

Web Seminar

LA NUOVA REGOLAMENTAZIONE DELL'NSFR: PRINCIPALI NOVITÀ DEL CRR2 E IMPATTI SULLE SEGNALAZIONI DI VIGILANZA

18 MAGGIO 2021 • Aula virtuale (10:00-13:00)



10.00 **Saluti di benvenuto e apertura dei lavori**

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

10.10 **Introduzione ai contenuti**

Massimo Casa,
Servizio Rilevazioni
ed Elaborazioni Statistiche
Banca d'Italia

OPEN SESSION

10.20 **Inquadramento generale**

- Il quadro normativo previgente (CRR) in materia di liquidità
- CRR2: recepimento in UE dell'NSFR
 - Principali componenti dell'indicatore
 - Principali differenze tra principio Basilea e requisito UE
- Simplified NSFR
- Prossimi passi e spunti per la discussione

Massimo Castagna,
Divisione Regolamentazione II,
Servizio Regolamentazione
e Analisi Macroprudenziale
Banca d'Italia

11.30  *Break*

11.45 **NSFR: i riflessi segnaletici e la soluzione PUMA2**

- I template EBA ITS
- La soluzione PUMA2:
 - le informazioni di input
 - il trattamento delle operazioni SFT
 - i covered bond e i derivati
 - il trattamento delle compensazioni
- Alcuni esempi di applicazione

Maria Perricone,
Servizio Rilevazioni ed
Elaborazioni Statistiche,
Coordinamento dei Gruppi
PUMA **Banca d'Italia**

13.00 *Chiusura dei lavori*

