

Roma, 30 giugno 2024

**Identificazione dei paesi terzi rilevanti per l'Italia ai sensi della raccomandazione ESRB/2015/1 del Comitato europeo per il rischio sistemico (European Systemic Risk Board, ESRB)**

Nel dicembre 2015 il Comitato europeo per il rischio sistemico (European Systemic Risk Board, ESRB) ha emanato una Raccomandazione (ESRB/2015/1) per favorire l'uniformità delle decisioni dei singoli Stati membri relative al coefficiente della riserva di capitale anticiclica (*countercyclical capital buffer*, CCyB) da applicare alle esposizioni verso residenti in paesi che non fanno parte dello Spazio economico europeo (paesi terzi). A tal fine, la raccomandazione prevede che le autorità nazionali designate per le politiche macroprudenziali identifichino annualmente i paesi terzi verso cui i sistemi bancari nazionali hanno esposizioni rilevanti.

Quest'anno la Banca d'Italia, sulla base dei dati al 31 dicembre 2023, ha identificato come paesi terzi rilevanti per il sistema bancario italiano il Regno Unito, la Russia, gli Stati Uniti, la Svizzera e la Turchia. Questi paesi sono identificati dall'ESRB come rilevanti anche per l'intero Spazio economico europeo e sono quindi sottoposti all'attività di valutazione dei rischi da parte dell'ESRB stesso.

L'identificazione dei paesi terzi rilevanti è stata effettuata seguendo i criteri riportati nella Decisione ESRB/2015/3. La valutazione ha riguardato tutti i paesi terzi verso cui le banche italiane hanno esposizioni e ha preso in considerazione tre indicatori riferiti alle quote delle esposizioni originarie (ossia le esposizioni non ponderate per il rischio), alle quote delle esposizioni ponderate per il rischio e alle quote delle esposizioni in default verso ciascun paese sul totale delle corrispondenti esposizioni del sistema bancario italiano. Sono stati identificati come rilevanti quei paesi terzi per i quali almeno uno dei tre indicatori era pari o superiore all'1 per cento in ciascuno dei precedenti due trimestri e nella media dei precedenti otto.