

Roma, 28 giugno 2019

**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 dell'Unione europea (paesi terzi). La raccomandazione prevede che le autorità nazionali designate identifichino annualmente i paesi terzi verso cui i sistemi bancari nazionali hanno esposizioni rilevanti e adottino misure per il controllo dei rischi per la stabilità del proprio sistema derivanti da una crescita eccessiva del credito in tali paesi.

La Banca d'Italia, sulla base dei dati disponibili al 31 dicembre 2018, ha identificato come paesi terzi rilevanti per il sistema bancario italiano la Russia, gli Stati Uniti, la Svizzera e la Turchia. L'attività di sorveglianza diretta dei rischi dei quattro paesi è svolta dall'ESRB, che ha incluso quei paesi tra quelli rilevanti per l'intera Unione europea.

L'identificazione dei quattro paesi è stata effettuata seguendo i criteri riportati nella decisione ESRB/2015/3. La valutazione ha riguardato tutti i paesi 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), di quelle ponderate per il rischio e di quelle in default verso ciascun paese sul totale complessivo delle corrispondenti esposizioni del sistema bancario italiano. Sono stati identificati come rilevanti quei paesi per i quali almeno uno dei tre indicatori era pari o superiore all'1 per cento in ciascuno degli ultimi due trimestri e nella media degli ultimi otto.