



ABISERVIZI  ABI
FORMAZIONE

Giornate formative

L'INTEGRAZIONE DEI FATTORI DI RISCHIO CLIMATICI E AMBIENTALI NELLE BANCHE LSI

I PASSAGGI NECESSARI, GLI IMPATTI E LE
PROSPETTIVE

10 e 11 maggio 2022 • Milano, Spazio Pola, Via Pola, 9 - Aula virtuale

PROGRAMMA

Prima giornata • 10 maggio 2022

INTEGRAZIONE DEI FATTORI ESG NEGLI ASSET DI GOVERNO, STRATEGIE E PROCESSI

Mattina 10.00 - 13.30

▶ APERTURA DEI LAVORI E INQUADRAMENTO DI CONTESTO

OPEN SESSION

▶ L'IMPIANTO REGOLAMENTARE E ASPETTATIVE DEI REGULATORS

▶ LE ASPETTATIVE DELLA BANCA D'ITALIA: IL PERCORSO PER LE LSI

Roberta Fiori, Servizio Regolamentazione e analisi macroprudenziale **Banca d'Italia**

Ignazio Avella, Servizio Supervisione Bancaria 2 **Banca d'Italia**

Q&A

▶ LE DISCONTINUITÀ DI CONTESTO E POSSIBILI IMPATTI DELLA CRISI GEOPOLITICA SULLE STRATEGIE ESG

Relatore in attesa di conferma

▶ L'INTEGRAZIONE DEI FATTORI DI RISCHIO CLIMATICO NEL SISTEMA DI VALUTAZIONE E GESTIONE DEI RISCHI DELLE BANCHE SI: LO STATO DELL'ARTE

- Esiti degli assessment 2021 delle banche: principali evidenze e buone prassi
- Gli adempimenti prudenziali: thematic review e climate stress test

Abulenta Librazhdi, Director **Deloitte**

Alessandra Mazziotti, Director **Deloitte**

▶ LESSON LEARNED: COME I FATTORI CLIMATICI E AMBIENTALI IMPATTANO SUI RISCHI TIPICI DELLA BANCA E COME LA STRATEGIA SI PUÒ ADATTARE PER TENERNE CONTO

Edoardo Faletti, Responsabile Risk Management **BancoBPM**

Unicredit *Relatore in attesa di conferma*

Pomeriggio 14.30 - 16.00

▶ GOVERNANCE: L'INTEGRAZIONE DEI RISCHI CLIMATICI E AMBIENTALI NEI PROCESSI DECISIONALI E NEGLI ASSETTI ORGANIZZATIVI E OPERATIVI

- Ruoli e responsabilità
- Flussi informativi qualitativi e quantitativi; KPI e KRI

Carlo Luison, Partner - Sustainable Innovation Leader **BDO**

▶ L'INTRODUZIONE NELLA STRATEGIA DEI RISCHI CLIMATICI E AMBIENTALI

- Individuazione dei fattori di rischio e dei relativi impatti sul business
- La valutazione della materialità
- Integrazione dei fattori di sostenibilità nei processi decisionali relativi agli investimenti

Marina Brogi, Full Professor of Banking and Capital Markets **Sapienza Università di Roma**

▶ SISTEMA ORGANIZZATIVO E PROCESSI OPERATIVI: MODELLI E APPROCCI POSSIBILI

Il coinvolgimento delle funzioni aziendali

- Evoluzione del risk management
- Il ruolo delle funzioni Compliance e Audit
- Adeguatezza dei sistemi informativi

Marcella Di Marcantonio, Partner **PWC**

Seconda giornata • 11 maggio 2022

INTEGRAZIONE DEI FATTORI ESG NEL FRAMEWORK RISK MANAGEMENT

Mattina 10.00 - 13.30

▶ **I PASSI DA FARE PER L'INTRODUZIONE DEI FATTORI DI RISCHIO CLIMATICI E AMBIENTALI NEL FRAMEWORK DI RISK MANAGEMENT**

- Identificazione dei fattori di rischio
- Le possibili metriche
- Integrazione delle metriche nel RAF e nel framework di gestione dei rischi

Fabio Salis, Chief Risk Officer **Creval**

▶ **LA MESSA A TERRA DEL PROCESSO DI INTRODUZIONE DEL RISCHIO CLIMATICO: LESSONS LEARNED**
Fabio Verachi, Financial Risk Manager **Intesa Sanpaolo**

▶ **IL RISK APPETITE FRAMEWORK (RAF) COME PUNTO DI PARTENZA PER L'INTEGRAZIONE DEI RISCHI ESG**
EY (*Relatore in attesa di conferma*)

▶ **IMPATTI SUI FATTORI ESG SUI RISCHI BANCARI TRADIZIONALI**
Bruna Zheng, Consulente **Deloitte**

▶ **IMPATTI DEI FATTORI ESG SUL RISCHIO DI CREDITO**

- Approccio per la valutazione sul portafoglio
- L'integrazione dei profili ESG nei modelli interni di analisi del rischio di credito

Aldo Letizia, Chief Risk Officer **Banca Popolare Pugliese**

▶ **LO SNODO DEL RATING: A CHE PUNTO SIAMO**
Monica Billio, Full professor of econometrics **Ca' Foscari Università di Venezia**
Marco Macellari, Director Process e Risk Advisory **CRIF**

Pomeriggio 14.30 - 16.00

▶ **ESG ATTENTION: ESG COME POTENZIALE FATTORE DI MITIGAZIONE DEL RISCHIO DI CREDITO?!**
Pasqualina Porretta, Professore Associato di Economia degli Intermediari Finanziari, Facoltà di Economia **Sapienza Università di Roma**

▶ **RISCHIO DI TRANSIZIONE: GLI SCENARI CLIMATICI E IL LORO IMPATTO SUL PORTAFOGLIO IMPIEGHI VERSO PMI E CORPORATE**
Maurizio Pierigé, Senior Partner, Head of Risk Integration Competence Line **Prometeia**

▶ **CREAZIONI DI BASI DATI SU PROFILI SUI PROFILI DI RISCHIO CLIMATICO E AMBIENTALE**
Antonio Tufano, Managing Director **Accenture**

▶ **L'INTEGRAZIONE DEI FATTORI ESG NELLE STRATEGIE CREDITIZIE, NEL PRICING E NELLA VALUTAZIONE DELLE GARANZIE**

▶ **I PASSI ESSENZIALI PERCHÈ L'INTEGRAZIONE DEI FATTORI DI RISCHIO ESG SIA COMPLETA**
Simona Ceccarelli, Responsabile Area Sostenibilità **SCS Consulting**