

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 - 13.15)

**09.30 ▶ APERTURA DEI LAVORI****09.45 ▶ INQUADRAMENTO GENERALE: RISCHIO DI CREDITO**

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

**10.30 ▶ INQUADRAMENTO GENERALE: RISCHIO DI CVA**

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

**10.55 ▶ INQUADRAMENTO GENERALE: RISCHIO OPERATIVO**

- Il perimetro di applicazione
- Le principali proposte di modifica

**11.20** *Coffee break***11.35 ▶ DAL CRR2 AL CRR3: I TEMPLATE EBA DEL DPM 4.0**

Contenuto e istruzioni per la compilazione

**12.15 ▶ LA SOLUZIONE PUMA2 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 (Art.119/120/121)
  - Finanziamenti Specializzati (Art.122 bis)
  - Esposizioni Retail (PMI) (Art.123)
  - Esposizioni Garantite da Immobili e ADC (ART.124/125/126/126bis)
  - Titoli di Capitale (Art.133)
  - Esposizioni in debito subordinato (Art.128)
  - Ulteriori approfondimenti

**13.15** *Chiusura dei lavori della prima giornata*



26 novembre 2024 • Aula virtuale (09.30 - 13.15)

---

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

- Le funzioni di calcolo dei parametri regolamentari: la Credit Risk Mitigation
- Output del processo di calcolo e produzione delle segnalazioni di vigilanza

**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

**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

**13.15** *Chiusura dei lavori*