

Seminario

# NUOVE RACCOLTE GRANULARI SU CREDITO E TITOLI: ANACREDIT E SHSG

## Lezioni apprese e prossimi passi

MILANO, 13 e 14 MAGGIO 2019

Centro Congressi Olona • Via Olona, 2

### ▶ PRIMA GIORNATA • 13 maggio 2019 (10.00-17.00)

#### ANACREDIT UN ANNO DOPO: IL RESOCONTO DELLE PRIME RILEVAZIONI

##### 10.00 APERTURA E COORDINAMENTO DEI LAVORI

**Maria Luisa Giachetti**, Ufficio Studi **ABI**

**Massimo Casa**, Divisione Assistenza agli Enti Segnalanti, Servizio Rilevazioni ed Elaborazioni Statistiche **Banca d'Italia**

##### 10.15 LE RACCOLTE GRANULARI: IL FRAMEWORK REGOLAMENTARE EUROPEO E NAZIONALE

- Il framework europeo di AnaCredit e RIAD (Regolamento, Guideline, Manual)
- Il framework nazionale: le Circolari 297 e 302 della Banca d'Italia
- Gli ambiti di complessità della rilevazione: informazioni su controparti, strumenti e garanzie

**Maria Di Noia**, Divisione Centrale dei Rischi, Servizio Rilevazioni ed Elaborazioni Statistiche **Banca d'Italia**

**Andrea Proietti**, Divisione Informazioni Anagrafiche, Servizio Rilevazioni ed Elaborazioni Statistiche **Banca d'Italia**

##### 11.00 ANACREDIT UN ANNO DOPO: IL RESOCONTO DELLE PRIME RILEVAZIONI

- Le principali evidenze a quasi un anno dal primo invio: lesson learned
  - L'attività di Data Quality Management su strumenti, controparti e importi
  - La gestione dei rilievi AnaCredit: le attività a carico degli intermediari
  - Il ruolo delle BCN nel processo di reporting e le evidenze rilevate con il secondary reporting
  - L'utilizzo dell'inquiry internet dell'AS (ASQ)
  - L'importanza del codice LEI e dei codici identificativi nazionali
  - L'analisi dei primi flussi segnalatici

**Maria Di Noia**, Divisione Centrale dei Rischi, Servizio Rilevazioni ed Elaborazioni Statistiche **Banca d'Italia**

**Andrea Proietti**, Divisione Informazioni Anagrafiche, Servizio Rilevazioni ed Elaborazioni Statistiche **Banca d'Italia**

*Pausa caffè (11.30-11.45)*

##### 12.30 LA ROADMAP DELLE PROSSIME EVOLUZIONI A LIVELLO NAZIONALE ED EUROPEO

- I prossimi step a livello nazionale ed europeo
  - La raccolta integrata tra AnaCredit e Centrale dei rischi: lavori in corso
  - Ampliamento dello scope di AnaCredit
  - Riflessioni sui feedback loops

**Maria Di Noia**, Divisione Centrale dei Rischi, Servizio Rilevazioni ed Elaborazioni Statistiche **Banca d'Italia**

13.00 *Pausa pranzo*

## DA REQUIREMENT REGOLAMENTARE A STRUMENTO DI GOVERNANCE

- 14.00 **RIPENSARE LA CATENA DEL CREDITO ALLA LUCE DEL PATRIMONIO INFORMATIVO RILEVATO ATTRAVERSO ANACREDIT**
- L'ottimizzazione dei principali processi del credito: come utilizzare i dati AnaCredit per efficientare il processo del credito e la data architecture
  - Il disegno di un nuovo modello organizzativo
- Sergio Gianni**, Partner **Avantage Reply**
- 15.00 **L'UTILIZZO DEI DATI SEGNALETICI NEI SISTEMI DI CONTROLLO DELLA REDDITIVITÀ E DEI RISCHI DEL PORTAFOGLIO CREDITI**
- Aldo Letizia**, Responsabile Risk Management **Banca Popolare Pugliese**
- 15.30 **REPORTISTICA REGOLAMENTARE E ANACREDIT: GOVERNANCE E QUALITY NELLA PREDISPOSIZIONE DELLE SEGNALAZIONI**
- Lanfranco Gastaldi**, Principal Business Consultant **Irion**
- 16.00 **LA BUSINESS INTELLIGENCE APPLICATA AD ANACREDIT**
- Diego Lissoni**, Director Engineering **Ingegneria Informatica**
- 17.00 *Chiusura della prima giornata*



## SECONDA GIORNATA • 14 maggio 2019 (9.30-13.00)

### L'ESPERIENZA MATURATA CON LE PRIME SEGNALAZIONI ANACREDIT: BANCHE A CONFRONTO

- 9.30 **AnaCredit in ISP: un investimento oltre la compliance regolamentare**
- Paolo Bonanomi**, Senior Director, Credit Risk Reporting and Infrastructure **Intesa Sanpaolo**
- 9.50 **AnaCredit in Cassa Depositi e Prestiti: le opportunità dei nuovi obblighi normativi**
- Sabrina Coletti**, Responsabile Segnalazioni di Vigilanza **Cassa Depositi e Prestiti**
- 10.10 **Segnalazioni granulari: prime evidenze e next steps**
- Luca Guarinoni**, Head of Individual Regulatory and Statistical Reporting **UniCredit**
- 10.30 **LE SEGNALAZIONI DELLE DISPONIBILITÀ IN TITOLI DEI GRUPPI BANCARI (SHS GROUP): LESSON LEARNED**
- I nuovi obblighi segnaletici introdotti dalla Circolare Bankit n. 303/2018
  - Il perimetro soggettivo e oggettivo delle segnalazioni
  - Lesson learned e primi risultati
- Maurizio Iannaccone**, Divisione Segnalazioni Creditizie e Finanziarie, Servizio Rilevazioni ed Elaborazioni Statistiche **Banca d'Italia**
- Pausa caffè (11.15-11.30)*
- 12.15 **LE INIZIATIVE DI COOPERAZIONE NAZIONALE ED EUROPEA A SUPPORTO DELLA PRODUZIONE DEI DATI**
- La soluzione Puma per AnaCredit
  - La soluzione Puma per SHSG
  - Le attività svolte nell'ambito del Banks' Integrated Reporting Dictionary (BIRD)
- Massimo Casa**, Divisione Assistenza agli Enti Segnalanti, Servizio Rilevazioni ed Elaborazioni Statistiche **Banca d'Italia**
- 13.00 *Chiusura dei lavori e light lunch*