



ABISERVIZI  **ABI
FORMAZIONE**

WORKSHOP

Business Model Analysis e rischio strategico: un framework concettuale e gestionale

27 e 28 MAGGIO 2021 • Aula virtuale (10.00-13.30)

BOZZA DI PROGRAMMA

PREMESSA

Il rischio strategico (RS) è destinato sempre più ad assumere un ruolo centrale all'interno della gestione delle banche in generale e dei sistemi di pianificazione strategica e di risk management in particolare.

L'introduzione della Business Model Analysis (BMA) nell'ambito dello SREP ha sottolineato la rilevanza della pianificazione strategica e la necessità che la banca disponga di un processo interno di valutazione dell'adeguatezza della strategia (ISAAP).

Oggi, alla luce della pandemia Covid-19, l'importanza di integrare nella BMA la stima di "eventi estremi" rende significativo un momento di confronto su Strategia aziendale, modelli, rischio strategico e sulle correlazioni tra di essi.

1° WORKSHOP
**BUSINESS MODEL,
 BUSINESS MODEL ANALYSIS
 E PIANIFICAZIONE
 STRATEGICA: TRA REGOLE
 E PRINCIPI GESTIONALI**
 27 maggio 2021
 (10.00-13.30)

2° WORKSHOP
**IL RISCHIO
 STRATEGICO**
 28 maggio 2021
 (10.00-13.30)

PROGRAMMI

1° WORKSHOP • BUSINESS MODEL, BUSINESS MODEL ANALYSIS E PIANIFICAZIONE STRATEGICA: TRA REGOLE E PRINCIPI GESTIONALI • 27 maggio 2021 (10.00-13.30)

LA PIANIFICAZIONE STRATEGICA

- Il cambiamento del contesto e le nuove sfide per la Pianificazione Strategica e per il Risk Management: un quadro d'insieme
- I driver e i fattori abilitanti del cambiamento

Marco Di Antonio, Ordinario di Economia degli Intermediari Finanziari **Università di Genova**

I BUSINESS MODEL

- Business Model, Strategie aziendali, Modelli imprenditoriali: definizioni, differenze e relazioni, contenuti

Maurizio Baravelli, Ordinario di Economia e Gestione della Banca **La Sapienza Università di Roma**

11.00  Break

Business Model Analysis e ISAAP

- La Business Model Analysis dello SREP europeo: linee guida EBA e orientamenti della BCE. Le aree di analisi e i criteri di valutazione. Gli impatti sul processo di pianificazione strategica. La viabilità e la sostenibilità del modello di business
- Dall'approccio normativo a quello gestionale: l'Internal Strateg Adequacy Assessment Process, ISAAP: punti di raccordo e di differenza con la BMA. Le modifiche al processo di pianificazione strategica
- Il principio di proporzionalità

Marco Di Antonio, Ordinario di Economia degli Intermediari Finanziari **Università di Genova**

Gabriele Guggiola, Associate Partner **PwC**

UN CASO AZIENDALE

- Business Model Analysis e cambiamenti nel processo di pianificazione strategica

Alessandro Simonazzi, Head of Planning & Control **BPER Banca**

 Spazio alle domande

Chiusura del 1° workshop

2° WORKSHOP • IL RISCHIO STRATEGICO • 28 maggio 2021 (10.00-13.30)

I RISCHI STRATEGICI

- I rischi strategici: inquadramento
- Rischio di business model, rischio strategico e rischio di business: definizione, differenze, collegamento con altri rischi. I diversi approcci alla valutazione e gestione

Marco Di Antonio, Ordinario di Economia degli Intermediari Finanziari **Università di Genova**

I CIGNI NERI

- I rischi a bassa probabilità e alto impatto
- Loro caratteristiche e classificazione
- Modalità di previsione, valutazione e gestione

Marco Di Antonio, Ordinario di Economia degli Intermediari Finanziari **Università di Genova**

LE TECNICHE QUANTITATIVE

- Le tecniche quantitative di valutazione e gestione del rischio strategico

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



LE TECNICHE QUALITATIVE

- Le tecniche qualitative di valutazione e gestione del rischio strategico
- L'approccio per processi
- I modelli di generazione, classificazione e governo del rischio strategico
- I presidi organizzativi a fronte del rischio strategico

Marco Di Antonio, Ordinario di Economia degli Intermediari Finanziari **Università di Genova**

STRESS TEST E RISCHIO STRATEGICO

Giovanni Papiro, Group Risk Governance **Iccrea Banca**

SESSIONE DI CONFRONTO BUSINESS MODEL, BUSINESS MODEL ANALYSIS, RISCHIO STRATEGICO

- Quali modelli di business nelle traiettorie delle banche?
- Quali sono le grandi sfide e i grandi cambiamenti del processo di pianificazione strategica?
- Come è cambiato il processo di pianificazione strategica alla luce della BMA/SREP?
- Come avviene il confronto/dialogo con il regulator sul tema BMA?
- Come rileva il principio di proporzionalità e quindi quali sono le scelte delle LSI?

Relatori in attesa di conferma



Chiusura dei lavori