

Corso interaziendale

LA GESTIONE DEI RISCHI OPERATIVI E NON FINANZIARI: CONTESTO NORMATIVO-METODOLOGICO E CASI PRATICI

14 e 15 DICEMBRE 2020 • Aula virtuale

▶ Prima giornata • 14 dicembre 2020

LA GESTIONE DEI RISCHI OPERATIVI E NON FINANZIARI: DALLA TEORIA ALLA PRATICA

▶ I rischi operativi

- Cenni sull'evoluzione del contesto regolamentare del rischio operativo
- Il nuovo approccio per la gestione dei rischi operativi nell'attività bancaria
- Il nuovo ruolo dell'Operational Risk Manager: dalla misurazione del capitale regolamentare all'analisi degli eventi di rischio

▶ I rischi non finanziari

- Cenni sull'evoluzione del contesto regolamentare e di mercato
- Possibili modelli aziendali di gestione dei rischi non finanziari
- Presentazione e discussione dei risultati di un benchmark condotto da Accenture sui rischi non finanziari

▶ Evoluzione dell'assetto dei controlli interni alla luce dell'emergenza Covid-19

- L'assetto organizzativo delle funzioni aziendali di controllo e le interrelazioni con le altre unità organizzative
- Il modello di collaborazione tra le aree Risk management e Operations nella gestione della crisi Covid-19
- Le interconnessioni con altri presidi di Governance e di Business Continuity
- Business case: come le funzioni di controllo hanno risposto all'emergenza sanitaria. La nuova operatività a tutela della Business Continuity

▶ Seconda giornata • 15 dicembre 2020

CONTROLLI A DISTANZA, APPROCCIO DATA DRIVEN E “NEW NORMAL”

▶ I controlli a distanza

- L'evoluzione del sistema dei controlli interni in chiave digitale
- L'uso degli analytics nella implementazione dei controlli a distanza

▶ Digital transformation e nuovi controlli

- L'approccio “data driven” per le funzioni aziendali di controllo
- Le strategie per guidare la trasformazione digitale dei controlli interni

▶ Casi pratici

- Business case: le principali linee di intervento per la mitigazione degli impatti derivanti dal Covid-19 nell'ottica di rafforzare la business resilience
- L'applicazione del modello Analitico ai rischi non finanziari per l'analisi combinata degli indicatori di performance (KPI) e degli indicatori di rischio operativo (KRI)
- Dashboard KPI & KRI sui rischi non finanziari
- L'applicazione del modello Analitico per la conduzione di analisi di scenario in relazione agli impatti sulla liquidità derivanti dal Covid-19 (e.g. moratorie, contrazione della raccolta)
- L'adozione di un tool di screening per la prioritizzazione ed il monitoraggio delle terze parti critiche per la continuità operativa della Banca