

SEMINARIO

LE SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SULLE CARTOLARIZZAZIONI: GLI STEP PER LA PRIMA APPLICAZIONE

MILANO, 20 FEBBRAIO 2020 (9.45-16.00)

Copernico Centrale • Via Copernico, 38

9.45 APERTURA DEI LAVORI

Massimo Casa, Divisione Assistenza agli Enti segnalanti, Servizio Rilevazioni ed Elaborazioni Statistiche **Banca d'Italia**

10.00 INQUADRAMENTO GENERALE

- Regolamento UE n. 2402/2017 (STS Regulation)
- Trattamento prudenziale delle esposizioni in cartolarizzazioni – Regolamento UE n. 2401/2017
- Opinion dell'EBA sul trattamento regolamentare delle cartolarizzazioni di NPL
- GACS – Garanzia sulla Cartolarizzazione delle Sofferenze

FOCUS ON – LE CARTOLARIZZAZIONI SINTETICHE

- Caratteristiche delle cartolarizzazioni sintetiche e riflessi sul significativo trasferimento del rischio
- La consultazione EBA per l'estensione del framework STS alle cartolarizzazioni sintetiche

Bernardo D'Alessandro Tavani, Divisione Supporto Regolamentazione Internazionale, Servizio Regolamentazione e Analisi Macroprudenziale **Banca d'Italia**

11.15 Pausa caffè

11.30 DALLA FASE DI TRANSIZIONE ALL'APPLICAZIONE: I TEMPLATI DELL'EBA

Contenuto e istruzioni per la compilazione

- I template del DPM 2.8
- I nuovi template del DPM 2.9
 - Il template C 13 01
 - I template C 14 00 e C 14 01

Valentina Murano, Divisione Assistenza agli Enti segnalanti, Servizio Rilevazioni ed Elaborazioni Statistiche **Banca d'Italia**

Andrea Conardi, Ufficio Contabilità Generale **Credito Emiliano**

13.00 Pausa pranzo

14.00 CARATTERISTICHE FONDAMENTALI DELLA SOLUZIONE PUMA2 PER LA GESTIONE DELLE OPERAZIONI DI CARTOLARIZZAZIONE

- Le informazioni di input necessarie
- Le funzioni di calcolo dei parametri regolamentari
- Output del processo di calcolo e produzione delle segnalazioni di vigilanza

Valentina Murano, Divisione Assistenza agli Enti segnalanti, Servizio Rilevazioni ed Elaborazioni Statistiche **Banca d'Italia**

15.00 ALCUNI ESEMPI SEGNALETICI DELLE CARTOLARIZZAZIONI TRADIZIONALI E SINTETICHE

- La cartolarizzazione tradizionale
 - Metodo SEC-SA
 - Metodo SEC-ERBA
 - L'autocartolarizzazione
- La cartolarizzazione sintetica: il ruolo dell'originator, dell'investor e le garanzie ricevute

Valentina Murano, Divisione Assistenza agli Enti segnalanti, Servizio Rilevazioni ed Elaborazioni Statistiche **Banca d'Italia**

Andrea Conardi, Ufficio Contabilità Generale **Credito Emiliano**

16.00 Chiusura dei lavori