

Web Seminar

LA NUOVA REGOLAMENTAZIONE DEL RISCHIO DI CONTROPARTE E DEL RISCHIO DI CREDITO: PRINCIPALI NOVITÀ DEL CRR2 E IMPATTI SULLE SEGNALAZIONI DI VIGILANZA

27, 28 e 29 APRILE 2021 • Aula virtuale (10:00-13:00)



PRIMA GIORNATA • 27 aprile 2021

10.00	Apertura dei lavori	Maria Angiulli , Ufficio Studi ABI
10.10	Introduzione ai contenuti	Massimo Casa , Servizio Rilevazioni ed Elaborazioni Statistiche Banca d'Italia
<small>OPEN SESSION</small>		
10.25	Inquadramento generale <ul style="list-style-type: none"> • Novità regolamentari rispetto alla disciplina corrente del rischio di controparte • CRR: gli approcci correnti • CRR2: il SA-CCR e gli approcci semplificati (proporzionalità) <ul style="list-style-type: none"> - Mandati EBA nella CRR2 - Alcuni spunti per la discussione 	Riccardo Rocco , Divisione Supporto Regolamentazione Internazionale, Servizio Regolamentazione e Analisi Macroprudenziale Banca d'Italia
11.30	<i>Break</i>	
11.45	Dal CRR al CRR2: i template dell'EBA Contenuto e istruzioni per la compilazione	Valentina Murano , Divisione Assistenza agli Enti Segnalanti, Servizio Rilevazioni ed Elaborazioni Statistiche, Coordinamento Gruppi PUMA Banca d'Italia
12.15	Caratteristiche fondamentali della soluzione PUMA2 per la gestione del SA-CCR <ul style="list-style-type: none"> • 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, Coordinamento Gruppi PUMA Banca d'Italia
13.00	<i>Chiusura dei lavori della prima giornata</i>	



SECONDA GIORNATA • 28 aprile 2021

10.00 **Caratteristiche fondamentali della soluzione PUMA2 per la gestione del SA-CCR** *(segue)*

Valentina Murano,
Divisione Assistenza
agli Enti Segnalanti, Servizio
Rilevazioni ed Elaborazioni
Statistiche, Coordinamento
Gruppi PUMA **Banca d'Italia**

10.45 **Caratteristiche fondamentali della soluzione PUMA2 per la gestione del SA-CCR semplificato e del metodo OEM**

- Gli elementi di differenza con il SA-CCR
- Le nuove richieste informative di input e 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, Coordinamento
Gruppi PUMA **Banca d'Italia**

11.30  Break

11.45 **Alcuni esempi segnaletici delle metodologie di calcolo del rischio di contoparte**

- Il template C 34 02: esposizioni soggette al CCR in base ai metodi
- Il template C 34.03: esposizioni soggette al CCR trattate con il SA-CCR
- Il template C 34 04: esposizioni soggette al CCR trattate con l'OEM

Valentina Murano,
Divisione Assistenza
agli Enti Segnalanti, Servizio
Rilevazioni ed Elaborazioni
Statistiche, Coordinamento
Gruppi PUMA **Banca d'Italia**

13.00 *Chiusura dei lavori della seconda giornata*

TERZA GIORNATA • 29 aprile 2021

OPEN SESSION

10.00 **Inquadramento generale**

Novità regolamentari del rischio di credito:

- CRR2 (equity investments in funds)
- Quick fix (supporting factors)

Simone Calogero Marino,
Divisione Regolamentazione II,
Servizio Regolamentazione
e Analisi Macroprudenziale
Banca d'Italia

10.30 **Adeguamento della soluzione PUMA2 per la gestione del regolamento Quick Fix**

- L'anticipo di alcune disposizioni della CRR2
- L'applicazione dell'IFRS 9 durante la pandemia Covid-19
- Il trattamento temporaneo di profitti e perdite non realizzati misurati al FVOCI

Valentina Murano,
Divisione Assistenza
agli Enti Segnalanti, Servizio
Rilevazioni ed Elaborazioni
Statistiche, Coordinamento
Gruppi PUMA **Banca d'Italia**

Andrea Conardi,
Ufficio Contabilità Generale
Credito Emiliano

Gruppo Interbancario PUMA

11.30 Break

11.45 **Adeguamento della soluzione PUMA2 per la gestione delle esposizioni sotto forma di quote o azioni in OIC**

- Il metodo LTA: le informazioni di input
- Il metodo dell'MBA: le informazioni di input e le funzioni di calcolo
- Un esempio applicativo sul metodo MBA

Valentina Murano,
Divisione Assistenza
agli Enti Segnalanti, Servizio
Rilevazioni ed Elaborazioni
Statistiche, Coordinamento
Gruppi PUMA **Banca d'Italia**

Andrea Conardi,
Ufficio Contabilità Generale
Credito Emiliano

Gruppo Interbancario PUMA

12.30 **Dal CRR al CRR2: i template dell'EBA** (segue) Contenuto e istruzioni per la compilazione

Valentina Murano,
Divisione Assistenza
agli Enti Segnalanti, Servizio
Rilevazioni ed Elaborazioni
Statistiche, Coordinamento
Gruppi PUMA **Banca d'Italia**

13.00 *Chiusura dei lavori*