










VIGILANZA PRUDENZIALE DEGLI INTERMEDIARI ALBO UNICO

*I PRINCIPALI RIFLESSI SULLA MISURAZIONE DEI RISCHI, SULLA VALUTAZIONE
DELL'ADEGUATEZZA PATRIMONIALE E SULLE SEGNALAZIONI DI VIGILANZA*

MILANO, 5 - 6 DICEMBRE 2019

Starhotels Anderson - Piazza Luigi di Savoia, 20

-  Base YF
 -  Circolare 288 Banca d'Italia
 -  Composizione del patrimonio
 -  Fondi propri
 -  Valutazione dei rischi
 -  Segnalazioni armonizzate per le finanziarie
-  *Esempi e casi pratici*

DESTINATARI

Responsabili e addetti Area:

- Contabilità e Bilancio e Segnalazioni
- Pianificazione e Controllo di Gestione
- Risk Management e Auditing Interno
- Organizzazione e Sistemi Informativi

OBIETTIVI

Il corso esamina le **novità prudenziali** e **segnalatiche** previste per gli **intermediari finanziari** appartenenti all'**Albo Unico**.

Nelle due giornate saranno esaminati gli aspetti più problematici nell'applicazione della **normativa** con particolare attenzione alla **valutazione dei rischi** assunti, alle **tecniche di copertura**, nella stima complessiva dei fondi propri disponibili, dando ampio spazio - anche attraverso **casi pratici** - alle regole di compilazione delle **segnalazioni prudenziali**. **Focus particolare sarà inoltre dato ai risvolti prudenziali connessi all'introduzione dell'IFRS 9 e alle altre novità intervenute sui temi oggetto di trattazione.**

CONTENUTI

Milano – giovedì 5 dicembre 2019 – ore 10:30/18:00

Andrea CAPPELLI

Specialist Normativa di Vigilanza, Amministratore

AEM SOLUTIONS

IL QUADRO NORMATIVO DI RIFERIMENTO

- Basilea III per gli intermediari finanziari: CRR, CRD IV e gli Atti Delegati
- La Circolare n. 288 della Banca d'Italia
- Gli adempimenti segnalatici: dalla Circolare n. 217/1996 alla Circolare n. 286/2013

LE NUOVE DISPOSIZIONI DI VIGILANZA PER GLI INTERMEDIARI FINANZIARI

- La portata del cambiamento (cenni):
 - Il regime autorizzativo
 - Le attività esercitabili e le partecipazioni detenibili
 - La nozione di Gruppo Finanziario
 - Il Sistema dei Controlli Interni
- Lo scenario futuro: cenni alle principali novità allo studio delle Autorità di Vigilanza (Basilea 4, coperture minime sui crediti, trattamento delle esposizioni sovrane, ecc...)

GLI ISTITUTI DELLA VIGILANZA PRUDENZIALE: LE PRINCIPALI NOVITÀ

- L'approfondimento sui fondi propri
 - I nuovi aggregati patrimoniali: CET 1, AT 1 e T2
 - I nuovi vincoli alla computabilità degli strumenti di capitale
 - Filtri patrimoniali e deduzioni: profili di criticità
 - Il regime transitorio ed il *grandfathering*
 - Il regime transitorio dell'IFRS 9

- I requisiti patrimoniali obbligatori
 - Il rischio di credito ed i nuovi criteri di portafogliazione
 - Rassegna delle altre principali novità per il computo del requisito patrimoniale a fronte del rischio di credito
 - Il rischio di controparte: operazioni in derivati e con controparti centrali
 - Il rischio operativo: modalità di calcolo dell'indicatore rilevante
 - Rischi di mercato: cenni alle principali novità
 - Grandi esposizioni
- I requisiti patrimoniali di secondo pilastro
 - Il processo ICAAP in Basilea III: profili di analisi
 - Il rischio di concentrazione
 - Il rischio di tasso di interesse
 - Il rischio di liquidità e la leva finanziaria
 - Gli altri profili di rischio rilevanti nel processo ICAAP
- Il terzo pilastro
 - Come cambia l'informativa al pubblico
 - Un modello metodologico per la compilazione del documento di informativa al pubblico
- La valutazione dell'adeguatezza patrimoniale dell'intermediario
 - I nuovi coefficienti patrimoniali
- La valutazione attuale, prospettica e in ottica di stress

Milano – venerdì 6 dicembre 2019 – ore 10:30/18:00

I NUOVI SCHEMI SEGNALETICI NEL REGIME BASILEA3

- Le novità nella predisposizione dell'input segnaletico
 - Accenni alla procedura P.u.m.a.2
 - Rischio di credito e cartolarizzazioni
 - Grandi esposizioni
- L'ampliamento del set informativo segnaletico: dalla Matrice al DPM
 - L'importanza del raccordo fra le segnalazioni di vigilanza e il reporting aziendale
 - Gli schemi dei fondi propri, rischio di credito, cartolarizzazioni e grandi esposizioni
 - La posizione patrimoniale

Esempi sulle modalità di calcolo delle voci derivate

- L'attribuzione del portafoglio di Basilea3: la classe di merito e l'utilizzo delle ECAI
- La credit risk mitigation
- Lo SME supporting factor



ORARIO	10:30 – 18:00 09:30 – 17:00
PRANZO	13:30 – 14.30
COFFEE-BREAK	16:00 – 16:20 (solo primo giorno) 11:00 – 11:20 (solo secondo giorno)

QUOTA

€ 1.950 + IVA

ADVANCED BOOKING

Per iscrizioni entro **11/11/2019**
applichiamo le seguenti riduzioni:

- **10%** di sconto per singola iscrizione
- **20%** di sconto per iscrizioni multiple, da 2 a 4 partecipanti

Agevolazioni non cumulabili fra loro