



Convention AIFIRM

(partecipazione riservata ai soci)

Le sfide del risk management alla luce delle evoluzioni normative e regolamentari: dall'avvio dei principi IFRS9 agli stress test EBA /SSM 2018

28 Novembre 2017

Sede del Convegno: BANCO BPM – Sala delle Colonne – Via San Paolo, 12 – 20121 Milano

La Convention, **organizzata da AIFIRM in collaborazione con Prometeia**, propone una giornata di discussione sugli impatti della professione di risk manager a seguito dei recenti cambiamenti normativi.

I temi di riflessione e approfondimento sono numerosi e riguardano tra gli altri:

- Le sfide della first time adoption IFRS9: dal roll-out alla validation
- Il nuovo framework di stress test integrati EBA/SSM, relazioni con IFRS9 e l'impatto sulla capital guidance SREP
- Le implicazione per lo sviluppo di un efficace collaboration model con le altre funzioni di governo (CFO, CLO..)

Durante la giornata saranno presentati i lavori di ricerca condotti da AIFIRM.

Si ringrazia





Programma

- 9.30-9.40 **Presentazione dell'evento e saluti** – Paolo Testi (Direttore Generale BPM)/ e Davide Alfonsi (Presidente AIFIRM)
- Moderatore:** Giuseppe Lusignani (Università di Bologna, Presidente Collegio Probiviri di AIFIRM)
- 09.40-10.10 Introduzione a cura di Giuseppe Lusignani
- 10.10-10.40 **L'approccio ai rischi nella prospettiva del supervisore: stato dell'arte e agenda per il futuro**
Francesco Cannata (Banca di Italia)
- 10.40-11.00 **La vigilanza sugli impieghi nell'Eurozona: credito e discredito**
Andrea Resti (Università Bocconi e advisor del Parlamento Europeo)
- 11.00-11.20 **I nuovi stress test EBA/SSM e le prospettive per la redditività bancaria**
Giampaolo Gabbi (Università di Siena)
- 11.20-11.50 *Coffee break*
- 11.50-12.20 **IFRS9: challenges implementative e implicazioni per Stress Test 2018"**
Lorenzo Bocchi (Prometeia) e Fabio Salis (Banco BPM)
- 12.20-12.40 **Integrazione del CRO con le funzioni di governo: opportunità dal contesto regolamentare**
Mauro Senati (UBI)
- 12.40-13.00 **Il Ruolo del RAF nella governance delle banche**
Diego Onorato (Intesa San Paolo) e Marina Brogi (Università La Sapienza)

13.00 – 14.00 Lunch

L'ATTIVITA' DI RICERCA AIFIRM

- Moderatore** Maurizio Vallino (Banca Carige e Direttore responsabile "Risk Management Magazine")
- 14.00-14.20 **Commissione AIFIRM "Il Margin of Conservatism nei Modelli IRB: requisiti normativi, fondamenti statistici e problemi applicativi"**
Franco Varetto (Politecnico di Torino) e Silvio Cuneo (Intesa San Paolo)
- 14.20-14.40 **Commissione AIFIRM " Recovery Plan: punti di forza e di debolezza"**
Mario Anolli (Università Cattolica), Maurizio Vallino (Banca Carige) e Fabio Verachi (Intesa San Paolo)
- 14.40-15.00 **Commissione AIFIRM Rischi di Mercato – "Fundamental Review of the Trading Book"**
Umberto Cherubini (Università di Bologna) e Marco Bianchetti (Intesa San Paolo)
- 15.00-15.20 **Machine Learning: uno strumento diagnostico per l'individuazione di anomalie di mercato**
Alessia Cafferata (Università di Genova) e Pier Giuseppe Giribone (Banca Carige SpA)
- 15.20-15.40 **The Standardised Measurement Approach (SMA) per i rischi operativi**
Giacomo Petrini (Banco BPM) e Camillo Giliberto (pubblicista Aifirm)
- 15.40 16.00 **Bilancio Aifirm (assemblea ordinaria)**
- 16.00 16.15 **il dialogo con l'UNI per la definizione di standard sulla professione di Risk Manager**
Fernando Metelli (presidente onorario Aifirm)
- 16.15 17.00 **Dibattito e Conclusioni**