

Seminario

LE OPERAZIONI DI CARTOLARIZZAZIONE: IL REGOLAMENTO CRR, GLI OBBLIGHI SEGNALETICI E LA SOLUZIONE PUMA PER LE BANCHE E GLI INTERMEDIARI FINANZIARI

17 e 18 giugno 2024 • Aula virtuale



17 giugno 2024 • Aula virtuale (09.45 - 12.30)

09.45 ► APERTURA DEI LAVORI

10.00 ► INTRODUZIONE AI CONTENUTI

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

10.15 ► INQUADRAMENTO GENERALE

- Il quadro normativo europeo sulle cartolarizzazioni – Regolamenti UE n° 2402/2017 e Regolamento UE n° 557/2021
- Il trattamento prudenziale delle esposizioni in cartolarizzazioni – Regolamento UE n° 2401/2017 e Regolamento UE n° 558/2021
- Riflessi sulla normativa nazionale: le modifiche del TUF e delle Circolari di Banca d'Italia

Bernardo D'Alessandro Tavani Divisione Supporto regolamentazione internazionale, Servizio Regolamentazione e analisi macroprudenziale **Banca d'Italia**

Daniele Dell'Aira Divisione Supporto regolamentazione internazionale, Servizio Regolamentazione e analisi macroprudenziale **Banca d'Italia**

11.30 *Coffee break*

11.45 ► I TEMPLATI DELL'EBA

Contenuto e istruzioni per la compilazione

- I nuovi template del DPM 3.2:
 - Il template C 13 01
 - I template C 14 00 e C 14 01
- Le differenze con i template del DPM 2.8

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

Andrea Conardi Ufficio Contabilità Generale **Credito Emiliano**

12.30 *Chiusura dei lavori della prima giornata*

18 giugno 2024 • Aula virtuale (10.00 - 12.30)

10.00 ► 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**

11.30 *Coffee break*

11.45 ► 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**

12.30 *Chiusura dei lavori*