

The Department of MANAGEMENT of Sapienza University in Rome, in collaboration with ABI (Italian Banking Association) and AIFIRM (Italian Association of Financial Industry Risk Managers) is organizing on 22nd March 2019 a Conference entitled "Risk Supervision and Governance: beyond Basel 4". The Conference will aim at discussing among regulators and banking industry representatives procedures, methodologies, results of SREP and supervisory stress testing process. Specific attention will be put on the potential alternative ways of banks to improve profitability in the low interest rate environment. In particular, by adopting a managerial and regulatory perspective, the Conference aims to investigate two topics:

- ◆ procedures, methodologies and Results of SREP and supervisory stress testing process;
- ◆ how to create performance from strategic risk planning and governance.

In collaborazione con



Comitato scientifico—Scientific Committee

Marina Brogi

Mario La Torre

Ida Claudia Panetta

Valerio Pesic

Pasqualina Porretta

Fabrizio Santoboni

Sabrina Leo

Ai partecipanti soci Aifirm verranno riconosciuti
14 crediti formativi

www.aifirm.it/formazione/convenzioni/

Per motivi organizzativi si prega di confermare
la presenza alla d.ssa Luisa Nicolai:

T (+39) 06 49.766.921 — luisa.nicolai@uniroma1.it

Oppure amministrazione@aifirm.it



FACOLTÀ DI ECONOMIA



SAPIENZA
UNIVERSITÀ DI ROMA

RISK SUPERVISION AND GOVERNANCE: BEYOND BASEL 4

22 MARZO 2019
AULA V, ORE 10.00

Ore 10,00 Saluti istituzionali

Fabrizio D'Ascenzo

Preside della Facoltà di Economia
Sapienza, Università di Roma

Sergio Barile

Direttore del Dipartimento di Management
Sapienza, Università di Roma

Corrado Meglio

Vice Presidente AIFIRM, Banca di Credito
Popolare

I sessione

**Procedures, methodologies and results of SREP
process and supervisory stress testing**

Modera

Mario La Torre, prof.re Ordinario di Economia
degli intermediari finanziari Sapienza, Università di
Roma

**La vigilanza sulle Less Significant Institutions:
priorità e sfide nell'attuale contesto**

Giovanbattista Sala, Vice Capo Servizio Supervisio-
ne Bancaria 2, Banca d'Italia

**La sostenibilità dei modelli di business delle
banche italiane nell'attuale contesto di mercato
e regolamentare**

Gianfranco Torriero, Vice Direttore Generale,
Associazione Bancaria Italiana (ABI)

**Risks and Vulnerabilities in the European
Banking Sector**

Gaetano Chionsini, Head of Statistics
European Banking Authority (EBA)

**La metodologia SREP del Meccanismo di
Vigilanza Unico per le LSI**

Gianluca Trevisan, Head of Analysis and
Methodological Support, Divison, European
Central Bank (ECB)

**La riforma del credito cooperativo in Italia: i
gruppi bancari cooperativi e l'esperienza di
Iccrea Banca**

Cosimo Damiano Capolupo, Responsabile
Amministrazione e Bilancio di Gruppo,
Iccrea Banca

**Stress testing regolamentari: sfide ed
opportunità per gli intermediari bancari**

Lorenzo Bocchi, Director & Board Member,
Prometeia

Ore 13.30 Light Lunch

II sessione, ore 14:15

**Strategic planning and risk governance: where
are the performance?**

Modera

Pasqualina Porretta, prof. Associato in Risk
Management Sapienza, Università di Roma

**Metodi per la stima del General Estimation Error
(MOC C) dei modelli IRB nell'attuale normativa
EBA e BCE**

Avataneo Federico e Cavarero Dario,
Direzione Credit Risk Management di
Intesa Sanpaolo

**NPLs e Forborne Management tra Pillar2
Guidance, IFRS9 e sentiment di mercato:
minacce e opportunità per il Risk Management**

Aldo Letizia, Risk Manager, Banca Popolare
Pugliese

**La validazione dei modelli IFRS9: Un nuovo
approccio basato su tecniche di Artificial
Intelligence**

Biondi Stefano, Responsabile Risk Management,
Banca Mediolanum

**Risk strategic planning: il punto di vista del
credito cooperativo**

Rossano Giuppa, Direttore Pianificazione e Gestione
Rischi BCC Roma, Consigliere AIFIRM

**Capital Adequacy nel processo decisionale
under Basel 4: tra "own funds" and other
Liability Requirements**

Andrea Cremonino, Capital Management
UniCredit

Il Risk Manager 2.0: view a confronto

Pietro Penza, PwC, Partner, Head of Risk
Consulting

Q&A