



BANCA D'ITALIA
EUROSISTEMA

F.A.Q. - Segnalazioni EBA-ITS

Supervisory Benchmarking Portfolio

(basi informative SBMI-SBMC; SBCI-SBCC; IMVC-IMVI)

Per quesiti sulle modalità tecnico-operative delle segnalazioni che non trovano risposta in queste FAQ si invita a scrivere a segnalazioni_EBA_ITS@bancaditalia.it

1. SBMI-SBMC-SBCI-SBCC

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

A. Sono tenute a inviare le segnalazioni le banche che al 31.12 dell'anno di riferimento sono autorizzate all'utilizzo dei modelli interni per la quantificazione dei requisiti di capitale per il rischio di credito (per le basi SBCI-SBCC) e/o di mercato (per le basi SBMI-SBMC), 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.

2. SBMI-SBMC-SBCI-SBCC-IMVC-IMVI

Q. Di quanti e quali moduli si compone la segnalazione sul Supervisory Benchmarking Portfolio?

A. La segnalazione sul SBP è composta da 3 moduli (i.e. tre file XBRL) per la segnalazione consolidata e 3 moduli analoghi per la segnalazione individuale. Tutti gli enti autorizzati all'uso dei modelli interni per il rischio di credito e/o di mercato devono inviare rispettivamente i moduli SBP_CR_Con/SBP_CR_Ind e/o SBP_MR_Con/SBP_MR_Ind (cfr. documentazione EBA sul [Data Point Model](#)). Il modulo "Initial Market Valuation" (SBPIMV_Con/SBPIMV_Ind) deve essere inviato dalle sole banche autorizzate all'utilizzo dei modelli interni per i rischi di mercato.

Le basi informative sono le seguenti:

<i>Nome base informativa</i>	<i>Descrizione base informativa</i>
SBCC	SBP_CR_Con, dati a livello consolidato relativi al rischio di credito
SBMC	SBP_RM_Con, dati a livello consolidato relativi al rischio di mercato
SBCI	SBP_CR_Ind, dati a livello individuale relativi al rischio di credito
SBMI	SBP_RM_Ind, dati a livello individuale relativi al rischio di mercato
IMVC	SBPIMV_Con, dati Initial Market Valuation a livello consolidato
IMVI	SBPIMV_Ind, dati Initial Market Valuation a livello individuale

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; la base SBPI includeva le attuali basi SBCI e SBMI, e la base SBPC includeva le attuali basi SBCC e SBMC.

3. IMVC-IMVI (modificata 05/10/2021)

Q. Quali sono le scadenze per la trasmissione dei due moduli?

A. Le date di riferimento e di scadenza d'invio del modulo "Initial Market Valuation" sono aggiornate di anno in anno dall'EBA (vedi FAQ successiva).

La scadenza di inoltro alla Banca d'Italia è il 15.10 per l'esercizio 2022.

4. SBMI-SBMC-SBCI-SBCC-IMVC-IMVI (modificata 05/10/2021)

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

A. La fonte primaria è il [Reg. di esecuzione UE n. 2016/2070](#). Alcuni elementi delle rilevazioni variano annualmente. A tal fine l'EBA pubblica per ciascun esercizio degli aggiornamenti agli "Annex" che specificano in dettaglio il contenuto dell'intera rilevazione; in tali documenti sono inoltre specificate le date di riferimento e di invio per il modulo "Initial Market Valuation". In particolare per le data contabili del

30.09.2021 (IMVI-IMVC), 31.12.2021 (SBCC-SBCI) e 31.01.2022 (SBMC-SBMI) la documentazione di riferimento è "[ITS Package for 2022 benchmarking exercise](#)".

5. SBMI-SBMC-SBCI-SBCC (modificata 05/10/2021)

Q. Quali sono le date di riferimento e scadenze d'inoltro per le basi informative SBCC-SBMC-SBCI-SBMI per il Supervisory Benchmarking Exercise del 2022?

A. Gli enti autorizzati a utilizzare i modelli interni per il calcolo dei requisiti in materia di rischio di mercato devono inviare i dati per le basi informative SBMC e SBMI entro il 4 marzo 2022 (data di riferimento 31 gennaio 2022).

Gli enti autorizzati a utilizzare i modelli interni per il calcolo dei requisiti in materia di rischio di credito devono inviare i dati per le basi informative SBCC e SBCI entro il 11 aprile 2022 (data di riferimento 31 dicembre 2021).