gamma di potenziali approcci metodologici e applicativi** che le banche possono implementare, anche con la presentazione di casi di applicazione delle metodologie da parte di alcune banche del Gruppo di Lavoro.

Inoltre, nell'ambito del seminario saranno trattati a più ampio spettro i temi correlati alle nuove regole sul rischio di liquidità e alle loro implicazioni gestionali. Tra i temi trattati:

- Liquidità e Mercati: quali *market parameters* e quali modelli
- L'inclusione dei premi di liquidità nei Tassi Interni di Trasferimento
- I TTT delle poste a vista e dei mutui
- I TTT (*cost of carry*) del portafoglio Titoli e Buffer di Liquidità
- Dal TIT *Liquidity Risk Adjusted* al Pricing dei Crediti
- L'applicabilità delle metodologie nelle Banche di differenti dimensioni

Il programma del seminario è disponibile sui siti www.abi.it e www.abiformazione.it

Trova allegato alla presente il modulo di partecipazione al seminario, comprensivo di dettagli su quota e modalità di iscrizione.

La invito a contattare per ogni ulteriore approfondimento in merito ABIFormazione, in particolare: Marco Pigliacampo, 06.6767.369; m.pigliacampo@abiformazione.it; Anna Massucci, 06.67.67.742; a.massucci@abiformazione.it.

Le aziende che hanno aderito ai fondi FONDIR (Avviso 03/11 – Voucher formativi) e Fondo Banche e Assicurazioni (Avviso 2/2011 - Piani Individuali) hanno la possibilità di iscrivere al seminario propri dirigenti, dipendenti e collaboratori a progetto accedendo ai finanziamenti per la formazione continua. Per informazioni su queste opportunità, è possibile rivolgersi ad Andrea Giuliattini 06.6767.227; a.giuliattini@abiformazione.it.

Nell'esprimere un sincero ringraziamento per l'attenzione che vorrà riservare all'iniziativa, l'occasione è gradita per porgere i migliori saluti.

Gianfranco Torriero

Direttore Centrale

Responsabile Direzione Strategie e Mercati

Finanziari

Codice AF10340

ALLEGATO: SCHEDA D'ISCRIZIONE

**TIT LIQUIDITY RISK E PREMI DI LIQUIDITÀ:
LE NUOVE REGOLE E LE IMPLICAZIONI GESTIONALI**

MILANO, 18 OTTOBRE 2011

PROGRAMMA

9.30	Introduzione ai lavori	Marco PIGLIACAMPO <i>Settore Sviluppo Competenze, ABIFORMAZIONE</i>
9.45	Scenario macroeconomico e impatti sulla liquidità	Lea ZICCHINO <i>Prometeia</i>
10.45	L'inclusione dei premi di liquidità nei Tassi Interni di Trasferimento	Luca FIAMMENGO <i>Prometeia</i>
11.30	<i>Coffee Break</i>	
11.45	Testimonianza aziendale: l'applicazione dei Tassi Interni di Trasferimento	Marco FRANCESCHINI <i>BANCO POPOLARE</i>
12.20	Testimonianza aziendale: l'applicazione dei TIT in una banca di piccole dimensioni	Massimiliano PELLEGRINI <i>BANCA POPOLARE DI VICENZA</i>
13.00	<i>Pausa pranzo</i>	
14.00	Il documento ABI prodotto dal Gruppo di Lavoro 'Liquidity TIT'	Claudia PASQUINI <i>Responsabile Ufficio Analisi e Gestione dei Rischi, ABI</i>
14.15	I TIT delle poste a vista e dei mutui	Pierluigi CORIAZZI <i>Prometeia</i>
15.00	Testimonianza: l'applicazione di un modello di TIT nel Gruppo UBI	Ivano TRAINA <i>UBI BANCA</i>
15.30	<i>Coffee Break</i>	
15.45	L'impatto di Basilea 3 sulle banche italiane: prime evidenze empiriche	Gabriele ASTOLFI <i>Prometeia</i>
16.15	Dal TIT liquidity risk adjusted al Pricing dei Crediti	Lorenzo BOCCHI <i>Prometeia</i>
17.00	Testimonianza: l'applicazione gestionale di un modello di TIT nell'ambito del Pricing degli impieghi Corporate del Gruppo BPER	Michele CAMPANARDI <i>BANCA POPOLARE EMILIA ROMAGNA</i>
17.30	<i>Chiusura dei lavori</i>	