

# Istruzioni operative per la segnalazione dei dati in materia di Liquidity Coverage Requirements

Si fa seguito alla comunicazione del 22 giugno u.s. n. 0814201/16 con la quale è stata illustrata la pianificazione per il passaggio alle nuove modalità di gestione, rappresentazione e trasmissione delle segnalazioni di vigilanza, secondo le indicazioni fornite dai regolamenti comunitari attuativi degli schemi segnaletici predisposti dalla European Banking Authority (EBA).

L'avvio delle nuove modalità segnaletiche avverrà in occasione della prima trasmissione da parte delle banche e dei gruppi bancari delle rinnovate segnalazioni consolidate e individuali in materia di Liquidity Coverage Requirement (LCR)<sup>1</sup>, prevista con riferimento alla data contabile del 30 settembre 2016<sup>2</sup>.

Le nuove segnalazioni dovranno essere trasmesse secondo il modello di rappresentazione dei dati Data Point Model (DPM) e la correlata tassonomia XBRL, seguendo le regole di compilazione previste dall'EBA (EBA XBRL Filing Rules)<sup>3</sup> e mediante l'utilizzo della piattaforma INFOSTAT. Le nuove survey saranno denominate "LCRC" per le segnalazioni consolidate e "LCRI" per le segnalazioni individuali.

Si richiama l'attenzione sulla circostanza che le nuove modalità non prevedono la possibilità di trasmettere flussi di "rettifica". Pertanto, nei casi in cui si renda necessario effettuare revisioni, dovrà essere prodotta una segnalazione completa in sostituzione della precedente.

Nel nuovo sistema le segnalazioni dovranno essere compilate utilizzando, nell'ambito del file XBRL, il codice LEI<sup>4</sup> dell'intermediario in luogo del codice ABI. Qualora il segnalante sia tenuto, nelle segnalazioni consolidate, anche all'invio dei dati relativi al c.d. "sottogruppo di liquidità nazionale", tale 'partizione' dovrà essere identificata dal codice MFI<sup>5</sup> attribuito all'intermediario.

---

<sup>1</sup>Regolamento di esecuzione (UE) 2016/322 della Commissione del 10 febbraio 2016 che modifica il Regolamento di esecuzione (UE) n. 680/2014 che stabilisce norme tecniche di attuazione per quando riguarda le segnalazioni degli enti a fini di vigilanza relativamente al requisito di copertura della liquidità, disponibile all'indirizzo <http://eur-lex.europa.eu/legal-content/IT/TXT/PDF/?uri=CELEX:32016R0322&from=EN>.

<sup>2</sup> Cfr. articolo 2 del citato Regolamento di esecuzione.

<sup>3</sup> Si rimanda al sito dell'EBA per i documenti di riferimento. ([www.eba.europa.eu/regulation-and-policy/supervisory-reporting/implementing-technical-standard-on-supervisory-reporting-data-point-model-](http://www.eba.europa.eu/regulation-and-policy/supervisory-reporting/implementing-technical-standard-on-supervisory-reporting-data-point-model-)).

<sup>4</sup>Il codice Legal Entity Identifier è composto da 20 cifre alfanumeriche ed è volto a individuare, su scala globale, ciascuna azienda operante sui mercati finanziari (si veda: [www.gleif.org/en/lei-data/access-and-use-lei-data](http://www.gleif.org/en/lei-data/access-and-use-lei-data)).

<sup>5</sup>MFI: Monetary and Financial Institution (per la lista cfr.: [www.ecb.europa.eu/stats/money/mfi/general/html/elegass.en.html](http://www.ecb.europa.eu/stats/money/mfi/general/html/elegass.en.html)).

Si precisa che, fino all'invio riferito alla data contabile del 31 agosto 2016, le banche e i gruppi bancari dovranno trasmettere le segnalazioni in materia del requisito di copertura della liquidità mediante le basi informative L1 e LY secondo le attuali modalità.

Le istruzioni segnaletiche di cui alla presente comunicazione non interessano le SIM e i gruppi di SIM, che continuano a produrre le segnalazioni in materia di liquidità, nel rispetto di quanto previsto dalle Comunicazioni della Banca d'Italia del 31 marzo 2014 e del 30 novembre 2015, con le consuete modalità.

### **Accesso all'applicazione INFOSTAT**

Le banche che, alla data della presente comunicazione, risultano già accreditate potranno continuare a utilizzare le medesime credenziali di accesso. Gli intermediari che segnalano ai fini della liquidità anche le informazioni relative al “sottogruppo di liquidità nazionale” dovranno utilizzare per tale ‘partizione’ un apposito codice partner assegnato dalla Banca d'Italia. Si invitano gli intermediari che rientrano in quest'ultima fattispecie a richiedere le necessarie istruzioni tecniche inviando una e-mail all'indirizzo [rdvi.helpdesk@bancaditalia.it](mailto:rdvi.helpdesk@bancaditalia.it).

Le banche che alla data della presente comunicazione non sono abilitate ad accedere all'applicazione INFOSTAT (ad esempio le banche neo-costituite che non hanno ancora inviato alcuna segnalazione) dovranno richiedere un PIN di accesso. La richiesta dovrà essere effettuata utilizzando il modulo reperibile sul sito web [www.bancaditalia.it](http://www.bancaditalia.it), nella sezione “Statistiche/Raccolta dati presso gli intermediari/Raccolta dati via internet”. Tale modulo, compilato in modo elettronico in ogni sua parte, deve essere inviato a mezzo posta elettronica all'indirizzo e-mail [rdvi.helpdesk@bancaditalia.it](mailto:rdvi.helpdesk@bancaditalia.it); una copia del modulo deve essere stampata, firmata e inviata via fax al numero 0647926713. Successivamente, questo Istituto provvederà a trasmettere il PIN di accesso, in busta sigillata, all'indirizzo e all'attenzione del destinatario indicato dagli intermediari nel modulo stesso.

Per tutte le questioni inerenti all'accesso a INFOSTAT e all'uso dei relativi servizi è possibile fare riferimento all'help desk del Servizio Rilevazioni ed elaborazioni statistiche (indirizzo e-mail: [rdvi.helpdesk@bancaditalia.it](mailto:rdvi.helpdesk@bancaditalia.it), tel.0647926459).

Eventuali richieste di chiarimenti tecnico-operativi andranno inoltrate alla casella funzionale [segnalazioni\\_eba\\_its@bancaditalia.it](mailto:segnalazioni_eba_its@bancaditalia.it). Le risposte saranno pubblicate in forma di FAQ sul sito web della Banca d'Italia, alla pagina “Statistiche/Raccolta-dati/Segnalazioni creditizie e finanziarie”, a beneficio di tutti i segnalanti. Per quesiti di carattere segnaletico-normativo si rinvia al sistema di “Questions and Answers” dell'EBA<sup>6</sup>.

---

<sup>6</sup> [www.eba.europa.eu/single-rule-book-qa](http://www.eba.europa.eu/single-rule-book-qa)