ABISERVIZI ABI FORMAZIONE

Giornate formative

L'INTEGRAZIONE DEI FATTORI DI RISCHIO CLIMATICI E AMBIENTALI

Strategia, framework risk management, propensione al rischio, stress test e informativa al pubblico

30-31 MARZO e 1° APRILE 2021 • Aula virtuale

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.

1ª GIORNATA • STRATEGIA AZIENDALE E INFORMATIVA AL PUBBLICO

30 marzo 2021 *(10.00-13.15)*

10.00 **Le dimensioni Environmental, Social and Governance nel settore bancario**

Le aspettative degli enti regolatori e di supervisione sui rischi ESG: la consultazione pubblica dell'EBA sull'introduzione dei rischi ESG nella governance, nel risk management; la Guida BCE sui rischi climatici e ambientali

Claudia Pasquini, Responsabile Ufficio Rischi, Controlli e Sostenibilità **ABI**

11.00 *Break*

11.30 **Introduzione dei fattori di rischio climatici e ambientali nei modelli di business e nella strategia aziendale**

Giulio Naso, Partner **Bain & Company**

Focus on:

- La trasformazione sostenibile come parte della strategia aziendale
- Framework regolamentare
- Le principali implicazioni per il sistema bancario italiano
- La supervisione efficace da parte dell'organo di amministrazione sui rischi climatici e ambientali
- Rischi climatici e ambientali: rischio fisico e rischio di transizione
- Impatti e action plan delle aspettative di vigilanza
- Fattori ESG nella pianificazione strategica e impatto sulla business model analysis

12.30 **L'informativa al pubblico**

Abulenta Librazhdi, Director **Deloitte**

Focus on:

- EBA Consultation Paper: Draft Implementing Standards on prudential disclosures on ESG risks in accordance with Article 449a CRR
- Presentazione degli orientamenti della Commissione europea sulla comunicazione di informazioni di carattere non finanziario
- La comunicazione finanziaria dell'esposizione ai fattori di rischio ESG: Tassonomia, NFDR, SFDR

13.15 *Chiusura dei lavori della prima giornata*

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.

2ª GIORNATA • IL «FRAMEWORK RISK MANAGEMENT» E LA «GESTIONE DEI RISCHI»

31 marzo 2021 *(10.00-13.15)*

10.00	**L'integrazione dei fattori di rischio climatico ed ambientale nel framework risk mangement: una priorità per significant e less significant banks**	**Fabio Salis**, Chief Risk Officer **Creval**
10.20	**Pronti alla "factor climate risk roadmap" muovendosi tra i diversi framework regolamentari?**	**Fabio Verachi**, FRM Enterprise Risk Manager **Intesa Sanpaolo**
10.50	**Un approccio "bottom up" al rischio di cambiamento climatico: un passaggio nel mondo dei calcoli**	**Luca Trussoni**, Owner/Quant Developer **Ltlogics**
11.15	*Break*	
11.30	**Rischio di transizione: gli scenari climatici e il loro impatto sul portafoglio impieghi verso SME e Corporate**	**Luca Bartolucci**, Principal **Prometeia**
12.10	**Rischio climatico e il set-up del data model: un business case su SME & retail portfolios**	**Francesco Mottola**, Senior Manager **Accenture**
12.50	**ITA Rischio fisico: una metodologia per definire gli impatti prodotti dal Climate Change e le misure di rischio nei portafogli real estate e produttivi**	**Federico Carturan**, Chief Executive Officer **RiskAPP**
13.15	*Chiusura dei lavori della seconda giornata*	

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.

3ª GIORNATA • PROPENSIONE AL RISCHIO E INTRODUZIONE DEI FATTORI DI RISCHIO AMBIENTALI E CLIMATICI NELLO STRESS TESTING

1° aprile 2021 *(10.00-13.15)*

10.00 **Propensione al rischio**

Focus on:

- Framework regolamentare
- Implicazioni per gli istituti di credito
  - La struttura di un RAF per le banche
  - Dagli obiettivi di RAF ai limiti operativi di rischio
  - Che cos'è un RAF integrato con fattori climatici
  - Da standalone climate category a impatto trasversale sulle categorie di rischio
  - Connessione tra strategia, (governance) e risk management
- Prossimi passi
  - L'impatto della Tassonomia EU
  - Da standalone a impatto trasversale: indicatori di rischio

Antonio Altieri Pignalosa, Partner **EY**

Stefania Galletti, Climate Change and Sustainability Services **EY**

Alessio Mastroianni, Senior Manager **EY**

Stefano Biondi, Group Chief Risk Officer **Banca Mediolanum**

11.00 *Break*

11.15 **Scenario e stress testing**

Focus on:

- Un framework metodologico per l'integrazione dei fattori di rischio climatici nel rischio di credito
- Modellizzazione di Physical Risk, Transitional Risk e Pandemic Risk
- Analisi di scenario e stress test climatici
- Case study

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

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

12.45 **Integrazione dei fattori di rischio climatici e ambientali nella governance aziendale**

Focus on:

- Codice di Autodisciplina 2020 e "governance" della sostenibilità dalle analisi CONSOB
- Ruolo degli organi di governo: dall'approvazione delle politiche alla definizione delle strategie "integrate"
- Impatti per le politiche di remunerazione
- Monitoraggio secondo le aspettative di vigilanza

Carlo Luison, Partner Sustainable Innovation **BDO**

13.15 *Chiusura dei lavori*

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.