

# OPERATIONAL RISK ASSESSMENT: NOVITÀ E IMPATTI VERSO IL NUOVO MODELLO SMA

19 e 20 settembre 2022 • Aula virtuale

## PRIMA GIORNATA • 19 SETTEMBRE 2022

- ▶ **I rischi operativi**
  - Cenni sull'evoluzione del contesto regolamentare e di mercato
  - Possibili modelli di gestione
  - Nuovi trend e rischi emergenti
- ▶ **Evoluzione dell'assetto organizzativo delle funzioni di controllo**
  - L'assetto organizzativo delle funzioni e le interrelazioni con le altre unità organizzative
  - Il modello di collaborazione tra le aree Risk e Operations
  - Le interconnessioni con altri presidi di governance e di Business Continuity
- ▶ **L'applicazione del modello analitico per l'analisi combinata degli indicatori di performance (KPI) e degli indicatori di rischio operativo (KRI)**
  - Dashboard KPI & KRI sui rischi operativi
- ▶ **I rischi operativi alla luce dell'emergenza sanitaria Covid-19: cronistoria e prossimi passi**

## SECONDA GIORNATA • 20 SETTEMBRE 2022

- ▶ **Le modalità di calcolo del requisito patrimoniale**
  - Focus sulla nuova metodologia SMA -Standardised Measurement Approach
- ▶ **I controlli a distanza**
  - L'evoluzione del sistema dei controlli interni in chiave digitale: digital transformation nuovi controlli
  - L'uso degli analytics nella implementazione dei controlli a distanza
  - Alcuni casi pratici
- ▶ **L'applicazione del modello analitico per la conduzione di analisi di scenario**
  - Focus sugli impatti sulla liquidità derivanti dal Covid-19 (e.g. moratorie, contrazione della raccolta)
- ▶ **Use case analytics a supporto della gestione dei rischi operativi**