









LA VIGILANZA PRUDENZIALE
COEFFICIENTI PATRIMONIALI E RISCHI
SEGNALAZIONI BASILEA3

MILANO, 9 -10 maggio 2018

Starhotels Anderson - Piazza Luigi di Savoia, 20

-  Copertura dei rischi
-  Misura correttive di vigilanza
-  Disposizioni transitorie IFRS 9
-  Rischio di credito, CRM e garanzie
-  Profili segnaletici e casi pratici
-  Schemi ITS Corep

DESTINATARI

Responsabili e addetti Area:

- Contabilità, Bilancio e Segnalazioni
- Risk Management e Auditing Interno
- Organizzazione e Sistemi Informativi

OBIETTIVI

Il seminario affronta l'esame della **normativa prudenziale**, in particolare nella valutazione dei rischi assunti, nelle tecniche di copertura, nella stima complessiva del patrimonio di vigilanza disponibile, dando ampio spazio - anche attraverso **casi pratici** - alle regole di compilazione delle **segnalazioni prudenziali**. In particolare il seminario intende:

- Esaminare dettagliatamente le metodologie di calcolo e di attenuazione del **rischio di credito** anche attraverso **esercitazioni e casi pratici**
- Prendere in esame l'evoluzione normativa di Basilea
- Analizzare **patrimonio di vigilanza** e le metodologie di determinazione dei **requisiti patrimoniali**
- Definire la mappa dei rischi e trattare le **modalità di segnalazione** alla Banca d'Italia delle principali tipologie di rischio anche **attraverso esercitazioni pratiche**

CONTENUTI

Milano - mercoledì 9 maggio 2018 - ore 10:30/18:00

Carlo Antonio SANTI

Ufficio Studi Divisione Finance GRUPPO ENGINEERING

LA VIGILANZA PRUDENZIALE

- Introduzione alla vigilanza prudenziale
- Il contesto europeo
- Il rischio e le sue declinazioni
- Relazioni tra rischio e patrimonio

LA STRUTTURA DELL'IMPIANTO REGOLAMENTARE

- Regolamento 575/2013 e Direttiva 2013/36/UE
- Regolamento 680/2014 e Circolari Banca d'Italia (285 e 286)
- Relazione tra ITS e schemi segnaletici

EVOLUZIONI DEI RISCHI E DEL PATRIMONIO: da Basilea 1 a Basilea 3

- La classificazione e la misurazione dei rischi
- La classificazione del patrimonio di vigilanza
- Le riserve di capitale e coefficienti patrimoniali
- Analisi di un caso

LE "DISPOSIZIONI TRANSITORIE" A SEGUITO DELL'APPLICAZIONE IFRS9

- La normativa di riferimento: analisi e contenuto
- Gli aggiustamenti del Cet1
- Lo scaling factor

GLI STANDARD MINIMI DI LIQUIDITÀ

- Liquidity Coverage Ratio (LCR)
- Net Stable Funding Ratio (NSFR)
- Additional Liquidity Monitoring Metrics.

Milano – giovedì 10 maggio 2018 – ore 9:30/17:00

Francesco VACCARO

Responsabile Segnalazioni Prudenziali - Basilea

Sistemi di Governance Area solutions, GRUPPO ENGINEERING

GLI SVILUPPI DI VIGILANZA: IL REGOLAMENTO 575/2013 e GLI SCHEMI ITS (Corep)

- Normativa di riferimento
- Principali impatti

RISCHIO DI CREDITO E CREDIT RISK MITIGATION (CRM): APPROFONDIMENTI

- Classificazione in portafogli prudenziali
- Le modalità di determinazione degli Rwa
- Approfondimenti su definizione di default, credit support factor
- Approfondimenti Crm e criteri di eleggibilità delle garanzie

Approfondimenti sulle nuove segnalazioni Basilea 3 – Schemi ITS Corep

- *Casi pratici di segnalazione sul rischio di credito:
determinazione delle voci e dei campi da generare*

GRANDI RISCHI: CENNI

- Classificazione in portafogli prudenziali
- Particolarità delle specifiche ponderazioni
- **Approfondimenti sulle nuove segnalazioni Basilea 3 – Schemi ITS Corep**

RISCHI DI MERCATO: CENNI

- Il rischio di posizione e di regolamento sul portafoglio di negoziazione ai fini di vigilanza
- Il rischio di cambio
- Il rischio di posizione su merci
- **Approfondimenti sulle nuove segnalazioni Basilea 3 – Schemi ITS Corep**

RISCHI OPERATIVI: CENNI

- I metodi base e standardizzato
- I metodi avanzati (AMA): requisiti organizzativi e quantitativi
- **Approfondimenti sulle nuove segnalazioni Basilea 3 - Schemi ITS Corep**

LEVA FINANZIARIA - CENNI

- **Approfondimenti sulle nuove segnalazioni Basilea 3 - Schemi ITS Corep**

LE SEGNALAZIONI A BANCA D'ITALIA DELLE PRINCIPALI TIPOLOGIE DI RISCHIO: RISCHIO DI CREDITO, CRM, POSIZIONE PATRIMONIALE, GRANDI RISCHI, RISCHI DI MERCATO, RISCHI OPERATIVI

- Schema di segnalazione
 - Composizione e termini di invio
 - Controlli formali
- Casi pratici*



ORARIO	10:30 – 18:00 09:30 – 17:00
PRANZO	13:30 – 14.30
COFFEE-BREAK	16:00 – 16:20 (1st Day) 11:00 – 11:20 (2nd Day)

QUOTA

€ 1.950 + IVA

ADVANCED BOOKING

per iscrizioni entro **10/04/2017**
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