

**LE SEGNALAZIONI PRUDENZIALI SECONDO GLI SCHEMI "PUMA"
ALLA LUCE DEGLI AGGIORNAMENTI DELLA
CIRCOLARE N.263 DELLA BANCA D'ITALIA
E DELLE DISPOSIZIONI IN MATERIA DI
GOVERNO E GESTIONE DEL RISCHIO DI LIQUIDITA'**

Milano, 10 febbraio 2011
Hotel Four Points Sheraton – Via Cardano 1

Il seminario in oggetto ha come obiettivo l'analisi dello stato avanzamento lavori delle note tecniche Puma trapiantato per la prima segnalazione utile riferita al 31/12/2010 con scadenza 25/03/2011 e dei relativi adeguamenti operativi. Si rivolge pertanto a:

- responsabili e addetti alle segnalazioni di vigilanza
- funzione IT
- e in generale alle figure organizzative e di risk management

Nel corso della giornata verrà inoltre illustrato l'atteso documento Bankit relativo al **rischio di liquidità** pubblicato in data 17/12/2010

Ore 9.30 apertura dei lavori

Situazione generale delle attività di adeguamento Direttive Europee

L'approccio PUMA trapiantato alle specificità della segnalazione di Base Y

La fase di Input, controllo e arricchimento:

I principali campi di input - La segmentazione di portafoglio - I rating esterni

Rischio di credito e controparte

La fase fidi e garanzie

La "Credit Risk Mitigation": I principali campi di input - Le operazioni particolari (SFT, accordi quadro) -

Le esposizioni garantite da immobili

Il trattamento delle esposizioni scadute - Il trattamento delle esposizioni al dettaglio

Rischi di mercato

Rischio di posizione - Il nuovo trattamento F11

Derivati e derivati creditizi - Il trattamento delle quote OICR - Rischio di posizione in merci

Rischio di regolamento - Rischio di cambio

Le cartolarizzazioni

I principali campi di input

La determinazione del requisito: Fattore medio ponderato - Metodo look-through - Cap test

Novità per intermediari finanziari

Leasing – Factoring - Credito al consumo

I grandi rischi

I principali campi di input - Le funzioni preliminari alla CRM per i grandi rischi

La CRM per i grandi rischi - Le attività di controllo e adeguamento finale

La tabella di raccordo PUMA

La gestione ed il governo del rischio di liquidità

Ore 17.30 chiusura dei lavori

RELATORI: **Dott. ROBERTO SAVELLI** e **Dott. DAVIDE SAVELLI**, Save Consulting Group

Quota di partecipazione comprensiva di colazione di lavoro, 2 coffee break e materiale didattico su formato cartaceo ed elettronico: **Euro 700,00 + Iva 20% a partecipante**

Per iscrizioni e ulteriori informazioni Tel. 02/36577120 - email: informa@informabanca.it