

**GESTIRE I RISCHI.  
GUARDARE LONTANO.**



# AGENDA

**21 | 22 GIUGNO 2022**  
**MILANO**

Live streaming su <https://basilea.abieventi.it>

 **#abisupervision**

[basilea.abieventi.it](https://basilea.abieventi.it)



Promosso da

**ABI** Associazione  
Bancaria  
Italiana

Organizzato da

**ABISERVIZI** 

In collaborazione con

**dipo**  
database italiano per le operative

Media Partner

**BANCAFORTE**  
innovation key

21 | 22 GIUGNO 2022

**SUPERVISION  
 RISKS &  
 PROFITABILITY**

MILANO, CENTRO CONGRESSI BEZZI BANCO BPM  
 Live streaming su <https://basilea.abieventi.it>

**MARTEDI' 21 GIUGNO/TUESDAY 21 JUNE | MATTINA/MORNING**

**PLENARIA DI APERTURA OPENING PLENARY SESSION (9.00 – 10.15)**

**Il presidio dei nuovi rischi: instabilità politica, inflazione, politiche monetarie e fiscali, clima e ambiente, digitalizzazione e fintech: la prospettiva dei supervisors**

*The monitoring of new risks: political instability, inflation, monetary and fiscal policy, climate and environment, digitalisation and fintech: the supervisors' perspective*

Chair: Marco Ferrando, Il Sole 24 Ore

10.15 - 10.45 | Break e networking / Break and networking

**TAVOLA ROTONDA / ROUND TABLE (10.45 – 12.30)**

**Il presidio dei nuovi rischi: instabilità politica, inflazione, politiche monetarie e fiscali, clima e ambiente, digitalizzazione e fintech: la prospettiva dei consulenti**

*The monitoring of new risks: political instability, inflation, monetary and fiscal policy, climate and environment, digitalisation and fintech: the consultants' perspective*

Chair: Marco Ferrando, Il Sole 24 Ore

**RENATO MAINO LECTURE (12.30 – 13.00)**

Tensie Whelan, Director of the Centre for Sustainable Business Stern School of Business

1.00 - 2.00 pm | Break e networking / Break and networking

**MARTEDI' 21 GIUGNO/TUESDAY 21 JUNE | POMERIGGIO/AFTERNOON**

**SESSIONI PARALLELE / PARALLEL SESSIONS (2.00 – 3.30 PM)**

PARALLEL SESSIONS 1.1	<p>L'attuazione delle linee guida EBA LOM: un'occasione per rivedere i processi creditizi?  <i>Implementation of the EBA LOM guidelines: an opportunity to review credit processes?</i></p> <p>Chair: Giacomo De Laurentis, Università Bocconi</p>
PARALLEL SESSIONS 1.2	<p>La disciplina EBA su interest rate e credit spread risk per il banking book  <i>EBA regulations on interest rate risk and credit spread risk for the banking book</i></p> <p>Chair: Mario Anolli, Università Cattolica del Sacro Cuore</p>
PARALLEL SESSIONS 1.3	<p>L'evoluzione degli stress test regolamentari  <i>The evolution of regulatory stress tests</i></p> <p>Chair: Simona Cosma, Università del Salento</p>

3.30 – 3.45 pm | Break e networking / Break and networking

21 | 22 GIUGNO 2022

**SUPERVISION  
 RISKS &  
 PROFITABILITY**

MILANO, CENTRO CONGRESSI BEZZI BANCO BPM  
 Live streaming su <https://basilea.abieventi.it>

**SESSIONI PARALLELE / PARALLEL SESSIONS (3.45 – 5.15 PM)**

PARALLEL SESSIONS 2.1	<p>I modelli di rating ed i processi creditizi tra rinnovate esigenze gestionali e nuovi perimetri regolamentari (EBA-GL LOM e CRR3/CRD6)  <i>Rating models and credit processes: renewed management needs and new regulatory perimeters (EBA-GL LOM and CRR3/CRD6)</i></p> <p>Chair: Giacomo De Laurentis, Università Bocconi</p>
PARALLEL SESSIONS 2.2	<p>I rischi di secondo pilastro e il framework del model risk  <i>Pillar 2 risks and the model risk framework</i></p> <p>Chair: Simona Cosma, Università del Salento</p>
PARALLEL SESSIONS 2.3	<p>Banche nell'era post AMA e il trasferimento assicurativo del rischio operativo  <i>Banks in the post-AMA era and the operational risk's insurance transfer</i></p> <p>Chair: Alessandra Tanda, Università di Pavia</p>

**MERCOLEDÌ', 22 GIUGNO/WEDNESDAY, 22 JUNE | MATTINA/MORNING**

**SESSIONI PARALLELE / PARALLEL SESSIONS (9.30 – 11.00)**

PARALLEL SESSIONS 3.1	<p>Rischi ed opportunità di settore e di filiera  <i>Sector and supply chain risks and opportunities</i></p> <p>Chair: Franco Fiordelisi, University of Essex &amp; Università di Roma Tre</p>
PARALLEL SESSIONS 3.2	<p>La priorità dell'SSM 2022-2024 per far emergere in salute le banche dalla pandemia  <i>The SSM 2022-2024 priority is for banks to emerge from the pandemic in good health</i></p> <p>Chair: Marina Brogi, Sapienza Università di Roma</p>
PARALLEL SESSIONS 3.3	<p>L'impatto della pandemia sui rischi operativi  <i>The impact of the pandemic on operational risks</i></p> <p>Chair: Paolo Prandi, Università degli Studi di Teramo</p>

11.00 - 11.30 | Break e networking / Break and networking

21 | 22 GIUGNO 2022

**SUPERVISION  
 RISKS &  
 PROFITABILITY**

MILANO, CENTRO CONGRESSI BEZZI BANCO BPM  
 Live streaming su <https://basilea.abieventi.it>

**SESSIONI PARALLELE / PARALLEL SESSIONS (11.30 – 1.00 PM)**

PARALLEL SESSIONS 4.1	<p>La credit opinion della funzione di risk management secondo le EBA-GL LOM  <i>The credit opinion of the risk management function according to the EBA-GL LOM</i></p> <p>Chair: Alessandro Carretta, Università di Roma Tor Vergata</p>
PARALLEL SESSIONS 4.2	<p>Le priorità SSM 2022-2024: affrontare i rischi emergenti, inclusi i rischi climatici  <i>SSM 2022-2024 priorities: tackling emerging risks, including climate-related and environmental risks</i></p> <p>Chair: Marina Brogi, Sapienza Università di Roma</p>
PARALLEL SESSIONS 4.3	<p>Le nuove sfide della CRR3/CRD6  <i>The new challenges of CRR3/CRD6</i></p> <p>Chair: Franco Fiordelisi, University of Essex &amp; Università di Roma Tre</p>

1.00 - 2.00 pm | Break e networking / Break and networking

**MERCOLEDÌ, 22 GIUGNO/WEDNESDAY, 22 JUNE | POMERIGGIO/AFTERNOON**

**SESSIONI PARALLELE / PARALLEL SESSIONS (2.00 – 3.30 PM)**

PARALLEL SESSIONS 5.1	<p>Le priorità 2022-24 della BCE e le nuove regole “fit-and-proper” della CRR3/CRD6  <i>ECB 2022-24 priorities and the new “fit-and-proper” CRR3/CRD6 rules</i></p> <p>Chair: Alessandro Carretta, Università di Roma Tor Vergata</p>
PARALLEL SESSIONS 5.2	<p>Il criterio di proporzionalità nelle EBA-GL LOM  <i>The proportionality criterion in EBA-GL LOM</i></p> <p>Chair: Rosa Coccozza, Università degli Studi di Napoli</p>
PARALLEL SESSIONS 5.3	<p>Rischi Operativi e Climate Change  <i>Operational risks and Climate Change</i></p> <p>Chair: Marco Giorgino, Politecnico di Milano</p> 

21 | 22 GIUGNO 2022

**SUPERVISION  
RISKS &  
PROFITABILITY**

MILANO, CENTRO CONGRESSI BEZZI BANCO BPM  
Live streaming su <https://basilea.abieventi.it>

**MARTEDI' 21 GIUGNO/TUESDAY 21 JUNE | MATTINA/MORNING**

8.30 - 9.00 | **Accredito e collegamento dei partecipanti / Registration and link-up of participants**

**PLENARIA DI APERTURA/OPENING PLENARY SESSION (9.00 – 10.15)**

**IL PRESIDIO DEI NUOVI RISCHI: INSTABILITÀ POLITICA, INFLAZIONE, POLITICHE MONETARIE E FISCALI, CLIMA E AMBIENTE, DIGITALIZZAZIONE E FINTECH: LA PROSPETTIVA DEI SUPERVISORS**  
**THE MONITORING OF NEW RISKS: POLITICAL INSTABILITY, INFLATION, MONETARY AND FISCAL POLICY, CLIMATE AND ENVIRONMENT, DIGITALISATION AND FINTECH: THE SUPERVISORS' PERSPECTIVE**

Chair: **Marco Ferrando**, Caporedattore Finanza **Il Sole 24 Ore**

9.00 **Giovanni Sabatini**, Direttore Generale **ABI**

**Riforme e investimenti: il ruolo dell'Europa, dei governi, delle imprese, delle banche e dei mercati**

**Mario Nava**, Director General Directorate General for Structural Reform Support **European Commission**

**Giuseppe Siani**, Capo del Dipartimento Vigilanza Bancaria e Finanziaria **Banca d'Italia**

10.15 - 10.45 | **Break e networking / Break and networking**

**TAVOLA ROTONDA / ROUND TABLE (10.45 – 12.30)**

**IL PRESIDIO DEI NUOVI RISCHI: INSTABILITÀ POLITICA, INFLAZIONE, POLITICHE MONETARIE E FISCALI, CLIMA E AMBIENTE, DIGITALIZZAZIONE E FINTECH: LA PROSPETTIVA DEI CONSULENTI**  
**THE MONITORING OF NEW RISKS: POLITICAL INSTABILITY, INFLATION, MONETARY AND FISCAL POLICY, CLIMATE AND ENVIRONMENT, DIGITALISATION AND FINTECH: THE CONSULTANTS' PERSPECTIVE**

Chair: **Marco Ferrando**, Caporedattore Finanza **Il Sole 24 Ore**

10.45 **Giorgio Costantino**, Executive Director Global Transformation Services **CRIF**

**Andrea Partesotti**, Managing Director, Head of Enterprise Risk Management Area **Prometeia**

**Pietro Penza**, Partner **PwC Italia**

**Giovanni Pepe**, Partner **KPMG Advisory**

**Giuseppe Quaglia**, Partner, Financial Services Risk Management Italy Leader **EY**

**Fabrizio Sarrocco**, Functional Consulting Lead Italy, Central Europe & Greece **Accenture**

**RENATO MAINO LECTURE (12.30 – 1.00)**

**Monetizing the business case for corporate sustainability and ESG investing**  
**Tensie Whelan**, Director of the Centre for Sustainable Business **Stern School of Business**

1.00 - 2.00 pm | **Break e networking / Break and networking**

21 | 22 GIUGNO 2022

**SUPERVISION  
RISKS &  
PROFITABILITY**

MILANO, CENTRO CONGRESSI BEZZI BANCO BPM  
Live streaming su <https://basilea.abieventi.it>

**MARTEDI' 21 GIUGNO / TUESDAY 21 JUNE | POMERIGGIO / AFTERNOON**

**SESSIONI PARALLELE / PARALLEL SESSIONS (2.00 – 3.30)**

**L'ATTUAZIONE DELLE LINEE GUIDA EBA LOM: UN'OCCASIONE PER RIVEDERE I PROCESSI CREDITIZI?  
IMPLEMENTATION OF THE EBA LOM GUIDELINES: AN OPPORTUNITY TO REVIEW CREDIT PROCESSES?**

**PARALLELA 1.1**

**TRA I TEMI TRATTATI:**

- Il Questionario Bdl sulle LOM 2021
- Le LOM presuppongono una nuova segmentazione della clientela per differenziare molto più che in passato i processi creditizi?
- Allineare RAF, Politiche Creditizie, analisi forward looking (anche in prospettiva "E"SG), declinazione e monitoraggio dei covenant (come EWS)
- Integrazione dati, open banking e spinte verso l'Instant lending
- L'internal auditing dopo le EBA-GL LOM

**TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:**

- *The Bdl Questionnaire on LOM 2021*
- *Do LOMs presume new customer segmentation to differentiate credit processes much more so than in the past?*
- *Aligning RAFs, credit policies, forward looking analysis (including from an "E"SG perspective), structuring and monitoring of covenants (such as EWS)*
- *Data integration, open banking and the push towards instant lending*
- *Internal auditing after EBA-GL LOM*

**Chair: Giacomo De Laurentis, Università Bocconi**

**2.00 Apertura dei lavori a cura del chair / Opening address by the chair**

**Giacomo De Laurentis**, Professore Ordinario di Finanza **Università Bocconi**

**Le linee guida EBA LOM nella prospettiva dell'internal auditing**

**Fabio Arnaboldi**, Co-Head of Governance Functions and Group Credit Risks Audit **UniCredit**

**Un approccio forward-looking per la credit allocation nel nuovo contesto di mercato**

**Lorenzo Bocchi**, Director, Deputy Head Enterprise Risk Management Area **Prometeia**

**La gestione dei requisiti AIRB ed EBA LOM in processi di digital lending per PMI**

**Giovanni Campani**, Responsabile Divisione Crediti Gruppo **Cedacri**

**Ferdinando Cinquegrana**, Responsabile Area Origination e Monitoring **Banco Desio**

**Dalla crisi globale ad un'opportunità di innovazione - Tecnologia e strumenti alla guida dei Credit Analytics**

**From crisis to opportunity: driving Innovation through Credit Analytics**

**Alberto Roitz**, Principal System Engineer - Customer Advisory - Risk Management **SAS**

**EBA LOM bridging-up: come massimizzare il ritorno (risk adjusted!) dell'investimento**

**Natale Schettini**, Head of Governo del Credito **Banco BPM**

21 | 22 GIUGNO 2022


 SUPERVISION  
RISKS &  
PROFITABILITY

 MILANO, CENTRO CONGRESSI BEZZI BANCO BPM  
 Live streaming su <https://basilea.abieventi.it>

## LA DISCIPLINA EBA SU INTEREST RATE RISK E CREDIT SPREAD RISK PER IL BANKING BOOK EBA REGULATIONS ON INTEREST RATE RISK AND CREDIT SPREAD RISK FOR THE BANKING BOOK

### PARALLELA 1.2

#### TRA I TEMI TRATTATI:

- I documenti di consultazione EBA del dicembre 2021
- La nuova rilevanza di IRRBB e CSRBB
- I rischi posti dall'inflazione
- RRBB e CSRBB: evoluzione del contesto e delle metriche di rischio
- IRRB e CRBB: gestione, flussi informativi e profili di governance...

#### TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- *EBA December 2021 consultation documents*
- *The new relevance of IRRBB and CSRBB*
- *The risks posed by inflation*
- *IRRBB and CSRBB: the changing environment and risk metrics*
- *IRRBB and CSRBB: management, information flows and governance profiles.*

Chair: Mario Anolli, Università Cattolica del Sacro Cuore

#### 2.00 Apertura dei lavori a cura del chair / *Opening address by the chair*

Mario Anolli, Professore Ordinario di Economia degli Intermediari Finanziari **Università Cattolica del Sacro Cuore**

#### La disciplina EBA su interest rate e credit spread risk per il banking book

Gennaro Pezzullo, Responsabile Area Rischi Finanziari ed Operativi **Banca d'Italia**

Eleonora Cernuschi, Head of Internal Validation - Operational Risks and ICAAP Internal Systems **Intesa Sanpaolo**

#### Il ritorno dell'inflazione: impatti e strategie per la gestione del rischio di tasso

Elisabetta Tisato, Partner **Deloitte**

#### Alcune riflessioni sul nuovo framework IRRBB proposto da EBA

Alberto Mietto, Responsabile Rischio Tasso **Banco BPM**

#### Impatto del rischio tasso e credit spread sugli strumenti obbligazionari alla luce dei recenti sviluppi di mercato

*Impact of interest rate and credit spread risk on fixed income instruments as a function of recent market developments*

Angelo Dipasquale, Global Markets - Co-Head of Fixed Income Desk - Head of Fixed Income Sales **Equita**

21 | 22 GIUGNO 2022


 SUPERVISION  
RISKS &  
PROFITABILITY

 MILANO, CENTRO CONGRESSI BEZZI BANCO BPM  
 Live streaming su <https://basilea.abieventi.it>
**L'EVOLUZIONE DEGLI STRESS TEST REGOLAMENTARI**  
**THE EVOLUTION OF REGULATORY STRESS TESTS**
**PARALLELA 1.3**
**TRA I TEMI TRATTATI:**

- Un cambiamento di paradigma?
- Come prepararsi al nuovo ruolo dei challenging models nella regolamentazione
- L'impatto dei challenging models regolamentari sulla gestione e l'utilizzo gestionale degli stress test
- Gli stress test sulle metriche regolamentari
- Governance e reporting degli stress test

**TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:**

- *A paradigm shift?*
- *How to prepare for the new role of challenging models in regulation*
- *Regulatory challenging models – their impact on management and the managerial use of stress tests*
- *Stress testing on regulatory metrics*
- *Stress test governance and reporting*

**Chair: Simona Cosma, Università del Salento**
**2.00 Apertura dei lavori a cura del chair / *Opening address by the chair***
**Simona Cosma, Professore associato Università del Salento**
**Stress test regolamentari: situazione attuale e possibili evoluzioni**
***Regulatory stress tests: current status and possible evolutions***
**Paolo Marietti, Head of Group Strategic and Integrated Risks UniCredit**
**Stress Testing regolamentare: trade-off tra efficienza/profittabilità e controllo del rischio**
**Marco Zilioli, Risk and Regulatory Expert Wolters Kluwer**
**Le metodologie di stress test in banca Popolare Pugliese: stato dell'arte e prospettive di sviluppo**
**Aldo Letizia, Head of Risk Management Banca Popolare Pugliese**
**Il framework di stress test in Credem: evoluzione nel tempo e prossime sfide**
**Agnese Gramoli, Coordinatore Area Rischi Integrati e Stress Test Credem**



21 | 22 GIUGNO 2022


 SUPERVISION  
RISKS &  
PROFITABILITY

 MILANO, CENTRO CONGRESSI BEZZI BANCO BPM  
 Live streaming su <https://basilea.abieventi.it>
**SESSIONI PARALLELE / PARALLEL SESSIONS (4.00 – 5.30 PM)**

**I MODELLI DI RATING ED I PROCESSI CREDITIZI TRA RINNOVATE ESIGENZE GESTIONALI E NUOVI PERIMETRI REGOLAMENTARI (EBA-GL LOM E CRR3/CRD6)**  
**RATING MODELS AND CREDIT PROCESSES: RENEWED MANAGEMENT NEEDS AND NEW REGULATORY PERIMETERS (EBA-GL LOM AND CRR3/CRD6)**

**PARALLELA 2.1**

**TRA I TEMI TRATTATI:**

- I take home dal TRIM ECB del 2021
- L'introduzione dei fattori ESG nei modelli
- Big data e uso dell'artificial intelligence: sono anche una risposta alle LOM?
- Gestire l'origination con gli analytics per tutelare i valori delle garanzie e le LGD
- Implicazioni del nuovo perimetro regolamentare e il nuovo contributo gestionale dei modelli interni

**TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:**

- *Takeaways from the 2021 ECB TRIM*
- *Introducing ESG factors into models*
- *Big data and the use of artificial intelligence: are they also a response to LOMs?*
- *Manage origination with analytics to protect the values of warranties and LGDs*
- *Implications of the new regulatory perimeter and the internal models' new contribution to management*

**Chair: Giacomo De Laurentis, Università Bocconi**

**4.00 I modelli di rating e le EBA-GL LOM: un rapporto da chiarire**

**Giacomo De Laurentis**, Professore Ordinario di Finanza **Università Bocconi**

**Artificial intelligence e modelli interni di rating: opportunità "gestionali" alla luce delle LOM**

**Fabio Salis**, Chief Risk Officer **Creval**

**I modelli di rating tra rinnovate esigenze gestionali e nuovi perimetri regolamentari (EBA-GL LOM e CRR3/CRD6)**

**Alessandra Mazziotti di Celso**, Director **Deloitte**

**Micol Tovaglieri**, Partner **Deloitte**

**L'introduzione dei fattori ESG nei modelli**

**Antonio Rizzo**, Director, Risk Solutions **S&P Global**

**L'integrazione dei profili ESG nei modelli di rating Corporate**

**Fiorella Salvucci**, Head of Credit Risk Models **Intesa Sanpaolo**

21 | 22 GIUGNO 2022


 SUPERVISION  
 RISKS &  
 PROFITABILITY

 MILANO, CENTRO CONGRESSI BEZZI BANCO BPM  
 Live streaming su <https://basilea.abieventi.it>

## I RISCHI DI SECONDO PILASTRO E IL FRAMEWORK DEL MODEL RISK PILLAR 2 RISKS AND THE MODEL RISK FRAMEWORK

### PARALLELA 2.2

#### TRA I TEMI TRATTATI:

- I rischi emergenti: identificazione, misurazione e gestione
- Il macroprudential stress test BCE dell'ottobre 2021
- Il framework del model risk
- I sistemi più complessi di quantificazione della model uncertainty
- I sistemi di integrazione e reporting sul model risk

#### TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- *Emerging risks: identification, measurement and management*
- *The ECB macroprudential stress test in October 2021*
- *The model risk framework*
- *The most complex systems for quantifying model uncertainty*
- *Model risk integration and reporting systems*

Chair: **Simona Cosma, Università del Salento**

#### 4.00 Il model risk negli studi di banking and finance

**Simona Cosma**, Professore Associato **Università del Salento**

#### L'applicazione del Model Risk Framework nei processi aziendali

**Rita Gnutti**, Executive Director, Head of Internal Validation and Controls - Head Office Department **Intesa Sanpaolo**

#### Unsolved issues on the current state of model risk management

**José Luis Carazo**, Partner **Management Solutions**

#### Il framework del model risk

**Chiara Capelli**, Head of Group Internal Validation – Group Risk Management **UniCredit**

21 | 22 GIUGNO 2022

**SUPERVISION  
RISKS &  
PROFITABILITY**

MILANO, CENTRO CONGRESSI BEZZI BANCO BPM  
Live streaming su <https://basilea.abieventi.it>

**BANCHE NELL'ERA POST AMA E IL TRASFERIMENTO ASSICURATIVO DEL RISCHIO OPERATIVO**  
***BANKS IN THE POST-AMA ERA AND THE OPERATIONAL RISK'S INSURANCE TRANSFER***

**PARALLELA 2.3**



**TRA I TEMI TRATTATI:**

- ORM come strumento gestionale - L'aumentare dei possibili rischi operativi, legati a pericolosi eventi esterni rende sempre più necessaria la considerazione dei rischi operativi nella formulazione dei piani di sviluppo gestionali. In particolare, ci occuperemo dell'impatto sui modelli gestionali di:
  - eventi esterni di tipo informatico
  - eventi esterni di tipo socio-sanitario
- Emendamento ABI su polizze assicurative nella SMA

**TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:**

- *ORM as a management tool - The increase in possible operational risks related to dangerous external events makes it increasingly necessary to consider operational risks when structuring management development plans. We will consider how management models are impacted by:*
  - external IT events
  - external social and health events
- *ABI amendment on insurance policies in the SMA*

**Chair: Alessandra Tanda, Università di Pavia**

**4.00 Apertura dei lavori a cura del chair / *Opening address by the chair***

**Alessandra Tanda**, Professoressa Associata di Economia degli Intermediari Finanziari **Università di Pavia**

**Basilea IV Rischi Operativi – Rischi e Opportunità nella transizione da AMA a SMA**

**Ennio Menicucci**, Head of Operational Risk Analytics and Oversight **UniCredit**

**AMA: Essere o non Essere...**

**Vitantonio Matarazzo**, Risk Manager **Bancoposta**

21 | 22 GIUGNO 2022

**SUPERVISION  
RISKS &  
PROFITABILITY**

MILANO, CENTRO CONGRESSI BEZZI BANCO BPM  
Live streaming su <https://basilea.abieventi.it>

**MERCOLEDÌ', 22 GIUGNO/WEDNESDAY, 22 JUNE | MATTINA/MORNING**

**SESSIONI PARALLELE / PARALLEL SESSIONS (9.30 – 11.00)**

**RISCHI ED OPPORTUNITA' DI SETTORE E DI FILIERA  
SECTOR AND SUPPLY CHAIN RISKS AND OPPORTUNITIES**

**PARALLELA 3.1**

**TRA I TEMI TRATTATI:**

- Trarre insegnamenti duraturi dalla pandemia
- I nuovi pivot delle politiche creditizie e dell'assorbimento di capitale
- Specializzare la banca lungo le direttrici dei settori e delle filiere?

**TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:**

- *Drawing lasting lessons from the pandemic*
- *The new pivots of credit policies and capital absorption*
- *Specialise the banks along sector and supply chain lines?*

**Chair: Franco Fiordelisi, University of Essex & Università di Roma Tre**

**9.30 Apertura dei lavori a cura del chair / Opening address by the chair**  
**Franco Fiordelisi, Professor of Finance University of Essex & Università di Roma Tre**

**Aurelio Maccario, Head of Group Credit Risk UniCredit**

**Inventing Finance: ambiti di applicazione e abilitatori tecnologici**  
**Paolo Arzani, Managing Director Strategy & Consulting Accenture**

**(Big)Dati + Fintech + Banca = Filiera del turismo italiano**  
**Gabriele Nanni, Presidente InTour Rete d'impresa - UO Turismo Gruppo ICCREA Banca**

**L'integrazione della dimensione di filiera nel rating delle imprese a fini regolamentari e gestionali**  
**Daniele Monzali, Associate Partner, FSO Consulting Services EY**

**Fabrizio Reggi, Deputy Chief Risk Officer Crédit Agricole Italia**

21 | 22 GIUGNO 2022


 SUPERVISION  
**RISKS &**  
 PROFITABILITY

 MILANO, CENTRO CONGRESSI BEZZI BANCO BPM  
 Live streaming su <https://basilea.abieventi.it>

## LA PRIORITÀ DELL'SSM 2022-2024 PER FAR EMERGERE IN SALUTE LE BANCHE DALLA PANDEMIA THE SSM 2022-2024 PRIORITY IS FOR BANKS TO EMERGE FROM THE PANDEMIC IN GOOD HEALTH

### PARALLELA 3.2

#### TRA I TEMI TRATTATI:

- Il rischio di liquidità nel nuovo assetto del mercato
- La supervisione ECB e i requisiti regolamentari sulle cartolarizzazioni
- La bozza della Guida ECB su notification of securitisation transactions
- i meccanismi per la gestione dell'impatto degli shock di medio termine sui tassi di interesse e sui differenziali creditizi
- l'adeguamento dei sistemi di valutazione, attenuazione e monitoraggio dei rischi alle nuove esigenze

#### TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- *Liquidity risk in the new market framework*
- *ECB supervision and regulatory requirements for securitisation*
- *The draft ECB Guidance on notification of securitisation transactions*
- *mechanisms for managing the impact of medium-term shocks on interest rates and credit spreads*
- *adaptation of risk assessment, mitigation and monitoring systems to new needs*

Chair: Marina Brogi, Sapienza Università di Roma

#### 9.30 Apertura dei lavori a cura del chair / *Opening address by the chair*

Marina Brogi, Professore Ordinario di International Banking and Capital Markets Sapienza Università di Roma

#### La supervisione ECB e i requisiti regolamentari sulle cartolarizzazioni

Emanuele Piergentili, Advisor Servizio Supervisione Bancaria 1 Banca d'Italia

#### La pandemia come occasione di apprendimento nella gestione di eventi disruptive

Michela Pinto, Risk Strategy and Capital Adequacy Banco BPM

#### Priorità SSM, implicazioni e le azioni di rafforzamento intraprese in ottica di continuo miglioramento

*SSM priorities, implications and strengthening actions undertaken*

Antonio Medda, Risk Strategy Senior Expert Illimity

#### Sensibilità agli shock dei tassi di interesse e dei differenziali creditizi

Maurizio Vallino, Head of Regulatory Affairs Banca Carige

#### ESG Integration into Banks' Business Models: New Risks and Opportunities

Cristiano Zazzara, Adjunct Professor of Finance NYU Stern School of Business

21 | 22 GIUGNO 2022


 SUPERVISION  
RISKS &  
PROFITABILITY

 MILANO, CENTRO CONGRESSI BEZZI BANCO BPM  
 Live streaming su <https://basilea.abieventi.it>
**L'IMPATTO DELLA PANDEMIA SUI RISCHI OPERATIVI**  
**THE IMPACT OF THE PANDEMIC ON OPERATIONAL RISKS**

**PARALLELA 3.3**
**TRA I TEMI TRATTATI:**

- L'evoluzione della banca (intesa come strumenti, know how, cultura in ambito rischi operativi ecc) a seguito della pandemia
- L'evoluzione delle richieste e delle necessità operative dei clienti a seguito della pandemia
- La gestione dei rischi operativi della banca è oggi più resiliente di fronte ad eventuali nuove minacce?

**TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:**

- *The evolving bank (in terms of tools, know-how, culture in the area of operational risk, etc.) after the pandemic*
- *Evolving customer demands and operational needs after the pandemic*
- *Is the bank's operational risk management now more resilient in the face of possible new threats?*

**Chair: Paolo Prandi, Università degli Studi di Teramo**
**9.30 Apertura dei lavori a cura del chair / Opening address by the chair**
**Paolo Prandi, Professore di Economia degli Intermediari Finanziari e Risk Management Università degli Studi di Teramo**
**Risk Management in Sanità. Le lezioni apprese dalla Pandemia. Approccio proattivo alla sicurezza delle cure**
***Risk Management in Healthcare. Lessons learned from the Pandemic. Building a proactive approach to patient safety***
**Francesco Venneri, Direttore Struttura Organizzativa Direzionale Aziendale di Risk Management**
**Azienda USL Toscana Centro**
**Evoluzione della funzione ORM delle banche: verso una gestione più integrata dei rischi non finanziari**
***The evolving landscape of bank's ORM function: the path to Non-Financial Risk management***
**Andrea Colombo, Associate Partner, Financial Risk Management KPMG**
**Silvia Maroni, Responsabile Operational & IT Risk Management ICCREA Banca**
**L'argine dell'operational risk framework alla pandemia**
**Federico Peretti, Chief Risk Officer Allianz Bank Financial Advisors**

21 | 22 GIUGNO 2022

**SUPERVISION  
RISKS &  
PROFITABILITY**

MILANO, CENTRO CONGRESSI BEZZI BANCO BPM  
Live streaming su <https://basilea.abieventi.it>

**SESSIONI PARALLELE / PARALLEL SESSIONS (11.30 – 1.00)**

**LA CREDIT OPINION DELLA FUNZIONE DI RISK MANAGEMENT SECONDO LE EBA-GL LOM  
THE CREDIT OPINION OF THE RISK MANAGEMENT FUNCTION ACCORDING TO THE EBA-GL LOM**

**PARALLELA 4.1**

**TRA I TEMI TRATTATI:**

- Le EBA-GL LOM riflettono l'assetto tipico delle funzioni crediti e risk management nelle banche estere?
- Come adattare le EBA-GL LOM al contesto italiano di coesistenza di CLO e CRO
- L'interazione tra CRO, Comitato rischi, e CdA
- L'esperienza della second credit opinion nelle OMR
- Come differenziare operativamente le credit opinion dalle OMR alle piccole esposizioni

**TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:**

- *Do the EBA-GL LOM reflect the typical framework of credit and risk management functions in foreign banks?*
- *How to adapt the EBA-GL LOM to the Italian context of CLO and CRO coexistence*
- *Interaction between CRO, Risk Committee and Board of Directors*
- *The experience of the second credit opinion in STs*
- *How to operationally differentiate credit opinions from STs to small exposures*

**Chair: Alessandro Carretta, Università di Tor Vergata Roma**

**11.30 Apertura dei lavori a cura del chair / Opening address by the chair**

**Alessandro Carretta**, Professore ordinario di Economia degli intermediari finanziari **Università di Tor Vergata Roma** e  
Presidente Comitato Controllo e Rischi **Banca Popolare di Sondrio**

**Credit opinion: le prospettive CRO e CLO a confronto**

**Michele Campanardi**, CLO BPER Banca

**Impatti derivanti dalle implementazioni di EBA Guidelines per LOM nel modello integrato di gestione del rischio**

**Emanuela Maria Giusti**, Head of Credit Risk Management in Private and Commercial Banking **Deutsche Bank**

**EBA Loan And Monitoring Guidelines e parere del CRO ex ante per le Operazioni di Maggior Rilievo "OMR" nel modello organizzativo "duale" CLO-CRO: proposte, vincoli e sinergie**

**Andrea Violante**, Risk Management, Head of Most Significant Transactions **Intesa Sanpaolo**

21 | 22 GIUGNO 2022

SUPERVISION  
**RISKS &**  
PROFITABILITY

MILANO, CENTRO CONGRESSI BEZZI BANCO BPM  
Live streaming su <https://basilea.abieventi.it>

**LE PRIORITÀ SSM 2022-2024: AFFRONTARE I RISCHI EMERGENTI, INCLUSI I RISCHI CLIMATICI**  
**SSM 2022-2024 PRIORITIES: TACKLING EMERGING RISKS, INCLUDING CLIMATE-RELATED**  
**AND ENVIRONMENTAL RISKS**

**PARALLELA 4.2**

**TRA I TEMI TRATTATI:**

- Sostenibilità e transizione green nel CRR3/CRD6 package
- Il climate risk stress test 2022 della BCE
- Trasformare i vincoli della regolamentazione in opportunità della gestione

**TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:**

- *Sustainability and the green transition in the CRR3/CRD6 package*
- *The ECB 2022 climate risk stress test*
- *Turning regulatory constraints into management opportunities*

**Chair: Marina Brogi, Sapienza Università di Roma**

**11.30 Apertura dei lavori a cura del chair / Opening address by the chair**

**Marina Brogi, Professore Ordinario di International Banking and Capital Markets Sapienza Università di Roma**

**Climate/ESG integration into Risk Strategies: few steps to get closer**

**Fabio Verachi, FRM – Enterprise Risk Manager Intesa Sanpaolo**

**Come affrontare un mondo che cambia? Analisi di scenario: istruzioni per l'uso**

**How to tackle an ever-changing world? A comprehensive guide to scenario analysis**

**Giada Scalpelli, Senior System Engineer SAS**

**Maurizio Pierigè, Senior Partner - Head of Climate Change & ESG Risks, Head of Risk Integration & Advanced Analytics business lines Prometeia**

**Antonio Messina, Relationship Manager – Banking sector Moody's Analytics**

**Giuseppe Zammarchi, Head of ESG Metrics, Policies and Disclosure - Group Strategy & ESG UniCredit**



21 | 22 GIUGNO 2022


 SUPERVISION  
RISKS &  
PROFITABILITY

 MILANO, CENTRO CONGRESSI BEZZI BANCO BPM  
 Live streaming su <https://basilea.abieventi.it>

## LE NUOVE SFIDE DELLA CRR3/CRD6 THE NEW CHALLENGES OF CRR3/CRD6

### PARALLELA 4.3

#### TRA I TEMI TRATTATI:

- La revisione 27 ottobre 2021 del pacchetto CRR CRD e BRRD
- Il potenziamento della disciplina di mercato attraverso gli obblighi di informativa al pubblico e il miglioramento dell'accesso ai dati prudenziali
- Il limite inferiore (output floor) per i requisiti patrimoniali prodotti dai modelli interni: impatti economici e gestionali

#### TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- *The 27 October 2021 revision of the CRR CRD and BRRD package*
- *Strengthening market discipline through public disclosure obligations and improving access to prudential data*
- *The output floor for capital requirements produced by internal models: economic and management impacts*

Chair: Franco Fiordelisi, University of Essex & Università di Roma Tre

#### 11.30 Apertura dei lavori a cura del chair / *Opening address by the chair*

**Franco Fiordelisi**, Professor of Finance **University of Essex & Università di Roma Tre**

#### **Governance delle banche: vecchie e nuove sfide**

**Francesco Mauro**, Head of Supervisory Review, Recovery and Resolution Unit **EBA**

**Luca Serafini**, Titolare della Divisione Supporto regolamentazione internazionale **Banca d'Italia**

#### **CRR3/CRD6: sfide consolidate, ma un nuovo approccio possibile**

**Marco Zilioli**, Risk and Regulatory Expert **Wolters Kluwer**

#### **Basel III implementation in the EU – State of play**

**Almorò Rubin de Cervin**, Head of Unit D1 - Banking regulation and supervision, DG FISMA (Financial Stability, Financial Services and Capital Markets Union) **Commissione Europea**

21 | 22 GIUGNO 2022


 SUPERVISION  
RISKS &  
PROFITABILITY
MILANO, CENTRO CONGRESSI BEZZI BANCO BPM  
Live streaming su <https://basilea.abieventi.it>

MERCOLEDI', 22 GIUGNO/WEDNESDAY, 22 JUNE | POMERIGGIO/AFTERNOON

SESSIONI PARALLELE / PARALLEL SESSIONS (2.00 – 3.30 PM)

## LE PRIORITÀ 2022-24 DELLA BCE E LE NUOVE REGOLE "FIT-AND-PROPER" DELLA CRR3/CRD6 ECB 2022-24 PRIORITIES AND THE NEW "FIT-AND-PROPER" CRR3/CRD6 RULES

### PARALLELA 5.1

#### TRA I TEMI TRATTATI:

- I rilievi BCE alla capacità di indirizzo degli organi di amministrazione
- Cosa attendersi dagli "Stronger enforcement tools"
- La supervisione delle capacità e competenze degli amministratori
- Le analisi mirate dell'efficacia degli organi di amministrazione
- Le verifiche dei requisiti di idoneità sulla base del rischio

#### TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- *ECB findings on the guiding capacity of the governing bodies*
- *What to expect from "stronger enforcement tools"*
- *Supervising the capacity and skills of administrators*
- *Targeted analyses of the effectiveness of governing bodies*
- *Risk-based suitability requirement checks*

Chair: **Alessandro Carretta**, Università di Roma Tor Vergata

#### 2.00 Apertura dei lavori a cura del chair / *Opening address by the chair*

**Alessandro Carretta**, Professore ordinario di Economia degli intermediari finanziari **Università di Roma Tor Vergata** e Presidente Comitato Controllo e Rischi **Banca Popolare di Sondrio**

#### La governance nelle priorità della Vigilanza e il primo ciclo di valutazioni FAP sulle LSI

**Enrico Fleres**, Servizio Supervisione Bancaria 2 **Banca d'Italia**

**Giovanni Di Balsamo**, Divisione Coordinamento SSM **Banca d'Italia**

#### Fit&Proper: aspettative di vigilanza in tema di governance sui rischi climatici e ambientali

**Elisabetta Gualandri**, Professore ordinario di Economia degli intermediari finanziari, **Università di Modena e Reggio Emilia** e Presidente Comitato Controlli, Rischi e sostenibilità **Credito Emiliano**

#### Vigilanza Europea e nuove regole Fit&Proper nei gruppi bancari cooperativi italiani

**Maria Luisa Di Battista**, Amministratore Indipendente, Presidente del Comitato Rischi, Membro del Comitato Nomine e del Comitato Amministratori Indipendenti **Cassa Centrale Banca**

#### Il nuovo processo Fit&Proper: teoria e prassi

**Paolo Maria Vittorio Grandi**, Chief Governance Officer **Intesa Sanpaolo**

21 | 22 GIUGNO 2022


 SUPERVISION  
RISKS &  
PROFITABILITY

 MILANO, CENTRO CONGRESSI BEZZI BANCO BPM  
 Live streaming su <https://basilea.abieventi.it>

## IL CRITERIO DI PROPORZIONALITÀ NELLE EBA-GL LOM THE PROPORTIONALITY CRITERION IN EBA-GL LOM

### PARALLELA 5.2

#### TRA I TEMI TRATTATI:

- I principi di proporzionalità nelle LOM
- Le 4 dimensioni della proporzionalità: Internal Governance, Origination, beni immobili e monitoring
- Come conciliare la single customer view con la proporzionalità legata ai prodotti finanziari
- La proporzionalità delle LOM per gli intermediari specializzati
- Modelli di business e processi del credito: interrogativi di "less significance"

#### TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- *The principles of proportionality in LOMs*
- *The four dimensions of proportionality: Internal governance, origination, real estate and monitoring*
- *Reconciling the single customer view with financial product-linked proportionality*
- *The proportionality of LOMs for specialised intermediaries*
- *Business models and credit processes: questions of less significance*

Chair: Rosa Coccozza, Università degli Studi di Napoli

#### 2.00 Apertura dei lavori a cura del chair / *Opening address by the chair*

Rosita Coccozza, Ordinario di Economia degli Intermediari Finanziari **Università degli Studi di Napoli**

#### Il principio di proporzionalità e le EBA – GL LOM per le Banche less significant

Luigi Avogadro, Direttore Generale **Luigi Luzzatti S.C.p.A.**

#### Le 4 dimensioni della proporzionalità: Internal Governance, Origination, beni immobili e monitoring

Ignace Gustave Bikoula, Head of EU and Regulatory Affairs **Federcasse**

#### Modelli di business e processi del credito: interrogativi di "less significance"

Francesca Scaglia, CRO **Banco Desio**

#### La proporzionalità delle LOM per gli intermediari specializzati

Fausto Galmarini, Presidente **Assifact**

21 | 22 GIUGNO 2022

**SUPERVISION  
RISKS &  
PROFITABILITY**

MILANO, CENTRO CONGRESSI BEZZI BANCO BPM  
Live streaming su <https://basilea.abieventi.it>

**RISCHI OPERATIVI E CLIMATE CHANGE  
OPERATIONAL RISKS AND CLIMATE CHANGE**

**dipo**   
database italiano per il rischio operativo

**PARALLELA 5.3**

**TRA I TEMI TRATTATI:**

- Impatti diretti e indiretti del CC sul business della banca
- Impatti diretti del rischio fisico e connessa mitigazione: il contributo dell'OR
- Il rischio di compliance sulle normative Esg: come registrare le perdite?
- Aspettative di vigilanza
- Possibili impatti sulla continuità operativa
- Effetti sui rischi reputazionali e legali

**TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:**

- *CC direct and indirect impacts on banks' business*
- *Direct impacts of physical risk and related mitigation: the contribution of OR*
- *ESG compliance risk: how to record losses?*
- *Supervisory outlook*
- *Possible impacts on business continuity*
- *Effects on reputational and legal risks*

**Chair: Marco Giorgino, Politecnico di Milano**

**1.45 Apertura dei lavori a cura del chair / Opening address by the chair**

**Marco Giorgino**, Full Professor of Finance and Risk Management **Politecnico di Milano**

**Integrazione dei fattori ESG nel framework dei rischi operativi: l'esperienza di Intesa Sanpaolo**

**Veruska Orio**, Responsabile Operational, Technology and Information Risk Management **Intesa Sanpaolo**

**L'integrazione dei fattori ESG nel framework dei rischi operativi: la punta dell'ICEBERG e le sfide future**

**Nicasio Muscia**, Managing Director Strategy & Consulting **Accenture**

**Giuseppe Di Leo**, Head of ESG Risk team **Banca Monte dei Paschi di Siena**

**La valutazione del rischio fisico di aziende e immobili: l'utilizzo per il rischio operativo**

**Letizia Sampoli**, Responsabile Qualitative Risk Analysis and Forecasting **Cerved**

**Integrazione dei fattori ESG nel framework dei rischi operativi: l'esperienza di Mediobanca**

**Marco Castellaneta**, Operational Risk Management **Mediobanca**

Promosso da



Organizzato da



In collaborazione con



Media Partner



basilea.abieventi.it  
#abisupervision



21 | 22 GIUGNO 2022

# SUPERVISION RISKS & PROFITABILITY

MILANO, CENTRO CONGRESSI BEZZI BANCO BPM  
Live streaming su <https://basilea.abieventi.it>

Promosso da



Organizzato da



In collaborazione con



Concessione Spazi



Main Partner



Platinum Partner



Golden Partner



Brand Partner

