

CORSO DI FORMAZIONE

Il framework ICAAP e ILAAP

MILANO, 14 e 15 FEBBRAIO 2019

Centro Congressi Olona • Via Olona, 2

▶ Prima giornata • 14 febbraio 2019

▶ **L'evoluzione del framework regolamentare**

- Le nuove Guide della BCE sul processo interno di valutazione dell'adeguatezza della liquidità (ILAAP) e sul processo interno di valutazione dell'adeguatezza patrimoniale (ICAAP)
- Processo integrato ICAAP/ILAAP: la nuova definizione di ICLAAP e le novità introdotte nel 25° aggiornamento della circolare di BI 285/2013
- Sintesi e analisi della sezione comune, della sezione ICAAP e della sezione ILAAP

▶ **Elementi operativi dell'ICLAAP per le banche less significant**

- Principio di proporzionalità intermediari di classe 2 e 3
- La struttura del Resoconto
- Dichiarazione formale dell'organo con funzione di supervisione strategica
- Lo schema di riferimento per il resoconto ICAAP/ILAAP

▶ **Elementi operativi dell'ICAAP per le banche less significant**

- Business Model Analysis (BAM)
- Lo Stress Testing ICAAP
- Integrazione con il piano strategico e mgmt. actions
- Orizzonte temporale dello stress testing
- Reverse Stress testing

▶ **Elementi operativi dell'ILAAP per le banche less significant**

- Ruoli e responsabilità dei diversi attori dell'ILAAP: primo (Treasury & Finance), secondo (Risk & Validation, Compliance) e terzo livello (Audit) dello SCI bancario
- La struttura della Documentazione ILAAP
- Le 5 fasi dell'ILAAP

▶ **Le best practices operative nel mondo Bancario: Significant vs Less Significant Institution (focus su Indicatori e Stress Test dell'ILAAP)**

▶ Seconda giornata • 15 febbraio 2019

▶ **Focus: Stress Test della liquidità e centralità nella gestione della liquidità bancaria**

▶ **CFP: Elementi base (Scenarios, EWIs, Escalation Processes e Back-Up Liquidity) e requisiti regolamentari**

▶ **CFP: esempio pratico di strutturazione e utilizzo del Piano**

▶ **Esempi di early warning indicator**

▶ **Le 10 cose da non dimenticare mentre si redige il reporting ICLAAP**