

### **FAQs in materia di funding plan – 2023**

**Q1.** Nel foglio SECTION 1 del questionario sul funding (FP) si chiede di inserire per gli item da 4000 a 4233 (Long-term Debt Securities issuances) l'informazione sullo stock per il 2022 e quella sui flussi previsti per i tre anni successivi. Per quanto concerne il 2022, è corretto fattorizzare i flussi (in uscita e in entrata) oppure si conferma la necessità di fornire anche il dato di stock?

**A1.** Nella colonna D del foglio SECTION 1 (actual current position) va riportato lo stock di titoli di debito (voce maturing) che andranno in scadenza a partire dal 01/01/2023 e l'ammontare di tutte le nuove emissioni (voci issuances e retained) che si prevede di effettuare a partire dal 01/01/2023, per cui includendo anche le scadenze e le emissioni successive al 2025 (per le nuove emissioni si intendono quelle già pianificate dalla banca).

Nelle successive colonne E-H (planned position) va riportato l'ammontare previsto dei titoli di debito che andranno in scadenza (voce maturing) nonché il flusso di nuove emissioni da effettuarsi (voci issuances e retained) nel solo semestre/anno di riferimento.

Per i soli item da 4000 a 4233, per costruzione, la colonna D non potrà essere inferiore alla somma delle successive colonne E-H.

**Q2.** Nel foglio SECTION 2 del questionario sul funding (FP) si chiede di riportare un dettaglio del canale di distribuzione (ad es. mercati regolamentati, collocamento privato, altro), tipo di investitori (ad es. retail, investitori istituzionali, altro), pricing e duration dei flussi previsti per gli anni 2023-25 per gli item da 4000 a 4233 (Long-term Debt Securities issuances). Che importo bisogna indicare, in particolare per il pricing e la duration, qualora nello stesso periodo sia prevista più di una operazione?

**A2.** Nel caso la banca abbia previsto più operazioni nello stesso semestre/anno, nella cella 'amount' va riportato l'ammontare complessivo delle scadenze e delle nuove emissioni, ripartite per canale di distribuzione e tipologia di investitori. Nelle celle 'pricing' e 'duration', invece, va riportata la media ponderata rispettivamente per il pricing e la duration delle nuove emissioni, ripartite per canale di distribuzione e tipologia di investitori.