

Giornate formative

“ICAAP, ILAAP, RECOVERY E RESOLUTION PLAN, STRESS TESTING”

Confronto e verifica per gli adempimenti 2024, implementazione del framework integrato e prospettive

6 e 7 marzo 2024 • Aula virtuale



Prima giornata • 6 marzo 2024 (10.00 - 16.00)

► ANALISI DI CONTESTO ED EVOLUZIONE DEL FRAMEWORK REGOLAMENTARE

- Evoluzione del contesto e rischi emergenti
- Le priorità della Vigilanza per il 2024-2025
- Gli aggiornamenti normativi in tema di rischio di tasso di interesse e rischio di spread
- Integrazione del rischio ICT nel framework di risk management
- Integrazione dei rischi climatici e ambientali nel framework di credit risk management: dove siamo
- Gestione della liquidità dopo la scadenza del TLTRO

Elisabetta Tisato, Partner **Deloitte**

Alessandra Mazziotti, Director **Deloitte**

► ELEMENTI PER L'IMPLEMENTAZIONE DI UN FRAMEWORK INTEGRATO DI GESTIONE DEI RISCHI: INTERCONNESSIONI, REPORTING INTERNO E NUOVE COMPETENZE

- Pianificazione e processi di risk assessment: quali interconnessioni
- Come migliorare l'integrazione tra strategie, RAF, ICAAP, ILAAP e Recovery Plan: l'impiego di modellistica e stress testing
- Tradurre informazioni granulari e tecniche in report sintetici e fruibili ai risk takers: quali competenze del risk management per comunicare in modo efficace con gli Organi Aziendali

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

► RISK DIGITAL STRATEGY: COSTRUIRE IL RISK MANAGEMENT DEL FUTURO

- Le sfide per il Risk Management derivanti dall'evoluzione tecnologica
- Gli elementi per l'impostazione di una strategia efficace: key pillars, cultura digitale e skills, target state

Domenico Fileppo, Executive Director - Group Head of Operational, IT & Cyber Risk Management Department **Intesa Sanpaolo**

Vincenzo Cosenza, Partner Deloitte Risk Advisory - Simone Francesia, Director **Deloitte Risk Advisory**

► LA GESTIONE DEL PROCESSO ICAAP: INTEGRAZIONE DEI RISCHI EMERGENTI E IMPATTI DELLA REGOLAMENTAZIONE

► I FATTORI DI RISCHIO CLIMATICI E AMBIENTALI

- Le analisi di scenario climatico e le stime dei rischi climatici scenario-based
- L'introduzione dei rischi climatici nell'ICAAP: l'integrazione del capitale economico
- Il climate stress testing: impatti sulle controparti NFC e garanzie immobiliari

Giovanni Papiro, Partner **ValueCube**

► I RISCHI DI TASSO D'INTERESSE E DI SPREAD

Amamou Raschid, Manager **Deloitte Risk Advisory**

► ICT RISK, RISCHIO TERZE PARTI, CYBER STRESS TEST

Ivan Comunale, Partner Digital Risk Area **Deloitte**

16.00 *Fine lavori prima giornata*



Seconda giornata • 7 marzo 2024 (10.00 - 16.00)

► **LA GESTIONE DEL PROCESSO ILAAP DOPO LA SCADENZA DEL TLTRO: STRATEGIE DI FUNDING**

Elisabetta Tisato, Partner **Deloitte**

Rodolfo Dozio, Head of ALM & Liquidity **Mediobanca**

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

Benedetta Vitale, Responsabile Risk Models & Methodologies, Financial Risks, Liquidity & Interest Rate Risks **BANCO BPM**

► **RESOLUTION PLAN E RECOVERY: LE PRIORITA' DELL'AUTORITA' IN AMBITO RESOLUTION PLAN E GLI APPROCCI METODOLOGICI E OPERATIVI SEGUITI DALLE LSI**

Marisa Friaglia, BSH Risk Governance & Regulatory Reporting Risk Management **Banca Sella**

Federico Vezzino, Director Risk Advisory **Deloitte**

FOCUS OPERATIVI E TREND SU TEMATICHE EMERGENTI:

► **LA STIMA DEL MARGINE DI INTERESSE ATTESO NELL'AMBITO DEI SUPERVISORY OUTLIER TEST PREVISTO DAGLI ORIENTAMENTI EBA**

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

► **LE STIME DEI RISCHI CLIMATICI NEL PILLAR 3 REPORTING ESG E NEL RAF**

- Analisi dei primi due giri di reporting dei dati di Pillar 3 ESG
- Sinergie nell'integrazione tra RAF Dashboard e Pillar 3 Reporting nella scelta degli indicatori
- Collegamenti tra climate stress test e calibrazione delle soglie degli indicatori RAF

Giovanni Papiro, Partner **ValueCube**

► **LA GOVERNANCE TRA PRESENTE E FUTURO – L'INTEGRAZIONE DELLA RISK CULTURE NEI PROCESSI AZIENDALI**

- La Risk culture nell'ambito delle Attività di Vigilanza – linee guida e aspettative
- L'importanza della diffusione della cultura del rischio
- Il Risk management del futuro contribuisce attivamente alla diffusione della Risk culture
- Potenziali approcci per la definizione di un Framework di Risk Culture, definizione della maturità delle Banche e monitoraggio

Edoardo Faletti, Responsabile Enterprise Risk Management **Banco BPM**

► **PUNTI APERTI E PROSPETTIVE FUTURE DEI SISTEMI DI CONTROLLO DEI RISCHI NELLE BANCHE**

Federico Vezzino, Director Risk Advisory **Deloitte**

16.00 *Fine lavori*