



UNIONE BANCARIA E BASILEA 3 RISK & SUPERVISION 2017

ROME
14th - 15th JUNE
Palazzo dei Congressi

 #abibasilea

ABI Associazione
Bancaria
Italiana

ABISERVIZI  **ABI
EVENTI**

MERCOLEDÌ 14 GIUGNO | WEDNESDAY 14th JUNE

9.15 AM **SESSIONE PLENARIA DI APERTURA - PRIMA PARTE**
PLENARY OPENING SESSION - PART ONE
I NUOVI SCENARI REGOLAMENTARI | *THE NEW REGULATORY SCENARIOS*

SESSIONE PLENARIA DI APERTURA - SECONDA PARTE
PLENARY OPENING SESSION - PART TWO
I NUOVI SCENARI REGOLAMENTARI | *THE NEW REGULATORY SCENARIOS*

2.30 PM **SESSIONI PARALLELE** | *PARALLEL SESSIONS*

A
SESSIONE PARALLELA
PARALLEL SESSION
RISCHIO DI CREDITO
CREDIT RISK

B
SESSIONE PARALLELA
PARALLEL SESSION
RISCHIO DI LIQUIDITÀ
E FUNDING
*LIQUIDITY AND FUNDING
RISK*

C
SESSIONE PARALLELA
PARALLEL SESSION
RISCHIO DI
CONTROPARTE
E DI MERCATO
*COUNTERPARTY
AND MARKET RISK*

D
SESSIONE PARALLELA
PARALLEL SESSION
RISCHI DI GOVERNANCE,
REPUTAZIONALI,
DI COMPLIANCE E
DI COMUNICAZIONE
*GOVERNANCE,
REPUTATIONAL,
COMPLIANCE AND
COMMUNICATION RISKS*

E
SESSIONE PARALLELA
PARALLEL SESSION
RISCHIO OPERATIVO
OPERATIONAL RISK

dipo
dati e servizi italiani per la politica operativa



GIOVEDÌ 15 GIUGNO | THURSDAY 15th JUNE

9.15 AM SESSIONI PARALLELE | PARALLEL SESSIONS

F SESSIONE PARALLELA PARALLEL SESSION

RISK DATA
AGGREGATION
E RISK REPORTING
*RISK DATA
AGGREGATION
AND RISK REPORTING*

G SESSIONE PARALLELA PARALLEL SESSION

BMA, RAF E RECOVERY
PLAN
*BMA, RAF AND
RECOVERY PLAN*

H SESSIONE PARALLELA PARALLEL SESSION

RISK MANAGEMENT
E IFRS9
*RISK MANAGEMENT
AND IFRS9*

I SESSIONE PARALLELA PARALLEL SESSION

BANCHE LESS
SIGNIFICANT E
INTERMEDIARI
FINANZIARI
*LESS SIGNIFICANT
BANKS AND FINANCIAL
INTERMEDIARIES*

L SESSIONE PARALLELA PARALLEL SESSION

RISCHIO OPERATIVO
OPERATIONAL RISK

dipo
divisione fiduciaria credito operativo

2.00 PM TAVOLA ROTONDA DI CHIUSURA CLOSING ROUNDTABLE LA GESTIONE DEGLI NPL | NPL MANAGEMENT



8.30 AM Registrazione dei partecipanti, caffè di benvenuto e visita all'Area Espositiva
Participant registration, Welcome Coffee and visit to the Exhibition Area

I NUOVI SCENARI REGOLAMENTARI THE NEW REGULATORY SCENARIOS

Chair

Giovanni Sabatini, ABI

Prima Parte - First Part

9.15 AM Apertura dei lavori | Opening address

Giovanni Sabatini, *Direttore Generale* ABI

LE BANCHE CENTRALI | THE CENTRAL BANKS

Le sfide affrontate dal settore bancario europeo

Challenges faced by the European banking sector

Vitor Constâncio, *Vice Presidente* Banca Centrale Europea

Il sistema bancario italiano e l'uscita dalla crisi

The Italian banking system and the exit from the crisis

Fabio Panetta, *Vice Direttore Generale* Banca d'Italia

e *Membro del Supervisory Board* Single Supervisory Mechanism

LA COMMISSIONE EUROPEA | THE EUROPEAN COMMISSION

Verso un nuovo equilibrio regolamentare | Towards a new regulatory equilibrium

Mario Nava, *Direttore per la sorveglianza del sistema finanziario e per la gestione delle crisi* Commissione Europea

11.15 AM Coffee Break, networking e visita all'Area Espositiva

Coffee Break, networking and visit to the Exhibition Area

Chair

Luca Davi, *Giornalista* Il Sole 24 Ore

Seconda Parte - Second Part

12.00 PM I nuovi scenari regolamentari - Banking Union e Capital Markets Union: le sfide future

The new regulatory scenarios - Banking Union and Capital Markets Union: the challenges ahead

Rainer Masera, *Preside della Facoltà di Economia* Università degli Studi Guglielmo Marconi

Il risk management oltre la regolamentazione | Risk management beyond regulation

Pietro Penza, *Partner* PwC

Ultimo miglio all'arrivo? | Last mile home?

Giovanni Pepe, *Partner* KPMG Advisory

RENATO MAINO LECTURE

Recovery in profits

Mark Carey, *Associate Director Division of International Finance* Federal Reserve Board

1.15 PM Buffet Lunch, networking e visita all'Area Espositiva

Buffet Lunch, networking and visit to the Exhibition Area

2.30 PM Inizio sessioni parallele | Parallel sessions start

RISCHIO DI CREDITO | CREDIT RISK

Chair

Giacomo De Laurentis, Università Bocconi

2.30 PM I modelli, la regolamentazione e la gestione: un rapporto in divenire

Models, regulation and management: an ongoing relationship

Giacomo De Laurentis, Professore Ordinario di Finanza Università Bocconi

Modelli interni e supervisione: sviluppi recenti e prospettive

Internal models and supervision: recent developments and perspectives

Massimo Gangeri, Capo Divisione Validazione modelli interni - Servizio Ispettorato Banca d'Italia

Model risk management | Model risk management

Javier Calvo Martin, Partner Management Solutions

Dall'IFRS 9 agli NPE: un approccio integrato per la gestione strategica del rischio di credito

From IFRS 9 to NPE: an integrated approach for the strategic management of credit risk

Anselmo Marmonti, Regional Leader Risk & Finance Solutions SAS

Le nuove linee guida dell'EBA su PD e LGD: quali sfide per le banche AIRB

The new EBA guidelines on PD & LGD: as challenges for the AIRB banks

Fabio Salis, Responsabile Risk Model Gruppo Banco BPM

Il credit risk modeling tra nuovi scenari regolamentari ed innovazione: dalla targeted review of internal models (TRIM) a soluzioni machine learning

"The new" credit risk modeling beyond regulatory constraints: from targeted review of internal models (TRIM) to machine learning opportunities

Giovanni Gandini, Managing Director Finance&Risk Accenture

Stefano Bonini, Senior Manager Accenture

EBA Guidelines on PD and LGD estimation and the treatment of defaulted assets: un possibile framework per la definizione dei MoC (margin of conservatism)

EBA Guidelines on PD and LGD estimation and the treatment of defaulted assets: a possible framework for defining the MoC (margin of conservatism)

Fiorella Salvucci, Responsabile Ufficio Sviluppo Modelli Corporate, Sovereign e Financial Institutions Intesa Sanpaolo

Il benchmarking da requisito di convalida a motore di ottimizzazione (degli RWA e delle perdite attese)

Benchmarking: from validation requirement to optimization engine (of RWA and expected losses)

Marco Macellari, Senior Manager - Management Consulting & Solutions

CRIF Credit Solutions

Giorgio Costantino, Executive Director - Management Consulting & Solutions

CRIF Credit Solutions

La validazione del sistema di rating interno da parte della BCE: l'esperienza BPER

The validation of the internal rating system by the ECB: the BPER experience

Emanuele Cristini, Responsabile Servizio Rischi di Credito e Operativi BPER Banca

5.30 PM Chiusura dei lavori | End of the first day



#abibasilea

RISCHIO DI LIQUIDITÀ E FUNDING LIQUIDITY AND FUNDING RISK

Chair

Giampaolo Gabbi, Università di Siena

2.30 PM Apertura dei lavori a cura del Chair | *Opening address by the Chair*

Giampaolo Gabbi, Professore Ordinario di Economia degli Intermediari Finanziari
Università di Siena

Rischio di liquidità infraday | *Intraday liquidity risk*

Daniela Migliasso, Responsabile Ufficio Monitoraggio Rischio Liquidità di Gruppo,
Direzione Rischi Finanziari e di Mercato Intesa Sanpaolo

Liquidity Risk: framework per la gestione delle tensioni di liquidità

Liquidity Risk: a management approach for liquidity crisis

Fabio Massimo Valente, Responsabile Servizio Rischi di Liquidità e ALM
Banca Monte dei Paschi di Siena

ALM integrato & liquidity management: dalla view regolamentare alle nuove esigenze di business

Integrated Alm & Liquidity Management: from regulatory perspective to new business needs
Luigi Mastrangelo, Partner Deloitte Consulting

Approcci regolamentari e interni ai fini della valutazione di adeguatezza della liquidità

Liquidity adequacy assessment: regulatory and internal perspectives

Carlo Enrico De Bernardi, CFA, Head of Financial & Liquidity Risk Banco BPM
Alberto Mietto, Specialist Rischio di Tasso, Liquidità e Il Pilastro Banco BPM

Interest Rate Risk in the Banking Book: una guida pratica

Interest Rate Risk in the Banking Book: a practical guide to compliance

Matteo Namari, Responsabile Mercato Italiano Moody's Analytics

Liquidity stress test: un utile strumento di risk management

Liquidity stress test: a useful risk-management tool

Francesca Scaglia, Group Head of Liquidity and Interest Rate Risk Management
UniCredit

5.30 PM Chiusura dei lavori | *End of the first day*



RISCHIO DI CONTROPARTE E DI MERCATO

COUNTERPARTY AND MARKET RISK

Chair

Mario Anolli, Università Cattolica del Sacro Cuore

2.30 PM Apertura dei lavori a cura del Chair | Opening address by the Chair

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

The Fundamental Review of the Trading Book

The Fundamental Review of the Trading Book

Fausto Marseglia, *Head of Industry Solutions* Thomson Reuters

I PNL Types e la loro rilevanza nell'ambito della prossima regolamentazione sul rischio di mercato

PNL Types and their relevance under forthcoming market risk regulation

Niccolò Cottini, *Head of Group Financial Risk Models* UniCredit

Verso nuovi approcci standard: gli impatti del framework SA-CCR sul trattamento del rischio di controparte

Towards new standard approaches: the impacts of the SA-CCR framework on counterparty credit risk management

Andrea Montinaro, *Finance & Risk* Accenture

Abulenta Librazhdi, *Senior Manager Finance & Risk* Accenture

Le nuove frontiere del Regtech in ambito FRTB:

Adjoint Algorithmic Differentiation (AAD) e Machine Learning

The new technologies in support of market-risk management from a FRTB standpoint:

Adjoint Algorithmic Differentiation (AAD) & Machine Learning

Mario Pace, *Manager* Advantage Reply

Il ruolo del market risk manager nel nuovo contesto definito dalla normativa per la tutela degli investitori e per la prevenzione degli abusi di mercato

The role of a market risk manager in the context defined by the new regulation for investor protection and prevention of market abuse

Emilio Maffi, *Partner* EY

Davide Viglioli, *Executive Director* EY

Interdipendenze e effetti domino tra Intermediari Finanziari:

un approccio network-based per gli stress test delle CCP

Interdependencies and spillover effects among financial intermediaries: a network based stress testing for CCPs

Marco Polito, *Chief Risk Officer* CC&G e Montetitoli

Mariangela Rizzo, *Risk Analyst* CC&G

Il problema dei tassi d'interesse negativi nel pricing e nell'hedging

Pricing and hedging problems linked with negative interest rates

Pier Giuseppe Giribone, *Financial Administration* Banca CARIGE

Fundamental Review of the Trading Book: impatti, implicazioni operative, punti aperti

Fundamental Review of the Trading Book: impacts, practical issues, open points

Paolo Galli, *Responsabile Risk Management* Banca Akros

5.30 PM Chiusura dei lavori | End of the first day

RISCHI DI GOVERNANCE, REPUTAZIONALI, DI COMPLIANCE E DI COMUNICAZIONE

GOVERNANCE, REPUTATIONAL, COMPLIANCE AND COMMUNICATION RISKS

Chair

Paola Schwizer, Università di Parma

2.30 PM I nuovi requisiti di idoneità degli amministratori

The new suitability requirements for directors

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

Targeted Review Of Internal Models (TRIM) - Il ruolo della corporate governance

Targeted Review Of Internal Models (TRIM) - The role of corporate governance

Simone Boursier Niutta, Principal Supervisor Banca Centrale Europea

Governance Risk | Governance Risk

Alessandro Carretta, Professore Ordinario di Economia degli Intermediari Finanziari
Università di Roma Tor Vergata e Segretario Generale Associazione Italiana
per il Factoring

Profili di Governance e di controllo | Governance & control profiles

Sergio Sorrentino, Chief Audit Executive Banco BPM

I rischi di comunicazione con mercati e clienti: il presidio della reputazione

Risks of communication with markets and customers: protecting our reputation

Patrizia Michela Giangualano, Consigliere di Sorveglianza UBI Banca

Alessio Pentola, Responsabile Risk Governance UBI Banca

Lo sviluppo della cultura finanziaria dei clienti alla luce della Mifid II

Development of the financial culture of customers in the light of Mifid II

Laura Piatti, Chief Compliance Officer Fideuram - Intesa Sanpaolo Private Banking

Progetto "La Bussola della Qualità" | Project "The Quality Compass"

Alessio Balduini, CEO Credit Data Research

5.30 PM Chiusura dei lavori | End of the first day



RISCHIO OPERATIVO | OPERATIONAL RISK

Chair

Daniele Previati, Università Roma Tre

2.30 PM Spunti per un'analisi critica dello SMA per l'operational risk

New ideas for a critical analysis of the SMA for operational risk

Daniele Previati, Professore Ordinario di Economia degli Intermediari Finanziari
Università Roma Tre

UK Pillar 2a framework for operational risk | UK Pillar 2a framework for operational risk

Ian Evans, Operational Risk Policy Specialist Bank of England

L'Operational RAF da strumento di vigilanza a strumento di gestione

Operational RAF - from a surveillance tool to a management tool

Mario Vellella, Responsabile Bancoposta, Risk Management, Analisi e Integrazione Rischi
Poste Italiane

Giovanni Machetti, Responsabile Bancoposta, Risk Management, Operational Risk
Poste Italiane

IT Risk e Operational Risk: due visioni per uno stesso rischio?

Come utilizzare i risultati di un IT Risk Assessment nell'Operational Risk Management

IT Risk & Operational Risk: two different views of the same risk? How to use the results of an IT Risk Assessment as part of Operational Risk Management

Claudio Ruffini, Presidente Augeos

Conduct Risk Framework e Scenario Analysis

Conduct-Risk Framework & Scenario Analysis

Marco Castellaneta, Responsabile Operational Risk Management Mediobanca

Michele Treccani, Quantitative Analyst Mediobanca

Il processo di loss data collection nella gestione effettiva del rischio: spunti e riflessioni

The loss-data collection process as part of effective risk management: thoughts and ideas

Francesco De Notti, Operational & Non Financial Risk Gruppo Banco BPM

Un modello evolutivo nella gestione dei rischi operativi: i controlli permanenti periferici

An innovative approach in operational risk management: local permanent controls

Carmine Candolfo, Direttore Rischi e Controlli Nuova Banca delle Marche

5.30 PM Chiusura dei lavori | End of the first day



RISK DATA AGGREGATION E RISK REPORTING

RISK DATA AGGREGATION AND RISK REPORTING

Prima Parte - First Part

Chair

Alfredo Biffi, Università dell'Insubria

9.15 AM Apertura dei lavori a cura del Chair | Opening address by the Chair

Alfredo Biffi, Professore Associato di Organizzazione Aziendale Università dell'Insubria

Risk Data Aggregation - Nuova opportunità per migliorare la gestione dei rischi e creare valore

Risk Data Aggregation - New opportunities for a better risk management and value creation

Paolo Ceschi, Managing Director Finance & Risk ICEG Banking Lead Accenture

Marianna Leoni, Managing Director Finance & Risk Accenture

Evolving a unified Finance, Risk & Treasury data management capability in support of regulatory and management drivers: case studies on benefits and challenges of transformation

Evolving a unified Finance, Risk & Treasury data management capability in support of regulatory and management drivers: case studies on benefits and challenges of transformation

Stuart Houston, Global Head of Solution Consulting Oracle Financial Services Analytics

La misurazione dell'adeguatezza dei sistemi e dei processi IT come elemento di mitigazione dei rischi

Adequacy measurement of IT System and Processes as a risk mitigation factor

Simone Rossatti, Responsabile Servizio Monitoraggio, Processi e Qualità

Creval Sistemi e Servizi

Business Intelligence per ottimizzare le performance dei Non Performing Loans

Business Intelligence for NPL performance optimization

Natale Schettini, Head of NPL Performance Management Gruppo Banco BPM

11.00 AM Coffee Break, networking e visita all'Area Espositiva

Coffee Break, networking and visit to the Exhibition Area



#abibasilea

RISK DATA AGGREGATION E RISK REPORTING

RISK DATA AGGREGATION AND RISK REPORTING

Seconda Parte - Second Part

Chair

Alfredo Biffi, Università dell'Insubria

11.45 AM Data Quality e sostenibilità nel credito: il Loan Data Tape per gli NPE a supporto della governance

Data quality and credit sustainability: the NPE Loan Data Tape to support governance

Fabrizio Arboresi, Director - Italy Finance CRIF Credit Solutions

Regulatory Reporting Template ed il Banks' Integrated Reporting Dictionary (BIRD)

Regulatory Reporting Template and the Banks' Integrated Reporting Dictionary (BIRD)

Alberto Scavino, CEO Irion

L'impatto evolutivo del Risk Data Reporting nel monitoraggio, nelle analisi e negli indirizzi commerciali. Ma ci siamo dimenticati qualcosa... ?

The Evolutionary Impact of Risk Data Reporting in monitoring, analysis and business ideas. But have we forgotten something?

Enrico Giancoli, Responsabile Marketing e Business Intelligence Iccrea Banca

Risk Analytics: The Journey | Risk Analytics: The Journey

Stefano Ferrari, Responsabile Servizio Sistemi di Governo, Rischi e Controlli BPER Services

Luca Rubbiati, Responsabile Ufficio Sistemi Risk Management e Controllo BPER Services

1.00 PM Buffet Lunch, networking e visita all'Area Espositiva

Buffet Lunch, networking and visit to the Exhibition Area

SESSIONE PARALLELA
PARALLEL SESSION

GIOVEDÌ 15 GIUGNO
THURSDAY 15th JUNE



#abibasilea

agenda

BMA, RAF E RECOVERY PLAN BMA, RAF AND RECOVERY PLAN

Chair

Giuseppe Lusignani, Università di Bologna

9.15 AM Apertura dei lavori a cura del Chair | Opening address by the Chair

Giuseppe Lusignani, Professore di Economia degli Intermediari Finanziari
Università di Bologna

Sviluppi recenti a Londra (EBA) e Francoforte (SSM)

Recent Developments in London (EBA) and Frankfurt (SSM)

Sergio Lugaresi, Consulente ABI

e Membro del Banking Stakeholder Group Autorità Bancaria Europea

Recovery Plan come un elemento essenziale di internal governance e risk management della banca

A Recovery Plan as an essential element of a bank's internal governance and risk management framework

Lima Alexandrova, Senior Manager Mazars

RAF: stato dell'arte e scenari evolutivi

RAF: state of the art and evolving scenarios

Diego Onorato, Responsabile Servizio Risk Capital and Policies Intesa Sanpaolo

11.00 AM Coffee Break, networking e visita all'Area Espositiva

Coffee Break, networking and visit to the Exhibition Area

11.45 AM NPE Plan & RAF: problematiche per la modellizzazione degli impatti delle azioni dei NPE Plan sul RAF e possibili approcci metodologici

NPE Plan & RAF: critical issues relating to modelling the impact of the NPE Plan actions on the RAF and possible methodological approaches

Maurizio Pierigè, Partner Prometeia

Dalla gestione all'ottimizzazione del capitale | From capital management to optimisation

Andrea Cremonino, Capital Optimisation - Capital Management UniCredit

La previsione e lo stress testing dei rischi nella risk governance del Gruppo BPER

Risk Forecasting and stress testing in the risk governance of BPER Group

Michele Campanardi, Chief Risk Officer BPER Banca

1.00 PM Buffet Lunch, networking e visita all'Area Espositiva

Buffet Lunch, networking and visit to the Exhibition Area



RISK MANAGEMENT E IFRS9 | RISK MANAGEMENT AND IFRS9

Chair

Maurizio Comoli, Università del Piemonte Orientale

9.15 AM IFRS9, Risk Management & Accounting: due facce della stessa medaglia

IFRS9, Risk Management & Accounting: two sides of the same coin

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

L'applicazione dell'IFRS9 dal punto di vista della vigilanza

The implementation of IFRS9 from the perspective of the supervision

Luca Serafini, Vice Capo Divisione Bilanci e Segnalazioni, Servizio Regolamentazione e Analisi Macroprudenziale Banca d'Italia

Interazione tra IFRS9 e i requisiti di capitale di Basilea: impatti sulla stabilità finanziaria

The Interplay of IFRS9 and Basel Capital Requirements: implication on financial stability

Cristiano Zazzara, Managing Director, Head of Relationship Management, Global Risk Services S&P Global Market Intelligence

La trasposizione del principio contabile nelle metriche di risk management: il caso della significant deterioration

The transposition of the accounting standard in risk-management metrics: the case of significant deterioration

Silvio Cuneo, Responsabile Direzione Credit Risk Management Intesa Sanpaolo

Real Estate Market: looking forward or forward looking?

Real Estate Market: looking forward or forward looking?

Luke Jonathan Brucato, Head of Business Development Prelios Valuations

11.00 AM Coffee Break, networking e visita all'Area Espositiva

Coffee Break, networking and visit to the Exhibition Area

11.45 AM IFRS9 - calcolo perdita attesa su stage 2 Living portfolio e implicazioni gestionali per l'industry bancaria

IFRS9 - expected loss calculation on stage 2 of the Living portfolio and management implications for the banking industry

Carlo Palego, Chief Risk Officer Gruppo Banco BPM

IFRS9 Impairment validation: design assessment, backtesting e benchmarking

IFRS9 Impairment validation: design assessment, backtesting and benchmarking

Daniele Monzali, Executive Director EY

IFRS9: impatto della regolamentazione bancaria sulla gestione della clientela, la problematica dell'asimmetria informativa

IFRS9: the impact of banking regulations on customer management, the problem of information asymmetry

Monica Dalla Bona, CFO Credit Data Research

IFRS9: punti di contatto tra accounting e risk management

L'esperienza di una banca "less significant"

IFRS9: points of contact between accounting and risk management

The experience of a "less significant" bank

Elia Circelli, Responsabile Funzione Bilancio e Amministrazione Banca Popolare di Bari

1.00 PM Buffet Lunch, networking e visita all'Area Espositiva

Buffet Lunch, networking and visit to the Exhibition Area

BANCHE LESS SIGNIFICANT E INTERMEDIARI FINANZIARI LESS SIGNIFICANT BANKS AND FINANCIAL INTERMEDIARIES

Chair

Alessandro Carretta, Università di Roma Tor Vergata

9.15 AM Apertura dei lavori a cura del Chair | Opening address by the Chair

Alessandro Carretta, *Professore Ordinario di Economia degli Intermediari Finanziari Università di Roma Tor Vergata e Segretario Generale Associazione Italiana per il Factoring*

Scenario regolamentare e ricadute gestionali nelle banche less significant. Una visione d'insieme

Regulatory backdrop and management consequences for less significant banks. An overview
Marco Corbellini, *Vice Direttore Generale, Responsabile Direzione Risk Governance e Pianificazione Federazione Lombarda delle Banche di Credito Cooperativo*

Garantire la competitività delle banche più piccole rispettando i nuovi criteri di regolamentazione bancari

Guaranteeing competitiveness for smaller banks whilst respecting the new regulatory banking criteria
Carlo Spagliardi, *Direttore Generale Credit Data Research Italia*

Performance, rischi e modelli di business nelle banche regionali e locali

Performance, risks and business models for local and regional banks
Lorenzo Rigodanza, *Docente Università di Parma*

Le nuove prospettive regolamentari del rischio tasso sul banking book.

Possibili effetti sul risk management delle piccole banche

New standards for the interest rate risk on banking book.

Possible effects on small banks risk management

Vittorio Vecchione, *Risk Manager Istituto per il Credito Sportivo e Professore di Risk Management* LUISS Guido Carli

11.00 AM Coffee Break, networking e visita all'Area Espositiva

Coffee Break, networking and visit to the Exhibition Area

11.45 AM Stress testing integrato: un nuovo punto di vista per le banche di piccole dimensioni

Integrated stress testing: a new slant for small-sized banks

Cristina Gualerzi, *Associate Director Protiviti*

Francesco Fizzotti, *Senior Consultant Protiviti*

Applicazione della CRR agli intermediari finanziari | Applying the CRR to financial brokers

Emmanuele Berselli, *Partner Audit & Assurance BDO*

Il punto di vista degli intermediari finanziari specializzati: leasing

The standpoint of specialised financial intermediaries: leasing

Gianluca De Candia, *Direttore Generale ASSILEA - Associazione Italiana Leasing*

La CRR genera squilibri competitivi fra gli intermediari specializzati? Il caso del factoring

Does the CRR lead to competitive imbalances between specialised intermediaries?

The factoring case

Diego Tavecchia, *Responsabile Commissioni Tecniche e Relazioni Internazionali Assifact*

1.00 PM Buffet Lunch, networking e visita all'Area Espositiva

Buffet Lunch, networking and visit to the Exhibition Area

RISCHIO OPERATIVO

OPERATIONAL RISK

Chair

Paolo Prandi, Università degli Studi di Teramo

9.15 AM Apertura dei lavori a cura del Chair | *Opening address by the Chair*

Paolo Prandi, *Professore a contratto Università degli Studi di Teramo e Presidente del Collegio Sindacale e dell'Organismo di Vigilanza* IW Bank

Il ruolo dell'operational risk management nel processo di validazione di un nuovo prodotto in relazione con il risk appetite framework

The role of operational risk management as part of the validation process of a new product in relation to the risk appetite framework

Olga Maria Quaranta, *Responsabile Operational Risk* BNL BNP Paribas

Regulatory Risk Strategy: gestione del rischio di non-compliance

Regulatory Risk Strategy: how to reduce the risk of non-compliance

Sergio Galanti, *Managing Partner* Inveniat Consulting

Un approccio alternativo di operational risk assessment per la valutazione dei nuovi prodotti

An alternative risk- assessment operational approach in evaluating new products

Andrea Giaccherio, *Head of Operational Risk* Cassa Depositi e Prestiti

Jacopo Moretti, *Quantitative Analyst - Operational Risk* Cassa Depositi e Prestiti

Navigating through uncertainty - Discussione dei risultati della survey KPMG survey on non-financial risks

Navigating through uncertainty: evidence from KPMG survey on non-financial risks

Andrea Colombo, *Associate Partner - Responsabile Operational & Reputational Risk Competence Team* KPMG Advisory

11.00 AM Coffee Break, networking e visita all'Area Espositiva

Coffee Break, networking and visit to the Exhibition Area

11.45 AM TAVOLA ROTONDA | ROUNDTABLE

"IL RISCHIO OPERATIVO NEI SETTORI DIVERSI DA QUELLO BANCARIO"
"OPERATIONAL RISK IN NON-BANKING SECTORS"

Giorgio Aprile, *Director - Group Head of Operational Risk* Ferrovie dello Stato

Biagio Di Carlo, *Risk & Business Continuity Specialist* TIM

Francesco Merlin, *Chief Risk Officer* Cattolica Assicurazioni

Luana Riccardi, *Regulatory & Safety Manager* Novo Nordisk

1.00 PM Buffet Lunch, networking e visita all'Area Espositiva

Buffet Lunch, networking and visit to the Exhibition Area



LA GESTIONE DEGLI NPL NPL MANAGEMENT

Moderatore | *Moderator*

Francesco Ninfole, *Giornalista* MF - Milano Finanza

2.15 PM PANEL

Matteo Coppola, *Partner & Managing Director* The Boston Consulting Group

Chiara Del Prete, *Partner, Italy Banking Advisory Leader* Mazars
Membro ESMA CWG CSRC, *Membro* EFRAG FIWG

Franco Fiordelisi, *Professore Ordinario di Economia degli Intermediari Finanziari*
Università di Roma Tre

Edoardo Ginevra, *Responsabile NPL* Gruppo Banco BPM

Andrea Giovanelli, *Partner - Head of Debt Advisory Services* Deloitte Financial Advisory

Alberto Sondri, *CRIF Servicing Director* CRIF

Gianfranco Torriero, *Vice Direttore Generale* ABI

Erberto Viazzo, *Partner* EY

4.15 PM Estrazione tra i presenti in sala dei premi in palio

Prize draw for those present in the hall

4.30 PM Chiusura del Convegno e appuntamento all'Edizione 2018!

Closing of the Conference and appointment for the 2018!



CONCORSO *PRICE DRAW*

ROME, 14th - 15th JUNE | Palazzo dei Congressi



UNIONE BANCARIA E BASILEA 3 RISK & SUPERVISION 2017

RIVOLGITI AL DESK BANCAFORTE!
GO TO THE BANCAFORTE DESK!

VINCI! | WIN!

I premi saranno estratti, alla fine della Tavola Rotonda di Chiusura di giovedì 15 giugno, tra i soli presenti in sala.

The prizes will be extracted, at the end of the Closing Round Table, just among physically present participants.

- | | |
|-----------------------------|-------------------------------------|
| 1st PRIZE | Smartphone Samsung Galaxy S8+ |
| 2nd PRIZE | Playstation 4 VR |
| 3rd PRIZE | Asus Transformer Book T101HA-GR029T |
| 4th PRIZE | Proiettore Portatile iCodis CB-100S |
| 5th PRIZE | Samsung New Gear VR SM-R323NBKAXEF |

**Coordinatore Scientifico** | *Scientific Coordinator*Giacomo De Laurentis,
Università Bocconi
@UnibocconiLima Alexandrova,
Mazars
@MazarsItaliaAlessandro Carretta,
Università di Roma Tor Vergata
@alecarretta @unitorvergataMario Anolfi,
Università Cattolica del Sacro Cuore
@UnicattMarco Castellaneta,
MediobancaGiorgio Aprile,
Ferrovie dello StatoPaolo Ceschi,
Accenture
@AccentureitaliaFabrizio Arboresi,
CRIF Credit SolutionsElia Circelli,
Banca Popolare di BariAlessio Balduini,
Credit Data Research
@Credit_Data_ResAndrea Colombo,
KPMG Advisory
@KPMGAdvisory @KPMG_ItalyEmmanuele Berselli,
BDO
@bdo_italiaMaurizio Comoli,
Università del Piemonte Orientale
@UniAvogadroAlfredo Biffi,
Università dell'Insubria
@AlfredoBiffi @Uni_InsubriaVítor Constâncio,
Banca Centrale Europea
@ecbStefano Bonini,
Accenture
@AccentureitaliaMatteo Coppola,
The Boston Consulting Group
@BCGinItalySimone Boursier Niutta,
Banca Centrale Europea
@ecbMarco Corbellini,
Federazione Lombarda BCCLuke Jonathan Brucato,
Prelios Valuations
@lukebrucato @PreliosGiorgio Costantino,
CRIF Credit SolutionsMichele Campanardi,
BPER Banca
@GruppoBPER_PRNiccolò Cottini,
UniCredit
@UniCredit_IT @UniCredit_PRCarmine Candolfo,
Nuova Banca delle Marche
@1969cc920Andrea Cremonino,
UniCredit
@UniCredit_IT @UniCredit_PRMark Carey,
Federal Reserve Board
@federalreserveEmanuele Cristini,
BPER Banca
@GruppoBPER_PR



Silvio Cuneo,
Intesa Sanpaolo
[@intesasampaolo](#)



Monica Dalla Bona,
Credit Data Research
[@Credit_Data_Res](#)



Luca Davi,
Il Sole 24 Ore
[@lucaaldodavi](#) [@sole24ore](#)



Carlo Enrico De Bernardi,
Banco BPM
[@BancoBPMSpa](#)



Gianluca De Candia, ASSILEA
Associazione Italiana Leasing
[@gluca1970](#) [@Assilea_IT](#)



Francesco De Notti,
Gruppo Banco BPM
[@BancoBPMSpa](#)



Chiara Del Prete, Mazars
ESMA CWG CSRC - EFRAG FIWG
[@MazarsItalia](#)



Biagio Di Carlo,
TIM
[@TIM_Official](#) [@biagio1970](#)



Ian Evans,
PRA Bank of England



Stefano Ferrari,
BPER Services
[@GruppoBPER_PR](#)



Franco Fiordelisi,
Università di Roma Tre
[@UnivRoma3](#)



Francesco Fizzotti,
Protiviti
[@Protiviti_Ita](#)



Giampaolo Gabbi,
Università di Siena
[@giampaologabbi](#) [@unisienna](#)



Sergio Galanti,
Inveniat Consulting
[@InveniatConsult](#)



Paolo Galli,
Banca Akros



Giovanni Gandini,
Accenture
[@Accentureitalia](#)



Massimo Gangeri,
Banca d'Italia
[@bancaditalia](#)



Andrea Giaccherio,
Cassa Depositi e Prestiti
[@GruppoCdp](#)



Enrico Giancoli,
Iccrea Banca
[@gruppoiccrea](#)



Patrizia Michela Giangualano,
UBI Banca



Edoardo Ginevra,
Gruppo Banco BPM
[@BancoBPMSpa](#)



Andrea Giovanelli,
Deloitte Financial Advisory
[@DeloitteItalia](#)



Pier Giuseppe Giribone,
Banca CARIGE
[@Carige_news](#)



Cristina Gualerzi,
Protiviti
[@CGualerzi](#) [@Protiviti_Ita](#)



Stuart Houston,
Oracle Financial Services Analytics
[@OracleItalia](#)



Marianna Leoni,
Accenture
[@Accentureitalia](#)



Abulenta Librazhdi,
Accenture
[@Accentureitalia](#)



Sergio Lugaresi,
ABI - Autorità Bancaria Europea
[@EBA_News](#)



Giuseppe Lusignani,
Università di Bologna



Marco Macellari,
CRIF Credit Solutions



Giovanni Machetti,
Poste Italiane
[@PosteNews](#)



Emilio Maffi,
EY
[@EY_Italy](#)



Anselmo Marmonti,
SAS
[@anselmomarmonti](#) [@SASItaly](#)



Fausto Marseglia,
Thomson Reuters
[@thomsonreuters](#)



Javier Calvo Martin,
Management Solutions



Rainer Stefano Masera,
Università degli Studi G. Marconi
[@Uni_Marconi](#)



Luigi Mastrangelo,
Deloitte Consulting
[@DeloitteItalia](#)



Francesco Merlin,
Cattolica Assicurazioni



Alberto Mietto,
Banco BPM
[@BancoBPMSpa](#)



Daniela Migliasso,
Intesa Sanpaolo
[@intesaspaolo](#)



Andrea Montinaro,
Accenture
[@AccentureItalia](#)



Daniele Monzali,
EY
[@EY_Italy](#)



Jacopo Moretti,
Cassa Depositi e Prestiti
[@GruppoCdp](#)



Matteo Namari,
Moody's Analytics
[@MoodyAnalytics](#)



Mario Nava,
Commissione Europea
[@EU_Commission](#)



Francesco Ninfolo,
MF - Milano Finanza
[@fninfole](#) [@MilanoFinanza](#)



Diego Onorato,
Intesa Sanpaolo
[@intesaspaolo](#)



Mario Pace,
Avantage Reply
[@AvantageReply](#)



Carlo Palego,
Gruppo Banco BPM
[@BancoBPMSpa](#)



Fabio Panetta,
Banca d'Italia
[@bancaditalia](#)



Alessio Pentola,
UBI Banca



Pietro Penza,
PwC
[@PwC_Italy](#)



Giovanni Pepe,
KPMG Advisory
[@KPMG_Italy](#) [@KPMGAdvisory](#)



Laura Piatti, Fideuram
Intesa Sanpaolo Private Banking



Maurizio Pierigè,
Prometeia
[@PrometeiaGroup](#)



Marco Polito,
CC&G e Montetitolò



Paolo Prandi, Università degli Studi
di Teramo e IW Bank
[@UniTeramo](#)



Daniele Previati,
Università Roma Tre
[@D_Previati](#) [@UnivRoma3](#)



Giuseppe Quaglia,
EY
@EY_Italy



Olga Maria Quaranta,
BNL BNP Paribas
@BNL_PR



Luana Riccardi,
Novo Nordisk
@Luana030976 @novonordisk



Lorenzo Rigodanza,
Università di Parma
@unipr



Mariangela Rizzo,
CC&G



Simone Rossatti,
Creval Sistemi e Servizi



Luca Rubbiati,
BPER Services
@GruppoBPER_PR



Claudio Ruffini,
Augeos
@cl456rf



Giovanni Sabatini,
ABI



Fabio Salis,
Gruppo Banco BPM
@BancoBPMSpa



Fiorella Salvucci,
Intesa Sanpaolo
@intesasanpaolo



Francesca Scaglia,
UniCredit
@UniCredit_IT @UniCredit_PR



Alberto Scavino,
Irion
@Irion_Platform



Natale Schettini,
Gruppo Banco BPM
@BancoBPMSpa



Paola Schwizer,
Università di Parma
@paolaschwizer @unipr



Luca Serafini,
Banca d'Italia
@bancaditalia



Alberto Sondri,
CRIF
@AlbertoSondri



Sergio Sorrentino,
Banco BPM
@BancoBPMSpa



Carlo Spagliardi,
Credit Data Research Italia
@Credit_Data_Res



Diego Tavecchia,
Assifact



Gianfranco Torriero,
ABI



Michele Treccani,
Mediobanca



Fabio Massimo Valente,
Banca Monte dei Paschi di Siena
@Banca_MPS



Vittorio Vecchione,
Istituto per il Credito Sportivo
@UniLUISS



Mario Vellella,
Poste Italiane
@PosteNews



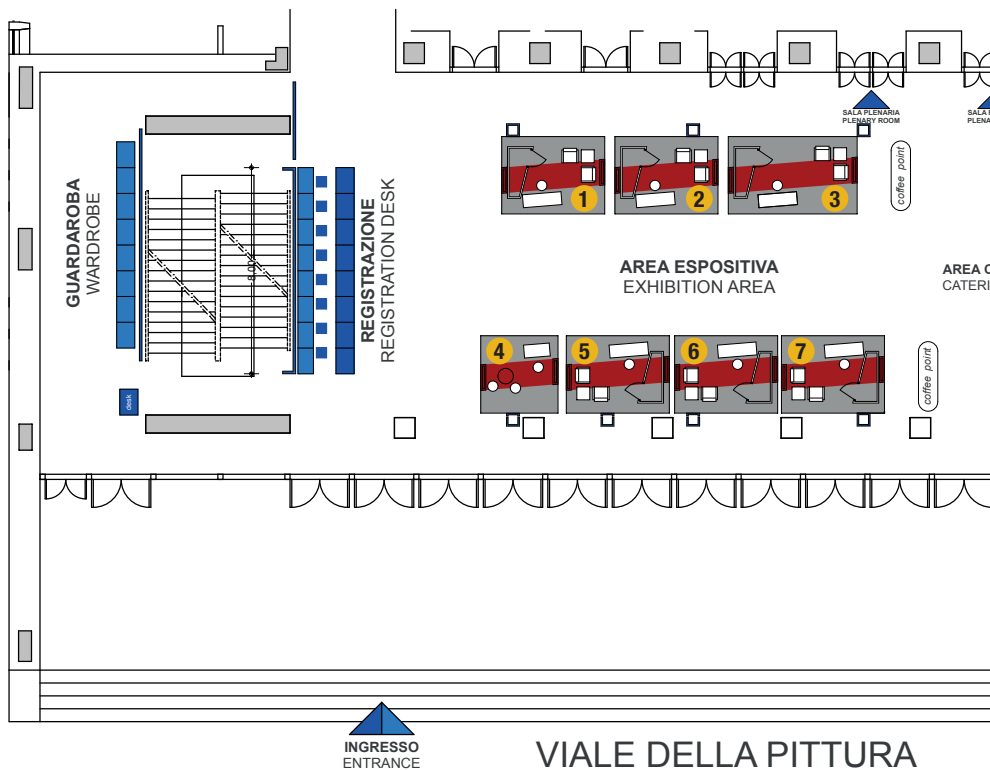
Erberto Viazzo,
EY
@EY_Italy



Davide Viglioli,
EY
@EY_Italy



Cristiano Zazzara,
S&P Global Market Intelligence
@SPGMarketIntel



STAND AREA EXPO

A **BANCAFORTE**
Innovation key

1 **Augeos**
Servizi e tecnologie per creare valore

2 **Inveniat**
CONSULTING

3 **Irion**
creating data advantage

4 **LIST**

5 **CRIF**
Together to the next level

6 **MAZARS**

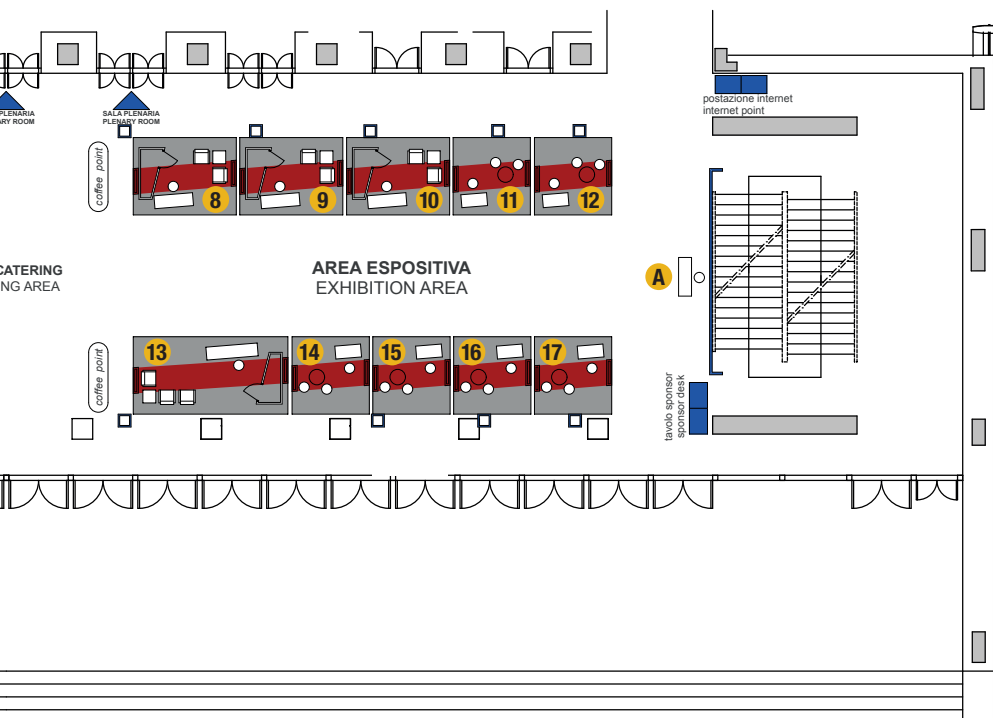
7 **S&P Global**
Market Intelligence

8 **EY**
Building a better working world

9 **ORACLE**

10 **KPMG**

11 **FitchSolutions**



12  **Ribes**
GRUPPO TECNOINVESTIMENTI

13  **sas**

14  **BDO**

15  **the answer company™**
THOMSON REUTERS®

16 **Deloitte.**

17  **MOODY'S**
ANALYTICS



PUNTO TAXI
TAXI POINT

14th JUNE | h 5.00 pm - 6.30 pm
15th JUNE | h 4.00 pm - 5.30 pm

Main Partner



Platinum Partner



Golden Partner



Silver Partner



Brand Partner



In collaboration with



Media Partner

