

Gestione della liquidità e del rischio tasso nel settore bancario

Periodo del corso	Dal 9 al 16 dicembre 2025
Durata	12 Ore
Erogazione	In aula
Edizione	XVII Edizione
Livello	Avanzato
Termine iscrizioni	14/11/2025

Data ultimo aggiornamento: 17/06/2025

La gestione della tesoreria richiede competenze ampie, non solo di tipo finanziario. Le sfide sono innumerevoli e vanno affrontate con flessibilità e buon senso, nel rispetto dei dettami regolamentari, del contesto di riferimento e della Corporate Governance. In questo scenario la misurazione e la gestione del rischio tasso e di liquidità occupano un ruolo cruciale per assicurare redditività o addirittura sopravvivenza alla banca. Con l'introduzione di un indice di liquidità a breve termine (Liquidity Coverage Ratio - LCR) e di un indicatore di liquidità strutturale (Net Stable Funding Ratio) Basilea 3 prevede regole nuove e più stringenti. La circolare FINMA sulla liquidità richiede inoltre un rendiconto sugli indici di determinazione del LCR e requisiti qualitativi concernenti la gestione del rischio di liquidità, differenziati a seconda della tipologia, dell'entità, della complessità e del livello di rischio della banca.

Il corso affronta tutte le tematiche sopra menzionate con un approccio ricco di esempi e applicazioni.

Obiettivi del corso

Al termine del corso il partecipante è in grado di:

- delineare il contesto regolamentare di riferimento
- identificare, misurare e monitorare i rischi di tasso di interesse e di liquidità
- applicare un approccio critico verso le diverse metodologie di gestione esistenti di tali rischi

Il corso si rivolge a

Revisione interna

Risk management/Risk control

Trading/Tesoreria/Sala mercati

Tematiche trattate

Governance / Risk / Compliance

Costi

CHF 1440 ~~CHF 1224~~ (Early Booking valido fino al 24/10/2025)

Periodo

9/12/2025, 8.30 - 17.00

16/12/2025, 13.30 - 17.00

Programma

1. Il rischio tasso d'interesse – Asset and Liability Management a livello di bilancio bancario
2. Analisi e misurazione del rischio di liquidità a breve termine e a medio/lungo termine (strutturale)
3. Stress testing
4. Pricing del rischio di liquidità
5. Costo della liquidità nei tassi interni di trasferimento
6. Aspetti regolamentari sul rischio di liquidità: Basilea 3 e normativa svizzera
7. Casi pratici

Interventi

DOCENTI:

Maria Ciorciari: MAS, FRM, SCR, Global Head of Enterprise Risk, ALM & Liquidity Risk, EFG Bank, Lugano

Michele Framba: Principal Financial Risk Management, Prometeia SpA, Milano

Contatto

Nicola Donadio

ndonadio@csvn.ch

091 961 65 20

© Fondazione Centro Studi Villa Negroni, tutti i diritti riservati