



**MONTE  
DEI PASCHI  
DI SIENA**  
BANCA DAL 1472

## Processo RAF

*Compito*

Siena, 04/10/2018

Direzione Chief Audit Executive  
Area Revisione Specialistica  
Servizio Financial & Model Risk Audit

*La revisione, prevista nell'ambito della pianificazione annuale, è indirizzata a valutare l'impostazione, la completezza e l'adeguatezza del RAF al fine di valutare l'efficacia del processo e la sua coerenza interna.*

*La revisione si colloca nell'ambito del Secondo Pilastro SREP.*



# Compito

## INTERVENTO

- » Intervento: Revisione Processo RAF
- » Unità auditata: Servizio Integrazione Rischi e Reporting – Area Financial Risk Officer  
Servizio Pianificazione – Area Pianificazione, CDG e Data Governance

### Ambito

Governo/Pianificazione strategica/Governo del Risk Appetite Framework

Secondo Pilastro SREP

### Obiettivi

- Analisi dell'impianto metodologico in termini di:
  - eventuali modifiche Risk Framework;
  - risk identification;
  - definizione dei KRI
- Analisi delle assunzioni alla base degli scenari macroeconomici
- Valutazione dei processi di calibrazione delle soglie dei principali indicatori
- Verifica del processo di cascading down
- Analisi dell'informativa prodotta per i vertici aziendali
- Analisi principali fasi del RAM

### Limiti

Il perimetro dell'attività da svolgere non comprende le fasi legate ai sotto-processi di RAG (individuazione di ruoli e responsabilità) in quanto al momento non sono presenti novità rispetto all'ultima attività di revisione.

## TEAM

- » Responsabile Audit Team: Cristina Boffa
- » Audit Team:
  - Claudio Barone
  - Serena Bianconi
  - Francesco Spampani
  - Luca Valori

## TIMING

- » Data inizio: 04/10/2018
- » Data fine prevista: 21/12/2018
- » Data prevista consegna rapporto: 31/12/2018



# Firme

Ruolo	Cognome e Nome	Firma
Responsabile Audit Team	Boffa Cristina	
Auditors	Barone Claudio	
	Bianconi Serena	
	Spampani Francesco	
	Valori Luca	
V° Responsabile del Settore Risk Model Audit	Boffa Cristina	
V° Responsabile del Servizio Financial & Model Risk Audit	Della Lunga Giovanni	
V° Responsabile dell'Area Revisione Specialistica	Furlani Andrea	
V° Responsabile della Direzione Chief Audit Executive	Cocco Pierfrancesco	

