



ABI Associazione
Bancaria
Italiana

ABISERVIZI  ABI
FORMAZIONE

Seminario annuale

FUNZIONI AZIENDALI DI CONTROLLO

LA SFIDA DEL RISK (RE)MAPPING

PROGRAMMA

15 e 16 novembre 2023 • Milano, SpazioPola - Aula virtuale

PRESENTAZIONE

Lo scenario regolamentare, macro-economico e di mercato all'interno del quale il settore bancario si trova a operare pone le Funzioni Aziendali di Controllo di fronte alla sfida costante di considerare in senso critico quali siano i rischi principali all'attenzione della banca, chiedendosi quali siano le novità rispetto all'anno precedente, se sia possibile individuare nuovi fattori che incidono sui rischi già esistenti, se i rischi consolidati acquisiscano un peso diverso a fronte delle mutazioni e delle dinamiche di scenario.

L'**edizione 2023** dell'Annual **Funzioni Aziendali di Controllo - "LA SFIDA DEL RISK (RE)MAPPING"** - analizza il nuovo e sempre mutevole scenario di rischio col quale le funzioni di controllo delle banche devono misurarsi, focalizzando rischi emergenti, riemergenti e nuovi fattori di rischio.

Se da un lato infatti, il contesto ha riportato all'attenzione della banca alcuni rischi che negli ultimi anni erano gestiti senza particolari "criticità" - per esempio, rischio di liquidità o rischio di tasso - che potremmo definire **rischi riemergenti**, dall'altro alcuni nuovi **rischi emergono** come centrali e strategici nella risk governance della banca, come per esempio i rischi ICT e di Sicurezza, anche alla luce delle novità introdotte dal Regolamento DORA e dal 40° aggiornamento della Circolare 285/2013 di Banca d'Italia. Inoltre, assistiamo al proliferare di **nuovi fattori** che vanno a incidere sui rischi tipici della banca: basti pensare al peso delle componenti ESG sul rischio di credito o a quanto il rischio di greenwashing può condizionare il rischio reputazionale.

Tutto ciò rappresenta una **sfida continua per le Funzioni di Controllo**, chiamate a **ri-mappare costantemente i rischi** e i relativi pesi, per poi adattare o rinnovare i **framework di gestione**, gli **assetti organizzativi**, i **processi**, le **metodologie** e le **competenze** necessarie per produrre valore per la banca.

L'Annual accompagna le Funzioni Aziendali di Controllo nel compito di **disegnare e aggiornare la mappa dei rischi** e **individuare le più efficaci modalità di gestione**, attraverso gli interventi di esponenti delle Autorità di Vigilanza, di accademici, di consulenti, di responsabili delle funzioni Compliance, Risk management, Internal audit, nonché Antiriciclaggio e Gestione dei Rischi ICT del settore bancario.

Di seguito la struttura dei lavori dell'Annual:

► **15 novembre**

IL (RE)MAPPING DEI RISCHI E DEI CONTROLLI

<p>Sessione introduttiva</p>	<p>RISK (RE)MAPPING: RISCHI EMERGENTI, RIEMERGENTI E NUOVI FATTORI DI RISCHIO</p>
<p>Sessione plenaria</p>	<p>DAL (RE)MAPPING DEI RISCHI AL (RE)MAPPING DELLE FUNZIONI DI CONTROLLO DELLA BANCA</p>
<p> Tavoli di confronto</p>	<p>DALLA MAPPA AL TERRITORIO: GLI STRUMENTI E GLI ITINERARI PER RAGGIUNGERE GLI OBIETTIVI</p>

► **16 novembre**

RISCHI EMERGENTI, RIEMERGENTI E I NUOVI FATTORI DI RISCHIO

<p>Sessione rischi emergenti</p>	<p>IL DIGITALE TRA OPPORTUNITÀ DI EVOLUZIONE E NUOVI RISCHI ICT E DI SICUREZZA</p>
<p>Sessione rischi riemergenti</p>	<p>LA STAGIONE DEI RISCHI DI TASSO E DI LIQUIDITÀ VIENE E VA</p>
<p>Sessione nuovi fattori di rischio</p>	<p>LE DIMENSIONI ESG: GLI IMPATTI SUI RISCHI TRADIZIONALI</p>
<p>Sessione le faq delle faq</p>	<p>WHAT'S NEXT? LA GESTIONE DEI RISCHI TRA METODOLOGIE CONDIVISE E PROSPETTIVE DIFFERENZIATE</p>

PRIMA GIORNATA • 15 NOVEMBRE 2023 • 10.00 – 16.30

IL (RE)MAPPING DEI RISCHI E DEI CONTROLLI**▶ SESSIONE INTRODUTTIVA****RISK (RE)MAPPING: RISCHI EMERGENTI, RIEMERGENTI E NUOVI FATTORI DI RISCHIO**

- Il contesto regolamentare nella delineazione delle priorità di gestione dei rischi della banca
- Il nuovo contesto macroeconomico e gli impatti sui nuovi scenari di rischio della banca

Interventi di: Esponenti delle Autorità di Vigilanza, Accademici, ABI

▶ SESSIONE PLENARIA**DAL (RE)MAPPING DEI RISCHI AL (RE)MAPPING DELLE FUNZIONI DI CONTROLLO DELLA BANCA**

- La connessione tra rischi, governance e strategia della banca

Interventi di: Membri di Organi di Amministrazione delle banche; Responsabili di Funzioni Aziendali di Controllo di banche: Risk Management, Compliance, AML, Internal audit, Gestione Rischi ICT

▶ TAVOLI DI CONFRONTO**DALLA MAPPA AL TERRITORIO: GLI STRUMENTI E GLI ITINERARI PER RAGGIUNGERE GLI OBIETTIVI**

Lavoro in sottogruppi con il supporto di consulenti

1. La definizione della nuova mappa dei rischi: quali approcci metodologici
2. Connessioni e peculiarità delle singole funzioni di controllo: analisi dell'esistente
3. I driver dei processi di gestione dei rischi (cultura del rischio, dati, tecnologie, competenze...): quali priorità
4. La mappa obiettivo: sintesi dei lavori di confronto

SECONDA GIORNATA • 16 NOVEMBRE 2023 • 10.00 – 16.00

RISCHI EMERGENTI, RIEMERGENTI E NUOVI FATTORI DI RISCHIO

▶ SESSIONE RISCHI EMERGENTI

IL DIGITALE TRA OPPORTUNITÀ DI EVOLUZIONE E NUOVI RISCHI ICT E DI SICUREZZA

Interventi di: Responsabili di Funzioni Aziendali di Controllo di banche, Consulenti, ABI, ABI Lab

▶ SESSIONE RISCHI RIEMERGENTI

LA STAGIONE DEI RISCHI DI TASSO E DI LIQUIDITÀ VIENE E VA

Interventi di: Responsabili di Funzioni Aziendali di Controllo di banche, Consulenti, ABI

▶ SESSIONE NUOVI FATTORI DI RISCHIO

LE DIMENSIONI ESG: GLI IMPATTI SUI RISCHI TRADIZIONALI

Interventi di: Responsabili di Funzioni Aziendali di Controllo di banche, Consulenti, ABI

▶ SESSIONE LE FAQ DELLE FAC

**WHAT'S NEXT? LA GESTIONE DEI RISCHI TRA METODOLOGIE CONDIVISE
E PROSPETTIVE DIFFERENZIATE**

Sessione di confronto tra Responsabili delle funzioni aziendali di controllo interno di primari gruppi bancari