

MODULI SPECIALISTICI PER IL RISK MANAGEMENT IN BANCA

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

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

Aula virtuale



1° MODULO • 27 e 28 giugno 2023

RISCHIO DI CREDITO: 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, TASSO E SPREAD: 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**