

Finanza e controllo dei rischi finanziari

Didattica interattiva con Excel®

I modelli per la misurazione del rischio di tasso di interesse e del rischio di spread sul banking book

1

Date: venerdì 23 e lunedì 26 maggio 2025

Orari: dalle ore 10.00 alle 13.00 e dalle 14.30 alle 17.30

Modalità: Corso in videoconferenza tramite "teams". Modalità interattiva.

Didattica

A fini didattici, le metodologie trattate sono applicate su foglio di lavoro e le cartelle Excel realizzate durante il corso sono distribuite come materiale didattico per la revisione dei contenuti e per lo studio successivo.

Per il calcolo del delta-EVE e del NII sul banking book, mediante approccio deterministico e stocastico, si fa uso del software **Dynamic IRBBB** che sarà successivamente fornito in demo ai partecipanti.

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

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 modelling dei cash flows comportamentali

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.

Il rischio di spread

- Differenza tra rischio di tasso e rischio di spread.
- Tecniche avanzate di Discounted Cash Flow Analysys.
- 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.
- Calcolo della distribuzione del delta EVE
- Calcolo della distribuzione del NII su un orizzonte definito

Integrazione 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,
- Amministratore Unico di MetricsLab s.r.l.,
- Docente a contratto di Metodi Matematici per il Risk Management – Dipartimento di Matematica e Fisica dell'Università del Salento,
- Docente al Master in Banking e Finance – Università La Sapienza.

Quota di partecipazione al corso:

Euro 1.500 + 22% IVA

Per iscrizioni e ulteriori informazioni

Tel. 02.36577120; e-mail: informa@informabanca.it