



Associazione Italiana Financial Industry Risk Managers



**RISK
MANAGEMENT
MAGAZINE**

Rivista dell'Associazione Italiana Financial Industry Risk Managers

XIV Convention AIFIRM (partecipazione riservata ai soci)

I nuovi orizzonti del Risk Management nella creazione del valore

6 Dicembre 2018

Sede del Convegno: BANCO BPM – Centro servizi Bezzi - Via Massaua 6 Milano

La Convention, **organizzata da AIFIRM in collaborazione con Thomson Reuters**, propone una giornata di discussione sui nuovi orizzonti del risk manager nella creazione del valore in una fase economica ancora difficile per la redditività bancaria.

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

- gli aspetti di redditività del Sistema bancario
- i business model tra aspetti di *governance* e aspetti di strategia
- la declinazione della tecnologia tra reddito e rischi

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

Ai partecipanti soci Aifirm verranno riconosciuti 30 crediti formativi

Si ringrazia

The Financial and
Risk business of
Thomson Reuters
is now Refinitiv.



THOMSON REUTERS™

BANCO BPM



Programma

9.30-9.40 **Presentazione dell'evento e saluti** – Paolo Testi (BPM)/ e Davide Alfonsi (Presidente AIFIRM)

Moderatore: Giuseppe Lusignani (Università di Bologna, Presidente Collegio Probiviri di AIFIRM)

09.40-10.00 **Introduzione** a cura di Giuseppe Lusignani

10.00-10.20 **Quale Secondo Pilastro dopo la crisi?**
Francesco Cannata (Banca d'Italia)

10.20-10.40 **Il riassetto delle Autorità Indipendenti: le lezioni della crisi e le nuove sfide**
Vittorio Conti (HI-MTF)

10.40-11.00 **Business Model: dai modelli Srep alla governance bancaria, quale interiorizzazione?**
Paola Schwizer (Università di Parma)

11.00-11.20 *Coffee break*

11.20-11.40 **Prospettive di evoluzione della strategia di funding delle banche a fronte delle sfide poste dai nuovi requisiti prudenziali in materia di liquidity risk"**
Aurelio Maccario (Unicredit)

11.40-12.00 **La redditività del sistema bancario: dove sono finiti i soldi?**
Andrea Resti (Università Bocconi e advisor del Parlamento Europeo)

12.00-12.20 **ERM – A state of the Art**
Christophe Calant (Thomson Reuters Financial & Risk -now Refinitiv)

12.20-12.40 **Il lending digitale in Credimi : dati e connettività al servizio del Risk Management**
Ignazio Rocco di Torrepadula (Credimi)

12.40-13.00 **Cessioni di non performing loans ed LGD: come evitare la "distruzione di valore"?**
Fabio Salis (Credito Valtellinese)

13.00 – 14.00 Lunch

L'ATTIVITA' DI RICERCA AIFIRM

Moderatore Maurizio Vallino (Direttore responsabile "Risk Management Magazine")

14.00- 14.10 **Fintech risk management: ricerca e formazione per un modello regolamentare europeo**
Paolo Giudici (Università di Pavia)

14.10-14.30 *Commissione AIFIRM "Business Model e SREP"*
Marco Di Antonio (Università di Genova)

14.30-14.50 *Commissione AIFIRM "Intelligenza Artificiale: l'applicazione di Machine Learning e Predictive Analytics nel Risk Management"*
Paola Cerchiello (Università di Pavia) e Pier Giuseppe Giribone (Banca Carige)

14.50-15.10 *Commissione AIFIRM Rischi di Mercato – "Aggiornamenti FRTB e nuovi tassi Benchmark"*
Umberto Cherubini (Università di Bologna) e Marco Bianchetti (Intesa San Paolo)

15.10-15.30 *Commissione AIFIRM "Il Cyber Risk"*
Marina Brogi (Presidente Comitato Tecnico Scientifico AIFIRM)

15.30-15.50 **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)

15.50-16.00 **Il dialogo con l'UNI per la definizione di standard sulla professione di Risk Manager**
Fernando Metelli (presidente onorario Aifirm)

16.00-16.30 **Approvazione Bilancio, modifiche statutarie e elezione nuovo Consiglio Aifirm**

16.30-17.00 **Conclusioni**
Corrado Meglio (Vicepresidente Aifirm)