

Seminario

# IL REGOLAMENTO CRR: LE MODIFICHE NORMATIVE DEL CRR3, GLI SCHEMI SEGNALETICI DELL'EBA E LA SOLUZIONE PUMA

25 e 26 novembre 2024 • Aula virtuale



25 novembre 2024 • Aula virtuale (09.30 - 13.30)

## 09.30 ▶ APERTURA DEI LAVORI

**Maria Angiulli** Responsabile Ufficio Analisi Regolamentazione **ABI**

## 09.45 ▶ INTRODUZIONE AI CONTENUTI

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

## 10.00 ▶ INQUADRAMENTO GENERALE: RISCHIO DI CREDITO

- Sintesi del negoziato
- Le principali proposte di modifica
- Specificità europee

**Salvatore Di Bella** Divisione Regolamentazione II, Servizio Regolamentazione e analisi macroprudenziale **Banca d'Italia**

## 10.40 ▶ INQUADRAMENTO GENERALE: RISCHIO DI CVA

- Il perimetro di applicazione
- I nuovi metodi di calcolo del requisito
- Specificità europee

**Carlo Calvaruso** Divisione supporto regolamentazione internazionale, Servizio Regolamentazione e analisi macroprudenziale **Banca d'Italia**

## 11.10 ▶ INQUADRAMENTO GENERALE: RISCHIO OPERATIVO

- Il perimetro di applicazione
- Le principali proposte di modifica

**Carlo Calvaruso** Servizio Regolamentazione e analisi macroprudenziale **Banca d'Italia**

11.30 *Coffee break*

## 11.45 ▶ DAL CRR2 AL CRR3: I TEMPLATE EBA DEL DPM 4.0

Contenuto e istruzioni per la compilazione

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

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

## 12.25 ▶ LA SOLUZIONE PUMA<sub>2</sub> PER LA GESTIONE DEL RISCHIO DI CREDITO E PER LA PRODUZIONE DEI TEMPLATE DEL DPM 4.0

- Le informazioni di input necessarie in risposta alle modifiche regolamentari:
  - Calendar Provisioning (Art. 36 e Art. 47 quarter)
  - Esposizioni "Fuori Bilancio" (Art.111)
  - Esposizioni verso Enti (Artt. 119-121)
  - Finanziamenti Specializzati (Art.122 bis)
  - Esposizioni Retail (PMI) (Art.123)
  - Esposizioni Garantite da Immobili e ADC (Artt. 124-126bis)

**Valentina Murano** Servizio Rilevazioni ed Elaborazioni Statistiche **Banca d'Italia**

**Paola Caposeno** Servizio Rilevazioni ed Elaborazioni Statistiche **Banca d'Italia**

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

13.30 *Chiusura dei lavori della prima giornata*



26 novembre 2024 • Aula virtuale (09.30 - 13.15)

**09.30 ▶ LA SOLUZIONE PUMA2 PER LA GESTIONE DEL RISCHIO DI CREDITO E PER LA PRODUZIONE DEI TEMPLATE DEL DPM 4.0 – (2^ PARTE)**

- Le informazioni di input necessarie in risposta alle modifiche regolamentari:
  - Titoli di Capitale (Art.133)
  - Esposizioni in debito subordinato (Art.128)
  - Ulteriori approfondimenti
- Le funzioni di calcolo dei parametri regolamentari: la Credit Risk Mitigation
- 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**

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

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

**11.15** *Coffee break*

**11.30 ▶ LA SOLUZIONE PUMA2 PER LA GESTIONE DEL RISCHIO DI CVA E PER LA PRODUZIONE DEL TEMPLATE C 25 00 DEL DPM 4.0**

- Le informazioni di input necessarie per il metodo "Base" e "Standardizzato Semplificato":
  - Le esposizioni assoggettate al requisito
  - Le coperture ammissibili
- Le funzioni di calcolo dei parametri regolamentari
- Output del processo di calcolo e produzione delle segnalazioni di vigilanza

**Valentina Murano** Servizio Rilevazioni ed Elaborazioni Statistiche **Banca d'Italia**

**Matteo Dotto** Specialista Senior nelle segnalazioni COREP, Servizio Regulatory Reporting **Banca IFIS**

**12.15 ▶ LA SOLUZIONE PUMA2 PER LA GESTIONE DEL RISCHIO OPERATIVO E PER LA PRODUZIONE DEL TEMPLATE C 16.01 DEL DPM 4.0**

- Le informazioni di input necessarie
- Il raccordo di conto economico
- Le funzioni di calcolo delle componenti dell'indicatore BIC
- Output del processo di calcolo e produzione delle segnalazioni di vigilanza

**Fabio Galante** Servizio Rilevazioni ed Elaborazioni Statistiche **Banca d'Italia**

**Matteo Dotto** Servizio Regulatory Reporting **Banca IFIS**

**13.15** *Chiusura dei lavori*