

METRICHE AGGIUNTIVE PER LE SEGNALAZIONI SULLA LIQUIDITÀ

Roma, 16 Maggio 2016

Milano, 17 Maggio 2016

ALMM, LCR, NSFR, tante sigle alle cui spalle vigono delle precise nozioni sia regolamentari sia gestionali. Queste identificano e sensibilizzano, l'intermediario a prendere consapevolezza del "liquidity risk" inteso, ma non solo, come governo dei flussi di ingresso e di uscita in periodi congiunturali particolarmente sfavorevoli. Il convegno si propone quindi di:

- *Coinvolgere gli organi aziendali nell'individuazione di politiche gestionali del rischio in questione, idonee alla complessità operativa ed alla struttura della propria banca*
- *Individuare gli opportuni sistemi di misurazione, controllo e gestione del "liquidity risk" (in ultimo il regolamento di esecuzione (UE) 2016/313)*
- *Contenere gli scenari ed identificare piani di emergenza che tutelino l'ente da periodi depressivi*

La Save Consulting ha l'obiettivo di fornire un chiaro quadro di riferimento ed indicare le chiavi di lettura (segnalistiche e non) per interpretare correttamente tale fenomeno anche in logica ILAAP (Internal Liquidity Adequacy Assessment Process).

La giornata è pertanto aperta agli operatori dei servizi Rischi, Amministrativo e Organizzazione nonché a tutti gli altri settori che in azienda hanno impatti operativi nella gestione di tali informazioni.

Ore 09.30 registrazione partecipanti

Ore 09.40 apertura lavori

➤ **LIQUIDITÀ – IL QUADRO REGOLAMENTARE (dalla circolare 263 alla 285)**

- ✓ La *governance* della liquidità da Basilea 2,5 a Basilea 3
- ✓ Il requisito di liquidità nel breve periodo (LCR)
 - Il regolamento (UE) n. 575/2013
 - Il regolamento delegato (UE) 2015/061
 - La segnalazione “*ad interim*”
- ✓ La copertura stabile (NSFR)

➤ **LE METRICHE DI CONTROLLO DELLA LIQUIDITÀ (ALMM)**

- ✓ L’ambito normativo
 - Il Regolamento di esecuzione (UE) 2016/313
 - La *ratio*
 - La segnalazione
- ✓ I *template* per il *reporting*

➤ **I NUOVI MODELLI PER LA SEGNALEZIONE**

- ✓ Concentrazione del finanziamento (*funding*) per controparte (C_67.00)
 - Cosa segnalare e quali soglie
 - Allineamento rispetto a quanto segnalato nel FINREP
 - Le componenti da registrare per ciascuna controparte
 - Quale prodotto segnale
- ✓ Concentrazione del finanziamento (*funding*) per tipo di prodotto (C_68.00)
 - Ripartizione per il tipo di prodotto degli enti segnalanti
 - Importo da segnalare
 - Le componenti da registrare per ogni singolo prodotto
- ✓ Prezzi per finanziamenti (*funding*) di varia durata (C_69.00)
 - La segnalazione della durata dell’operazione
 - Quale differenziale segnale
 - come lo segnale

- ✓ Rinnovo del finanziamento (*funding*) (C_70.00)
 - Le categorie di scadenza

- ✓ Concentrazione della capacità di compensazione per emittente/controparte (C_71.00)
 - La capacità di compensazione
 - Cosa segnalare

- ✓ Le relative connessioni con i *requirements* di Banca d'Italia

- **LE CONNESSIONI CON LE ULTERIORI METRICHE DI CONTROLLO DELLA LIQUIDITÀ (ALMM)**
 - ✓ L'attendibile integrazione con gli *stress test*
 - ✓ Il supporto prospettico all'ILAAP

Ore 17.00 chiusura lavori

RELATORI: Roberto e Davide Savelli – partners Save Consulting Group
Paolo Cataldi – consultant Save Consulting Group



Certificazione BSI ANAB UNI EN ISO 9001:2008 n. FS 595396 settore EA35-37