



ABISERVIZI  **ABI
FORMAZIONE**

WORKSHOP

L'integrazione dei rischi climatici nel sistema di valutazione e gestione dei rischi nelle banche SI e LSI: stato dell'arte e punti aperti

20 e 21 MAGGIO 2021 • Aula virtuale (10.00-13.30)

PREMESSA

La gestione dei rischi climatici e ambientali rappresenta per le banche un esercizio nuovo e continuerà ad evolversi, diventando un argomento sempre più significativo per la governance e la gestione del rischio in banca.

La frequenza e la densità degli input normativi da parte delle autorità competenti evidenzia da una parte la richiesta sempre in evoluzione e la rilevanza del tema, e dall'altra la necessità di un impegno costante di tutto il settore bancario per soddisfare le istanze dei regolatori.

ABIFormazione propone un workshop di confronto finalizzato a fare il punto sullo stato dell'arte, i punti aperti, e le traiettorie future. La struttura del workshop vuole rappresentare la fotografia della situazione attuale e le prospettive, attraverso sessioni di confronto sui temi:

- Quali le tappe fondamentali che scaturiscono dai piani di azione presentati dalle banche SI?
- Quali le strategie e i passi che stanno facendo le banche LSI?
- Come si può valutare e integrare il rischio fisico e il rischio di transizione nel portafoglio crediti?
- La domanda e la disponibilità degli indicatori ESG di un'impresa è in rapida crescita ma questa massa di dati risulta ancora frammentata e disomogenea. Quali impatti ha sulla valutazione di sostenibilità la disomogeneità delle metriche ESG utilizzate da parte delle imprese nella rendicontazione?
- I dati "grezzi" forniti dalle imprese vengono raccolti, ordinati ed elaborati da altri soggetti specializzati: i cosiddetti ESG data provider e le agenzie di rating. Quali sono i criteri di aggregazione trasversali dei dati grezzi che le agenzie di rating e i data provider usano per creare i rating ESG e la "valutazione di sostenibilità"?
- Quale il ruolo delle tre linee di difesa nell'ambito della strategia di sostenibilità della banca?"

1° WORKSHOP
L'INTEGRAZIONE
DEI RISCHI CLIMATICI
NEL SISTEMA DI VALUTAZIONE
E GESTIONE DEI RISCHI
DELLE BANCHE SI E LS:
a che punto siamo

2° WORKSHOP
L'INTEGRAZIONE
DEI RISCHI CLIMATICI
NEL SISTEMA DI VALUTAZIONE
E GESTIONE DEI RISCHI
DELLE BANCHE SI E LS:
le sfide attuali
e prospettive

AGENDA

1° WORKSHOP • L'INTEGRAZIONE DEI RISCHI CLIMATICI NEL SISTEMA DI VALUTAZIONE E GESTIONE DEI RISCHI DELLE BANCHE SI e LSI: a che punto siamo

20 maggio 2021 (10.00-13.30)

Moderatrice: **Abulenta Librazhdi**, Director **Deloitte**

Il Framework di riferimento

- I temi fondamentali emersi sui rischi ESG: confronto tra regolamentazioni
- Approfondimento sul documento del Comitato di Basilea “Climate-related risk drivers and their transmission channels”

Abulenta Librazhdi, Director **Deloitte**

Il ruolo del Risk nell'integrazione degli aspetti ESG

Pasqualina Porretta, Prof. Associato di Economia degli Intermediari Finanziari, Docente di Risk Management, Facoltà di Economia **Sapienza Università di Roma**



SESSIONE DI CONFRONTO

L'integrazione dei rischi climatici nel sistema di valutazione e gestione dei rischi delle banche SI

Dal self assessment ai piani azione

Elisa Bottoni, Responsabile Sustainable Banking **Iccrea Banca**

Edoardo Faletti, Head of Enterprise Risk Management **BancoBPM**

Giuseppe Zammarchi, Head of Group Sustainability Group ESG Strategy & Impact Banking **UniCredit**

Approfondimento sul documento del Comitato di Basilea “Climate-related financial risks – measurement methodologies”

Abulenta Librazhdi, Director **Deloitte**

L'integrazione dei rischi climatici nel sistema di valutazione e gestione dei rischi delle banche LSI

Dalla strategia, all'individuazione al processo di integrazione nel risk management aziendale

Tommaso Giordani, Chief Risk Officer **Gruppo Banca Sella**

2° WORKSHOP • L'INTEGRAZIONE DEI RISCHI CLIMATICI NEL SISTEMA DI VALUTAZIONE E GESTIONE DEI RISCHI DELLE BANCHE SI e LSI: le sfide attuali e prospettive

21 maggio 2021 (10.00-13.30)

Coordinamento a cura di **SCS Consulting**

Integrazione nelle politiche creditizie: la valutazione ESG della controparte nell'iter creditizio

Simona Ceccarelli, Manager
SCS Consulting

Rating ESG: tassonomia delle similitudini e delle divergenze

Monica Billio, Full Professor
of Econometrics **Ca' Foscari**
Università di Venezia

SESSIONE DI CONFRONTO

Il mercato dei rating ESG modelli a confronto

- Le metodologie utilizzate dalle agenzie di rating
- Fornitori di dati finanziari e non finanziari: l'analisi ESG delle imprese

Valeria Nale, Principal **CRIF**

Umberto Bellorini, Dirigente
Cerved - MBS

Giulio Mariani e **Dario Girardi**,
Experian

SESSIONE DI CONFRONTO

L'incorporazione nelle politiche creditizie: impatti sulla qualità creditizia, rischi e opportunità di business - Prassi emergenti e punti aperti

- Percorsi possibili d'integrazione dei rating ESG nei modelli interni di gestione del portafoglio crediti
- Lo sviluppo delle analisi di scenario climatico e l'impatto nelle proiezioni dei piani strategici
- L'ottimizzazione delle politiche creditizie e dell'asset allocation di portafoglio in ottica ESG
- I parametri ESG e la relazione con i valori finanziari delle imprese: l'esigenza di database ESG imprese

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

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

Fabio Verachi, FRM Enterprise Risk
Manager **Intesa Sanpaolo**

Le aspettative future: il ruolo propositivo delle tre linee di difesa

Maurizio Barbadoro, Head of Credit
Audit **BPER Banca**