

La gestione degli impatti operativi: l'esperienza MPS



Collateral Management - Sfide ed opportunità
Milano, 24 giugno 2011

Rita Calossi, *Responsabile Servizio Tesoreria*



- Il gruppo MPS**
- Gestione del collateral – modello operativo (1)**
- Le esigenze / i cambiamenti**
- Gestione del collateral – modello operativo (2)**
- Gestione centralizzata del collateral**
- Le prossime integrazioni**

Il gruppo MPS

Terzo gruppo italiano, con circa 30.000 dipendenti e 3.000 filiali in Italia

Oltre 6 milioni di clienti

Marchi operanti in Italia:

- Banca Monte dei Paschi di Siena
- Banca Antonveneta
- Biverbanca
- Mps Leasing e Factoring

Filiali operanti all' Estero:

- New York
- Hong Kong
- Shanghai
- Londra

Sussidiarie Estere:

- Monte Paschi Banque Paris SA
- Monte Paschi Monaco S.A.M.
- Banca Montepaschi Belgio Bruxelles

Rappresentanze:

- Casablanca
- Il Cairo
- Tunisi
- Algeri
- Istanbul
- Mosca
- Bruxelles
- Francoforte
- Guangzhou
- Beijing
- Mumbai

Banche prodotto:

- AXA MPS
- MPS Capital Services Banca per le imprese
- Prima SGR
- MPS Leasing & Factoring

Entità accentrate in Target2:

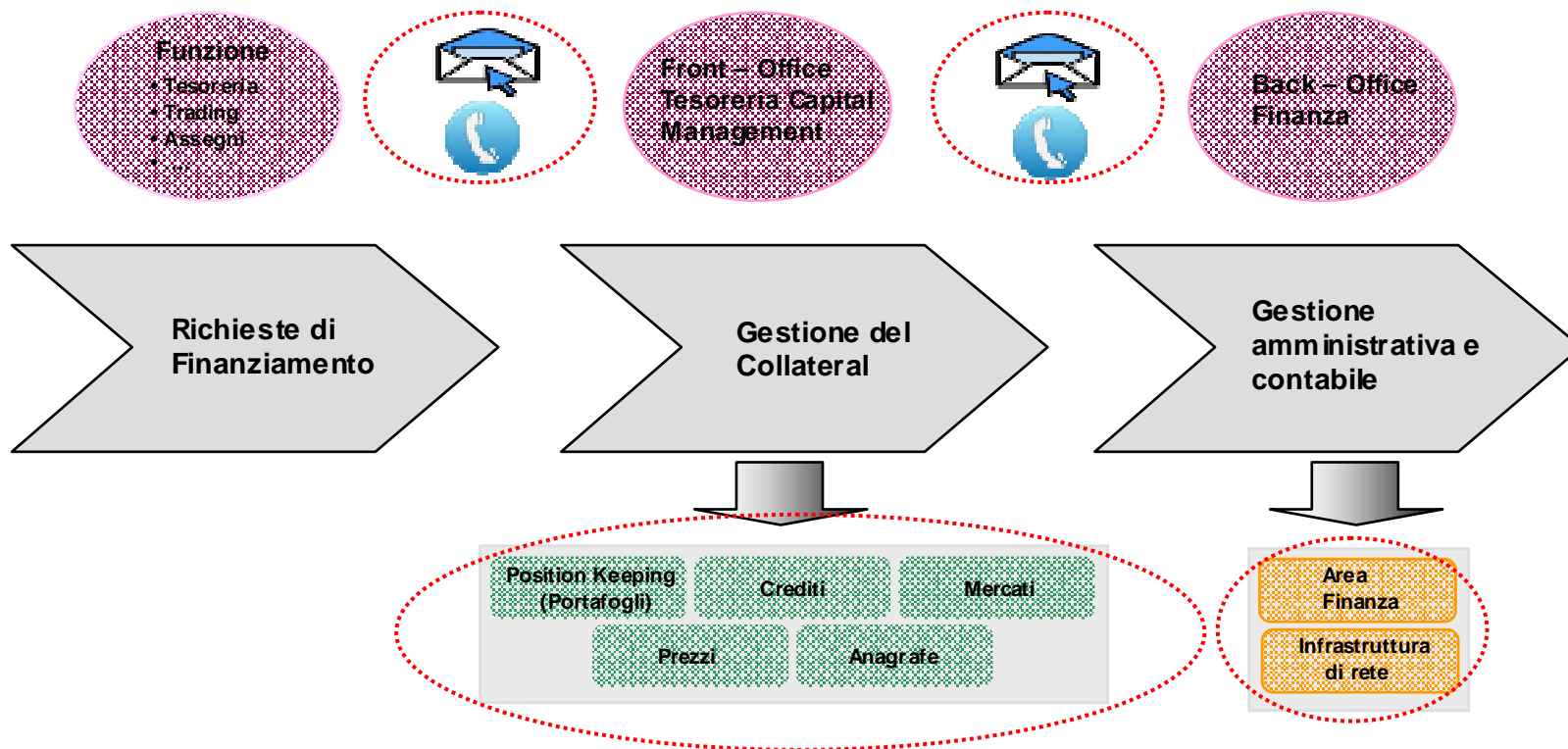
- Banca Monte dei Paschi di Siena (Conto PM)
- Banca Antonveneta (Indiretta con conto HAM)
- Biverbanca (Indiretta con conto HAM)
- Mps Leasing e Factoring (Addressable Bic)





- Il gruppo MPS
- Gestione del collateral – modello operativo (1)**
- Le esigenze / i cambiamenti
- Gestione del collateral – modello operativo (2)
- Gestione centralizzata del collateral
- Le prossime integrazioni

Gestione del collateral – processo operativo (1)



Agenda

- Il gruppo MPS
- Gestione del collateral – modello operativo (1)
- Le esigenze/i cambiamenti
- Gestione del collateral – modello operativo (2)
- Gestione centralizzata del collateral
- Le prossime integrazioni



Le esigenze/i cambiamenti

- ❑ Uno strumento standard per la raccolta delle richieste
- ❑ Monitoraggio in tempo reale :
 - Portafogli
 - Titoli
- ❑ Facilitare l'individuazione del titolo da mobilizzare
- ❑ Ridurre le attività manuali
- ❑ Semplificare le procedure di trasferimento

- ❑ Pooling Banca d'Italia :
 - Credit line
 - Operazioni di mercato aperto
 - Rifinanziamento marginale
 - Aste Optes (entro 2011)
- ❑ New Mic
- ❑ E-Mid Repo
- ❑ Triparty
- ❑ CCBM2
- ❑ Aumento crescente dell'utilizzo dei titoli presenti nei propri portafogli

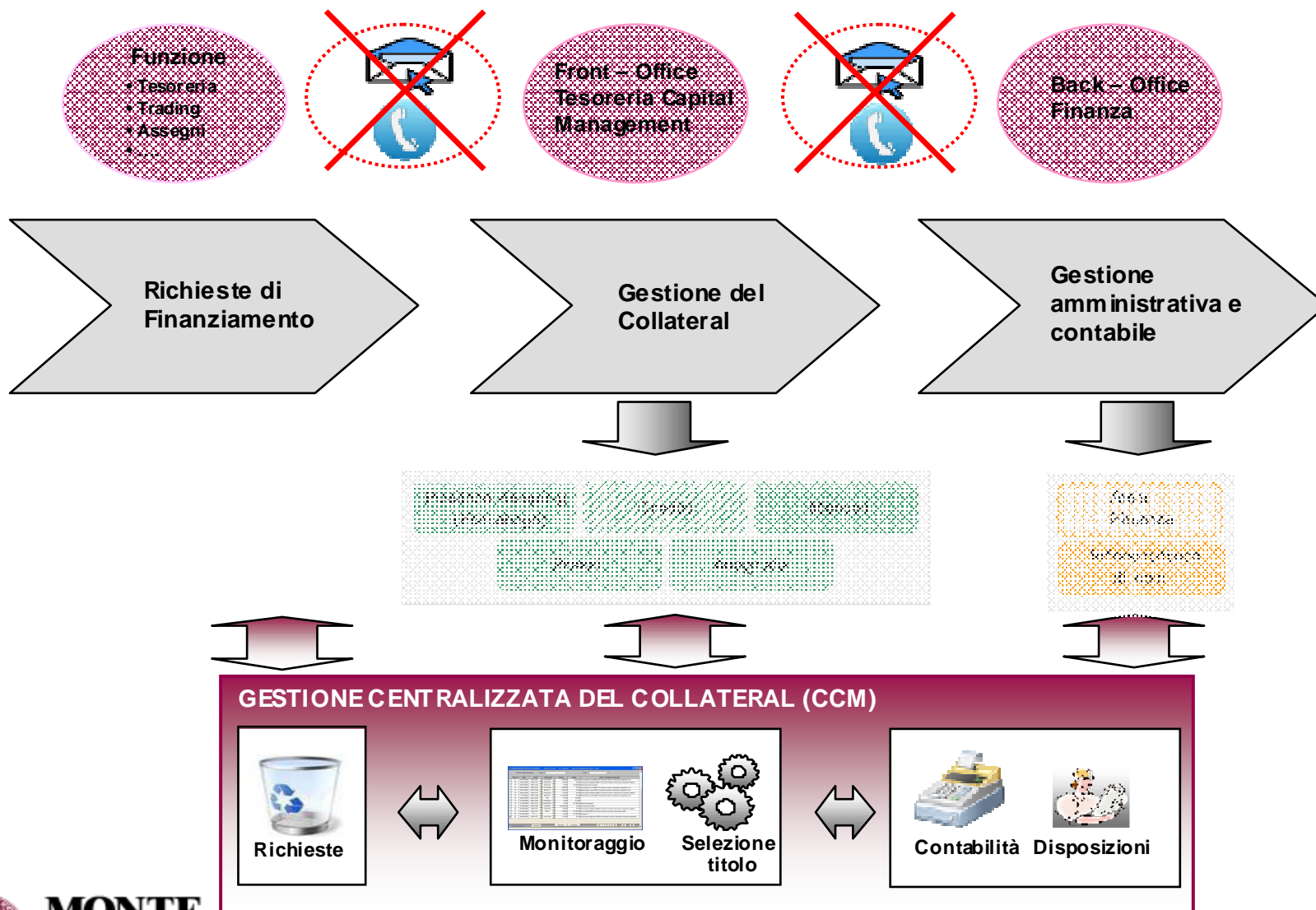
Nasce la necessità di avere uno strumento integrato in grado di accentrare la gestione del Collateral al fine di eliminare la frammentazione operativa (applicativa e logistica) e di supportare le analisi di business.

Agenda

- Il gruppo MPS
- Gestione del collateral – modello operativo (1)
- Le esigenze/i cambiamenti
- Gestione del collateral – modello operativo (2)**
- Gestione centralizzata del collateral
- Le prossime integrazioni



Gestione del collateral – modello operativo (2)



Agenda

- Il gruppo MPS
- Gestione del collateral – modello operativo (1)
- Le esigenze/i cambiamenti
- Gestione del collateral – modello operativo (2)
- Gestione centralizzata del collateral**
- Le prossime integrazioni



Gestione centralizzata del collateral

Monitoraggio e assegnazione

- Controlla il saldo (titoli e portafogli) e il loro andamento
- Identifica i titoli idonei
- Assegna le quantità calcolandone il controvalore
- Visione centralizzata della situazione delle diverse collateralizzazioni in corso

Disposizioni

- Verifica la capienza del titolo presso i depositari
- Gestisce lo spostamento degli assets
- Effettua i controlli specifici
- Verifica preventivamente il controllo di incapienza in funzione dell'esposizione
- Effettua lo svincolo dei titoli

Agenda

- ❑ Il gruppo MPS
- ❑ Gestione del collateral – modello operativo (1)
- ❑ Le esigenze / i cambiamenti
- ❑ Gestione del collateral – modello operativo (2)
- ❑ Gestione centralizzata del collateral
- ❑ Le prossime integrazioni



Le prossime integrazioni

- Classic Repo
- Triparty Repo
- Mid Repo
- Bilateral agreements
- CCBM2

GRAZIE PER L'ATTENZIONE