



Comunicato stampa

Informazioni: +41 61 280 8188
press@bis.org
www.bis.org

Rif. n.: 92/2013I

17 dicembre 2013

Il Comitato di Basilea pubblica il secondo rapporto sulla conformità regolamentare delle attività ponderate per il rischio nel portafoglio di negoziazione

Il Comitato di Basilea per la vigilanza bancaria pubblica oggi il [secondo rapporto sulla conformità regolamentare delle attività ponderate \(RWA\) per i rischi di mercato nel portafoglio di negoziazione](#). Esso si iscrive nel quadro del più ampio [programma del Comitato per la valutazione della conformità delle normative](#), inteso a garantire un'attuazione uniforme di Basilea 3.

Il rapporto di oggi fa seguito a un [primo studio](#) pubblicato dal Comitato nel gennaio scorso, ed estende l'analisi a posizioni di negoziazione più rappresentative e più complesse. In linea con quanto già riscontrato dal primo studio, il rapporto evidenzia la presenza di una variazione significativa nei risultati dei modelli interni per i rischi di mercato utilizzati nel computo del patrimonio di vigilanza. Esso indica inoltre che la variabilità tende ad aumentare per le posizioni di negoziazione più complesse.

L'analisi conferma che le diverse scelte di modellizzazione rappresentano la principale determinante della variazione fra le RWA per i rischi di mercato delle banche. Essa ribadisce la validità delle raccomandazioni di policy formulate nel precedente rapporto per ridurre il livello di variabilità delle RWA per i rischi di mercato, ossia:

- 1) migliorare l'informativa al pubblico e la raccolta dei dati a fini regolamentari per favorire la comprensione delle RWA per i rischi di mercato;
- 2) restringere la gamma di opzioni di modellizzazione a disposizione delle banche;
- 3) armonizzare ulteriormente le prassi di vigilanza per quanto riguarda l'autorizzazione all'uso dei modelli.



Nell'ottobre scorso il Comitato di Basilea ha pubblicato un [secondo documento consultivo sul riesame sostanziale del portafoglio di negoziazione](#), che prevede una serie di misure coerenti con le raccomandazioni sopraelencate e finalizzate a ridurre la variabilità delle RWA per i rischi di mercato. Il Comitato sta inoltre lavorando ad alcune proposte di miglioramento dei requisiti di informativa per le banche nell'ambito del terzo pilastro (disciplina di mercato). Tali proposte intendono accrescere la comparabilità delle informazioni rese note dalle banche e migliorare sostanzialmente la qualità, il contenuto e la coerenza dell'informativa sulle RWA per i rischi di mercato. Esse dovrebbero aiutare gli utilizzatori a comprendere meglio la restante variabilità delle RWA delle diverse banche.

Stefan Ingves, Presidente del Comitato di Basilea e Governatore della Sveriges Riksbank, ha affermato: "Il rapporto di oggi integra e consolida il precedente rapporto del Comitato sul portafoglio di negoziazione. Esso indica che all'aumentare della complessità dei portafogli può aumentare anche la variabilità. Questi risultati, insieme a quelli dell'[analisi del portafoglio bancario condotta dal Comitato](#), forniscono un importante contributo al lavoro che stiamo svolgendo per affrontare la questione della variabilità delle RWA".