

Assosim è lieta di presentarvi il corso di



MISURA E GESTIONE DEI RISCHI NELLE BANCHE

6 – 7 - 8 NOVEMBRE 2023

dalle 09.00 alle 17.30

RELATORI:

Alessio Seresini - Intesa Sanpaolo - IMI CIB

Pasqualina Porretta - Università degli Studi di Roma "La Sapienza"

Enrico Piccolini - Generali Insurance Asset Management

Cristiano Bonisoli - Banco BPM

Carlo De Bernardi - Banco BPM

MACRO-ARGOMENTO:

Back Office, Regulation, Risk mgmt/ALM

DESTINATARI:

Back Office, Compliance, Risk Manager, Trader/Sales



DESCRIZIONE DEL CORSO

Il controllo e la gestione proattiva dei rischi generati dallo svolgimento delle varie attività bancarie costituiscono oggi, oltre che un obbligo regolamentare, anche un vero e proprio asset gestionale. Apprendere le tecniche di misurazione e valutazione delle varie tipologie di rischio utilizzate da un Ente, significa infatti conoscerne i punti di forza ed i fattori di debolezza. A tale fine vengono dunque proposte tre giornate sul tema - fruibili anche selezionando singoli moduli di interesse - durante le quali saranno analizzati i tre rischi regolamentari di “primo pilastro”, quello di credito, di mercato ed operativo ed introdotti i principi fondamentali di Asset & liability Management secondo il programma che segue:

- 1° giorno: Rischio di credito: classificazione, impatti gestionali ed evoluzione dei ratios patrimoniali;
- 2° giorno: Rischio di mercato e rischio operativo: evoluzione delle tecniche di misurazione e di mitigazione;
- 3° giorno: Rischio e ALM – metriche a presidio del rischio di tasso e di liquidità.

CONCETTI BASE

- Rischio di credito e controparte: tipologie, limiti, tecniche di mitigazione, evoluzione dei requisiti patrimoniali;
- Rischio mercato: tipologie, limiti, concetti chiave sulle metriche di misurazione (VAR, Expected Shortfall, holding period), requisiti patrimoniali negli accordi di Basilea;
- Rischio operativo: tipologia, mitigazione, requisiti patrimoniali;
- ALM e liquidità: gestione della trasformazione delle scadenze, tecniche, metriche e modalità di gestione.

OBIETTIVI:

- Analisi delle principali tipologie di rischio
- Disamina delle relative tecniche di misurazione
- Comprensione delle modalità di mitigazione dei rischi





ASSOCIAZIONE INTERMEDIARI
MERCATI FINANZIARI - ASSOSIM

Per iscrizioni o per ricevere maggiori informazioni contattare la
Segreteria Assosim ai seguenti recapiti:

e-mail: assosim@assosim.it

telefono: 02 86454996

