



L'INTEGRAZIONE DEI FATTORI DI RISCHIO CLIMATICI E AMBIENTALI

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

1 WORKSHOP • GOVERNANCE, STRATEGIA AZIENDALE E INFORMATIVA AL PUBBLICO

30 marzo 2021 (9.30-13.30)

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

 Break

Introduzione dei fattori di rischio climatici e ambientali nei modelli di business, nella strategia aziendale e nella governance

Focus on:

- Framework regolamentare
- La supervisione efficace da parte dell'organo di amministrazione sui rischi climatici e ambientali
- La crisi climatica globale e gli impatti in Italia oggi e domani
- Le principali implicazioni per il sistema bancario italiano
- 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

L'informativa al pubblico

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, NFRD, SFDR

Chiusura dei lavori del primo workshop

Relatori:

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

Giulio Naso, Partner **Bain & Company**

Abulenta Librazhdi, Director **Deloitte**

2 WORKSHOP • IL «FRAMEWORK RISK MANAGEMENT» E LA «GESTIONE DEI RISCHI» 31 marzo 2021 (9.30-13.30)

Framework risk management

Focus on:

- Framework regolamentare
- Fattore Rischio climatico/ambientale e risk management bancario: la sfida della integrazione di risk driver nuovi nell'ambito dei tradizionali rischi bancari
- La valutazione della rischiosità finanziaria connessa ai rischi ESG delle controparti
- Come valutare il rischio finanziario connesso al climate change, dalla costruzione degli scenari alla misurazione degli impatti finanziari

 Break

La «gestione del rischio di credito»

Focus on:

- Framework regolamentare (Le Linee Guida EBA sulla concessione e monitoraggio del credito?)
- ESG rating e rischio di credito
- Il problema dei dati sui fattori di rischio ESG: raccolta autonoma vs info data provider

Le aspettative relative alla «gestione dei rischi»

Focus on:

- Framework regolamentare
- Il governo dei Rischi Reputazionali legati a ESG
- La definizione dell'elenco dei settori "sensibili" con riferimento a rischi ESG e le policy di autoregolamentazione
- ESG e rischio di mercato

Chiusura dei lavori del secondo workshop

Relatori:

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

Luca Trussoni, Owner/Quant Developer **Ltlogics**

Antonio Tufano, Senior Manager **Accenture**

Elisa Galassi, Principal, Head of ERM Presale Support **Prometeia**

Luca Bartolucci, Senior Manager **Prometeia**

Federico Carturan, RiskAPP

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

1° aprile 2021 (9.30-13.30)

Propensione al rischio

Focus on:

- Framework regolamentare
- Incorporazione dei rischi ESG nel RAF: KPI, Risk Appetite, ICAAP, ILAAP, Recovery, Capitale Economico

 Break

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

Chiusura dei lavori

Relatori:

Rossella Zunino, Financial Services Climate Change & Sustainability Services Leader **EY**

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

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

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