SUPERVISION
RISKS &
PROFITABILITY

PROVISIONAL AGENDA

21 | 22 GIUGNO 2022

MILANO, CENTRO CONGRESSI BEZZI BANCO BPM

Live streaming su **https://basilea.abieventi.it**

ABIEventi Digital

#abisupervision

basilea.abieventi.it

Promosso da ABI Associazione Bancaria Italiana

Organizzato da ABISERVIZI ABI EVENTI

In collaborazione con dipo database italiano perdite 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 – 10.30)
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

10.30 - 11.00 **Break e networking / *Break and networking***

TAVOLA ROTONDA / *ROUND TABLE* (11.00 – 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**	**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?***
	Chair: Giacomo De Laurentis, Università Bocconi
PARALLEL SESSIONS **1.2**	**La disciplina EBA su interest rate e credit spread risk per il banking book** ***EBA regulations on interest rate risk and credit spread risk for the banking book***
	Chair: Mario Anolli, Università Cattolica del Sacro Cuore
PARALLEL SESSIONS **1.3**	**L'evoluzione degli stress test regolamentari** ***The evolution of regulatory stress tests***
	Chair: Simona Cosma, Università del Salento

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

* da confermare / *to be confirmed*

SESSIONI PARALLELE / *PARALLEL SESSIONS* (3.45 – 5.15 PM)	
PARALLEL SESSIONS **2.1**	**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)***
	Chair: Giacomo De Laurentis, Università Bocconi
PARALLEL SESSIONS **2.2**	**I rischi di secondo pilastro e il framework del model risk** ***Pillar 2 risks and the model risk framework***
	Chair: Simona Cosma, Università del Salento
PARALLEL SESSIONS **2.3**	**Banche nell'era post AMA** ***Banks in the post-AMA era***
	Chair: Alessandra Tanda, Università di Pavia

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

SESSIONI PARALLELE / *PARALLEL SESSIONS* (9.30 – 11.00)	
PARALLEL SESSIONS **3.1**	**Rischi ed opportunità di settore e di filiera** ***Sector and supply chain risks and opportunities***
	Chair: Franco Fiordelisi, University of Essex & Università di Roma Tre
PARALLEL SESSIONS **3.2**	**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***
	Chair: Marina Brogi, Sapienza Università di Roma
PARALLEL SESSIONS **3.3**	**L'impatto della pandemia sui rischi operativi** ***The impact of the pandemic on operational risks***
	Chair: Paolo Prandi, Università degli Studi di Teramo

11.00 - 11.30 **Break e networking / *Break and networking***

* da confermare / *to be confirmed*

SESSIONI PARALLELE / *PARALLEL SESSIONS* (11.30 – 1.00 PM)	
PARALLEL SESSIONS **4.1**	**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***
	Chair: **Alessandro Carretta**, **Università di Roma Tor Vergata**
PARALLEL SESSIONS **4.2**	**Le priorità SSM 2022-2024: tackle emerging risks, including climate-related and environmental risks** ***SSM 2022-2024 priorities: tackling emerging risks, including climate-related and environmental risks***
	Chair: **Marina Brogi**, **Sapienza Università di Roma**
PARALLEL SESSIONS **4.3**	**Le nuove sfide della CRR3/CRD6** ***The new challenges of CRR3/CRD6***
	Chair: **Franco Fiordelisi, University of Essex & Università di Roma Tre**

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

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

SESSIONI PARALLELE / *PARALLEL SESSIONS* (2.00 – 3.30 PM)	
PARALLEL SESSIONS **5.1**	**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***
	Chair: **Alessandro Carretta**, **Università di Roma Tor Vergata**
PARALLEL SESSIONS **5.2**	**Il criterio di proporzionalità nelle EBA-GL LOM** ***The proportionality criterion in EBA-GL LOM***
	Chair: **Rosa Cocozza, Università degli Studi di Napoli**
PARALLEL SESSIONS **5.3**	**Rischi Operativi e Climate Change** ***Operational risks and Climate Change*** dipo
	Chair: **Marco Giorgino, Politecnico di Milano**

* da confermare / *to be confirmed*

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 – 10.30)

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**

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

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

EBA *

10.30 - 11.00 **Break e networking / *Break and networking***

TAVOLA ROTONDA / *ROUND TABLE* (11.00 – 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**

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

Pietro Penza, Partner **PwC Italia**

Giovanni Pepe, Partner **KPMG Advisory**

Prometeia

EY

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***

* da confermare / *to be confirmed*

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 BdI 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 BdI 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, Head of Group Audit Compliance, Operational, Credit & Finance Risks **UniCredit**

Prometeia

Cedacri

Alberto Roitz, Principal System Engineer **SAS**

EBA LOM bridging-up: come massimizzare il ritorno (risk adjusted!) dell'investimento
Natale Schettini, Head of Governo del Credito **Banco BPM**

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*
- *RRBB and CSRBB: the changing environment and risk metrics*
- *IRRB and CRBB: 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, Università Cattolica del Sacro Cuore

Eleonora Cernuschi, Head of Internal Sistems Operational Risk and ICAAP **Intesa Sanpaolo**

Deloitte

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

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

Altri interventi in corso di definizione

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**

L'evoluzione degli stress test regolamentari in UniCredit
Paolo Marietti, Head of Group Integrated Credit Risk – Group Risk Management **UniCredit**

Stress testing on regulatory metrics
Wolters Kluwer

Gli stress regolamentari e l'impatto sulla gestione: l'esperienza di banca popolare pugliese
Aldo Letizia, Head of Risk Management **Banca Popolare Pugliese**

Altri interventi in corso di definizione

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

Deloitte

L'introduzione dei fattori ESG nei modelli
Antonio Rizzo, Director, Risk Solutions **S&P Global**

Genius Analytics

L'integrazione dei profili ESG nei modelli di rating Corporate
Fiorella Salvucci, Head of Credit Risk Models **Intesa Sanpaolo**

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 Apertura dei lavori a cura del chair */ Opening address by the chair*
Simona Cosma, Professore associato **Università del Salento**

Il framework del model risk
Chiara Capelli, Head of Group Internal Validation – Group Risk Management **UniCredit**

Model risk e impatti sulla gestione
Rita Gnutti, Executive Director, Head of Internal Validation and Controls - Head Office Department **Intesa Sanpaolo**

Altri interventi in corso di definizione

BANCHE NELL'ERA POST AMA
BANKS IN THE POST-AMA ERA

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

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

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**

Ennio Menicucci, **UniCredit**

Vitantonio Matarazzo, **Bancoposta**

Altri interventi in corso di definizione

MERCOLEDI', 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**

Accenture

Gabriele Nanni, **Iccrea**

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

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

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**

Sensibilità agli shock dei tassi di interesse e dei differenziali creditizi
Maurizio Vallino, Head of Regulatory Affairs **Banca Carige**

Altri interventi in corso di definizione

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 Gestione del Rischio nel Sistema Creditizio e Economia degli Intermediari Finanziari
Università degli Studi di Teramo

Francesco Venneri, *Direttore Struttura Organizzativa Direzionale Aziendale di Risk Management*
Azienda USL Toscana Centro

Andrea Colombo, KPMG

Altri interventi in corso di definizione

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 Roma Tor Vergata**

11.30 **Apertura dei lavori a cura del chair / *Opening address by the chair***
Alessandro Carretta, **Università di Roma Tor Vergata**

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

Michele Campanardi, CLO **BPER Banca**

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

Altri interventi in corso di definizione

LE PRIORITÀ SSM 2022-2024: TACKLE EMERGING RISKS, INCLUDING CLIMATE-RELATED AND ENVIRONMENTAL RISKS

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**

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

Giada Scalpelli, Senior System Engineer **SAS**

Giuseppe Zammarchi, Head of ESG metrics, policies and disclosur **UniCredit ***

Prometeia

Altri interventi in corso di definizione

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**

Francesco Mauro, **EBA** *

Almorò Rubin de Cervin, **Commissione Europea** *

Altri interventi in corso di definizione

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

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, **Università di Roma Tor Vergata**

Maria Luisa Di Battista, Consigliere indipendente - Presidente Comitato Rischi - Membro del Comitato Nomine **Cassa Centrale Banca**

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

Elisabetta Gualandri, Consigliere Indipendente - Presidente Comitato controlli, rischi e sostenibilità - Membro Comitato nomine e Comitato amministratori indipendenti **Credito Emiliano**

Altri interventi in corso di definizione

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 Cocozza, Università degli Studi di Napoli**

2.00 **Apertura dei lavori a cura del chair** ***/ Opening address by the chair***
Rosita Cocozza, Ordinario di Economia degli Intermediari Finanziari **Università degli Studi di Napoli**

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

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

Miriam Lazzari, Vice Direttore Generale **La Cassa di Ravenna - Gruppo Bancario La Cassa di Ravenna**

Fausto Galmarini, Presidente **Assifact**

Altri interventi in corso di definizione

RISCHI OPERATIVI E CLIMATE CHANGE
OPERATIONAL RISKS AND CLIMATE CHANGE

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**

2.00 **Apertura dei lavori a cura del chair */ Opening address by the chair***
Marco Giorgino, Professore Ordinario di Financial Markets and Institutions e Financial Risk Management **Politecnico di Milano**

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

Accenture

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

Letiza Sampoli, Responsabile qualitative risk analysis and forecasting **Cerved**

Marco Castellaneta, Operational Risk Management **Mediobanca**

21 | 22 GIUGNO 2022

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

Promosso da

ABI Associazione Bancaria Italiana

Organizzato da

ABISERVIZI ABI EVENTI

In collaborazione con

dipo database italiano perdite operative

Main Partner

accenture | CRIF Together to the next level | EY Building a better working world

KPMG | prometeia | pwc

Platinum Partner

CEDACRI GROUP | sas

Golden Partner

S&P Global Market Intelligence | Wolters Kluwer

Brand Partner

BDO

Media Partner

BANCAFORTE innovation key | RISK & COMPLIANCE Platform Europe