



F.A.Q. - Segnalazioni EBA-ITS

Supervisory Benchmarking Portfolio

(basi informative IMVC/IMVI; SBMR; SBCR; SBI9)

[1]

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

A. Sono tenute a inviare le segnalazioni le banche che al 31 dicembre dell'anno di riferimento sono autorizzate all'utilizzo dei modelli interni per la quantificazione dei requisiti di capitale per il rischio di mercato (basi IMVC/IMVI, 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>
IMVC	SBPIMV_Con, dati Initial Market Valuation a livello consolidato
IMVI	SBPIMV_Ind, dati Initial Market Valuation a livello individuale
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. 2022/951](#). 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. In particolare, la documentazione di riferimento aggiornata è [ITS package for 2023 benchmarking exercise](#).

[3]

Q. Quali sono le date di riferimento e le relative scadenze segnaletiche per il *Supervisory Benchmarking Exercise* del 2023?

A.

BASE INFORMATIVA	DATA DI RIFERIMENTO	SCADENZA SEGNALETICA
IMVC/IMVI	30 settembre 2022	14 ottobre 2022
SBMR	31 gennaio 2023	3 marzo 2023
SBCR	31 dicembre 2022	11 aprile 2023
SBI9	31 dicembre 2022	11 aprile 2023

Per ogni altro quesito si invita a scrivere a Segnalazioni_EBA_ITS@bancaditalia.it