



SUPERVISION
RISKS &
PROFITABILITY

CON LO SGUARDO A **BASILEA 3+**

tra vigilanza, nuovi rischi e
la sfida della competitività

*LOOKING AHEAD TO **BASEL 3+***

*supervision, new risks and
the challenge of
competitiveness*

12 – 13 giugno / june

SUPERVISION RISKS &
PROFITABILITY 2024

Milano, Auditorium Bezzi
Banco BPM

basilea.abieventi.it
[#abisupervision](https://twitter.com/abisupervision)

**Programma
provvisorio**
Draft Agenda

Promosso da

ABI Associazione
Bancaria
Italiana

Organizzato da

ABISERVIZI 

In collaborazione con

dipo 
database italiano perdite operative

Media Partner

BANCAFORTE
innovation key



12 giugno
12 June

SCHEMA DELLE SESSIONI AGENDA SCHEME

SESSIONI
PLENARIE

SESSIONI
PARALLELE

SESSIONI
PARALLELE
DIPO

9.45 – 10.45 am PLENARIA DI APERTURA / OPENING PLENARY SESSION

GLI SVILUPPI DELLA VIGILANZA SULLE BANCHE NELL'ERA DELLA INCERTEZZA GLOBALE E DELLE SFIDE DELLA AI

DEVELOPMENTS IN BANKING SUPERVISION IN THE ERA OF GLOBAL UNCERTAINTY AND THE CHALLENGES OF AI

Chair: Luca Davi, Il Sole 24 Ore

10.45 – 11.15 am – BREAK E NETWORKING / BREAK AND NETWORKING

11.15 am – 1.00 pm TAVOLA ROTONDA / ROUND TABLE

LE BANCHE CHIAMATE A GESTIRE INCERTEZZA GLOBALE E SFIDE DELLA AI: LA VISIONE DEI CONSULENTI

BANKS COPING WITH GLOBAL UNCERTAINTY AND AI CHALLENGES: THE CONSULTANTS' VIEW

Chair: Luca Davi, Il Sole 24 Ore

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

2.00 – 3.30 pm

PARALLEL SESSION 1.1

GESTIRE IL RISCHIO DI CREDITO NELLA NUOVA FASE DI MERCATO, NELLA PROSPETTIVA DI BASELEA 3-PLUS E DELLE SPECIFICAZIONI DELL'EBA

MANAGING CREDIT RISK IN THE NEW MARKET PHASE, FROM THE PERSPECTIVE OF BASEL 3+ AND EBA SPECIFICATIONS

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

2.00 – 3.30 pm

PARALLEL SESSION 1.2

GLI SVILUPPI DELLA SUPERVISIONE, DELLA GESTIONE E DEL REPORTING DELLE BANCHE SU SOSTENIBILITÀ, RISCHI CLIMATICI, AMBIENTALI E GREENWASHING

DEVELOPMENTS IN BANK SUPERVISION, MANAGEMENT AND REPORTING ON SUSTAINABILITY AND CLIMATE, ENVIRONMENTAL AND GREENWASHING RISKS

Chair: Giuseppe Torluccio,
Università di Bologna

2.00 am – 3.30 pm

PARALLEL SESSION 1.3

STRATEGIA DIGITALE E AI PER INNOVARE I PRODOTTI, I PROCESSI, LA GESTIONE DEI RISCHI E COME FONTE DI NUOVI RISCHI

DIGITAL STRATEGY AND AI INTELLIGENCE FOR INNOVATING PRODUCTS, PROCESSES, RISK MANAGEMENT AND AS A SOURCE OF NEW RISKS

Chair: Luigi Proserpio,
Università Bocconi

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

3.45 – 5.15 pm

PARALLEL SESSION 2.1

LIQUIDITY RISK E STRATEGIE DI FUNDING NEL NUOVO SCENARIO DI MERCATO E DELLA REGOLAMENTAZIONE

LIQUIDITY RISKS AND FUNDING STRATEGIES IN THE NEW MARKET AND REGULATORY ENVIRONMENT

Chair: Valter Lazzari,
Università LIUC

3.45 – 5.15 pm

PARALLEL SESSION 2.2

RISCHIO OPERATIVO E MANDATI EBA

OPERATIONAL RISK AND EBA MANDATES

Chair: Marco Giorgino,
Politecnico di Milano



3.45 – 5.15 pm

PARALLEL SESSION 2.3

LA BUONA GOVERNANCE DI FRONTE AI RISCHI EMERGENTI

GOOD GOVERNANCE IN THE FACE OF EMERGING RISKS

Chair: Paola Schwizer,
Università di Parma





SCHEMA DELLE SESSIONI AGENDA SCHEME

SESSIONI
PLENARIE

SESSIONI
PARALLELE

SESSIONI
PARALLELE
DIPO

9.30 – 11.00 am

PARALLEL SESSION 3.1

**L'EVOLUZIONE DEI SISTEMI
DI RATING DELLE BANCHE
PER ACCOGLIERE I BIG
DATA E I RISCHI ESG**

*HOW BANK RATING SYSTEMS
ARE EVOLVING TO
ACCOMMODATE BIG DATA AND
ESG RISKS*

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

9.30 – 11.00 am



PARALLEL SESSION 3.2

**AI E CYBER RISK
INTERROGANO IL RISCHIO
OPERATIVO**

*AI AND CYBER RISK – HOW
THEY BEAR ON OPERATIONAL
RISK*

**Chair: Paolo Giudici,
Università di Pavia**

9.30 – 11.00 am

PARALLEL SESSION 3.3

**LSI E INTERMEDIARI
FINANZIARI: LA GESTIONE DEI
RISCHI EMERGENTI E DELLA
COMPETITIVITÀ TRA SFIDE E
OPPORTUNITÀ**

*LSI AND FINANCIAL
INTERMEDIARIES: MANAGING
EMERGING RISKS AND
COMPETITIVENESS –
CHALLENGES AND
OPPORTUNITIES*

**Chair: Rosa Coccozza,
Università degli Studi di
Napoli**

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

11.30 am – 1.00 pm

PARALLEL SESSION 4.1

**COME CAMBIA L'APPROCCIO
AI RISCHI DI MERCATO:
MODELLI, MATERIALITY DELLE
ESTENSIONI, RISK MEASURES,
GESTIONE E REPORTING**

*HOW THE APPROACH TO
MARKET RISKS IS CHANGING:
MODELS, MATERIALITY OF
EXTENSIONS, RISK MEASURES,
MANAGEMENT AND REPORTING*

**Chair: Mario Anolli,
Università Cattolica del Sacro
Cuore**

11.30 am – 1.00 pm

PARALLEL SESSION 4.2

**NOVITÀ DI VALUTAZIONI E
REPORTING PRUDENZIALI E
CONTABILI**

*NEW TOOLS FOR PRUDENTIAL
AND ACCOUNTING
ASSESSMENTS AND REPORTING*

**Chair: Maurizio Comoli,
Università del Piemonte
Orientale**

11.30 am – 1.00 pm

PARALLEL SESSION 4.3

**IL CAMBIAMENTO DEL BUSINESS
DI BANCHE, IMEL E ALTRI
INTERMEDIARI: NUOVI
STRUMENTI E NUOVI RISCHI PER
IL CRO**

*THE CHANGING BUSINESS OF
BANKS, IMELS AND OTHER
INTERMEDIARIES: NEW
OPPORTUNITIES AND NEW RISKS
FOR THE CRO*

**Chair: Claudio Giannotti,
Università Lumsa**

1.00 – 2.30 pm – BREAK E NETWORKING / BREAK AND NETWORKING

2.30 – 4.00 pm PLENARIA DI CHIUSURA / CLOSING PLENARY SESSION

LA STRATEGIA E LA COMPETITIVITÀ DELLE BANCHE TRA RISCHI, REGOLE E INNOVAZIONI

*THE STRATEGY AND COMPETITIVENESS OF BANKS BETWEEN RISKS, RULES AND
INNOVATION*

Chair: tbd

4.00 pm – CHIUSURA DEI LAVORI E APPUNTAMENTO A **SUPERVISION, RISKS &
PROFITABILITY 2025**

*CLOSING AND SEE YOU AT **SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2025***





12 giugno
mattina
12 June
morning

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2024

Con lo sguardo a **BASILEA 3+**
*Looking ahead to **BASEL 3+***

9.00 – 9.45 am – ACCREDITO DEI PARTECIPANTI E NETWORKING
ACCREDITATION OF THE PARTICIPANTS AND NETWORKING

9.45 – 10.45 am PLENARIA DI APERTURA / OPENING PLENARY SESSION

GLI SVILUPPI DELLA VIGILANZA SULLE BANCHE NELL'ERA DELLA INCERTEZZA GLOBALE E DELLE SFIDE DELLA AI

DEVELOPMENTS IN BANKING SUPERVISION IN THE ERA OF GLOBAL UNCERTAINTY AND THE CHALLENGES OF AI

Chair: Luca Davi, Il Sole 24 Ore

9.45 ABI

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

Altri inviti istituzionali in corso

10.45 – 11.15 am – BREAK E NETWORKING / *BREAK AND NETWORKING*

11.15 am – 1.00 pm TAVOLA ROTONDA / ROUND TABLE

LE BANCHE CHIAMATE A GESTIRE INCERTEZZA GLOBALE E SFIDE DELLA AI: LA VISIONE DEI CONSULENTI

BANKS COPING WITH GLOBAL UNCERTAINTY AND AI CHALLENGES: THE CONSULTANTS' VIEW

Chair: Luca Davi, Il Sole 24 Ore

11.00 Lorenzo Bocchi, Managing Director **Prometeia**

Antonio Deledda, Executive Director **CRIF**

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

Giovanni Pepe, Partner, Head of Regulatory and Risk Advisory **KPMG**

Fabrizio Sarrocco, *ICEG Strategy&Consulting Financial Service Lead* **Accenture**

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

Altro intervento in corso di definizione

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



12 giugno
pomeriggio

12 June
afternoon

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2024

Con lo sguardo a **BASILEA 3+**

Looking ahead to **BASEL 3+**

2.00 – 3.30 pm **PARALLEL SESSION 1.1**

GESTIRE IL RISCHIO DI CREDITO NELLA NUOVA FASE DI MERCATO, NELLA PROSPETTIVA DI BASILEA 3-PLUS E DELLE SPECIFICAZIONI DELL'EBA

MANAGING CREDIT RISK IN THE NEW MARKET PHASE, FROM THE PERSPECTIVE OF BASEL 3+ AND EBA SPECIFICATIONS

TRA I TEMI TRATTATI:

- Il metodo AIRB è ancora conveniente?
- Gestire il livello di prudenza indotto dalla regolamentazione in modo da non rendere inaffidabile la stima dei parametri
- Le banche di fronte ai nuovi "Core principles for effective banking supervision" del Comitato di Basilea
- EU Banking Package CRR3 CRD6: opzioni regolamentari e riflessi sulla gestione del credito
- EBA impact study Basel III monitoring
- EBA-GL on Loan Origination and Monitoring: siamo a regime?

TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- *Is the AIRB method still cost-effective?*
- *Managing the regulatory-induced level of caution so that parameter estimates are not made unreliable*
- *Banks facing the Basel Committee's new "Core principles for effective banking supervision"*
- *EU Banking Package CRR3 CRD6: regulatory options and impact on credit management*
- *EBA impact study Basel III monitoring*
- *EBA-GL on Loan Origination and Monitoring: are we up to speed?*

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**

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

Emanuela Lanzara, Chief Operating Officer **PRIMESAIL**

Aurelio Maccario, Head of Risk Management **UniCredit**

Francesco Mottola, Managing Director **Accenture**

Michele Maugeri, Associate Partner **KPMG**

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



12 giugno
pomeriggio

12 June
afternoon

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2024

Con lo sguardo a **BASILEA 3+**

Looking ahead to **BASEL 3+**

2.00 – 3.30 pm **PARALLEL SESSION 1.2**

GLI SVILUPPI DELLA SUPERVISIONE, DELLA GESTIONE E DEL REPORTING DELLE BANCHE SU SOSTENIBILITÀ, RISCHI CLIMATICI, AMBIENTALI E GREENWASHING

DEVELOPMENTS IN BANK SUPERVISION, MANAGEMENT AND REPORTING ON SUSTAINABILITY AND CLIMATE, ENVIRONMENTAL AND GREENWASHING RISKS

TRA I TEMI TRATTATI:

- Piani di adeguamento alle aspettative BCE/Banca d'Italia
- EBA Environmental & Social Risks in prudential framework
- EBA sustainability disclosures for financial sectors
- Rendicontazione di sostenibilità nelle filiere
- I rischi climatici ed ambientali nel framework di risk management: situazione attuale e prospettive future

TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- Adjustment plans for ECB/Bank of Italy expectations
- EBA environmental & social risks in the prudential framework
- EBA sustainability disclosures for financial sector
- Sustainability reporting in supply chains
- Climate and environmental risks in the risk management framework: current situation and outlook

Chair: Giuseppe Torluccio, Università di Bologna

2.00 Apertura dei lavori a cura del chair

Giuseppe Torluccio, Professore Ordinario di Economia degli Intermediari Finanziari **Università di Bologna**

Tommaso Loizzo, Servizio Regolamentazione e Analisi Macroprudenziale **Banca d'Italia**

Nicola Gatto, ESG Governance Manager **illimity**

Luca Bartolucci, Associate Partner **Prometeia**

Gruppo Bancario La Cassa di Ravenna *

Banca Popolare Pugliese *

Altro intervento in corso di definizione

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



12 giugno
pomeriggio

12 June
afternoon

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2024

Con lo sguardo a **BASILEA 3+**

Looking ahead to **BASEL 3+**

2.00 – 3.30 pm PARALLEL SESSION 1.3

STRATEGIA DIGITALE E INTELLIGENZA ARTIFICIALE PER INNOVARE I PRODOTTI, I PROCESSI, LA GESTIONE DEI RISCHI E COME FONTE DI NUOVI RISCHI

DIGITAL STRATEGY AND ARTIFICIAL INTELLIGENCE FOR INNOVATING PRODUCTS, PROCESSES, RISK MANAGEMENT AND AS A SOURCE OF NEW RISKS

TRA I TEMI TRATTATI:

- Digital business transformation
- Digital customer relationships
- L'AI come fonte di innovazioni di prodotto e di processo
- La strategia digitale come volano per la realizzazione dei programmi di risk transformation e operational resilience
- EBA Open Forum on Digital Transformation

TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- Digital business transformation
- Digital customer relationships
- AI as a source of product and process innovations
- Digital strategy as a driver for the implementation of risk transformation and operational resilience programmes
- EBA Open Forum on Digital Transformation

Chair: Luigi Proserpio, Università Bocconi

2.00 Apertura dei lavori a cura del chair

Luigi Proserpio, Professore Associato di Management e Tecnologia **Università Bocconi**

Alessio Tartaglione, Servizio Ispettorato Vigilanza **Banca d'Italia**

Luca Giordano, Head of Data Governance **Intesa Sanpaolo**

Anselmo Marmonti, Vice President Risk, Fraud & Compliance Solutions **SAS**
e **Alida Popescu**, Customer Advisory Manager Risk Practice **SAS**

Manuel Angel Guzman Caba, Partner **Management Solutions**

Fabio Foglia, Docente di Intelligenza Artificiale **Università Bocconi** e **Talent garden** e
Fondatore **AiLandings**

Altro intervento in corso di definizione

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



12 giugno
pomeriggio

12 June
afternoon

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2024

Con lo sguardo a **BASILEA 3+**

Looking ahead to **BASEL 3+**

3.45 – 5.15 pm **PARALLEL SESSION 2.1**

LIQUIDITY RISK E STRATEGIE DI FUNDING NEL NUOVO SCENARIO DI MERCATO E DELLA REGOLAMENTAZIONE

LIQUIDITY RISKS AND FUNDING STRATEGIES IN THE NEW MARKET AND REGULATORY ENVIRONMENT

TRA I TEMI TRATTATI:

- L'impatto dei trend di politica monetaria su forme mix di raccolta beta dei depositi
- Il pricing della raccolta commerciale: come gestire il beta dei depositi durante restrizioni ed espansioni monetarie
- Vincoli di liquidità e gestione del conto economico nel nuovo paradigma di politica monetaria
- Altri canali di trasmissione delle nuove politiche monetarie sui profili di redditività e liquidità delle banche
- EBA Report su specific aspects of net stable funding ratio (NSFR) framework
- Liquidity esg

TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- *The impact of monetary policy trends on beta deposit collection mix*
- *Commercial collection pricing: how to manage deposit beta during monetary restrictions and expansions*
- *Liquidity constraints and income statement management in the new monetary policy paradigm*
- *Other transmission channels of the new monetary policies on banks' profitability and liquidity profiles*
- *EBA Report on specific aspects of net stable funding ratio (NSFR) framework*
- *Liquidity esg*

Chair: Valter Lazzari, Università LIUC

3.45 Apertura dei lavori a cura del chair

Valter Lazzari, Professore Ordinario di Economia degli Intermediari Finanziari **Università LIUC**

Mauro Ronca, Servizio Supervisione Bancaria 2 **Banca d'Italia**

Rocco Fanciullo, Head of Liquidity Risk Management **UniCredit**

Francesco Berti, Risk management - Coordinatore Team Rischi di Liquidità **Banca Monte dei Paschi di Siena**

Matteo Formenti, Group Treasury - Business Development **Mediobanca**

Altro interventi in corso di definizione

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



12 giugno
pomeriggio

12 June
afternoon

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2024

Con lo sguardo a **BASILEA 3+**

Looking ahead to **BASEL 3+**

3.45 – 5.15 pm **PARALLEL SESSION 2.2**

RISCHIO OPERATIVO E MANDATI EBA

OPERATIONAL RISK AND EBA MANDATES

TRA I TEMI TRATTATI:

EBA, i temi del Rischio Operativo in consultazione: RTS e ITS sulla composizione del nuovo Business Indicator e ITS riguardo la modifica dell'informativa di terzo pilastro e i requisiti di segnalazione di vigilanza per il rischio operativo

TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

EBA – consultation on operational risk issues: RTS and ITS on the composition of the new Business Indicator and ITS on the change in Pillar 3 disclosure and supervisory reporting requirements for operational risk

Chair: Marco Giorgino, Politecnico di Milano

dipo

database italiano perdite operative

3.45 Apertura dei lavori a cura del chair

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

Marco Castellaneta, Operational Risk Management **Mediobanca**

Altri interventi in corso di definizione

5.15 pm - CHIUSURA DEI LAVORI DELLA PRIMA GIORNATA

END OF THE FIRST DAY OF THE CONFERENCE



12 giugno
pomeriggio

12 June
afternoon

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2024

Con lo sguardo a **BASILEA 3+**

Looking ahead to **BASEL 3+**

3.45 – 5.15 pm PARALLEL SESSION 2.3

LA BUONA GOVERNANCE DI FRONTE AI RISCHI EMERGENTI

GOOD GOVERNANCE IN THE FACE OF EMERGING RISKS

TRA I TEMI TRATTATI:

- ESA (ESMA, EIOPA, EBA) second public consultation on fit & proper assessment
- La direttiva su corporate sustainability due diligence (CSDDD)
- La governance dei rischi non finanziari
- Il Board e il Reputational risk
- Come potenziare la Risk culture

TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- ESA (ESMA, EIOPA, EBA) second public consultation on fit & proper assessment
- The Corporate Sustainability Due Diligence Directive (CSDDD)
- The governance of non-financial risks
- The board and reputational risk
- How to enhance risk culture

Chair: Paola Schwizer, Università di Parma

3.45 Apertura dei lavori a cura del chair

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

Alessandro Carretta, Presidente Comitato Rischi **Banca Popolare di Sondrio** e Ordinario di
Economia degli Intermediari Finanziari **Università di Roma Tor Vergata**

Domenico Fileppo, Responsabile Direzione Operational, ICT e Cyber Risk Management **Intesa
Sanpaolo**

Avantage Reply

Giovanni Lombardo, General Counsel **illimity**

Barbara Chiloire, Partner **Management Solutions**

Altri interventi in corso di definizione

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



**13 giugno
mattina**

13 June
morning

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2024

Con lo sguardo a **BASILEA 3+**

Looking ahead to **BASEL 3+**

9.30 – 11.00 am **PARALLEL SESSION 3.1**

L'EVOLUZIONE DEI SISTEMI DI RATING DELLE BANCHE PER ACCOGLIERE I BIG DATA E I RISCHI ESG

HOW BANK RATING SYSTEMS ARE EVOLVING TO ACCOMMODATE BIG DATA AND ESG RISKS

TRA I TEMI TRATTATI:

- Motori evoluti di stima del rischio di credito a servizio dei processi decisionali (leva su nuove sorgenti dati e analytics)
- Gli Score ESG in un contesto di informazioni ancora non standardizzate: Make or Buy?
- Le metodologie di inclusione dei fattori ESG nei rischi bancari
- L'utilizzo dei dati alternativi (quali i dati transazionali) e delle tecniche di ML nei modelli credit risk, manageriali (EWS, Next Best Actions) e regolamentari
- La proiezione delle misure di rischio includendo i fattori ESG

TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- *Evolved credit risk estimation engines aiding decision-making processes (leveraging new data sources and analytics)*
- *ESG scores in a context of still non-standardised information: Make or Buy?*
- *Methodologies for including ESG factors in banking risks*
- *The use of alternative data (such as transactional data) and ML techniques in credit risk, managerial (EWS, Next Best Actions) and regulatory models*
- *The projection of risk measures including ESG factors*

Chair: Giacomo De Laurentis, Università Bocconi

9.30 Apertura dei lavori a cura del chair

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

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

Fabio Salis, Chief Risk Officer **Gruppo Banco Desio**

Valuecube

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

Deloitte

Altri interventi in corso di definizione

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



13 giugno
mattina

13 June
morning

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2024

Con lo sguardo a **BASILEA 3+**

Looking ahead to **BASEL 3+**

9.30 – 11.00 am **PARALLEL SESSION 3.2**

AI E CYBER RISK INTERROGANO IL RISCHIO OPERATIVO

AI AND CYBER RISK – HOW THEY BEAR ON OPERATIONAL RISK



TRA I TEMI TRATTATI:

- Il Rischio operativo associato con l'intelligenza artificiale: opportunità e limitazioni, l'uso dell'AI per la creazioni di false persone
- Un case study di AI analizzato dall'ORM
- Strategie di Cyber security per contrastare le eventuali minacce dell'AI
- La resilienza dell'ORM alla continua evoluzione del Cyber Risk
- Risk analytics per l'individuazione, prevenzione e forecasting delle frodi
- Tassonomia dei rischi
- Rischio fisico

TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- *Operational risks linked to artificial intelligence: opportunities and limitations; the use of AI to create false persons*
- *An AI case study analysed by ORM*
- *Cyber security strategies to counter possible AI threats*
- *ORM resilience in the face of evolving cyber risks*
- *Risk analytics for fraud detection, prevention and forecasting*
- *Taxonomy of risk*
- *Physical risk*

Chair: Paolo Giudici, Università di Pavia

9.30 Apertura dei lavori a cura del chair

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

Ilaria Masiani, Servizio Rapporti Istituzionali di Vigilanza **Banca d'Italia**

Mattia Centurelli, Data Scientist **Credem**

Augeos

Nicasio Muscia, Managing Director e **Martina Pettazzi**, Manager **Accenture Risk & Compliance**

Silvano Basile, Senior Manager **Sopra Steria**

Altri interventi in corso di definizione

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



**13 giugno
mattina**

*13 June
morning*

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2024

Con lo sguardo a **BASILEA 3+**

*Looking ahead to **BASEL 3+***

9.30 – 11.00 am PARALLEL SESSION 3.3

LSI E INTERMEDIARI FINANZIARI: LA GESTIONE DEI RISCHI EMERGENTI E DELLA COMPETITIVITÀ TRA SFIDE E OPPORTUNITÀ

LSI AND FINANCIAL INTERMEDIARIES: MANAGING EMERGING RISKS AND COMPETITIVENESS – CHALLENGES AND OPPORTUNITIES

TRA I TEMI TRATTATI:

- Analisi e aspettative della Banca d'Italia su rischi climatici e ambientali
- Piani di azione di LSI e intermediari non bancari
- Il rischio fisico per LSI e IF
- CSRD: un'opportunità rilevante
- Nuovi profili di competenza della governance

TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- *BDI, climate and environmental risks*
- *Action plans of LSIs and non-bank intermediaries*
- *Physical risks for LSIs and IFs*
- *CSRD: a Significant opportunity*
- *New governance competency profiles*

Chair: Rosa Coccozza, Università degli Studi di Napoli

9.30 Apertura dei lavori a cura del chair

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

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

Anna Pignagnoli, Sustainable Finance **BDO Advisory Services**
e **Emanuele Berselli**, Partner **BDO Italia**

Altri interventi in corso di definizione

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



13 giugno
mattina

13 June
morning

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2024

Con lo sguardo a **BASILEA 3+**

Looking ahead to **BASEL 3+**

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

COME CAMBIA L'APPROCCIO AI RISCHI DI MERCATO: MODELLI, MATERIALITY DELLE ESTENSIONI, RISK MEASURES, GESTIONE E REPORTING

HOW THE APPROACH TO MARKET RISKS IS CHANGING: MODELS, MATERIALITY OF EXTENSIONS, RISK MEASURES, MANAGEMENT AND REPORTING

TRA I TEMI TRATTATI:

- La gestione del rischio Tasso del portafoglio di proprietà: aggiornamenti normativi,
- Gli spazi di manovra nella gestione del Banking Book e le implicazioni sul modello di business
- Le implicazioni per la ristima dei Modelli comportamentali per i depositi a vista
- FRTB: aggiornamenti normativi EBA e implicazioni sul modello di business
- I profili di governance dei rischi di mercato

TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- *Property portfolio rate risk management: regulatory updates*
- *Room for manoeuvre in the management of the Banking Book and the implications for business model*
- *The Implications for the reestimation of behavioural models for demand deposits*
- *FRTB: EBA regulatory updates and implications for business models*
- *Governance profiles of market risks*

Chair: Mario Anolli, Università Cattolica del Sacro Cuore

11.30 Apertura dei lavori a cura del chair

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

Mario Cortese, Servizio Supervisione Bancaria 1 **Banca d'Italia**

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

Giada Scalpelli, Senior Customer Advisor Risk Management **SAS**

Davide Segantin, Head of Market and Counterparty Risk **Banco BPM**

Altri interventi in corso di definizione

1.00 – 2.30 pm – BREAK E NETWORKING / *BREAK AND NETWORKING*



**13 giugno
mattina**

*13 June
morning*

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2024

Con lo sguardo a **BASILEA 3+**

*Looking ahead to **BASEL 3+***

11.30 am – 1.00 pm PARALLEL SESSION 4.2

NOVITÀ DI VALUTAZIONI E REPORTING PRUDENZIALI E CONTABILI

NEW TOOLS FOR PRUDENTIAL AND ACCOUNTING ASSESSMENTS AND REPORTING

TRA I TEMI TRATTATI:

- L'inclusione dei fattori ESG nella valutazione dei crediti
- CRSBB in ambito EBA RTS Reporting Framework
- Il Framework IFRS9 nel contesto di incertezza macroeconomica: in-model e post-model adjustments
- L'inclusione della dimensione settoriale nei modelli satellite per il collegamento tra variabili macro e parametri di rischio
- EBA on the centralization of banks Pillar 3 disclosures

TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- *The inclusion of ESG factors in*
- *CRSBB within the EBA RTS Reporting Framework*
- *The IFRS9 Framework in the context of macroeconomic uncertainty: in-model and post-model adjustments*
- *The inclusion of the sectoral dimension in satellite models for linking macro variables and risk parameters*
- *EBA on the centralisation of banks: Pillar 3 disclosures*

Chair: Maurizio Comoli, Università del Piemonte Orientale

11.30 Apertura dei lavori a cura del chair

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

Banco BPM

Alessia Colagioia, **BDO Advisory Services** e
Emanuele Berselli, Partner **BDO Italia**

Jason Kessler, Chief Risk Officer **Cassa Centrale Banca**

Altri interventi in corso di definizione

1.00 – 2.30 pm – BREAK E NETWORKING / *BREAK AND NETWORKING*



13 giugno
mattina
13 June
morning

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2024

Con lo sguardo a **BASILEA 3+**
*Looking ahead to **BASEL 3+***

11.30 am – 1.00 pm PARALLEL SESSION 4.3

IL CAMBIAMENTO DEL BUSINESS DI BANCHE, IMEL E ALTRI INTERMEDIARI: NUOVI STRUMENTI E NUOVI RISCHI PER IL CRO

THE CHANGING BUSINESS OF BANKS, IMELS AND OTHER INTERMEDIARIES: NEW OPPORTUNITIES AND NEW RISKS FOR THE CRO

TRA I TEMI TRATTATI:

- Le strategie, il posizionamento competitivo e i modelli di business nella prospettiva delle piattaforme e degli ecosistemi
- Il valore delle connessioni tra operatori finanziari e non finanziari, pubblici e privati: tendenze, opportunità e fattori da governare
- Le nuove opportunità e i nuovi rischi: il punto di vista del CRO
- Verso l'Open Finance e la Data Economy: PSD3, PSR e FIDA
- Il Markets in Crypto-Assets Regulation (MICAR): impatti e nuovi scenari

TOPICS FOR DISCUSSION INCLUDE:

- *Strategies, competitive positioning and business models from the perspective of platforms and ecosystems*
- *The value of connections between financial and non-financial operators, public and private: trends, opportunities and factors to govern*
- *New Opportunities and Risks: CRO's Perspective*
- *Towards Open Finance and the Data Economy: PSD3, PSR and FIDA*
- *The Markets in Crypto-Assets Regulation (MICAR): impacts and new scenarios*

Chair: Claudio Giannotti, Università Lumsa

11.30 Apertura dei lavori a cura del chair

Claudio Giannotti, Professor of Banking and Finance **Università Lumsa**

Maria Grazia Topa, Servizio Supervisione Intermediari Finanziari **Banca d'Italia**

ABI

Banca Sella *

Banca Mediolanum *

Altri interventi in corso di definizione

1.00 – 2.30 pm – BREAK E NETWORKING / BREAK AND NETWORKING





12 giugno
pomeriggio

12 June
afternoon

SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2024

Con lo sguardo a **BASILEA 3+**

Looking ahead to **BASEL 3+**

2.30 – 4.00 pm PLENARIA DI CHIUSURA / CLOSING PLENARY SESSION

LA STRATEGIA E LA COMPETITIVITÀ DELLE BANCHE TRA RISCHI, REGOLE E INNOVAZIONI

THE STRATEGY AND COMPETITIVENESS OF BANKS BETWEEN RISKS, RULES AND INNOVATION

Chair: tbd

2.30 Gianfranco Torriero, Vice Direttore Generale Vicario **ABI**

Edoardo Maria Ginevra, Condirettore Generale e CFO **Banco BPM**

Intesa Sanpaolo *

Altri interventi in corso di definizione

4.00 pm – CHIUSURA DEI LAVORI E APPUNTAMENTO A **SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2025**

*CLOSING AND SEE YOU AT **SUPERVISION, RISKS & PROFITABILITY 2025***



Promosso da



Organizzato da



In collaborazione con



Main Partner



Platinum Partner



Golden Partner



Silver Partner



Partner Tecnico



Media Partner

