



SUPERVISION
RISKS &
PROFITABILITY

GESTIRE
i rischi.
GUARDARE
Lontano

MANAGING
risks and
LOOKING INTO
the future

**SUPERVISION,
RISKS &
PROFITABILITY 2023**

6 - 7 giugno
Milano, Auditorium Bezzi
Banco BPM

Programma
provvisorio
Provisional
Agenda

basilea.abieventi.it
#abisupervision

Promosso da

ABI Associazione
Bancaria
Italiana

Organizzato da

ABISERVIZI
ABI
EVENTI

In collaborazione con

dipo
database italiano perdite operative

Media Partner

BANCAFORTE
innovation key



6 giugno
6 June

SCHEMA DELLE SESSIONI AGENDA SCHEME

SESSIONI
PLENARIE

SESSIONI
PARALLELE

SESSIONI
PARALLELE
DIPO

9.15 – 10.30 am PLENARIA DI APERTURA / OPENING PLENARY SESSION

SCENARI ECONOMICO FINANZIARI, EVOLUZIONE DELLA VIGILANZA E PROGETTI DI ADEGUAMENTO A BASILEA 3 PLUS: LA PROSPETTIVA DEI SUPERVISORS

ECONOMIC AND FINANCIAL SCENARIOS, EVOLUTION OF SUPERVISION AND PROJECTS FOR UPDATING TO BASEL III PLUS: THE SUPERVISORS' PERSPECTIVE

Chair: Marco Ferrando, Il Sole 24 Ore

10.30 – 11.00 am – BREAK E NETWORKING / BREAK AND NETWORKING

11.00 am – 1.00 pm TAVOLA ROTONDA / ROUND TABLE

SCENARI ECONOMICO FINANZIARI, EVOLUZIONE DELLA VIGILANZA E PROGETTI DI ADEGUAMENTO A BASILEA 3 PLUS: LA PROSPETTIVA DEI CONSULENTI

ECONOMIC AND FINANCIAL SCENARIOS, EVOLUTION OF SUPERVISION AND PROJECTS FOR UPDATING TO BASEL III PLUS: THE CONSULTANTS' PERSPECTIVE

Chair: Marco Ferrando, Il Sole 24 Ore

1.00 – 2.00 pm – BREAK E NETWORKING / BREAK AND NETWORKING

2.00 – 3.30 pm

PARALLEL SESSION 1.1

I MODELLI PER IL RISCHIO DI CREDITO

THE MODELS FOR CREDIT RISK

Chair: Giacomo De Laurentis, Università Bocconi

2.00 – 3.30 pm

PARALLEL SESSION 1.2

MODELLI INTERNI E NOVITÀ REGOLAMENTARI PER I MARKET RISK

INTERNAL MODELS AND REGULATORY UPDATES FOR MARKET RISKS

Chair: Mario Anolli, Università Cattolica del Sacro Cuore

2.00 – 3.30 pm

PARALLEL SESSION 1.3

L'EVOLUZIONE DEI MODELLI IFRS9 E DIFFERENZIAZIONE DELLE RETTIFICHE COLLETTIVE

THE EVOLUTION OF IFRS9 MODELS AND DIFFERENTIATION OF THE COLLECTIVE RECTIFICATIONS

Chair: Maurizio Comoli, Università del Piemonte Orientale

3.30 – 3.45 pm – BREAK E NETWORKING / BREAK AND NETWORKING

3.45 – 5.15 pm

PARALLEL SESSION 2.1

INSERIMENTO DEI RISCHI ESG NEI SISTEMI DI RATING INTERNI DELLE BANCHE

INSERTION OF ESG RISKS IN THE INTERNAL RATING SYSTEMS OF BANKS

Chair: Marina Brogi, Sapienza Università di Roma

3.45 – 5.15 pm

PARALLEL SESSION 2.2

IRRBB EBA-GL&RTS 2022 PER IL RISCHIO DI TASSO D'INTERESSE DEL BANKING BOOK

IRRBB EBA-GL&RTS 2022 FOR THE INTEREST RATE RISK OF THE BANKING BOOK

Chair: Mario Anolli, Università Cattolica del Sacro Cuore

3.45 – 5.15 pm

dipo
database italiano credito cooperativo

PARALLEL SESSION 2.3

PROSPETTIVE PER IL RISCHIO OPERATIVO: DORA (DIGITAL OPERATIONAL RESILIENCE ACT), CATENE DEL VALORE, ESG

PROSPECTS FOR THE OPERATING RISK: DORA (DIGITAL OPERATIONAL RESILIENCE ACT), VALUE CHAINS, ESG

Chair: Paolo Giudici, Università di Pavia

SUPERVISION
RISKS &
PROFITABILITY



7 giugno
7 June

SCHEMA DELLE SESSIONI AGENDA SCHEME

SESSIONI
PLENARIE

SESSIONI
PARALLELE

SESSIONI
PARALLELE
DIPO

9.30 – 11.00 am

PARALLEL SESSION 3.1

EVOLUZIONE DEGLI STRUMENTI INFORMATICI PER LA RETE E ADEGUAMENTO DELLE COMPETENZE PROFESSIONALI

EVOLUTION OF IT TOOLS FOR THE WEB AND ADAPTATION OF EMPLOYEE SKILLS

Chair: Giacomo De Laurentis, Università Bocconi

9.30 – 11.00 am

PARALLEL SESSION 3.2

GESTIRE IL LIQUIDITY RISK NELLA NUOVA FASE CONGIUNTURALE

MANAGING LIQUIDITY RISK IN THE NEW ECONOMIC PHASE

Chair: Giampaolo Gabbi, SDA Bocconi School of Management

9.30 – 11.00 am



PARALLEL SESSION 3.3

VENTI ANNI DI DIPO: L'EVOLUZIONE DEL RUOLO DEI DATI NELL'ORM

TWENTY YEARS ON FROM DIPO: THE EVOLUTION OF DATA'S ROLE IN ORM

Chair: Daniele Previati, Università degli Studi Roma Tre

11.00 – 11.30 am – BREAK E NETWORKING / BREAK AND NETWORKING

11.30 am – 1.00 pm

PARALLEL SESSION 4.1

BIG DATA E INTELLIGENZA ARTIFICIALE PER MIGLIORARE I SISTEMI GESTIONALI

BIG DATA AND ARTIFICIAL INTELLIGENCE FOR IMPROVING MANAGEMENT SYSTEMS

Chair: Severino Meregalli, SDA Bocconi School of Management

11.30 am – 1.00 pm

PARALLEL SESSION 4.2

I RISCHI DI MONEY LAUNDERING E TERRORIST FINANCING

THE RISKS OF MONEY LAUNDERING AND TERRORIST FINANCING

Chair: Paola Schwizer, Università di Parma

11.30 am – 1.00 pm

PARALLEL SESSION 4.3

FORMULAZIONE DEGLI SCENARI E MISURAZIONE DELLE PERFORMANCE DELLA BANCA

SCENARIO FORMULATION AND BANK PERFORMANCE MEASUREMENT

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

1.00 – 2.00 pm – BREAK E NETWORKING / BREAK AND NETWORKING

2.00 – 3.30 pm

PARALLEL SESSION 5.1

DATI, STRUMENTI ED ORGANIZZAZIONE PER GESTIRE I RISCHI DEI SETTORI ECONOMICI

DATA, TOOLS AND ORGANISATION TO MANAGE RISKS IN ECONOMIC SECTORS

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

2.00 – 3.30 pm

PARALLEL SESSION 5.2

INSERIMENTO DEI FATTORI ESG NEL RAF, OBBLIGHI DI RENDICONTAZIONE E AZIONE

INCLUSION OF ESG FACTORS IN THE RAF, ACTION AND REPORTING OBLIGATIONS

Chair: Paola Schwizer, Università di Parma

2.00 – 3.30 pm

PARALLEL SESSION 5.3

LSI E INTERMEDIARI FINANZIARI: LE IMPLEMENTAZIONI REGOLAMENTARI E GESTIONALI

LSI AND FINANCIAL INTERMEDIARIES: REGULATORY AND MANAGEMENT IMPLEMENTATIONS

Chair: Rosa Coccozza, Università degli Studi di Napoli





6 giugno
mattina
6 June
morning

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2023

GESTIRE i rischi. **GUARDARE** lontano
MANAGING risks and **LOOKING INTO** the future

8.30 – 9.15 am – ACCREDITO DEI PARTECIPANTI E NETWORKING
ACCREDITATION OF THE PARTICIPANTS AND NETWORKING

9.15 – 10.30 am PLENARIA DI APERTURA / OPENING PLENARY SESSION

SCENARI ECONOMICO FINANZIARI, EVOLUZIONE DELLA VIGILANZA E PROGETTI DI ADEGUAMENTO A BASILEA 3 PLUS: LA PROSPETTIVA DEI SUPERVISORS
ECONOMIC AND FINANCIAL SCENARIOS, EVOLUTION OF SUPERVISION AND PROJECTS FOR UPDATING TO BASEL III PLUS: THE SUPERVISORS' PERSPECTIVE

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

9.15 **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**

10.30 – 11.00 am – BREAK E NETWORKING / BREAK AND NETWORKING

11.00 am – 1.00 pm TAVOLA ROTONDA / ROUND TABLE

SCENARI ECONOMICO FINANZIARI, EVOLUZIONE DELLA VIGILANZA E PROGETTI DI ADEGUAMENTO A BASILEA 3 PLUS: LA PROSPETTIVA DEI CONSULENTI
ECONOMIC AND FINANCIAL SCENARIOS, EVOLUTION OF SUPERVISION AND PROJECTS FOR UPDATING TO BASEL III PLUS: THE CONSULTANTS' PERSPECTIVE

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

11.00 **Antonio Altieri Pignalosa**, Partner, Financial Services **EY**

Lorenzo Bocchi, Managing Director **Prometeia**

Stefano Bonini, Head of Risk, Credit & ESG Advisory **Cerved**

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

Pietro Penza, Partner, Financial Services Risk & Regulatory Leader **PwC Italia**

Giovanni Pepe, Partner, Risk and Regulatory Leader **KPMG**

Francesco Zeigner, Partner, Financial Risk Leader **Deloitte Risk Advisory**

1.00 – 2.00 pm – BREAK E NETWORKING / BREAK AND NETWORKING

*In attesa di conferma.

Questa versione dell'agenda è provvisoria. Temi e Relatori potrebbero subire variazioni.



6 giugno
pomeriggio

6 June
afternoon

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2023

GESTIRE i rischi. **GUARDARE** lontano

MANAGING risks and **LOOKING INTO** the future

2.00 – 3.30 pm PARALLEL SESSION 1.1

I MODELLI PER IL RISCHIO DI CREDITO

THE MODELS FOR CREDIT RISK

TRA I TEMI TRATTATI:

- Nuove direttrici di sviluppo per i modelli
- Vincoli regolamentari per la validazione e gli orientamenti di fatto dei supervisors e dei singoli JST
- Il benchmarking EBA dei modelli di credit risk
- Linee-guida EBA LOM e cambiamenti nell'uso dei rating
- Modelli di rating e politiche creditizie: quale interazione

TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- New development guidelines for the models
- Regulatory constraints for the validation and the actual guidelines of supervisors and individual JSTs
- The EBA benchmarking of credit risk models
- EBA LOM guidelines and changes in the use of ratings
- Rating models and credit policies: which interaction

Chair: Giacomo De Laurentis, Università Bocconi

2.00 Apertura dei lavori a cura del chair

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

«Nuove» direttrici per lo sviluppo dei modelli. Le esperienze del Gruppo Intesa Sanpaolo

Fiorella Salvucci, Executive Director - Deputy Credit Risk Manager, Credit Risk Models, Direzione Credit Risk Management **Intesa Sanpaolo**

Fabio Salis, Head of RAF, Models and Reporting **Credit Agricole Italia**

Gestire l'innovazione nel corrente quadro regolamentare e di Vigilanza

Daniele Monzali, Partner, Financial Services **EY**

Giovanna Compagnoni, Head of Group Risk Management **ICCREA Banca**

Alida Popescu, Customer Advisory Manager Risk Practice **SAS**

3.30 – 3.45 pm – BREAK E NETWORKING / BREAK AND NETWORKING

*In attesa di conferma.

Questa versione dell'agenda è provvisoria. Temi e Relatori potrebbero subire variazioni.



6 giugno
pomeriggio

6 June
afternoon

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2023

GESTIRE i rischi. **GUARDARE** lontano

MANAGING risks and **LOOKING INTO** the future

2.00 – 3.30 pm PARALLEL SESSION 1.2

MODELLI INTERNI E NOVITÀ REGOLAMENTARI PER I MARKET RISK

INTERNAL MODELS AND REGULATORY UPDATES FOR MARKET RISKS

TRA I TEMI TRATTATI:

- Stato dell'arte dei modelli
- L'EBA Benchmarking dei modelli interni per i Market risk (EBA CP 2022 14)
- Il Default risk charge (DRC) e il Residual risk add-on (RRAO)
- Il tema della proporzionalità
- Backtesting e validazione

TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- State of the art of the models
- The EBA benchmarking of internal models for market risks (EBA CP 2022 14)
- The default risk charge (DRC) and the residual risk add-on (RRAO)
- The issue of proportionality
- Backtesting and validation

Chair: Mario Anolli, Università Cattolica del Sacro Cuore

2.00 Apertura dei lavori a cura del chair

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

Modello per l'inclusione dei rischi ESG nei rischi di mercato

Luigi Terzi, Head of Market Risk Management **Banco BPM**

Carlo Frazzei, Head of Market/Financial Risk Management **Banca Sella**

Emanuele Cristini, Chief Risk Officer **BPER Banca**

Altri interventi in corso di definizione/Other speakers to be defined

3.30 – 3.45 pm – BREAK E NETWORKING / BREAK AND NETWORKING

6 giugno
pomeriggio

6 June
afternoon

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2023

GESTIRE i rischi. **GUARDARE** lontano

MANAGING risks and **LOOKING INTO** the future

2.00 – 3.30 pm PARALLEL SESSION 1.3

L'EVOLUZIONE DEI MODELLI IFRS9 E DIFFERENZIAZIONE DELLE RETTIFICHE COLLETTIVE

THE EVOLUTION OF IFRS9 MODELS AND DIFFERENTIATION OF THE COLLECTIVE RECTIFICATIONS

TRA I TEMI TRATTATI:

- Scenari e modelli settoriali per le rettifiche collettive
- Modelli per identificazione del SICR
- Gestione e documentazione dei management overlay
- Modelli per le rettifiche collettive dei crediti non performing
- Modelli per le rettifiche collettive delle esposizioni senza rating interno

TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- Sectoral scenarios and models for the collective rectifications
- Models for identification of the SICR
- Management and documentation of management overlays
- Models for collective rectifications to non-performing loans
- Models for collective rectifications to exposures without internal rating

Chair: Maurizio Comoli, Università del Piemonte Orientale

2.00 Apertura dei lavori a cura del chair

Maurizio Comoli, Professore Ordinario di Economia Aziendale **Università del Piemonte Orientale**

Lorenzo Boetti, Responsabile Risk Management **Banca Monte dei Paschi di Siena**

Modelli per identificazione del SICR

Francesco La Spada, Responsabile Rischio di Credito **Banco BPM**

Enton Resuli, Responsabile Servizio Controllo Rischi **Banca Popolare di Sondrio**

Altri interventi in corso di definizione/Other speakers to be defined

3.30 – 3.45 pm – BREAK E NETWORKING / BREAK AND NETWORKING



*In attesa di conferma.

Questa versione dell'agenda è provvisoria. Temi e Relatori potrebbero subire variazioni.

6 giugno
pomeriggio

6 June
afternoon

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2023

GESTIRE i rischi. **GUARDARE** lontano
MANAGING risks and **LOOKING INTO** the future

3.45 – 5.15 pm PARALLEL SESSION 2.1

INSERIMENTO DEI RISCHI ESG NEI SISTEMI DI RATING INTERNI DELLE BANCHE

INSERTION OF ESG RISKS IN THE INTERNAL RATING SYSTEMS OF BANKS

TRA I TEMI TRATTATI:

- La quadratura dei rischi ESG
- Come inserire i rischi ESG nei rating interni
- Profili di validazione del contributo dei fattori ESG alla misurazione del credit risk
- Rischi climate/ESG: scenario analysis e risk management framework

TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- The balancing of ESG risks
- How to insert ESG risks in internal ratings
- Validation profiles of the contribution of ESG factors to credit risk measurement
- Climate risks/ESG: scenario analysis and risk management framework

Chair: Marina Brogi, Sapienza Università di Roma

3.45 Apertura dei lavori a cura del chair

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

Anastasia Giakoumelou, Assistant Professor of Corporate Finance **Università di Venezia Ca' Foscari, Dipartimento di Management**

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

Rischi ESG nelle LSI

Fabio Firullo, Responsabile Servizio Sostenibilità **Banca Agricola Popolare di Ragusa**

Antonio Rizzo, Director - Credit Risk Solutions **S&P Global Market Intelligence**

Il challenge regolamentare legato ai Rischi Climatici: stato dell'arte e possibili integrazioni nei modelli interni

Giuliana Caivano, Head of Risk Modeling & Governance **Cerved Group**

Marco Stella, Senior Partner, Head Credit Risk competence line **Prometeia**

Giovanni Pepe, Partner, Risk and Regulatory Leader **KPMG**

5.15 pm - CHIUSURA DEI LAVORI DELLA PRIMA GIORNATA
END OF THE FIRST DAY OF THE CONFERENCE

*In attesa di conferma.

Questa versione dell'agenda è provvisoria. Temi e Relatori potrebbero subire variazioni.



6 giugno
pomeriggio

6 June
afternoon

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2023

GESTIRE i rischi. **GUARDARE** lontano

MANAGING risks and **LOOKING INTO** the future

3.45 – 5.15 pm PARALLEL SESSION 2.2

IRRBB EBA-GL&RTS 2022 PER IL RISCHIO DI TASSO D'INTERESSE DEL BANKING BOOK

IRRBB EBA-GL&RTS 2022 ON INTEREST RATE RISK IN THE BANKING BOOK

TRA I TEMI TRATTATI:

- Il nuovo impianto regolamentare e il nuovo SOT sul margine di interesse
- L'implementazione delle nuove regole sul CSRBB
- Le nuove metodologie standard
- Impatti organizzativi
- Recente evoluzione dei tassi di interesse e problemi di implementazione

TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- *The new regulatory framework and the new SOT on net interest income*
- *The implementation of the new framework for the CSRBB*
- *The new standardised methodologies*
- *Organizational impacts*
- *Recent evolution of interest rates and implementation problems*

Chair: Mario Anolli, Università Cattolica del Sacro Cuore

3.45 Apertura dei lavori a cura del chair

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

Elisa Recchi, Esperta, Divisione Procedure di Vigilanza e Analisi dei Rischi, Servizio Regolamentazione e Analisi Macroprudenziale **Banca d'Italia**

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

Giada Scalpelli, Customer Advisory Risk Management **SAS**

Mattia Cesana, Asset & Liability Risk Management **Mediobanca**

Intesa Sanpaolo

Altri interventi in corso di definizione/Other speakers to be defined

5.15 pm - CHIUSURA DEI LAVORI DELLA PRIMA GIORNATA

END OF THE FIRST DAY OF THE CONFERENCE

*In attesa di conferma.

Questa versione dell'agenda è provvisoria. Temi e Relatori potrebbero subire variazioni.



6 giugno
pomeriggio

6 June
afternoon

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2023

GESTIRE i rischi. **GUARDARE** lontano

MANAGING risks and **LOOKING INTO** the future



3.45 – 5.15 pm PARALLEL SESSION 2.3

PROSPETTIVE PER IL RISCHIO OPERATIVO: DORA (DIGITAL OPERATIONAL RESILIENCE ACT), CATENE DEL VALORE, ESG

PROSPECTS FOR THE OPERATING RISK: DORA
(DIGITAL OPERATIONAL RESILIENCE ACT), VALUE CHAINS, ESG

TRA I TEMI TRATTATI:

- Misura e gestione dei rischi IT: il framework DORA
- Rischio operativo e ESG
- Rischi IT e rischi cyber

TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- IT risk measurement and management: the DORA framework
- Operational risk and ESG
- IT risk and cyber risk

Chair: Paolo Giudici, Università di Pavia

3.45 Apertura dei lavori a cura del chair

Paolo Giudici, Professore Ordinario di Statistica e Coordinatore del Laboratorio Fintech
Università di Pavia

Luca Cusmano, Consigliere, Divisione Supporto Statistico e Informatico, Servizio Rapporti
Istituzionali di Vigilanza **Banca d'Italia**

**DORA: Nuove regole per velocizzare la trasformazione digitale e gestire i rischi ICT;
Cosa "Re -inventare"?**

Nicasio Muscia, Managing Director, Function Risk & Compliance **Accenture**

Roberta Ranaldi, Head of Data Quality Controls & Analytics **Intesa Sanpaolo**

Andrea Violato, Product Owner **Augeos**

Francesco De Notti, Head of Operational risk management **Banco BPM**

5.15 pm - CHIUSURA DEI LAVORI DELLA PRIMA GIORNATA
END OF THE FIRST DAY OF THE CONFERENCE

*In attesa di conferma.

Questa versione dell'agenda è provvisoria. Temi e Relatori potrebbero subire variazioni.





**7 giugno
mattina**

*7 June
morning*

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2023

GESTIRE i rischi. **GUARDARE** lontano

MANAGING risks and **LOOKING INTO** the future

9.30 – 11.00 am PARALLEL SESSION 3.1

EVOLUZIONE DEGLI STRUMENTI INFORMATICI PER LA RETE E L'ADEGUAMENTO DELLE COMPETENZE PROFESSIONALI

EVOLUTION OF IT TOOLS FOR THE WEB AND ADAPTATION OF EMPLOYEE SKILLS

TRA I TEMI TRATTATI:

- L'implementazione operativa delle Linee-Guida EBA su Concessione e monitoraggio dei prestiti
- I nuovi strumenti informatici per la rete
- L'adeguamento delle competenze degli addetti
- L'occasione per rivedere i processi creditizi?
- Il ruolo del Board e dell'alta direzione

TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- *The operating implementation of the EBA Guidelines on loan origination and monitoring*
- *The new IT tools for the Web*
- *The adaptation of employee skills*
- *The opportunity to review credit processes?*
- *The role of the Board and of the top management*

Chair: Giacomo De Laurentis, Università Bocconi

9.30 Apertura dei lavori a cura del chair

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

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

Natale Schettini, Responsabile Governo del Credito **Banco BPM**

Roberto Cravero, **Ned Community**

Altri interventi in corso di definizione/*Other speakers to be defined*

11.00 – 11.30 am – BREAK E NETWORKING / *BREAK AND NETWORKING*



**7 giugno
mattina**

*7 June
morning*

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2023

GESTIRE i rischi. **GUARDARE** lontano

MANAGING risks and **LOOKING INTO** the future

9.30 – 11.00 am PARALLEL SESSION 3.2

GESTIRE IL LIQUIDITY RISK NELLA NUOVA FASE CONGIUNTURALE

MANAGING LIQUIDITY RISK IN THE NEW ECONOMIC PHASE

TRA I TEMI TRATTATI:

- Il rischio di liquidità e le nuove crisi bancarie
- Costo del funding e gestione della liquidità con la nuova strategia di politica monetaria
- Impatto ed efficacia delle riforme introdotte sulla liquidità
- Revisione del nuovo funding plan delle banche
- Market liquidity risk e integrazione con i rischi finanziari della banca

TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- *Liquidity risk and new banking crises*
- *Cost of funding and liquidity management with the new monetary policy strategy*
- *Liquidity reforms: impact and effectiveness*
- *Revision of the banks' new funding plan*
- *Market liquidity risk and integration with the bank's financial risks*

Chair: Giampaolo Gabbi, SDA Bocconi School of Management

9.30 Apertura dei lavori a cura del chair

Giampaolo Gabbi, Professore di Risk Management Practice **SDA Bocconi School of Management**

Liquidity

Giansimone Ghiottone, Chief Risk Officer **Banca Popolare di Puglia e Basilicata**

Liquidity Optimization

Emilio Maffi, Partner, Financial Services **EY**

Elisabetta Tisato, Partner **Deloitte**

Francesco Berti, Risk management - Responsabile Settore Rischi di Liquidità **Banca Monte dei Paschi di Siena**

Altri interventi in corso di definizione/Other speakers to be defined

11.00 – 11.30 am – BREAK E NETWORKING / BREAK AND NETWORKING

**In attesa di conferma.*

Questa versione dell'agenda è provvisoria. Temi e Relatori potrebbero subire variazioni.





**7 giugno
mattina**

*7 June
morning*

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2023

GESTIRE i rischi. **GUARDARE** lontano

MANAGING risks and **LOOKING INTO** the future

9.30 – 11.00 am **PARALLEL SESSION 3.3**

VENTI ANNI DI DIPO: L'EVOLUZIONE DEL RUOLO DEI DATI NELL'ORM

TWENTY YEARS ON FROM DIPO: THE EVOLUTION OF DATA'S ROLE IN ORM

TRA I TEMI TRATTATI:

- Loss Data Collection e DB perdite esterne nel mondo post AMA
- Loss Data Collection in una banca digitale
- Cantieri aperti DIPO

TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- Loss Data Collection and external loss DB in a post-AMA world
- Loss Data Collection in a digital bank
- DIPO gets under way

Chair: Daniele Previati, Università degli Studi Roma Tre

dipo
database italiano perdite operative

9.30 Apertura dei lavori a cura del chair

Daniele Previati, Professore Ordinario di Economia degli Intermediari Finanziari, Dipartimento di Economia Aziendale **Università degli Studi Roma Tre**

Maria Giovanna Grieco, Esperta, Divisione Gruppi Bancari IV, Servizio Supervisione Bancaria I **Banca d'Italia**

Ilaria Nava, Credit & Operational Risk Expert **illimity Bank**

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

Chiara Baratelli, Senior Functional Analyst **List**

Maurizio Gargano, Head of Operational Risk & Business Continuity Management **BancoPosta**

11.00 – 11.30 am – BREAK E NETWORKING / *BREAK AND NETWORKING*

**In attesa di conferma.*

Questa versione dell'agenda è provvisoria. Temi e Relatori potrebbero subire variazioni.



7 giugno
mattina

7 June
morning

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2023

GESTIRE i rischi. **GUARDARE** lontano
MANAGING risks and **LOOKING INTO** the future

11.30 am – 1.00 pm **PARALLEL SESSION 4.1**

BIG DATA E INTELLIGENZA ARTIFICIALE PER MIGLIORARE I SISTEMI GESTIONALI *BIG DATA AND ARTIFICIAL INTELLIGENCE FOR IMPROVING MANAGEMENT SYSTEMS*

TRA I TEMI TRATTATI:

- Il completamento della trasformazione digitale della banca secondo la logica post-digital
- L'integrazione dei nuovi dati nei processi di risk management e di gestione del business
- Le applicazioni dell'intelligenza artificiale
- L'integrazione delle tecnologie di Intelligenza Artificiale nei sistemi informativi bancari
- Il sistema di offerta e le tecnologie rilevanti

TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- The completion of the bank's digital transformation according to the post-digital logic
- The integration of new data in risk management and business management processes
- The applications of artificial intelligence
- The integration of Artificial Intelligence technologies into banking information systems
- The supply system and relevant technologies

Chair: Severino Meregalli, SDA Bocconi School of Management

11.30 Apertura dei lavori a cura del chair

Severino Meregalli Associate Professor of Practice di Information Systems – Direttore Scientifico DEVO Lab
SDA Bocconi School of Management

Machine Learning Applications leveraging on transactional data

Alessandro Barardi, Head of Data Science & Artificial Intelligence Group Data & Intelligence Office **UniCredit**

L'uso delle tecniche di Intelligenza Artificiale al servizio della sicurezza della Banca e dei suoi clienti

Andrea Claudio Cosentini, Head of Data Science & AI **Intesa Sanpaolo**

Un'applicazione NLP all'analisi di scenario

Silvia Nardini, Competence leader Scenari e stress testing **Credem**

L'uso dell'intelligenza artificiale e dei dati alternativi nel rischio di credito

Giorgio Baldassarri, Global Head of the Analytical Innovation & Development Group **S&P Global Market Intelligence**

Altri interventi in corso di definizione/Other speakers to be defined

1.00 – 2.00 pm – BREAK E NETWORKING / *BREAK AND NETWORKING*

*In attesa di conferma.

Questa versione dell'agenda è provvisoria. Temi e Relatori potrebbero subire variazioni.



**7 giugno
mattina**

*7 June
morning*

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2023

GESTIRE i rischi. **GUARDARE** lontano

MANAGING risks and **LOOKING INTO** the future

11.30 am – 1.00 pm PARALLEL SESSION 4.2

I RISCHI DI MONEY LAUNDERING E TERRORIST FINANCING

THE RISKS OF MONEY LAUNDERING AND TERRORIST FINANCING

TRA I TEMI TRATTATI:

- La gestione del rischio AML alla luce delle Linee Guida EBA sul de-risking e financial inclusion nell'ottica AML
- Presidi di governance per la gestione del rischio AML e l'implementazione delle linee guida EBA in materia
- L'integrazione tra AML e gestione dei rischi di credito e dei rischi emergenti
- Digitalizzazione e Data Analytics: applicazioni ad AML e CTF
- AML e criptovalute

TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- *The management of AML risk in the light of the EBA Guidelines on de-risking and financial inclusion in an AML perspective*
- *Governance measures for managing AML risk and the implementation of the relevant EBA guidelines*
- *The integration between AML and management of credit and emerging risks*
- *Digitization and Data Analytics: applications to AML and CTF*
- *AML and Cryptocurrencies*

Chair: Paola Schwizer, Università di Parma

11.30 Apertura dei lavori a cura del chair

Paola Schwizer, Professore Ordinario di Economia degli Intermediari Finanziari **Università di Parma**

Michele Pisani, Chief AML Officer **BPER Banca**

Daniele Fradegrada, Group head of AML Advisory, Oversight & Investigations **UniCredit**

La nuova governance AML e l'autovalutazione come strumento di reporting

Massimiliano Baldoni, Head of AML/CFT **Gruppo Credem**

Matteo Montorfano, Senior Manager, Function Risk & Compliance **Accenture**

Altri interventi in corso di definizione/Other speakers to be defined

1.00 – 2.00 pm – BREAK E NETWORKING / BREAK AND NETWORKING

**In attesa di conferma.*

Questa versione dell'agenda è provvisoria. Temi e Relatori potrebbero subire variazioni.





**7 giugno
mattina**

*7 June
morning*

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2023

GESTIRE i rischi. **GUARDARE** lontano

MANAGING risks and **LOOKING INTO** the future

11.30 am – 1.00 pm PARALLEL SESSION 4.3

FORMULAZIONE DEGLI SCENARI E MISURAZIONE DELLE PERFORMANCE DELLA BANCA

SCENARIO FORMULATION AND BANK PERFORMANCE MEASUREMENT

TRA I TEMI TRATTATI:

- Lo EU-wide stress test EBA-ECB del 2023
- La formulazione degli scenari a fini regolamentari e gestionali
- Scenari e misurazione delle performance in termini di resilienza ai rischi e redditività

TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- *The EBA-ECB EU-wide stress test of 2023*
- *Scenario formulation for regulatory and management purposes*
- *Performance scenarios and measurement in terms of resilience to risks and profitability*

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

11.30 Apertura dei lavori a cura del chair

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

Carmelo Salleo, Head of Stress testing, Policy modelling, Climate change Division **Banca Centrale Europea**

Emanuela Lanzara, Chief Operating Officer **PRIMESAIL**

Daniela Garroni, Responsabile Pianificazione Strategica e Studi **Banco BPM**

Altri interventi in corso di definizione/Other speakers to be defined

1.00 – 2.00 pm – BREAK E NETWORKING / BREAK AND NETWORKING

**In attesa di conferma.*

Questa versione dell'agenda è provvisoria. Temi e Relatori potrebbero subire variazioni.



**7 giugno
pomeriggio**

7 June
afternoon

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2023

GESTIRE i rischi. **GUARDARE** lontano

MANAGING risks and **LOOKING INTO** the future

2.00 – 3.30 pm PARALLEL SESSION 5.1

DATI, STRUMENTI ED ORGANIZZAZIONE PER GESTIRE I RISCHI DEI SETTORI ECONOMICI

DATA, TOOLS AND ORGANISATION TO MANAGE RISKS IN ECONOMIC SECTORS

TRA I TEMI TRATTATI:

- Misurare l'appetibilità dei settori e delle filiere per le politiche creditizie
- Come segnalare alla rete i fattori critici di successo nei singoli settori, compresi quelli ESG?
- La creazione di unità della banca per presidiare in maniera sinergica i principali settori: pro e contro per la gestione dei rischi e lo sviluppo commerciale

TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- *Measuring the attractiveness of sectors and supply chains for credit policies*
- *How to signal to the network critical success factors in the individual sectors, including ESG sectors?*
- *The setting up of bank units for monitoring the main sectors in a synergistic way: pros and cons for risk management and commercial development*

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

2.00 Apertura dei lavori a cura del chair

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

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

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

Le "3F" del turismo. Finanza innovativa, Filiere, Fatti

Gabriele Nanni, Presidente InTour Rete d'impresa - UO Turismo Gruppo **Iccrea Banca**

Altri interventi in corso di definizione/Other speakers to be defined

1.00 – 2.00 pm – CHIUSURA DEI LAVORI E APPUNTAMENTO A SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2024
CLOSING AND SEE YOU AT SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2024

**In attesa di conferma.*

Questa versione dell'agenda è provvisoria. Temi e Relatori potrebbero subire variazioni.



7 giugno
pomeriggio

7 June
afternoon

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2023

GESTIRE i rischi. **GUARDARE** lontano

MANAGING risks and **LOOKING INTO** the future

2.00 – 3.30 pm PARALLEL SESSION 5.2

INSERIMENTO DEI FATTORI ESG NEL RAF, OBBLIGHI DI RENDICONTAZIONE E AZIONE

INCLUSION OF ESG FACTORS IN THE RAF, ACTION AND REPORTING OBLIGATIONS

TRA I TEMI TRATTATI:

- Le aspettative delle autorità di vigilanza sull'integrazione dei fattori ESG nel RAF
- Organizzarsi per la nuova rendicontazione di sostenibilità (CSRD e Pillar 3)
- Il valore della disclosure di sostenibilità: gli effetti sulla gestione aziendale, sulle relazioni di clientela e sulla reputazione della banca
- Il Say on Climate: prime esperienze
- Gli Stress Test climatici: take home e utilizzi gestionali

TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- The expectation of the supervisory authorities on the incorporation of ESG factors in the RAF
- Gearing up for the new sustainability reporting (CSRD and Pillar 3)
- The value of sustainability disclosure: the effects on corporate management, customer relations and the reputation of the bank
- The Say on Climate: first experiences
- Climate stress tests: take-homes and management uses

Chair: Paola Schwizer, Università di Parma

2.00 Apertura dei lavori a cura del chair

Paola Schwizer, Professore Ordinario di Economia degli Intermediari Finanziari
Università di Parma

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

L'evoluzione della disclosure sui rischi climatici e ambientali

Marzia Nobili, Relazioni Istituzionali **Credem Banca**

L'inserimento dei fattori ESG nel RAF: dalle aspettative di Vigilanza al Risk Appetite.

L'esperienza di una LSI

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

Giovanni Papiro, Partner & Co-Founder **ValueCube** e **Roberto Russo**, Chief Risk Officer **Banca Progetto**

Altri interventi in corso di definizione/Other speakers to be defined

1.00 – 2.00 pm – CHIUSURA DEI LAVORI E APPUNTAMENTO A **SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2024**
CLOSING AND SEE YOU AT **SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2024**

*In attesa di conferma.

Questa versione dell'agenda è provvisoria. Temi e Relatori potrebbero subire variazioni.



7 giugno
pomeriggio

7 June
afternoon

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2023

GESTIRE i rischi. **GUARDARE** lontano

MANAGING risks and **LOOKING INTO** the future

2.00 – 3.30 pm PARALLEL SESSION 5.3

LSI E INTERMEDIARI FINANZIARI: LE IMPLEMENTAZIONI REGOLAMENTARI E GESTIONALI

LSI AND FINANCIAL INTERMEDIARIES: REGULATORY AND MANAGEMENT IMPLEMENTATIONS

TRA I TEMI TRATTATI:

- L'impatto dei nuovi orientamenti della Banca d'Italia sulla governance
- Nuovi strumenti e nuove competenze
- Insourcing e outsourcing: un nuovo bilanciamento?
- LSI e ESG: interazioni "sostenibili"
- Modelli di business e dinamiche dei tassi di interesse

TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- The impact of the Bank of Italy's new guidelines on governance
- New tools and new skills
- Insourcing and outsourcing: a new balance?
- LSI and ESG: "sustainable" interactions
- Business models and interest rate dynamics

Chair: Rosa Coccozza, Università degli Studi di Napoli

2.00 Apertura dei lavori a cura del chair

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

Emanuela Salvi, Direttore, Divisione Gruppi Bancari V, Servizio Supervisione Bancaria II **Banca d'Italia** e **Francesca Cipriani**, Consigliere, Divisione Società Finanziarie e Organismi, Servizio Supervisione Intermediari Finanziari **Banca d'Italia**

Il ruolo della biodiversità per la stabilità del sistema finanziario

Saverio Continella, Direttore Generale **Banca Agricola Popolare di Ragusa**

Sergio Gatti, Direttore Generale **Federcasse**

Diversità e Inclusione nel Sistema del Credito Cooperativo

Teresa Fiordelisi, Presidente **Associazione delle Donne del Credito Cooperativo (IDEE)**

Altri interventi in corso di definizione/Other speakers to be defined

1.00 – 2.00 pm – CHIUSURA DEI LAVORI E APPUNTAMENTO A **SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2024**
CLOSING AND SEE YOU AT **SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2024**

*In attesa di conferma.

Questa versione dell'agenda è provvisoria. Temi e Relatori potrebbero subire variazioni.





SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2023

GESTIRE i rischi. **GUARDARE** lontano
*MANAGING risks and **LOOKING INTO** the future*

Promosso da



Organizzato da



In collaborazione con



Main Partner



Platinum Partner



Golden Partner



Brand Partner



Media Partner



Concessione Spazi

