

## FAQ - Segnalazioni EBA-ITS

### *Supervisory Benchmarking Portfolio Exercise*

(basi informative IMV, SBMR, SBCR, SBI9)

[1]

Q. Quali banche devono segnalare le basi informative sul *Supervisory Benchmarking Portfolio Exercise*?

A. Sono tenute a inviare le segnalazioni le banche che all'anno di riferimento dell'esercizio sono autorizzate all'utilizzo dei modelli interni per la quantificazione dei requisiti di capitale per il rischio di mercato (basi IMV, SBMR) e/o di credito (basi SBCR, SBI9), a norma del [Reg. UE 575/2013](#).

La segnalazione va inviata a livello consolidato dalle banche capogruppo e a livello individuale dalle singole componenti autorizzate all'uso dei modelli interni (cfr. documentazione EBA sul [Data Point Model](#)).

Le basi informative sono le seguenti:

<i>Nome base informativa</i>	<i>Descrizione base informativa</i>
IMV	SBPIMV, dati a livello consolidato e/o individuale relativi all'Initial Market Valuation
SBMR	SBP_RM, dati a livello consolidato e/o individuale relativi al rischio di mercato
SBCR	SBP_CR, dati a livello consolidato e/o individuale relativi al rischio di credito
SBI9	SBP_IFRS9, dati a livello consolidato e/o individuale relativi al benchmarking IFRS9

NOTA: nelle versioni del DPM antecedenti al 2.9, non vi era distinzione fra i moduli SBP relativi al rischio di credito e quelli relativi al rischio di mercato.

[2]

Q. Qual è il riferimento normativo che definisce la periodicità ed il contenuto della base informativa sul *Supervisory Benchmarking Portfolio*?

A. La fonte primaria è il [Reg. di esecuzione UE n. 2016/2070 e successive modifiche](#). Alcuni elementi delle rilevazioni variano annualmente: per questa ragione, l'EBA pubblica per ciascun esercizio degli aggiornamenti agli "Annex" che specificano in dettaglio il contenuto dell'intera rilevazione. La documentazione aggiornata è disponibile sul sito internet dell'EBA: [ITS package for benchmarking exercise](#).

[3]

Q. Quali sono le date di riferimento e le relative scadenze segnaletiche per il *Supervisory Benchmarking Exercise* del 2025?

A.

BASE INFORMATIVA	REPORTING FRAMEWORK	DATA DI RIFERIMENTO	SCADENZA SEGNALETICA
IMV	DPM 3.3	31 gennaio 2025*	28 febbraio 2025*
SBMR	DPM 4.1	30 giugno 2025*	18 luglio 2025*
SBCR	DPM 3.3	31 dicembre 2024	11 aprile 2025
SBI9	DPM 3.3	31 dicembre 2024	11 aprile 2025

\* Le date di riferimento "tecniche" (ovvero da riportare nel *filename* e all'interno della segnalazione) e le scadenze per le segnalazioni delle basi IMV e SBMR sono state posticipate, in accordo con quanto previsto dal [Final Draft ITS on Supervisory Benchmarking for the 2025 exercise](#) e relativo [Annex II, rep. Annex V \(pag. 3\)](#).

Come di consueto, le date di riferimento "effettive" sono riportate all'interno della documentazione appena richiamata.

---

Per ogni altro quesito si invita a scrivere a [Segnalazioni\\_EBA\\_ITS@bancaditalia.it](mailto:Segnalazioni_EBA_ITS@bancaditalia.it)