Corso interaziendale

EVOLUZIONE DELLO STRESS TESTING E DELL'ANALISI DI SCENARIO NEL NUOVO CONTESTO

15 LUGLIO 2020 • Incontro in aula virtuale

▶ INQUADRAMENTO REGOLAMENTARE E AMBITI DI APPLICAZIONE DEGLI STRESS TEST INSTITUTION WIDE

- Le novità delle linee guida EBA sullo stress testing: reverse stress test, proporzionalità, liquidity-solvency linkage, scenario plausibility, scenario narrative
- Le nuove richieste del supervisor e le deroghe nel contesto post Covid
- Il 32° aggiornamento della Circolare Banca d'Italia 285/2013: i nuovi requisiti in materia di stress test attesi per il prossimo resoconto ICAAP/ILAAP

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

▶ PROBLEMATICHE METODOLOGICHE E LINEE EVOLUTIVE NELLO STRESS TESTING E L'ANALISI DI SCENARIO

- Le problematiche e i limiti degli attuali approcci allo stress testing: scenario, severity, non linearity effects, model risk, ecc.
- L'integrazione dei fattori di rischio tramite un modello di tipo ERM
- L'interrelazione tra solvency & liquidity
- La modellizzazione dei fattori di rischio di difficile quantificazione: rischio strategico, reputazionale, misconduct

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

▶ IL REVERSE STRESS TESTING

- Inquadramento generale e problematiche metodologiche
- L'utilizzo del reverse stress test nel nuovo contesto
- Stima della capacità massima di assorbimento delle perdite
- Tecniche quantitative di modellizzazione

Giuseppe Montesi, Partner e Amministratore **Valuecube**, Professore Scuola di Economia e Management **Università di Siena**

▶ LE ANALISI DI SCENARIO NEL NUOVO CONTESTO ECONOMICO E REGOLAMENTARE POST COVID

- Le analisi di scenario in ottica Covid: problematiche e soluzioni operative
- L'analisi dei fattori di rischio nel contesto post Covid
- La modellizzazione degli effetti degli interventi pubblici di moratoria e garanzie nei business plan

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

▶ LINEE EVOLUTIVE DI GOVERNO E ORGANIZZAZIONE DEI PROCESSI DI STRESS TESTING

- L'integrazione tra le funzioni di pianificazione e risk management
- Un nuovo approccio di simulazione stocastica per lo stress testing
- Nuove modalità di definizione del risk appetite e di condivisione dei risultati con il Board

Giuseppe Montesi, Partner e Amministratore **Valuecube**, Professore Scuola di Economia e Management **Università di Siena**

Copyright © ABISERVIZI SpA. Tutti i diritti riservati.
È proibita la riproduzione, anche parziale, in qualsiasi forma senza espresso permesso scritto di ABISERVIZI SpA. - Divisione ABIFormazione.
Il ricevente è tenuto ad utilizzare il documento esclusivamente per esigenze di documentazione personale nell'ambito delle proprie esigenze lavorative; non può in alcun modo ridistribuire o comunicare a terzi le informazioni in esso presenti.