

**AIFIRM**  
**COMMISSIONE “IL MOC NEI MODELLI IRB”**  
**I RIUNIONE – TORINO, 10 OTTOBRE 2017**

La discussione del gruppo di lavoro ha seguito la traccia rappresentata nella presentazione allegata.

È stato innanzitutto presentata, da parte dei coordinatori della Commissione, una descrizione del problema che si intende affrontare, illustrando in particolare i riferimenti normativi alla base.

È seguita una discussione aperta tra i partecipanti, che hanno evidenziato come il quadro frammentario della normativa si rifletta anche nei processi di interlocuzione già intrattenuti con i supervisors e, conseguentemente, negli approcci finora presi in considerazione dalle diverse banche. È stato manifestato un generale interesse ad approfondire la tematica, al fine di definire una posizione condivisa da parte dell’Industry.

Il prof. Varetto ha successivamente illustrato sinteticamente i possibili approcci al tema già sviluppati in ambito accademico, sottolineando la complessità dell’argomento e la necessità di ricercare un compromesso tra l’accuratezza metodologica e la semplicità realizzativa.

Il gruppo di lavoro ha concordato di organizzare i lavori come descritto nella tavola allegata, con l’obiettivo di sottoporre al Consiglio dell’AIFIRM una proposta di Position Paper nell’ultimo trimestre 2018.

La prossima riunione sarà convocata per gennaio 2018.

**Franco Varetto**  
**Silvio Cuneo**



Commissione  
AIFIRM MOC - I riun