

Giornate formative

## “ICAAP, ILAAP, RECOVERY E RESOLUTION PLAN, STRESS TESTING”

Confronto e verifica per gli adempimenti 2025, integrazione dei novel risks e delle evoluzioni regolamentari

26 e 27 febbraio 2025 • Aula virtuale



Prima giornata • 26 febbraio (10.00 - 16.00)

### ► ANALISI DEI CONTESTI DI MERCATO E REGOLAMENTARE

- Evoluzione del contesto e rischi emergenti
- Le priorità della Vigilanza per il 2025-2027
- Gli aggiornamenti normativi in ambito rischio di credito ed impatti sul mercato del credito
- Rischio di mercato: evoluzione normativa e gestione del rischio
- Sfide ed opportunità per il rischio tasso di interesse: segnalazioni regolamentari e rispetto dei limiti di SOT

### ► FOCUS ON

#### FRAMEWORK REGOLAMENTARE DI GESTIONE DEI RISCHI ESG: COSA CAMBIA CON LE LINEE GUIDA EBA

- Identificazione, misurazione, valutazione di materialità
- Integrazione dei rischi ESG nei processi aziendali e nel sistema dei controlli interni
- Standard minimi e metodologia per la gestione ed il monitoraggio dei rischi ESG
- Consultazione EBA sull'ESG scenario analysis

### ► EVOLUZIONE DEL FRAMEWORK DEI RISCHI: I NUOVI RISCHI NEL PROCESSO ICAAP E ILAAP

- Rischio geopolitico: impatti sul sistema bancario ed integrazione nel processo ICAAP e ILAAP
- Rischio strategico: misura e monitoraggio del rischio in ambito ICAAP
- Novità della CRR ed impatto sulle proiezioni dei rischi di credito e di mercato
- Nuove politiche sulla gestione dei rischi climatici ed impatti sul mondo finanziario
- Nuovi requisiti regolamentari ed ottimizzazione del portafoglio bancario

### ► LA GESTIONE DEL PROCESSO ICAAP: L'INTEGRAZIONE DEI RISCHI ESG

#### ► Integrazione dei rischi ESG nell'ICAAP: focus on

- rischio di credito
- rischio di mercato e di liquidità
- altri rischi finanziari



Seconda giornata • 27 febbraio (10.00 - 16.00)

---

▶ **LA GESTIONE DEL PROCESSO ILAAP: RISCHIO DI LIQUIDITA' ED EVOLUZIONI ALLA LUCE DELLE ULTIME CRISI DI LIQUIDITÀ**

- Lessons learned dalle crisi di liquidità del 2023
- Potenziali evoluzioni normative ed azioni concrete per lo sviluppo della gestione del rischio
- Data transazionali e misurazione del rischio di liquidità intraday

▶ **RESOLUTION PLAN E RECOVERY: SFIDE ED OPPORTUNITÀ**

- Sfide ed opportunità nella definizione degli scenari di risoluzione e recovery
- Framework per la misurazione della Overall Recovery Capacity

**FOCUS OPERATIVI E TREND**

▶ **RISCHIO TASSO DI INTERESSE: EVOLUZIONE DEL FRAMEWORK DI MISURAZIONE IRRBB**

- Ottimizzazione del profilo di rischio tasso di interesse e rispetto dei limiti regolamentari (SOT)
- Evoluzione dei processi di definizione e calibrazione dei modelli comportamentali

▶ **IA E RISK DIGITAL STRATEGY: COSTRUIRE IL RISK MANAGEMENT DEL FUTURO**

- Trend di mercato in Italia e in EU
- Digitalizzazione dei processi di gestione del rischio: use case in ambito credito, mercato e liquidità

▶ **DATA MANAGEMENT E REPORTING INTERNO COME ELEMENTI DI IMPLEMENTAZIONE DI UN FRAMEWORK INTEGRATO DI GESTIONE DEI RISCHI**

▶ **LA GOVERNANCE DEI RISCHI – INTEGRAZIONE DELLA RISK CULTURE NEI PROCESSI AZIENDALI**

- Cultura del rischio e rafforzamento del sistema dei controlli interni