

# Rischi di mercato ricerca e nuove sfide per il risk management

## EVENTO IN MEMORIA DI MAURO MACCARINELLI

**Mercoledì 11 ottobre 2023, ore 14,30 → 17,30**

**Sede del Convegno: Sala Bramante Fondazione Stelline  
Corso Magenta, 61 - 20123 Milano (Italia)**

AIFIRM e Intesa Sanpaolo dedicano una giornata di studio sui rischi di mercato alla memoria di Mauro Maccarinelli, recentemente e prematuramente scomparso.

I temi affrontati comprendono le attività di ricerca, le novità del settore quale le segnalazioni FRTB, il rischio modello, l'introduzione dei fattori ESG per la gestione del rischio, ecc.

La partecipazione è gratuita e aperta.

Per iscriversi all'evento compilare il form al seguente link:

<https://www.segreteria-aifirm.it/Eventi/regForm?TID=27>

Ai partecipanti soci AIFIRM verranno riconosciuti **8 crediti formativi**

In collaborazione con

**INTESA**  **SANPAOLO**



## Programma

Saluti e introduzione ai lavori

- **Fernando Metelli**, *Presidente onorario, AIFIRM*

Chairman

- **Davide Alfonsi**, *Chief Risk Officer, Intesa Sanpaolo e Past President, AIFIRM*

Relatori

- **Pietro Virgili**, *Head of Market and Financial Risk Management, Intesa Sanpaolo* **Model risk: risk identification - limiti e debolezze dei modelli di valutazione del rischio**
- **Francesco Saita**, *Professore Ordinario, Università Bocconi* **Model risk: la governance e il ruolo del top management e del Board**
- **Pierpaolo Montana**, *Chief Risk Officer, Mediobanca* **Integrazione del rischio climatico nel market risk**
- **Raffaele Barteselli**, *Head of Risk Models, Banco BPM* **Inclusione del “fattore green” nei rischi di mercato**
- **Lorenzo Liesch**, *Head of Valuation Methodologies and Models & Market Risk Management, Unicredit* – **FRTB: Failed Review of the Trading Book?!**
- **Carlo Frazzei**, *Head of Market/ALM Risk, Banca Sella* **FRTB: Implicazioni per la gestione del portafoglio e del rischio per un banca di medie dimensioni**
- **Maurizio Vallino**, *Head of Risk & ESG Integration, BPER Banca e Direttore responsabile Risk Management Magazine* - **Pier Giuseppe Giribone**, *Financial Engineer, BPER Banca - Adjunct Professor, Università di Genova (DIEC)* **Risk Management Magazine - Studi e approfondimenti di finanza quantitativa**

Saluti e conclusioni

- **Corrado Meglio**, *Chief Risk Officer, Banco di Credito Popolare e Vice President, AIFIRM*