



# UNIONE BANCARIA E BASILEA 3 RISK & SUPERVISION 2017

---

**ROME**  
**14<sup>th</sup> - 15<sup>th</sup> JUNE**  
Palazzo dei Congressi

---

 #abibasilea

**ABI** Associazione  
Bancaria  
Italiana

**ABISERVIZI**  **ABI  
EVENTI**

# MERCOLEDÌ 14 GIUGNO | WEDNESDAY 14<sup>th</sup> 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**

divisione italiana per il credito operativo



#abibasilea

## GIOVEDÌ 15 GIUGNO | THURSDAY 15<sup>th</sup> 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 mercato credito operativo

### 2.00 PM TAVOLA ROTONDA DI CHIUSURA CLOSING ROUNDTABLE NPL MANAGEMENT | 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

---

**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

---

**12.00 PM** **I nuovi scenari regolamentari**

**Banking Union and capital markets union: the challenges ahead**

*The new regulatory scenarios - Banking Union and capital markets union: the challenges ahead*

Rainer Maserà, *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 intraday | *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

#### PNL Types and their relevance under forthcoming market risk regulation

*PNL Types and their relevance under forthcoming market risk regulation*

Nicolò 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 tecnologie a supporto del market risk management in ottica 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* Avantage 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 Policy* 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

#### Titolo intervento

*Titolo inglese*

Simone Boursier Niutta, 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

#### Titolo Intervento | Titolo intervento

Ian Evans, Prudential Regulation Authority - 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



#abibasilea

---

# 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

Crevat Sistemi e Servizi

#### Business Intelligence per ottimizzare le performance dei Non Performing Loans

*Business Intelligence for boosting the performance of Non Performing Loans*

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

SESSIONE PARALLELA  
PARALLEL SESSION  
**F**

GIOVEDÌ 15 GIUGNO  
THURSDAY 15<sup>th</sup> JUNE

agenda

---

## 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 Iriion

#### 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*

---



#abibasilea

---

# 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*

---



#abibasilea

## 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

#### The Interplay of IFRS 9 and Basel Capital Requirements: implication on financial stability

*The Interplay of IFRS 9 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 IFRS 9 - calcolo perdita attesa su stage 2 Living portfolio e implicazioni gestionali per l'industry bancaria

*IFRS 9 - expected loss calculation on stage 2 of the living portfolio e management implications for the banking industry*

Carlo Palego, Chief Risk Officer Gruppo Banco BPM

#### IFRS9 Impairment validation: Design assessment, backtesting and benchmarking

*IFRS9 Impairment validation. Design assessment, backtesting and benchmarking*

Daniele Monzali, Executive Director EY

Giuseppe Quaglia, Partner EY

#### IFRS 9: impatto della regolamentazione bancaria sulla gestione della clientela, la problematica dell'asimmetria informativa

*IFRS 9: the impact of banking regulations on customer management, the problem of information asymmetry*

Monica Dalla Bona, CFO Credit Data Research

#### IFRS 9: punti di contatto tra accounting e risk management

*L'esperienza di una banca "less significant"*

*IFRS 9: 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 **Spagiardi**, *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**

#### **Nuovo metodo standardizzato e risk management nelle piccole banche**

*New standardised approach and risk management for small banks*  
Vittorio **Vecchione**, *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

#### Managing regulatory risk within a single, end-to-end, regulatory-change operating model: a RegTech case study

*Managing regulatory risk within a single, end-to-end, regulatory-change operating model: a RegTech case study*

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 ne products*

Andrea Giacchero, *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 sui non-financial risks

*Navigating through uncertainty: evidence from KPMG survey KPMG 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*

---

# NPL MANAGEMENT

## NPL MANAGEMENT

---

**Moderatore** | *Moderator*

Francesco Ninfolo, *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

Alberto Sondri, *CRIF Servicing Director* CRIF

Gianfranco Torriero, *Vice Direttore Generale* ABI

Erberto Viazzo, *Partner* EY

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

---

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

*Prize draw for those present in the all*

---

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

*Closing of the Conference and appointment for the 2018!*

---

TAVOLA ROTONDA DI CHIUSURA  
CLOSING ROUNDTABLE

GIOVEDÌ 15 GIUGNO  
THURSDAY 15<sup>th</sup> JUNE



#abibasilea

agenda