

SCHEDA INFORMATIVA

L'ICAAP PER GLI INTERMEDIARI FINANZIARI EX ART. 107 ANCHE IN VISTA DELLA SCADENZA PER L'INOLTRO A BANCA D'ITALIA DELLA PRIMA RELAZIONE ICAAP DEGLI IF 107 NON APPARTENENTI A GRUPPI BANCARI

Giovedì 29 gennaio 2009 (ore 9:00 - 17:00)
MILANO - Novotel Milano Linate Aeroporto (Via Mecenate, 121)

PRESENTAZIONE

L'iniziativa si propone di offrire un'esaustiva panoramica delle tematiche ICAAP con una particolare attenzione alla imminente scadenza dei termini (31 marzo 2009) per l'inoltro alla Banca d'Italia della prima rendicontazione completa relativa al processo interno di determinazione dell'adeguatezza patrimoniale (ICAAP) da parte degli Intermediari Finanziari ex. Art. 107 non appartenenti a gruppi bancari.

DESTINATARI

L'iniziativa è rivolta, in particolare, agli Intermediari Finanziari ex. Art. 107 non appartenenti a gruppi bancari (che quest'anno, per la prima volta, dovranno provvedere all'invio della Relazione ICAAP alla Banca d'Italia) ma potrà risultare utile anche ai responsabili di funzione degli IF 107 appartenenti ai gruppi bancari per approfondire la conoscenza delle tematiche ICAAP a cui le loro capogruppo devono già da un anno far fronte, nonché agli stessi responsabili delle Holding bancarie referenti dell'ICAAP a livello consolidato per conoscere le peculiarità di approccio nella misurazione dei rischi connessi alle attività di carattere specialistico tipicamente svolte da società aventi statuto di Intermediario Finanziario appartenenti al proprio gruppo bancario.

RELATORI

Fabrizio Orsatti - Banca d'Italia, Area Vigilanza – Servizio Supervisione Intermediari Specializzati

Fabrizio MARAFINI – Direttore Generale ASSILEA

Claudio D'Auria – Studio Legale associato Allen & Overy LLP

Pietro Penza – Partner PwC Advisory

Stefano Voltolina – Director Area Governance Risk Management Nexen Business Consultants

Roberto Rovere - Manager PwC Advisory

Massimo Carrozzo – Manager Area Governance e Risk Management Nexen Business Consultants

PROGRAMMA

09:15 Apertura lavori

Fabrizio Marafini – Direttore Generale Assilea

09:30 Gli adempimenti del 2 Pilastro di Basilea 2 per gli Intermediari Finanziari ex-art. 107

Fabrizio Orsatti - Banca d'Italia, Area Vigilanza – Servizio Supervisione Intermediari Specializzati

10:15 La relazione ICAAP per gli intermediari finanziari non bancari

Claudio D'Auria – Studio Legale associato Allen & Overy LLP

11:00 Coffee break

11:15 Definizione di capitale complessivo, della propensione al rischio e articolazione del profilo di rischio. Aspetti teorici e esempi applicativi

Pietro Penza – Partner PwC Advisory

12:00 Approccio Metodologico per il calcolo del capitale interno – calcolo consuntivo

Stefano Voltolina – Director Area Governance Risk Management Nexen Business Consultants

14:00 Rischio di concentrazione per singolo prenditore e settoriale e stress test sul rischio di credito nel metodo standardizzato

Roberto Rovere - Manager PwC Advisory

15:00 Approccio Metodologico per il calcolo del capitale interno – calcolo prospettico

Massimo Carrozzo – Manager Area Governance e Risk Management Nexen Business Consultants

16:30 Question time e fine lavori