

Giornata formativa

IL 32° AGGIORNAMENTO DELLA CIRCOLARE N. 285/2013 DI BANCA D'ITALIA: le novità in materia di rischio di tasso, stress test e rischio di spread

20 MAGGIO 2020 • Incontro in aula virtuale



10.00 **IL FRAMEWORK REGOLAMENTARE IN EVOLUZIONE: il 32° AGGIORNAMENTO DELLA CIRCOLARE N. 285/2013 DI BANCA D'ITALIA**

- ▶ Gli impatti del recepimento degli:
 - Orientamenti EBA/GL/2018/02 in materia di gestione del rischio di tasso di interesse derivante da attività diverse dalla negoziazione (IRRBB)
 - Orientamenti EBA/GL/2018/04 relativi alle prove di stress degli enti
- ▶ Le modifiche ai capitoli della Circolare n. 285/2013
- ▶ La convergenza dell'attività dei Regolatori sul rischio di tasso

Maria Angiulli, Ufficio Studi **ABI - Associazione Bancaria Italiana**

11.00 **IL NUOVO FRAMEWORK REGOLAMENTARE PER LA MISURAZIONE DEL RISCHIO DI TASSO DI INTERESSE NEL BANKING BOOK (IRRBB)**

- ▶ Analisi operativa delle principali novità introdotte nella Circolare 285/2013
- ▶ Analisi di margine e analisi di valore: inquadramento generale e possibili approcci
- ▶ Revisione dell'approccio semplificato per la stima del rischio in termini di variazione del valore economico
- ▶ Il nuovo approccio semplificato in tema di variazione del margine di interesse
- ▶ Modelli interni avanzati per la misurazione e la gestione dell'IRRBB

Aldo Letizia, Responsabile Risk Management **Banca Popolare Pugliese**

13.00 *Pausa pranzo*

14.00 **LINEE EVOLUTIVE DI GOVERNO E ORGANIZZAZIONE DEI PROCESSI DI STRESS TESTING**

- ▶ Analisi operativa delle principali novità introdotte nella Circolare n. 285/2013
 - La programmazione degli stress test tra vantaggi e complessità operative
 - La validazione da parte del CdA
 - La struttura degli stress test secondo gli Orientamenti europei
- ▶ Le problematiche e i limiti degli attuali approcci allo stress testing
- ▶ Lo stress test da strumento regolamentare a strumento gestionale
- ▶ L'integrazione dei rischi e second round effect nello stress testing
- ▶ Il reverse stress testing

Giovanni Papiro, Group Risk Governance **ICCREA Banca**

15.30 **IL RISCHIO DI SPREAD NEL BANKING BOOK: IL FRAMEWORK REGOLAMENTARE METODOLOGIE DI ANALISI DEL RISCHIO RELATIVO ALLE VARIAZIONI DEI DIFFERENZIALI CREDITIZI (CREDIT SPREAD RISK)**

- ▶ Il credit spread risk nel banking book: analisi di margine e analisi di valore
- ▶ La sensitivity del valore delle attività e delle passività alle oscillazioni degli spread creditizi
- ▶ Tecniche di maturity gap management per il controllo del funding spread risk
- ▶ Altri indicatori di accumulo di credit spread risk nel banking book
- ▶ Strumenti per la gestione del rischio di spread

Aldo Letizia, Responsabile Risk Management **Banca Popolare Pugliese**

17.00 *Chiusura dei lavori*