



PARADIGMA
ricerca e cultura d'impresa

STRESS TESTING

Linee evolutive
ed esperienze operative



Milano, 19 novembre 2010
Hotel Hilton

visitate il nostro sito
www.paradigma.it

PARADIGMA S.r.l. - Via Viotti, 9 - 10121 Torino
Tel. (011) 538.686/7/8/9 - Fax (011) 5621123-5611117

RELATORI

Dott. Nicola Andreis	Integrazione Rischi e Rischi Controparte Servizio Risk Management Banco Popolare
Dott. Giorgio Bonanni	Director, Finance Deloitte Consulting
Prof. Andrea Giacomelli	Docente di Misurazione del rischio Università Ca' Foscari, Venezia Financial Innovations SIM
Dott. Tullio Lucca	Risk Integration & Capital Adequacy Intesa Sanpaolo
Dott. Vittorio Maggiolini	Responsabile Credit Models Direzione Risk Management Unicredit S.p.A.
Dott. Alberto Piazza Spessa	Responsabile Risk Management UBI Banca
Dott. Gerardo Rescigno	Responsabile Servizio Capital Adequacy Banca Monte dei Paschi di Siena
Dott. Walter Vecchiato	Responsabile Risk Management Gruppo Veneto Banca Docente di Microstruttura dei Mercati Finanziari Università Ca' Foscari, Venezia

Al termine di ciascuna relazione seguirà un ampio dibattito durante il quale i partecipanti potranno *formulare domande e quesiti* di loro specifico interesse.

Venerdì, 19 novembre 2010

■ LO STATO DELL'ARTE E NUOVI SVILUPPI METODOLOGICI

- Linee guida Comitato di Basilea e CEBS
- Modalità di determinazione strutturata del numero e delle caratteristiche degli scenari di stress
- Oltre gli scenari storici: la definizione di scenari forward looking
- La valutazione della gravità degli impatti sui principali indicatori direzionali firm wide
(**Prof. Andrea Giacomelli**)

■ LO STRESS TESTING DEL RISCHIO DI CREDITO: FOCUS SUL BANKING BOOK

- Metodologie per lo Stress Test dei portafogli creditizi
- Disegno degli scenari di stress
- Impatti sul capitale economico e il capitale regolamentare
- Altre connessioni con le attività di risk management
 - relazioni con le metodologie di rating
 - cenni all'integrazione dei rischi(**Dott. Vittorio Maggiolini**)

■ IL REVERSE STRESS TEST

- Stress Testing & Reverse Stress Testing
- Le sollecitazioni dei Regulators
- Reverse Stress Testing in pratica
- Ambiti di utilizzo
(**Dott. Tullio Lucca**)

■ IL RUOLO DELLO STRESS TESTING NEL PROCESSO DI CAPITAL PLANNING

- Analisi dell'interazione delle variabili di stress con le grandezze economico-finanziarie oggetto di valutazione: qualche riflessione a proposito
- Modello di valutazione dell'adeguatezza patrimoniale in condizioni di stress
- Analisi degli impatti e processo di contingency.
(**Dott. Gerardo Rescigno**)

■ LO STRESS TESTING DI SECONDO PILASTRO

- Approccio integrato in sede Icaap per la stima dei rischi in condizioni di stress, con focus sui rischi di mercato, credito, tasso e liquidità
- Possibile evoluzione del processo di stress testing: dagli indicatori di early warning alle misure di expected shortfall
(**Dott. Nicola Andreis**)

■ LO STRESS TESTING DI LIQUIDITA'

- Liquidità a breve
 - Contingency funding plan
 - Liquidità strutturale
- (Dott. Alberto Piazza Spessa)**

■ L'ESPERIENZA DI UN GRUPPO DI MEDIE DIMENSIONI

- Principi generali e linee guida
 - Un'architettura di riferimento per il rischio di credito
 - Dallo Stress Testing al Capital Planning
 - Esempi operativi
- (Dott. Walter Vecchiato)**

■ SOLUZIONI ORGANIZZATIVE NEL PROCESSO DI STRESS TESTING

- Il processo di Stress Testing nel quadro di un framework evoluto di capital management
 - Il coinvolgimento degli Organi di Governance nel processo di Stress Testing
 - L'impatto sui processi core e sui processi direzionali delle Istituzioni Finanziarie
 - Possibili linee evolutive nel mercato domestico
- (Dott. Giorgio Bonanni)**



NOTE ORGANIZZATIVE

Data: 19 novembre 2010
Sede: Hotel Milan Hilton
Via Galvani, 12 – Milano – Tel. 02/69831
Orario: 9.00/13.00 - 14.00/18.00
Durata: 1 giornata

Quota di partecipazione:
€ 1.350,00 + IVA 20% per persona

Il numero di partecipanti al workshop è limitato. La priorità di iscrizione sarà determinata dalla data di ricezione della scheda di partecipazione.

La quota di partecipazione è comprensiva di colazioni di lavoro, coffeabreaks, documentazione, materiale didattico.

Modalità di iscrizione:

Versamento anticipato della quota a mezzo bonifico bancario intestato a:

PARADIGMA s.r.l., Via Viotti, 9 - 10121 Torino
c/o UNICREDIT BANCA D'IMPRESA S.P.A
FILIALE DI TORINO CENTRO
c/c n. 000001796607 - Cod. A.B.I. 03226
Cod. C.A.B. 01000 – CIN I
Cod. IBAN IT7210322601000000001796607

Per informazioni ed adesioni telefonare a:

PARADIGMA s.r.l., Via Viotti, 9 - 10121 Torino
P.Iva 06222110014
Tel. 011/538686/7/8/9 r.a.
Fax 011/5621123 – 5611117
Internet: <http://www.paradigma.it>
E – mail: info@paradigma.it

Modalità di disdetta:

Qualora la disdetta pervenga **entro 10 giorni lavorativi (esclusi i sabati e le domeniche) dalla data di inizio della manifestazione**, la quota di iscrizione sarà addebitata per intero.

In qualunque momento l'Azienda potrà sostituire il partecipante.

Ogni partecipante riceverà, all'apertura dei lavori, gli atti del Convegno. Il materiale didattico sarà costituito dall'insieme delle relazioni consegnate dai Docenti entro i termini stabiliti per la stampa. Tale documentazione costituirà un valido e completo supporto informativo ed un utile mezzo di aggiornamento per il partecipante, l'Azienda ed i Suoi collaboratori.

Si consiglia di provvedere alla prenotazione alberghiera entro e non oltre l' **8 novembre 2010**.

Prezzo camere Hotel (iva e piccola colazione inclusa):

Milano, Hotel Milan Hilton:
Camera singola: **Euro 205,00** – Camera doppia: **Euro 225,00**

SCHEDA DI ISCRIZIONE

L'iscrizione si intende perfezionata al momento del ricevimento della presente scheda (fax 011/562.11.23 o 011/561.11.17) regolarmente compilata e sottoscritta per accettazione

Titolo del Convegno

Data _____

Nome _____

Cognome _____

Funzione Aziendale _____

Fatturare a: _____

Rag. Sociale _____

Indirizzo _____

Città _____

CAP _____

Prov. _____

P.IVA _____

C.F. _____

Per informazioni: _____

Tel. _____

Fax _____

E-mail: _____

Data e Firma

Modalità di pagamento prescelta:

Bonifico bancario in via anticipata.....

Assegno bancario o circolare indirizzato a Paradigma

prima dell'inizio del Convegno

Ai sensi dell'art. 1341 c.c. si approva espressamente la clausola relativa alla disdetta come da note organizzative

Data e Firma

Informativa Privacy

I dati personali acquisiti tramite il presente modulo sono raccolti per le finalità connesse allo svolgimento del Convegno e trattati con l'ausilio di strumenti elettronici dal personale da noi incaricato (addetti alle attività commerciali, di amministrazione e di segreteria dei Convegni). I suddetti dati potranno essere utilizzati anche per informarLa dei nostri futuri eventi se esprimerà il Suo consenso barrando l'apposita casella.

Titolare del trattamento è Paradigma S.r.l., Via Viotti, 9 - 10121 Torino, presso cui possono essere esercitati i diritti di cui all'articolo 7 del D. Lgs. n. 196/2003.

Consento l'utilizzo dei dati per informazioni su vostri convegni.

SI

NO

Data e Firma