

ALLEGATO IV

DATI STATISTICI AGGREGATI	
Elenco dei modelli	
PARTE 1	Dati individuali per autorità competente
PARTE 2	Dati sul rischio di mercato
PARTE 3	Dati sulle misure di vigilanza e le sanzioni amministrative
PARTE 4	Dati sulle esenzioni

Osservazioni generali sulla compilazione dei modelli di cui all'allegato IV

- 1) Quando pubblicano le informazioni sui criteri generali e sulle metodologie, le autorità competenti non comunicano misure di vigilanza dirette a imprese di investimento specifiche, sia che riguardino un'unica impresa di investimento sia che riguardino un gruppo di imprese di investimento.
- 2) Le celle numeriche contengono soltanto numeri, senza alcun riferimento alle valute nazionali. La valuta utilizzata è l'euro e gli Stati membri non appartenenti alla zona euro convertono le loro valute nazionali in euro utilizzando i tassi di cambio della BCE (alla data di riferimento comune, ossia l'ultimo giorno dell'anno oggetto del riesame), con un decimale in caso di comunicazione degli importi in milioni.
- 3) Gli importi monetari segnalati sono espressi in milioni di euro (di seguito "MEUR").
- 4) Le percentuali sono comunicate con due decimali.
- 5) Se un dato non è comunicato, è indicato il motivo della mancata comunicazione utilizzando la nomenclatura dell'ABE, ossia "n.d." (non disponibile) o "C" (riservato).
- 6) I dati sono comunicati su base aggregata senza indicazione delle singole imprese di investimento.
- 7) I dati sono compilati solo per le imprese di investimento soggette alla direttiva (UE) 2019/2034. Le imprese di investimento che non sono soggette al regime instaurato dalla direttiva (UE) 2019/2034 sono escluse dall'esercizio di raccolta dei dati.

PARTE 1
Dati individuali per autorità competente (anno 2021)

		Riferimento al modello di segnalazione	Dati		
Numero e dimensioni delle imprese di investimento					
010	Numero di imprese di investimento		32		
020	Attività complessive di tutte le imprese di investimento nello Stato membro (in MEUR) ⁽¹⁾		1.191,6		
Numero e dimensioni delle imprese di investimento di paesi terzi²					
030	Paesi terzi	Numero di succursali ⁽³⁾	0		
040		Numero di filiazioni ⁽⁴⁾	5		
Composizione dei fondi propri in relazione ai requisiti di fondi propri			Dati, in milioni di euro	Dati, in percentuale dei requisiti di fondi propri totali ⁽⁶⁾	
050	Capitale primario di classe 1 totale ⁽⁵⁾	I 01.00 riga 0030	299,2	396,03%	
060	Capitale aggiuntivo di classe 1 totale ⁽⁵⁾	I 01.00 riga 0300	4,8	6,41%	
070	Capitale di classe 2 totale ⁽⁵⁾	I 01.00 riga 0420	1,0	1,31%	
080	Fondi propri totali ⁽⁶⁾	I 01.00 riga 0010	305,0	403,75%	
Requisiti di fondi propri totali per tipo			Dati, in milioni di euro	Dati, in percentuale dei requisiti di fondi propri totali ⁽⁶⁾	
090	Dati sui requisiti di fondi propri	Requisito relativo alle spese fisse generali ⁽⁷⁾	I 02.00 riga 0030	52,0	68,85%
100		Requisito patrimoniale minimo permanente ⁽⁸⁾	I 02.00 riga 0020	29,3	38,83%
110		Requisito relativo ai fattori K ⁽⁹⁾	I 02.00 riga 0040	51,7	68,48%
120		di cui rischio per il cliente (RtC) ⁽¹⁰⁾	I 04.00 riga 0020	24,1	31,93%
130		di cui rischio per il mercato (RtM) ⁽¹¹⁾	I 04.00 riga 0090	18,3	24,26%
140		di cui rischio per l'impresa (RtF) ⁽¹²⁾	I 04.00 riga 0120	9,3	12,30%

(1) Il valore delle attività complessive è pari alla somma dei valori delle attività di tutte le imprese di investimento in uno Stato membro, calcolata in base ai principi contabili applicabili, escluse le attività gestite.

(2) I paesi del SEE non sono inclusi.

(3) Numero di succursali come definite all'articolo 3, paragrafo 1, punto 3, della direttiva (UE) 2019/2034. Più sedi di attività costituite nello stesso paese da un'impresa di investimento con l'amministrazione centrale in un paese terzo dovrebbero essere considerate come una succursale unica.

(4) Numero di filiazioni come definite all'articolo 3, paragrafo 1, punto 29, della direttiva (UE) 2019/2034. Ogni filiazione di una filiazione è considerata come filiazione dell'impresa madre che è alla testa di tali imprese.

(5) Capitale ai sensi dell'articolo 9, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2019/2033.

(6) Requisiti di fondi propri ai sensi dell'articolo 11 del regolamento (UE) 2019/2033.

(7) Spese fisse generali ai sensi dell'articolo 11, paragrafo 1, lettera a), del regolamento (UE) 2019/2033.

(8) Requisito patrimoniale minimo permanente ai sensi dell'articolo 11, paragrafo 1, lettera b), del regolamento (UE) 2019/2033.

(9) Requisito relativo ai fattori K ai sensi dell'articolo 11, paragrafo 1, lettera c), del regolamento (UE) 2019/2033.

(10) Requisiti di fondi propri associati al rischio per il cliente ai sensi dell'articolo 15, paragrafo 1, lettera a), del regolamento (UE) 2019/2033. Indicare il coefficiente di capitale totale nella colonna "Dati, in percentuale dei requisiti di fondi propri totali %".

(11) Requisiti di fondi propri associati al rischio per il mercato ai sensi dell'articolo 15, paragrafo 1, lettera b), del regolamento (UE) 2019/2033.

(12) Requisiti di fondi propri associati al rischio per l'impresa ai sensi dell'articolo 15, paragrafo 1, lettera c), del regolamento (UE) 2019/2033.

Allegato IV

PARTE 2
Dati sul rischio di mercato ⁽¹⁾ (anno 2021)

Dati sul rischio per il mercato		Metodo	Riferimento al modello di segnalazione	Dati	
010	Requisiti di fondi propri relativi al rischio per il mercato				
020	Numero di imprese di investimento che utilizzano ciascun metodo in relazione al numero totale di imprese di investimento ⁽²⁾	Metodo del fattore K "rischio di posizione netta"	IF 04.00 riga 0100	11	
030		di cui metodo standardizzato		11	
040		di cui metodo standardizzato alternativo		0	
050		di cui metodo alternativo dei modelli interni		0	
060		di cui ciascuno dei metodi del fattore K "rischio di posizione netta" ⁽³⁾		0	
070		Metodo del fattore K "margine di compensazione fornito"	IF 04.00 riga 0110	0	
080		Entrambi i fattori K "margine di compensazione fornito" e "rischio di posizione netta"		0	
090		Disaggregazione per metodo			Dati, in milioni di euro
100	Requisiti di fondi propri totali per ciascun metodo ⁽²⁾	Metodo del fattore K "rischio di posizione netta"	IF 04.00 riga 0100	18,3	24,26%
110		di cui metodo standardizzato		18,3	24,26%
120		di cui metodo standardizzato alternativo		0	
130		di cui metodo alternativo dei modelli interni ⁽³⁾		0	
140		di cui ciascuno dei metodi del fattore K "rischio di posizione netta" ⁽³⁾		0	
150		Metodo del fattore K "margine di compensazione fornito"	IF 04.00 riga 0110	0	
160		Entrambi i fattori K "margine di compensazione fornito" e "rischio di posizione netta"		0	

(1) Il modello contiene informazioni su tutte le imprese di investimento e non solo su quelle con posizioni collegate al fattore K "rischio di posizione netta".

(2) Alcune imprese di investimento possono utilizzare più di un metodo, per cui la somma degli elementi delle righe da 020 a 060 può essere diversa dal numero totale delle imprese di investimento che calcolano il fattore K "rischio di posizione netta".

(3) Quando le imprese di investimento utilizzano più di un fattore K "rischio di posizione netta": metodo standardizzato, metodo standardizzato alternativo, metodo alternativo dei modelli interni.

(4) Requisiti di fondi propri ai sensi dell'articolo 9 del regolamento (UE) 2019/2033.

Allegato IV

PARTE 3
Dati sulle misure di vigilanza e le sanzioni amministrative ⁽¹⁾ (anno 2021)

Misure di vigilanza			Dati
010	Misure di vigilanza adottate conformemente all'articolo 38, lettera a)	Numero totale delle misure di vigilanza adottate conformemente all'articolo 39, paragrafo 2, della direttiva (UE) 2019/2034	C
020		detenere fondi propri superiori ai requisiti patrimoniali minimi [articolo 39, paragrafo 2, lettera a)]	C
030		rafforzare i meccanismi di governance e la gestione del capitale interno e delle attività liquide [articolo 39, paragrafo 2, lettera b)]	C
040		presentare un piano mirante a ripristinare la conformità ai requisiti in materia di vigilanza [articolo 39, paragrafo 2, lettera c)]	C
050		applicare una politica di accantonamenti specifica o un trattamento specifico delle voci dell'attivo [articolo 39, paragrafo 2, lettera d)]	C
060		restringere o limitare le attività [articolo 39, paragrafo 2, lettera e)]	C
070		ridurre il rischio connesso alle attività, ai prodotti e ai sistemi, comprese le attività esternalizzate [articolo 39, paragrafo 2, lettera f)]	C
080		limitare la componente variabile della remunerazione [articolo 39, paragrafo 2, lettera g)]	C
090		utilizzare l'utile netto per rafforzare i fondi propri [articolo 39, paragrafo 2, lettera h)]	C
100		limitare o vietare le distribuzioni o il pagamento di interessi [articolo 39, paragrafo 2, lettera i)]	C
110		imporre obblighi di segnalazione supplementari o più frequenti [articolo 39, paragrafo 2, lettera j)]	C
120		imporre requisiti specifici in materia di liquidità [articolo 39, paragrafo 2, lettera k)]	C
130		richiedere informazioni aggiuntive [articolo 39, paragrafo 2, lettera l)]	C
140		ridurre i rischi posti alla sicurezza dei sistemi informativi e di rete delle imprese di investimento [articolo 39, paragrafo 2, lettera m)]	C
150		Numero e natura delle altre misure di vigilanza adottate (non elencate all'articolo 39, paragrafo 2, della direttiva (UE) 2019/2034)	C
160	Misure di vigilanza adottate conformemente all'articolo 38, lettera b), e ad altre disposizioni della direttiva (UE) 2019/2034 o del regolamento (UE) 2019/2033	Numero totale delle misure di vigilanza adottate conformemente all'articolo 39, paragrafo 2, della direttiva (UE) 2019/2034	C
170		detenere fondi propri superiori ai requisiti patrimoniali minimi [articolo 39, paragrafo 2, lettera a)]	C
180		rafforzare i meccanismi di governance e la gestione del capitale interno e delle attività liquide [articolo 39, paragrafo 2, lettera b)]	C
190		presentare un piano mirante a ripristinare la conformità ai requisiti in materia di vigilanza [articolo 39, paragrafo 2, lettera c)]	C
200		applicare una politica di accantonamenti specifica o un trattamento specifico delle voci dell'attivo [articolo 39, paragrafo 2, lettera d)]	C
210		restringere o limitare le attività [articolo 39, paragrafo 2, lettera e)]	C
220		ridurre il rischio connesso alle attività, ai prodotti e ai sistemi, comprese le attività esternalizzate [articolo 39, paragrafo 2, lettera f)]	C
230		limitare la componente variabile della remunerazione [articolo 39, paragrafo 2, lettera g)]	C
240		utilizzare l'utile netto per rafforzare i fondi propri [articolo 39, paragrafo 2, lettera h)]	C
250		limitare o vietare le distribuzioni o il pagamento di interessi [articolo 39, paragrafo 2, lettera i)]	C
260		imporre obblighi di segnalazione supplementari o più frequenti [articolo 39, paragrafo 2, lettera j)]	C
270		imporre requisiti specifici in materia di liquidità [articolo 39, paragrafo 2, lettera k)]	C
280		richiedere informazioni aggiuntive [articolo 39, paragrafo 2, lettera l)]	C
290		ridurre i rischi posti alla sicurezza dei sistemi informativi e di rete delle imprese di investimento [articolo 39, paragrafo 2, lettera m)]	C
300		Numero e natura delle altre misure di vigilanza adottate (non elencate all'articolo 39, paragrafo 2, della direttiva (UE) 2019/2034)	C

Sanzioni amministrative ⁽²⁾			Dati
010	Sanzioni amministrative (per altre violazioni dei requisiti imposti dalla direttiva (UE) 2019/2034 o dal regolamento (UE) 2019/2033)	Numero totale delle sanzioni amministrative di cui all'articolo 18, paragrafo 2, della direttiva (UE) 2019/2034 applicate:	NA
020		dichiarazione pubblica che identifica la persona fisica o giuridica responsabile e la natura della violazione [articolo 18, paragrafo 2, lettera a)]	NA
030		ordine rivolto alla persona fisica o giuridica responsabile di porre termine alla condotta in questione e di astenersi dal ripeterla [articolo 18, paragrafo 2, lettera b)]	NA
040		divieto temporaneo dell'esercizio di funzioni in imprese di investimento a carico delle persone fisiche [articolo 18, paragrafo 2, lettera c)]	NA
050		sanzioni amministrative pecuniarie inflitte alla persona fisica/giuridica [articolo 18, paragrafo 2, lettere da d) a f)]	NA
060		Numero e natura di altre sanzioni amministrative applicate (non elencate all'articolo 18, paragrafo 2, della direttiva (UE) 2019/2034)	NA

Le autorità competenti non comunicano le azioni o le decisioni in materia di vigilanza dirette ad imprese di investimento specifiche. Quando pubblicano le informazioni sui criteri generali e sulle metodologie, le autorità competenti non comunicano misure di vigilanza dirette a imprese di investimento specifiche, sia che riguardino un'unica impresa di investimento sia che riguardino un gruppo di imprese di investimento.

(1) Le informazioni sono segnalate in base alla data della decisione. A causa di differenze tra le normative nazionali e le prassi e i metodi di vigilanza delle autorità competenti, i numeri riportati in questa tabella potrebbero non consentire un raffronto significativo fra giurisdizioni. Ogni conclusione che non tenga in debita considerazione queste differenze può essere fuorviante.

(2) Le sanzioni amministrative inflitte dalle autorità competenti. Le autorità competenti segnalano tutte le sanzioni amministrative per le quali non è prevista alcuna possibilità di ricorso nella loro giurisdizione entro la data di riferimento della comunicazione. Le autorità competenti degli Stati membri in cui è consentito pubblicare sanzioni amministrative passibili di ricorso segnalano anche tali sanzioni amministrative, tranne nei casi in cui il ricorso per l'annullamento sia stato accolto.

Allegato IV

PARTE 4 Dati sulle esenzioni ⁽¹⁾ (anno 2021)
--

	Esenzione concessa alle imprese di investimento	Numero totale di esenzioni concesse
010	Esenzione dall'applicazione su base individuale dei requisiti prudenziali di cui all'articolo 5 in relazione alle parti due, tre, quattro, sei e sette del regolamento (UE) 2019/2033 (articolo 6, paragrafo 1 (deroghe per le filiazioni) ⁽²⁾)	1
020	Esenzione dall'applicazione su base individuale dei requisiti prudenziali di cui all'articolo 5 in relazione alla parte sei del regolamento (UE) 2019/2033 (articolo 6, paragrafo 2 (deroghe per le filiazioni) ⁽²⁾)	0
030	Esenzione dall'applicazione su base individuale dei requisiti prudenziali di cui all'articolo 5 in relazione alla parte cinque del regolamento (UE) 2019/2033 (articolo 6, paragrafo 3 (deroghe all'applicazione dei requisiti di liquidità per le filiazioni))	0
040	Esenzione dall'applicazione su base consolidata dei requisiti prudenziali in relazione alla parte cinque del regolamento (UE) 2019/2033 (articolo 7, paragrafo 4 (consolidamento prudenziale))	
050	Numero totale di autorizzazioni concesse	0
060	Importo totale dei fondi propri consolidati detenuti in filiazioni stabilite in paesi terzi (in MEUR)	
070	Percentuale dei fondi propri consolidati totali detenuti in filiazioni stabilite in paesi terzi (%)	
080	Percentuale dei requisiti di fondi propri consolidati assegnati a filiazioni stabilite in paesi terzi (%)	

(1) Le autorità competenti segnalano informazioni sulle prassi di esenzione basate sul numero totale di esenzioni, concesse dall'autorità competente, che sono ancora effettive o in vigore. Le informazioni da segnalare sono limitate ai soggetti che hanno ottenuto un'esenzione. Se le informazioni non sono disponibili, ossia non rientrano nelle segnalazioni periodiche, vanno indicate come "n.d.".

(2) Il numero delle imprese di investimento che hanno ottenuto l'esenzione è utilizzato come base per il computo delle esenzioni.