

Il presente documento è conforme all'originale contenuto negli archivi della Banca d'Italia

Firmato digitalmente da



BANCA D'ITALIA
EUROSISTEMA

ISTRUZIONI PER LA COMPILAZIONE
DELLE SEGNALAZIONI
PRUDENZIALI PER LE BANCHE E LE
SOCIETA' DI INTERMEDIAZIONE
MOBILIARE

INDICE

Disposizioni di carattere generale

Parte I – Segnalazioni prudenziali (COREP)

<i>Sezione: 1 –</i>	FONDI PROPRI SU BASE INDIVIDUALE	1.1.1
<i>Sottosezione: 1 –</i>	Schema della segnalazione relativa ai fondi propri su base individuale	1.1.5
<i>Sottosezione: 2 –</i>	Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione	1.2.1
<i>Sezione: 2 –</i>	FONDI PROPRI SU BASE CONSOLIDATA.....	2.1.1
<i>Sottosezione: 1 –</i>	Schema della segnalazione relativa ai fondi propri su base consolidata	2.1.3
<i>Sottosezione: 2 –</i>	Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione	2.2.1
<i>Sezione: 3 –</i>	RISCHIO DI CREDITO E RISCHIO DI CONTROPARTE SU BASE INDIVIDUALE	3.1.1
<i>Sottosezione: 1 –</i>	Schema della segnalazione relativa al rischio di credito e di controparte su base individuale	3.1.3
<i>Sottosezione: 2 –</i>	Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione	3.2.1
<i>Sezione: 4 –</i>	RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE SU BASE CONSOLIDATA	4.1.1
<i>Sottosezione: 1 –</i>	Schema della segnalazione relativa al rischio di credito e di controparte su base consolidata	4.1.3
<i>Sottosezione: 2 –</i>	Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione	4.2.1
<i>Sezione: 5 –</i>	GRANDI ESPOSIZIONI SU BASE INDIVIDUALE	5.1.1

<i>Sottosezione: 1</i> –	Schema della segnalazione relativa alle grandi esposizioni su base individuale	5.1.3
<i>Sottosezione: 2</i> –	Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione	5.2.1
<i>Sezione: 6</i> –	GRANDI ESPOSIZIONI SU BASE CONSOLIDATA.....	6.1.1
<i>Sottosezione: 1</i> –	Schema della segnalazione relativa alle grandi esposizioni su base consolidata	6.1.3
<i>Sottosezione: 2</i> –	Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione	6.2.1
<i>Sezione: 7</i> –	REQUISITI PATRIMONIALI INDIVIDUALI SUI RISCHI DI MERCATO.....	7.1.1
<i>Sottosezione: 1</i> –	Schema della segnalazione relativa ai requisiti patrimoniali individuali sui rischi di mercato.....	7.1.3
<i>Sottosezione: 2</i> –	Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione	7.2.1
<i>Sezione: 8</i> –	REQUISITI PATRIMONIALI CONSOLIDATI SUI RISCHI DI MERCATO.....	8.1.1
<i>Sottosezione: 1</i> –	Schema della segnalazione relativa ai requisiti patrimoniali consolidati sui rischi di mercato.....	8.1.3
<i>Sottosezione: 2</i> –	Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione	8.2.1
<i>Sezione: 9</i> –	REQUISITO PATRIMONIALE INDIVIDUALE PER IL RISCHIO OPERATIVO	9.1.1
<i>Sottosezione: 1</i> –	Schema della segnalazione relativa al requisito patrimoniale individuale per il rischio operativo	9.1.3
<i>Sottosezione: 2</i> –	Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione	9.2.1
<i>Sezione: 10</i> –	REQUISITO PATRIMONIALE CONSOLIDATO PER IL RISCHIO OPERATIVO.....	10.1.1
<i>Sottosezione: 1</i> –	Schema della segnalazione relativa al requisito patrimoniale consolidato per il rischio operativo	10.1.3
<i>Sottosezione: 2</i> –	Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione	10.2.1

<i>Sezione:</i> 11 – POSIZIONE PATRIMONIALE INDIVIDUALE	11.1.1
<i>Sottosezione:</i> 1 – Schema di segnalazione della posizione patrimoniale individuale ...	11.1.3
<i>Sottosezione:</i> 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione	11.2.1
<i>Sezione:</i> 12 – POSIZIONE PATRIMONIALE CONSOLIDATA	12.1.1
<i>Sottosezione:</i> 1 – Schema di segnalazione della posizione patrimoniale consolidata ...	12.1.3
<i>Sottosezione:</i> 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione	12.2.1
<i>Sezione:</i> 13 – LIQUIDITA’ SU BASE INDIVIDUALE	13.1.1
<i>Sottosezione:</i> 1 – Schema della segnalazione relativa al rischio di liquidità su base individuale	13.1.3
<i>Sottosezione:</i> 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione	13.2.1
<i>Sezione:</i> 14 – LIQUIDITA’ SU BASE CONSOLIDATA	14.1.1
<i>Sottosezione:</i> 1 – Schema della segnalazione relativa al rischio di liquidità su base consolidata	14.1.3
<i>Sottosezione:</i> 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione	14.2.1
<i>Sezione:</i> 15 – LEVA FINANZIARIA SU BASE INDIVIDUALE	15.1.1
<i>Sottosezione:</i> 1 – Schema della segnalazione relativa alla leva finanziaria su base individuale	15.1.3
<i>Sottosezione:</i> 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione	15.2.1
<i>Sezione:</i> 16 – LEVA FINANZIARIA SU BASE CONSOLIDATA	16.1.1
<i>Sottosezione:</i> 1 – Schema della segnalazione relativa alla leva finanziaria su base consolidata	16.1.3
<i>Sottosezione:</i> 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione	16.2.1

<i>Sezione: 17</i> – ATTIVITA' VINCOLATE SU BASE INDIVIDUALE	17.1.1
<i>Sottosezione: 1</i> – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate su base individuale	17.1.3
<i>Sottosezione: 2</i> – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione	17.2.1
<i>Sezione: 18</i> – ATTIVITA' VINCOLATE SU BASE CONSOLIDATA	18.1.1
<i>Sottosezione: 1</i> – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate su base consolidata	18.1.3
<i>Sottosezione: 2</i> – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione	18.2.1

Parte II – Segnalazioni prudenziali ex T.U.B. articolo 51 e T.U.F. articolo 8

<i>Sezione: 1</i> – SOGGETTI COLLEGATI SU BASE INDIVIDUALE	1.1.1
<i>Sottosezione: 1</i> – Istruzioni di carattere generale	1.1.5
<i>Sottosezione: 2</i> – Schema di segnalazione dei soggetti collegati su base individuale	1.2.1
<i>Sottosezione: 3</i> – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione	1.3.1
<i>Sezione: 2</i> – SOGGETTI COLLEGATI SU BASE CONSOLIDATA	2.1.1
<i>Sottosezione: 1</i> – Istruzioni di carattere generale	2.1.3
<i>Sottosezione: 2</i> – Schema di segnalazione dei soggetti collegati su base consolidata	2.2.1
<i>Sottosezione: 3</i> – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione	2.3.1
<i>Sezione: 3</i> – SIM ESCLUSE DALL'AMBITO DI APPLICAZIONE DEL PACCHETTO "CRR/CRDIV"	3.1.1
<i>Sottosezione: 1</i> – Istruzioni di carattere generale	3.1.2
<i>Sottosezione: 2</i> – Schema di segnalazione delle SIM escluse dall'applicazione del pacchetto "CRR/CRDIV"	3.2.1
<i>Sottosezione: 3</i> – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione	3.3.1

VIGILANZA BANCARIA E FINANZIARIA

ISTRUZIONI PER LA COMPILAZIONE DELLE SEGNALAZIONI PRUDENZIALI PER LE BANCHE E LE SOCIETA' DI INTERMEDIAZIONE MOBILIARE

Circolare n. 286 del 17 dicembre 2013

Aggiornamenti :

1° Aggiornamento del 1 aprile 2014:

Parte I. Sez. I – Sottosez. I: pagg. da 1.1.12 a 1.1.18; Sez. I – Sottosez. II: pag. 1.2.3, da 1.2.23 a 1.2.32; Sez. II – Sottosez. I: pag. 2.1.4, 2.1.6, 2.1.7, pagg. da 2.1.9 a 2.1.16; Sez. II – Sottosez. II: pag. 2.2.3, 2.2.4; Sez. III – Sottosez. I: pag. 3.1.5, 3.1.7, 3.1.9, pagg. da 3.1.11 a 3.1.13, pagg. da 3.1.15 a 3.1.19, pag. 3.1.25, 3.1.28, pagg. da 3.1.30 a 3.1.34, pag. 3.1.37, 3.1.41, 3.1.42, 3.1.44; Sez. III – Sottosez. II, pag. 3.2.34, 3.2.38; Sez. IV – Sottosez. I: pag. 4.1.5, 4.1.9, pagg. da 4.1.11 a 4.1.13, pag. 4.1.15, 4.1.16, 4.1.18, 4.1.20, 4.1.23, 4.1.25, 4.1.28, pagg. da 4.1.30 a 4.1.35, pag. 4.1.38, 4.1.42, 4.1.43, 4.1.45; Sez. V – Sottosez. I: pag. 5.1.9; Sez. V – Sottosez. II: pag. 5.2.9; Sez. VI – Sottosez. I: pag. 6.1.11, 6.1.14; Sez. VII – Sottosez. I: pag. 7.1.5, 7.1.6, 7.1.8, pagg. da 7.1.10 a 7.1.12, pag. 7.1.16; Sez. VII – Sottosez. II: pag. 7.2.18; Sez. VIII – Sottosez. I: pag. 8.1.5, 8.1.6, 8.1.8, pagg. da 8.1.10 a 8.1.12, pag. 8.1.16; Sez. XI – Sottosez. I: pagg. 11.1.7, 11.1.8; Sez. XI – Sottosez. II: pag. 11.2.10; Sez. XII – Sottosez. I: pagg. da 12.1.6 a 12.1.11; Sez. XII – Sottosez. II: pag. 12.2.8, 12.2.9; Sez. XIII – Sottosez. I, pag. 13.1.7, 13.1.10, 13.1.12, 13.1.15, pagg. da 13.1.17 a 13.1.24, pag. 13.1.26, 13.1.29, pagg. da 13.1.32 a 13.1.34; Sez. XIII – Sottosez. II: pag. 13.2.15, 13.2.16, 13.2.20, 13.2.21, 13.2.23, pagg. da 13.2.30 a 13.2.32, pag. 13.2.40; Sez. XIV – Sottosez. I: pagg. da 14.1.5 a 14.1.35; Sez. XIV – Sottosez. II: pag. 14.2.3; Sez. XV – Sottosez. I: pag. 15.1.7, 15.1.10; Sez. XV – Sottosez. II: pag. 15.2.10, 15.2.11; Sez. XVI – Sottosez. I: 16.1.7, 16.1.10, 16.1.20.

Parte II. Sez. I, Sottosez. I, pag. 1.1.9; Sez. II, Sottosez. I, pagg. 2.1.7 a 2.1.9; Sez. III, Sottosez. I: pagg. da 3.1.1 a 3.1.8; Sez. III, Sottosez. II: pagg. da 3.2.1 a 3.2.2; Sez. III, Sottosez. III: pagg. da 3.3.1 a 3.3.3

2° Aggiornamento del 24 giugno 2014:

Parte I. Sez. III – Sottosez. I: pag. 3.1.5, da pagg. 3.1.8 a 3.1.12, pag. 3.1.14, pag. 3.1.16, pag. 3.1.17, pag. 3.1.20, pag. 3.1.23, pag. 3.1.25, pag. 3.1.27, da pagg. 3.1.29 a 3.1.37, pag. 3.1.45, pag. 3.1.46; Sez. III – Sottosez. II: pag. 3.2.5, pag. 3.2.6, pag. 3.2.11, pag. 3.2.12, pag. 3.2.32, pag. 3.2.40, pag. 3.2.41; Sez. IV – Sottosez. I: pag. 4.1.5, da pagg. 4.1.8 a pag. 4.1.15, pag. 4.1.17, pag. 4.1.18, pag. 4.1.21, pag. 4.1.24,

pag. 4.1.26, pag. 4.1.28, da pagg. 4.1.30 a 4.1.36, pag. 4.1.38, pag. 4.1.46; Sez. VII – Sottosez. I: da pagg. 7.1.6 a 7.1.12, pag. 7.1.16; Sez. VII – Sottosez. II: pag. 7.2.20; Sez. VIII – Sottosez. I, pag. 8.1.6, 8.1.7, da pagg. 8.1.9 a 8.1.11, pag. 8.1.16; Sez. XIII – Sottosez. I: pag. 13.1.16, pag. 13.1.19, pag. 13.1.32, pag. 13.1.33; Sez. XIII – Sottosez. II: pag. 13.2.21; Sez. XIV – Sottosez. I: pag. 14.1.17, pag. 14.1.20, pag. 14.1.21, pag. 14.1.35

3° Aggiornamento del 13 gennaio 2015:

Parte I. Sez. XVII e XVIII.

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

Sezione:

17 – ATTIVITA' VINCOLATE SU BASE INDIVIDUALE

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

Sottosezione:

**1 – SCHEMA DELLA SEGNALAZIONE RELATIVA ALLE ATTIVITA’
VINCOLATE SU BASE INDIVIDUALE**

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

ATTIVITÀ FINANZIARIE	Tipo Importo
Vincolate	
1. Finanziamenti a vista	21
- Verso altri enti appartenenti al gruppo	21
2. Titoli di capitale	21/101
- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo	21
3. Titoli di debito	21/101
- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo	21
3.1 Obbligazioni bancarie garantite	21/101
- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo	21
3.2 ABS	21/101
- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo	21
3.3 Emessi da Amministrazioni Pubbliche	21/101
3.4 Emessi da Intermediari Finanziari	21/101
- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo	21
3.5 Emessi da Società non Finanziarie	21/101
- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo	21
4. Finanziamenti diversi da quelli a vista	21
- Verso altri enti appartenenti al gruppo	21

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

4.1 Prestiti Ipotecari	21
- Verso altri enti appartenenti al gruppo	21
5. Altre attività	21
- Verso altri enti appartenenti al gruppo	21
Non Vincolate	
6. Finanziamenti a vista	21
- Verso altri enti appartenenti al gruppo	21
7. Titoli di capitale	21/101
- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo	21
8. Titoli di debito	21/101
- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo	21
8.1 Obbligazioni bancarie garantite	21/101
- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo	21
8.2 ABS	21/101
- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo	21
8.3 Emessi da Amministrazioni Pubbliche	21/101
8.4 Emessi da Intermediari Finanziari	21/101
- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo	21
8.5 Emessi da Società non Finanziaria	21/101
- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo	21

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

9. Finanziamenti diversi da quelli a vista	21
- Verso altri enti appartenenti al gruppo	21
9.1 Prestiti Ipotecari	21
- Verso altri enti appartenenti al gruppo	21
10. Altre attività	21
- Verso altri enti appartenenti al gruppo	21

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

ATTIVITÀ FINANZIARIE - AMMISSIBILI BCE	Tipo importo
Vincolate	
1. Finanziamenti a vista	21
2. Titoli di capitale	21/101
3. Titoli di debito	21/101
3.1 Obbligazioni bancarie garantite	21/101
3.2 ABS	21/101
3.3 Emessi da Amministrazioni Pubbliche	21/101
3.4 Emessi da Intermediari Finanziari	21/101
3.5 Emessi da Società non Finanziaria	21/101
4. Finanziamenti diversi da quelli a vista	21
4.1 Prestiti Ipotecari	21
5. Altre attività	21
Non Vincolate	
6. Finanziamenti a vista	21
7. Titoli di capitale	21/101
8. Titoli di debito	21/101
8.1 Obbligazioni bancarie garantite	21/101
8.2 ABS	21/101
8.3 Emessi da Amministrazioni Pubbliche	21/101

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

8.4 Emessi da Intermediari Finanziari	21/101
8.5 Emessi da Società non Finanziaria	21/101
9. Finanziamenti diversi da quelli a vista	21
9.1 Prestiti Ipotecari	21
10. Altre attività	21

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

GARANZIE RICEVUTE	Tipo importo
Vincolate	
1. Finanziamenti a vista	101
- Verso altri enti appartenenti al gruppo	101
2. Titoli di capitale	101
- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo	101
3. Titoli di debito	101
- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo	101
3.1 Obbligazioni bancarie garantite	101
- Emesse da altri enti appartenenti al gruppo	101
3.2 ABS	101
- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo	101
3.3 Emessi da amministrazioni pubbliche	101
3.4 Emessi da intermediari finanziari	101
- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo	101
3.5 Emessi da società non finanziaria	101
- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo	101
4. Finanziamenti diversi da quelli a vista	101
- Verso altri enti appartenenti al gruppo	101
5. Altre garanzie ricevute	101

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

- Da altri enti appartenenti al gruppo	101
6. Propri titoli di debito emessi diversi dalle Obbligazioni bancarie garantite e dagli ABS	101
Non vincolate	
7. Finanziamenti a vista	101
- Verso altri enti appartenenti al gruppo	101
8. Titoli di capitale	101
- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo	101
9. Titoli di debito	101
- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo	101
9.1 Obbligazioni bancarie garantite	101
- Emesse da altri enti appartenenti al gruppo	101
9.2 ABS	101
- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo	101
9.3 Emessi da amministrazioni pubbliche	101
9.4 Emessi da intermediari finanziari	101
- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo	101
9.5 Emessi da società non finanziaria	101
- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo	101
10. Finanziamenti diversi da quelli a vista	101
- Verso altri enti appartenenti al gruppo	101

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

11. Altre garanzie ricevute	101
- da altri enti appartenenti al gruppo	101
12. Propri titoli di debito emessi diversi dalle Obbligazioni bancarie garantite e dagli ABS	101

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

GARANZIE RICEVUTE – AMMISSIBILI BCE**Tipo importo****Vincolate**

1. Finanziamenti a vista	101
2. Titoli di capitale	101
3. Titoli di debito	101
3.1 Obbligazioni bancarie garantite	101
3.2 ABS	101
3.3 Emessi da amministrazioni pubbliche	101
3.4 Emessi da intermediari finanziari	101
3.5 Emessi da società non finanziaria	101
4. Finanziamenti diversi da quelli a vista	101
5. Altre garanzie ricevute	101
6. Propri titoli di debito emessi diversi dalle Obbligazioni bancarie garantite e dagli ABS	101

Non vincolate

7. Finanziamenti a vista	101
8. Titoli di capitale	101
9. Titoli di debito	101
9.1 Obbligazioni bancarie garantite	101
9.2 ABS	101
9.3 Emessi da amministrazioni pubbliche	101

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

9.4 Emessi da intermediari finanziari	101
9.5 Emessi da società non finanziaria	101
10. Finanziamenti diversi da quelli a vista	101
11. Altre garanzie ricevute	101
12. Propri titoli di debito emessi diversi dalle Obbligazioni bancarie garantite e dagli ABS	101

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

GARANZIE RICEVUTE E PROPRI TITOLI DI DEBITO EMESSI DIVERSI DALLE OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE E DAGLI ABS – NON VINCOLATE E NON DISPONIBILI ALL’IMPEGNO	Tipo importo
1. Finanziamenti a vista	24
2. Titoli di capitale	24
3. Titoli di debito	24
3.1 Obbligazioni bancarie garantite	24
3.2 ABS	24
3.3 Emessi da amministrazioni pubbliche	24
3.4 Emessi da intermediari finanziari	24
3.5 Emessi da società non finanziaria	24
4. Finanziamenti diversi da quelli a vista	24
5. Altre garanzie ricevute	24
6. Propri titoli di debito emessi diversi dalle Obbligazioni bancarie garantite e dagli ABS	24

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

	Tipo importo
ATTIVITÀ SOTTOSTANTI A PROPRIE OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE EMESSE E NON VINCOLATE	

1. Obbligazioni bancarie garantite emesse	21
---	----

2. Titoli ABS emessi	21
----------------------	----

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

	Tipo importo
TOTALE DEI TITOLI DI DEBITO EMESSI E NON VINCOLATI – DISPONIBILI ALL’IMPEGNO	
1. Obbligazioni bancarie garantite emesse	101
2. Titoli ABS emessi	101
2.1 Senior	101
2.2 Mezzanine	101
2.3 Junior	101
TITOLI DI DEBITO EMESSI E NON VINCOLATI – DISPONIBILI ALL’IMPEGNO – AMMISSIBILI BCE	
3. Obbligazioni bancarie garantite emesse	101
4. Titoli ABS emessi	101
4.1 Senior	101
4.2 Mezzanine	101
4.3 Junior	101

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

TOTALE DEI TITOLI DI DEBITO EMESSI, NON VINCOLATI E NON DISPONIBILI ALL'IMPEGNO	Tipo importo
--	---------------------

1. Obbligazioni bancarie garantite emesse	24
2. Titoli ABS emessi	24
2.1 Senior	24
2.2 Mezzanine	24
2.3 Junior	24

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

PASSIVITÀ FINANZIARIE, PASSIVITÀ POTENZIALI E TITOLI IN PRESTITO ASSOCIATI AD ATTIVITÀ VINCOLATE	Tipo importo
---	---------------------

1. Derivati	21
- Con altri enti appartenenti al gruppo	21
1.1 Derivati <i>over the counter</i>	21
- Con altri enti appartenenti al gruppo	21
2. Depositi	-
2.1 Pronti contro termine:	21
- con altri enti appartenenti a gruppi	21
2.1.1 Pronti contro termine con banche centrali	21
2.2 Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine	21
- di altri enti appartenenti a gruppi	21
2.2.1 Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine con banche centrali	21
3. Titoli di debito emessi	21
- detenuti da altri enti appartenenti a gruppi	21
3.1 Obbligazioni bancarie garantite	21
- detenute da altri enti appartenenti a gruppi	21
3.2 Titoli ABS	21
- detenuti da altri enti appartenenti a gruppi	21
4. Impegni a erogare fondi ricevuti	24
- da altri enti appartenenti a gruppi	24

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

5. Garanzie finanziarie ricevute	24
- da altri enti appartenenti a gruppi	24
6. Titoli presi a prestito senza garanzia in contanti	101
- da altri enti appartenenti a gruppi	101
7. Altre	21/24/101
- da altri enti appartenenti a gruppi	21/24/101

AVVERTENZE

Nella voce 7 la variabile “Tipo importo” può assumere soltanto uno dei valori indicati per ciascun fenomeno oggetto di segnalazione (passività finanziaria) in base alla tipologia.

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

ATTIVITÀ, GARANZIE RICEVUTE E PROPRI TITOLI DI DEBITO EMESSI VINCOLATI DIVERSI DA OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE E TITOLI ABS	Tipo importo
---	---------------------

1. Derivati	21/101
1.1 Derivati <i>over the counter</i>	21/101
2. Depositi	-
2.1 Pronti contro termine:	21/101
2.1.1 Pronti contro termine con banche centrali	21
2.2 Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine:	21/101
2.2.1 Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine con banche centrali	21
3. Titoli di debito emessi	21
3.1 Obbligazioni bancarie garantite	21
3.2 Titoli ABS	21
4. Impegni a erogare fondi ricevuti	21
5. Garanzie finanziarie ricevute	101
6. Titoli presi a prestito senza garanzia in contanti	101
7. Altre	21/101

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

ATTIVITÀ, GARANZIE RICEVUTE E PROPRI TITOLI DI DEBITO EMESSI DIVERSI DA OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE E ABS VINCOLATI¹ Tipo importo

Garanzie Ricevute - Riutilizzate

1. Derivati	101
1.1 Derivati <i>over the counter</i>	101
2. Depositi: pronti contro termine	101
3. Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine	101

Propri titoli di debito emessi

4. Derivati	101
4.1 Derivati <i>over the counter</i>	101
5. Depositi: pronti contro termine	101
5.1 Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine	101

LEGENDA

TIPO IMPORTO

21	Valore contabile
24	Valore nominale
101	Fair value

¹ Nella presente voce sono compresi i propri titoli di debito emessi vincolati diversi da Obbligazioni bancarie garantite e titoli ABS.

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

PASSIVITÀ FINANZIARIE RIPARTITE PER VITA RESIDUA	Vita residua dell'operazione	Tipo importo
1. Attività vincolate	X	21/101
2. Garanzie ricevute riutilizzate (con riferimento all'operazione originaria)	X	101
3. Garanzie ricevute riutilizzate (con riferimento all'operazione di riutilizzo)	X	101

LEGENDA**TIPO IMPORTO**

21	Valore contabile
101	Fair value

VITA RESIDUA**DELL'OPERAZIONE**

10	a vista e a revoca
46	overnight
25	oltre 1 giorno a 7 giorni
41	da oltre 7 giorni a 15 giorni
42	da oltre 15 giorni a 1 mese
40	da oltre 1 mese a 3 mesi
50	da oltre 3 mesi a 6 mesi
60	da oltre 6 mesi a 12 mesi
90	da oltre 1 anno a 2 anni
160	da oltre 2 anni a 3 anni
139	da oltre 3 anni a 5 anni
132	da oltre 5 anni a 10 anni
133	da oltre 10 anni

Avvertenze

Nella sottovoce 1 la variabile “Tipo importo” deve assumere alternativamente i valori: “valore contabile - 21” o “fair value - 101” in base alla tipologia di attività.

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

PASSIVITÀ ASSOCIATE ALLE ATTIVITÀ POTENZIALI VINCOLATE	Valuta	Tipo importo
1. Derivati	X	21/102/103
1.1 Derivati <i>over the counter</i>	X	21/102/103
2. Depositi	-	-
2.1 Pronti contro termine	X	21/102/103
2.1.1 Pronti contro termine con banche centrali	X	21/102/103
2.2 Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine	X	21/102/103
2.2.1 Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine con banche centrali	X	102/103
3. Titoli di debito emessi	X	21/102/103
3.1 Obbligazioni bancarie garantite	X	21/102/103
3.2. Titoli ABS	X	21/102/103
4. Altre fonti di attività vincolate	X	24/101/102/103

LEGENDA**TIPO IMPORTO**

21	Valore contabile
24	Valore nominale
101	Fair value
102	Valore addizionale scenario 1
103	Valore addizionale scenario 2

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

VALUTA

Tutti i valori previsti, incluso 777

Avvertenze

L'informazione "Tipo importo: valore addizionale scenario 2" deve essere fornito solo in corrispondenza dell'informazione "Valuta: diversa da 777"

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

PASSIVITÀ RELATIVE ALLE OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE	Codice identificativo cover pool	Compliance art. 129	Classe di attività primaria del cover pool	Nome CRA	Rating	Tipo Importo
1. Ammontare alla data di segnalazione	X	X	X	-	-	21/24/105
2. T + 6 mesi	X	-	-	-	-	24
3. T + 12 mesi	X	-	-	-	-	24
4. T + 2 anni	X	-	-	-	-	24
5. T + 5 anni	X	-	-	-	-	24
6. T + 10 anni	X	-	-	-	-	24
7. Cover pool: posizioni in derivati con valore di mercato negativo	X	-	-	-	-	105
8. Agenzia di rating 1	X	-	-	X	X	-
9. Agenzia di rating 2	X	-	-	X	X	-
10. Agenzia di rating 3	X	-	-	X	X	-

Avvertenze

Nella voce 1, le variabili “Compliance art. 129” e “Classe di attività primaria del cover pool” vanno fornite esclusivamente in corrispondenza della variabile “Tipo importo=24)

E’ prevista l’indicazione per ciascun gruppo (variabile aperta: “codice identificativo cover pool”)

La variabile “rating” non va fornita in corrispondenza di “Nome: non disponibile”.

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

Le voci 8, 9 e 10 devono essere compilate riportando convenzionalmente il valore “1” in corrispondenza del campo importo.

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

COVER POOL	Codice identificativo cover pool	Tipo importo cover pool
1. Ammontare alla data di segnalazione	X	21/24/104/105
2. T + 6 mesi	X	24
3. T + 12 mesi	X	24
4. T + 2 anni	X	24
5. T + 5 anni	X	24
6. T + 10 anni	X	24
7. Cover pool: posizioni in derivati con valore di mercato positivo	X	105

Avvertenze

E' prevista l'indicazione per ciascun gruppo (variabile aperta: "codice identificativo cover pool")

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

COVER POOL: AMMONTARE IN ECCESSO RISPETTO AI REQUISITI MINIMI DI COPERTURA	Codice identificativo cover pool	Nome CRA	Tipo importo
1. Secondo il pertinente regime regolamentare delle Obbligazioni bancarie garantite	X	-	24/104/105
2. Secondo la metodologia delle agenzie di rating per assicurare l'attuale rating esterno delle Obbligazioni bancarie garantite – Agenzia di rating 1	X	X	24/104/105
3. Secondo la metodologia delle agenzie di rating per assicurare l'attuale rating esterno delle Obbligazioni bancarie garantite – Agenzia di rating 2	X	X	24/104/105
4. Secondo la metodologia delle agenzie di rating per assicurare l'attuale rating esterno delle Obbligazioni bancarie garantite – Agenzia di rating 3	X	X	24/104/105

LEGENDA

CODICE IDENTIFICATIVO COVER POOL

COMPLIANCE ART. 129

1 Si
2 No

CLASSE DI ATTIVITÀ PRIMARIA DEL COVER POOL

NOME CRA

RATING

TIPO IMPORTO

21 Valore contabile
24 Valore nominale
104 Valore asset specific

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

105 Market value

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

PASSIVITÀ FINANZIARIE ASSOCIATE ALLE ATTIVITÀ VINCOLATE - RIPARTITE PER FORMA TECNICA	Forma tecnica dell'attività	Tipo importo
1. Finanziamenti da banca centrale	X	21
2. Derivati su mercati regolamentati	X	21
3. Derivati <i>over the counter</i>	X	21
4. Pronti contro termine passivi	X	21
5. Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine passivi	X	21
6. Obbligazioni bancarie garantite emesse	X	21
7. Titoli ABS emessi	X	21
8. Titoli di debito emessi diversi dalle Obbligazioni bancarie garantite e dagli ABS	X	21
9. Altre passività finanziarie	X	21/24/101

LEGENDA**FORMA TECNICA
DELL'ATTIVITÀ**

- 260 finanziamenti a vista;
- 204 titoli di capitale;
- 203 titoli di debito: totale;
- 99 titoli di debito: obbligazioni bancarie garantite ;
- 261 titoli di debito: obbligazioni bancarie garantite emesse da altre società
appartenenti al gruppo;
- 262 titoli di debito: ABS
- 263 titoli di debito: ABS emessi da altre società appartenenti al gruppo;

– 17.1.29 –

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

- 264 titoli di debito: emessi da amministrazioni pubbliche;
- 265 titoli di debito: emessi da intermediari finanziari;
- 266 titoli di debito: emessi da società non finanziarie;
- 267 finanziamenti diversi da quelli a vista: verso banche centrali e amministrazioni pubbliche;
- 268 finanziamenti diversi da quelli a vista: verso intermediari finanziari;
- 269 finanziamenti diversi da quelli a vista: verso controparti non finanziarie;
- 270 finanziamenti diversi da quelli a vista verso controparti non finanziarie: mutui ipotecari;
- 271 finanziamenti diversi da quelli a vista: verso famiglie;
- 272 finanziamenti diversi da quelli a vista verso famiglie: mutui ipotecari;
- 273 altre attività;
- 274 altre garanzie ricevute;
- 275 propri titoli di debito emessi diversi da Obbligazioni bancarie garantite o ABS

Tipo importo

- 21 Valore contabile
- 24 Valore nominale
- 101 Fair value
- 104 Valore asset specific
- 105 Present value o market value

AVVERTENZE

Nella sottovoce 9 la variabile “Tipo importo” deve assumere alternativamente i valori: “valore contabile - 21” , “fair value - 101” o “valore nominale - 24” in base alla tipologia di passività finanziaria

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

ATTIVITÀ VINCOLATE RIPARTITE PER FORMA TECNICA	Forma tecnica dell'attività	Forma tecnica della passività associata	Tipo importo
1. Finanziamenti a vista	-	X	21
2. Titoli di capitale	-	X	21
3. Titoli di debito	-	X	21
3.1 Obbligazioni bancarie garantite	-	X	21
3.2 Obbligazioni bancarie garantite emesse da altre società appartenenti al gruppo	-	X	21
3.3 ABS	-	X	21
3.4 ABS emessi da altre società appartenenti al gruppo	-	X	21
3.5 Emessi da amministrazioni pubbliche	-	X	21
3.6 Emessi da intermediari finanziari	-	X	21
3.7 Emessi da società non finanziarie	-	X	21
4. Finanziamenti diversi da quelli a vista verso banche centrali e amministrazioni pubbliche	-	X	21
5. Finanziamenti diversi da quelli a vista: verso controparti finanziarie	-	X	21
6. Finanziamenti diversi da quelli a vista: verso controparti non finanziarie	-	X	21
6.1 Mutui ipotecari	-	X	21
7. Finanziamenti diversi da quelli a vista: famiglie	-	X	21
7.1 Mutui ipotecari	-	X	21

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

8. Altre attività'	-	X	21
9. Totale delle attività vincolate – Ammissibili BCE	X	-	21

LEGENDA**FORMA TECNICA
DELLA PASSIVITÀ ASSOCIATA**

- 276 finanziamenti da banca centrale
- 277 derivati su mercati regolamentati
- 278 derivati over the counter
- 279 pronti contro termine passivi
- 280 depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine passivi
- 281 obbligazioni bancarie garantite emesse
- 282 titoli abs emessi
- 283 titoli di debito emessi diversi da obbligazioni bancarie garantite e titoli abs
- 284 altre passività finanziarie

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

ATTIVITÀ NON VINCOLATE	Forma tecnica dell'attività	Tipo importo
1. Attività non vincolate	X	21
2. Attività non vincolate - Ammissibili BCE	X	21

LEGENDA**FORMA TECNICA DELL'ATTIVITÀ**

- 260 finanziamenti a vista;
- 204 titoli di capitale;
- 203 titoli di debito: totale;
- 99 titoli di debito: obbligazioni bancarie garantite ;
- 261 titoli di debito: obbligazioni bancarie garantite emesse da altre società' appartenenti al gruppo;
- 262 titoli di debito: ABS
- 263 titoli di debito: ABS emessi da altre società appartenenti al gruppo;
- 264 titoli di debito: emessi da amministrazioni pubbliche;
- 265 titoli di debito: emessi da intermediari finanziari;
- 266 titoli di debito: emessi da società non finanziarie;
- 267 finanziamenti diversi da quelli a vista: verso banche centrali e amministrazioni pubbliche;
- 268 finanziamenti diversi da quelli a vista: verso intermediari finanziari;
- 269 finanziamenti diversi da quelli a vista: verso controparti non finanziarie;
- 270 finanziamenti diversi da quelli a vista verso controparti non finanziarie: mutui ipotecari;
- 271 finanziamenti diversi da quelli a vista: verso famiglie;
- 272 finanziamenti diversi da quelli a vista verso famiglie: mutui ipotecari;
- 273 altre attività;

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

PASSIVITÀ FINANZIARIE ASSOCIATE ALLE GARANZIE RICEVUTE VINCOLATE - RIPARTITE PER FORMA TECNICA	Forma tecnica attività	Tipo importo
1. Finanziamenti da banca centrale	X	21
2. Derivati su mercati regolamentati	X	21
3. Derivati <i>over the counter</i>	X	21
4. Pronti contro termine passivi	X	21
5. Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine passivi	X	21
6. Obbligazioni bancarie garantite emesse	X	21
7. Titoli ABS emessi	X	21
8. Titoli di debito emessi diversi dalle Obbligazioni bancarie garantite e dagli ABS	X	21
9. Altre passività finanziarie	X	21/24/101

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

GARANZIE RICEVUTE VINCOLATE - RIPARTITE PER FORMA TECNICA	Forma tecnica dell'attività	Forma tecnica della passività associata	Tipo importo
1. Finanziamenti a vista	-	X	101
2. Titoli di capitale	-	X	101
3. Titoli di debito	-	X	101
3.1 Obbligazioni bancarie garantite	-	X	101
3.2 Obbligazioni bancarie garantite emesse da altre società appartenenti al gruppo	-	X	101
3.3 ABS	-	X	101
3.4 ABS emessi da altre società appartenenti al gruppo	-	X	101
3.5 Emessi da amministrazioni pubbliche	-	X	101
3.6 Emessi da intermediari finanziari	-	X	101
3.7 Emessi da società non finanziarie	-	X	101
4. Finanziamenti diversi da quelli a vista verso banche centrali e amministrazioni pubbliche	-	X	101
5. Finanziamenti diversi da quelli a vista: verso controparti finanziarie	-	X	101
6. Finanziamenti diversi da quelli a vista: verso controparti non finanziarie	-	X	101
6.1 Mutui ipotecari	-	X	101
7. Finanziamenti diversi da quelli a vista: famiglie	-	X	101
7.1 Mutui ipotecari	-	X	101
8. Altre garanzie ricevute	-	X	101

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

9. Propri titoli di debito emessi diversi dai Obbligazioni bancarie garantite e dagli ABS	-	X	101
10. Totale delle garanzie ricevute vincolate – Ammissibili BCE	X	-	101

LEGENDA

FORMA TECNICA DELLA PASSIVITÀ ASSOCIATA

276	finanziamenti da banca centrale
277	derivati su mercati regolamentati
278	derivati over the counter
279	pronti contro termine passivi
280	depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine passivi
281	obbligazioni bancarie garantite emesse
282	titoli abs emessi
283	titoli di debito emessi diversi da obbligazioni bancarie garantite e titoli abs
284	altre passività finanziarie

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

GARANZIE RICEVUTE NON VINCOLATE	Forma tecnica attività	Tipo importo
1. Garanzie ricevute non vincolate	X	101
2. Totale delle garanzie ricevute non vincolate - Ammissibili BCE	X	101

LEGENDA

FORMA TECNICA DELL'ATTIVITÀ

- 260 finanziamenti a vista;
- 204 titoli di capitale;
- 203 titoli di debito: totale;
- 99 titoli di debito: obbligazioni bancarie garantite ;
- 261 titoli di debito: obbligazioni bancarie garantite emesse da altre società' appartenenti al gruppo;
- 262 titoli di debito: ABS
- 263 titoli di debito: ABS emessi da altre società appartenenti al gruppo;
- 264 titoli di debito: emessi da amministrazioni pubbliche;
- 265 titoli di debito: emessi da intermediari finanziari;
- 266 titoli di debito: emessi da società non finanziarie;
- 267 finanziamenti diversi da quelli a vista: verso banche centrali e amministrazioni pubbliche;
- 268 finanziamenti diversi da quelli a vista: verso intermediari finanziari;
- 269 finanziamenti diversi da quelli a vista: verso controparti non finanziarie;
- 270 finanziamenti diversi da quelli a vista verso controparti non finanziarie: mutui ipotecari;
- 271 finanziamenti diversi da quelli a vista: verso famiglie;
- 272 finanziamenti diversi da quelli a vista verso famiglie: mutui ipotecari;
- 274 altre garanzie ricevute;
- 275 propri titoli di debito emessi diversi da Obbligazioni bancarie garantite o ABS

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

Sottosezione:

2 – ISTRUZIONI PER LA COMPILAZIONE DELLO SCHEMA DI RILEVAZIONE

PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2. ISTRUZIONI PER LA COMPILAZIONE DELLO SCHEMA DI RILEVAZIONE – ATTIVITA' VINCOLATE

2.1 Premessa

La segnalazione sulle attività vincolate si compone delle seguenti aree informative: “Attività vincolate e passività associate: aspetti generali”, “Aspetti inerenti alla vita residua delle operazioni”, “Aspetti riguardanti le attività vincolate in situazioni di stress”, “Informazioni sulle emissioni di Obbligazioni bancarie garantite” e “Informazioni aggiuntive sulle attività vincolate e sulle passività associate”.

Nell’area “Attività vincolate e passività associate: aspetti generali”, sono incluse informazioni attinenti a: i) attività vincolate e non vincolate (¹); ii) garanzie ricevute vincolate e non vincolate (²); iii) obbligazioni bancarie garantite e titoli ABS emessi e non vincolati; iv) passività associate agli elementi dell’attivo vincolati (in bilancio e fuori bilancio).

Nell’area “Aspetti inerenti alla vita residua delle operazioni” sono incluse informazioni attinenti alle attività e alle garanzie ricevute e riutilizzate, ripartite in base alla scadenza delle passività.

Nell’area “Aspetti riguardanti le attività vincolate in situazioni di stress” sono incluse informazioni attinenti al fabbisogno aggiuntivo di garanzie da impegnare in caso di situazioni di stress (³).

Nell’area “Informazioni sulle emissioni di Obbligazioni bancarie garantite” sono contenute informazioni riguardanti le obbligazioni garantite emesse dall’ente segnalante che risultano essere conformi alla Direttiva 2009/65/CE (UCITS).

Nell’area “Informazioni aggiuntive sulle attività vincolate e sulle passività associate” sono contenute informazioni relative alle attività vincolate, alle garanzie ricevute e alle passività associate. Tale area raccoglie - con un maggior livello di granularità - le medesime informazioni riportate nell’area “Attività vincolate e passività associate: aspetti generali”.

Nei seguenti paragrafi sono illustrate prima le voci e, successivamente, gli attributi informativi richiesti.

¹ In bilancio.

² Fuori bilancio.

³ Deprezzamento del fair value delle attività vincolate o di una valuta significativa.

Parte I	
Sezione:	17 – Attività vincolate su base individuale
Sottosezione:	2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.2 “ATTIVITÀ VINCOLATE E PASSIVITÀ ASSOCIATE: ASPETTI GENERALI”

2.2.1 ATTIVITÀ FINANZIARIE

Con riferimento alla presente voce, tra gli attributi informativi illustrati al paragrafo 3.1. trovano applicazione i seguenti: Tipo importo

Vincolate

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.3, colonna 010, 020 e 040

2.2.1.1 Finanziamenti a vista

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 020

- **Verso altri enti appartenenti al gruppo**

2.2.1.2 Titoli di capitale

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 030

- **Emessi da altri enti appartenenti al gruppo**

2.2.1.3 Titoli di debito

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 040

- **Emessi da altri enti appartenenti al gruppo**

2.2.1.3.1 Obbligazioni bancarie garantite

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 050

- **Emessi da altri enti appartenenti al gruppo**

2.2.1.3.2 ABS

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 060

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

- **Emessi da altri enti appartenenti al gruppo**

2.2.1.3.3 Emessi da Amministrazioni Pubbliche

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 070

2.2.1.3.4 Emessi da Intermediari Finanziari

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 080

- **Emessi da altri enti appartenenti al gruppo**

2.2.1.3.5 Emessi da Società non Finanziarie

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 090

- **Emessi da altri enti appartenenti al gruppo**

2.2.1.4 Finanziamenti diversi da quelli a vista

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 100

- **Verso altri enti appartenenti al gruppo**

2.2.1.4.2 Prestiti Ipotecari

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 110

- **Verso altri enti appartenenti al gruppo**

2.2.1.5 Altre attività

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 120

- **Verso altri enti appartenenti al gruppo**

Non vincolate

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.3, colonna 060, 070 e 090

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.2.1.6 Finanziamenti a vista

- Verso altri enti appartenenti al gruppo

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 020

2.2.1.7 Titoli di capitale

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 030

- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo

2.2.1.8 Titoli di debito

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 040

- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo

2.2.1.8.1 Obbligazioni bancarie garantite

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 050

- Emesse da altri enti appartenenti al gruppo

2.2.1.8.2 ABS

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 060

- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo

2.2.1.8.3 Emessi da Amministrazioni Pubbliche

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 070

- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo

2.2.1.8.4 Emessi da Intermediari Finanziari

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 080

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo

2.2.1.8.5 Emessi da Società non Finanziarie

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 090

- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo

2.2.1.9 Finanziamenti diversi da quelli a vista

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 100

- Verso altri enti appartenenti al gruppo

2.2.1.9.1 Prestiti Ipotecari

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 110

- Verso altri enti appartenenti al gruppo

2.2.1.10 Altre attività

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 120

- Verso altri enti appartenenti al gruppo

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.2.2 ATTIVITÀ FINANZIARIE - AMMISSIBILI BCE

Vincolate

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.3, colonna 030 e 050

2.2.2.1 Finanziamenti a vista

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 020

2.2.2.2 Titoli di capitale

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 030

2.2.2.3 Titoli di debito

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 040

2.2.2.3.1 Obbligazioni bancarie garantite

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 050

2.2.2.3.2 ABS

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 060

2.2.2.3.3 Emessi da Amministrazioni Pubbliche

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 070

2.2.2.3.4 Emessi da Intermediari Finanziari

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 080

2.2.2.3.5 Emessi da Società non Finanziarie

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 090

2.2.2.4 Finanziamenti diversi da quelli a vista

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 100

2.2.2.4.1 Prestiti Ipotecari

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 110

2.2.2.5 Altre attività

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 120

Non vincolate

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.3, colonna 080 e 100

2.2.2.6 Finanziamenti a vista

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 020

2.2.2.7 Titoli di capitale

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 030

2.2.2.8 Titoli di debito

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 040

2.2.2.8.1 Obbligazioni bancarie garantite

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 050

2.2.2.8.2 ABS

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 060

2.2.2.8.3 Emessi da Amministrazioni Pubbliche

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 070

2.2.2.8.4 Emessi da Intermediari Finanziari

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 080

2.2.2.8.5 Emessi da Società non Finanziarie

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 090

2.2.2.9 Finanziamenti diversi da quelli a vista

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 100

2.2.2.9.1 Prestiti Ipotecari

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 110

2.2.2.10 Altre attività

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.1.2, riga 120

2.2.3 GARANZIE RICEVUTE

Vincolate

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.3, colonna 010

2.2.3.1 Finanziamenti a vista

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 140

- Verso altri enti appartenenti al gruppo

2.2.3.2 Titoli di capitale

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 150

- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo

2.2.3.3 Titoli di debito

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 160

- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo

2.2.3.3.1 Obbligazioni bancarie garantite

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 170

- Emesse da altri enti appartenenti al gruppo

2.2.3.3.2 ABS

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 180

- Emessi da altri enti appartenenti al gruppo

2.2.3.3.3 Emessi da Amministrazioni Pubbliche

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 190

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.2.3.3.4 Emessi da Intermediari Finanziari

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 200

- **Emessi da altri enti appartenenti al gruppo**

2.2.3.3.5 Emessi da Società non Finanziarie

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 210

- **Emessi da altri enti appartenenti al gruppo**

2.2.3.4 Finanziamenti diversi da quelli a vista

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 220

- Verso **altri enti appartenenti al gruppo**

2.2.3.5 Altre garanzie ricevute

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 230

- Verso **altri enti appartenenti al gruppo**

2.2.3.6 Propri titoli di debito emessi diversi dalle obbligazioni bancarie garantite e dagli ABS

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 240

Non vincolate

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.3, colonna 040

2.2.3.7 Finanziamenti a vista

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 140

- **Verso altri enti appartenenti al gruppo**

2.2.3.8 Titoli di capitale

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 150

- **Emessi da altri enti appartenenti al gruppo**

2.2.3.9 Titoli di debito

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 160

- **Emessi da altri enti appartenenti al gruppo**

2.2.3.9.1 Obbligazioni bancarie garantite

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 170

- **Emesse da altri enti appartenenti al gruppo**

2.2.3.9.2 ABS

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 180

- **Emessi da altri enti appartenenti al gruppo**

2.2.3.9.3 Emessi da Amministrazioni Pubbliche

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 190

2.2.3.9.4 Emessi da Intermediari Finanziari

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 200

- **Emessi da altri enti appartenenti al gruppo**

2.2.3.9.5 Emessi da Società non Finanziarie

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 210

- **Emessi da altri enti appartenenti al gruppo**

2.2.3.10 Finanziamenti diversi da quelli a vista

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 220

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

- Verso altri enti appartenenti al gruppo

2.2.3.11 Altre garanzie ricevute

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 230

- Da altri enti appartenenti al gruppo

2.2.3.12 Propri titoli di debito emessi diversi dalle obbligazioni bancarie garantite e dagli ABS

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 240

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.2.4 GARANZIE RICEVUTE – AMMISSIBILI BCE

Vincolate

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.3, colonna 030

2.2.4.1 Finanziamenti a vista

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 140

2.2.4.2 Titoli di capitale

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 150

2.2.4.3 Titoli di debito

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 160

2.2.4.3.1 Obbligazioni bancarie garantite

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 170

2.2.4.3.2 ABS

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 180

2.2.4.3.3 Emessi da Amministrazioni Pubbliche

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 190

2.2.4.3.4 Emessi da Intermediari Finanziari

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 200

2.2.4.3.5 Emessi da Società non Finanziarie

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 210

2.2.4.4 Finanziamenti diversi da quelli a vista

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 220

2.2.4.5 Altre garanzie ricevute

Parte I	
Sezione:	17 – Attività vincolate su base individuale
Sottosezione:	2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 230

2.2.4.6 Propri titoli di debito emessi diversi dalle obbligazioni bancarie garantite e dagli ABS

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 240

Non vincolate

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, colonna 060

2.2.4.7 Finanziamenti a vista

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 140

2.2.4.8 Titoli di capitale

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 150

2.2.4.9 Titoli di debito

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 160

2.2.4.9.1 Obbligazioni bancarie garantite

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 170

2.2.4.9.2 ABS

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 180

2.2.4.9.3 Emessi da Amministrazioni Pubbliche

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 190

2.2.4.9.4 Emessi da Intermediari Finanziari

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 200

2.2.4.9.5 Emessi da Società non Finanziarie

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 210

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.2.4.10 Finanziamenti diversi da quelli a vista

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 220

2.2.4.11 Altre garanzie ricevute

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 230

2.2.4.12 Propri titoli di debito emessi diversi dalle obbligazioni bancarie garantite e dagli ABS

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 240

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.2.5 GARANZIE RICEVUTE E PROPRI TITOLI DI DEBITO EMESSI DIVERSI DALLE OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE E DAGLI ABS – NON VINCOLATE E NON DISPONIBILI ALL’IMPEGNO

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.3, colonna 070

2.2.5.1 Finanziamenti a vista

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 140

2.2.5.2 Titoli di capitale

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 150

2.2.5.3 Titoli di debito

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 160

2.2.5.3.1 Obbligazioni bancarie garantite

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 170

2.2.5.3.2 ABS

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 180

2.2.5.3.3 Emessi da Amministrazioni Pubbliche

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 190

2.2.5.3.4 Emessi da Intermediari Finanziari

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 200

2.2.5.3.5 Emessi da Società non Finanziarie

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 210

2.2.5.4 Finanziamenti diversi da quelli a vista

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 220

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.2.5.5 Altre garanzie ricevute

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 230

2.2.5.6 Propri titoli di debito emessi diversi dalle obbligazioni bancarie garantite e dagli ABS

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.2.2, riga 240

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.2.6 ATTIVITÀ SOTTOSTANTI A PROPRIE OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE EMESSE E NON VINCOLATE

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.3.3, colonna 010

2.2.6.1 Obbligazioni bancarie garantite emesse

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.3.2, riga 010

2.2.6.2 Titoli ABS emessi

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.3.2, riga 020

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.2.7 TOTALE DEI TITOLI DI DEBITO EMESSI E NON VINCOLATI – DISPONIBILI ALL’IMPEGNO

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.3.3, colonna 020

2.2.7.1 Obbligazioni bancarie garantite emesse

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.3.2, riga 010

2.2.7.2 Titoli ABS emessi

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.3.2, riga 020

2.2.7.2.1 Senior

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.3.2, riga 030

2.2.7.2.2 Mezzanine

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.3.2, riga 040

2.2.7.2.3 Junior

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.3.2, riga 050

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.2.8 TOTALE DEI TITOLI DI DEBITO EMESSI E NON VINCOLATI – DISPONIBILI ALL’IMPEGNO – AMMISSIBILI BCE

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.3.3, colonna 030

2.2.8.1 Obbligazioni bancarie garantite emesse

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.3.2, riga 010

2.2.8.2 Titoli ABS emessi

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.3.2, riga 020

2.2.8.2.1 Senior

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.3.2, riga 030

2.2.8.2.2 Mezzanine

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.3.2, riga 040

2.2.8.2.3 Junior

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.3.2, riga 050

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.2.9 TOTALE DEI TITOLI DI DEBITO EMESSI, NON VINCOLATI E NON DISPONIBILI ALL'IMPEGNO

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.3.3, colonna 040

2.2.9.1 Obbligazioni bancarie garantite emesse

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.3.2, riga 010

2.2.9.2 Titoli ABS emessi

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.3.2, riga 020

2.2.9.2.1 Senior

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.3.2, riga 030

2.2.9.2.2 Mezzanine

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.3.2, riga 040

2.2.9.2.3 Junior

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.3.2, riga 050

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.2.10 PASSIVITÀ FINANZIARIE, PASSIVITÀ POTENZIALI E TITOLI IN PRESTITO ASSOCIATI AD ATTIVITÀ VINCOLATE

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.3, colonna 010

2.2.10.1 Derivati

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 020

2.2.10.1.1 Con altri enti appartenenti al gruppo

2.2.10.1.1.1 Derivati *over the counter*

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 030

2.2.10.1.1.1 Con altri enti appartenenti al gruppo

2.2.10.2 Depositi

2.2.10.2.1 Pronti contro termine:

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 050

2.2.10.2.1.1 Con altri enti appartenenti al gruppo

2.2.10.2.1.1 Pronti contro termine con banche centrali

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 060

2.2.10.2.2 Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 070

2.2.10.2.2.1 di altri enti appartenenti al gruppo

2.2.10.2.2.1 Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine con banche centrali

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 080

2.2.10.2.3 Titoli di debito emessi

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 090

2.2.10.2.3.1 Detenuti da altri enti appartenenti al gruppo

2.2.10.2.3.1 Obbligazioni bancarie garantite

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 100

2.2.10.2.3.1.1 Detenute da altri enti appartenenti al gruppo

2.2.10.2.3.2 Titoli ABS

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 110

2.2.10.2.3.2.1 Detenuti da altri enti appartenenti al gruppo

2.2.10.2.4 Impegni a erogare fondi ricevuti

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 130

2.2.10.2.5 Garanzie finanziarie ricevute

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 140

2.2.10.2.6 Titoli presi in prestito senza garanzia in contanti

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 150

2.2.10.2.7 Altre

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 160

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.2.11 ATTIVITÀ, GARANZIE RICEVUTE E PROPRI TITOLI DI DEBITO EMESSI VINCOLATI DIVERSI DA OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE E TITOLI ABS

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.3, colonna 030

2.2.11.1 Derivati

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 020

2.2.11.1.1 Derivati *over the counter*

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 030

2.2.11.2 Depositi

2.2.11.2.1 Pronti contro termine:

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 050

2.2.11.2.1.1 Pronti contro termine con banche centrali

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 060

2.2.11.2.2 Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 070

2.2.11.2.2.1 Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine con banche centrali

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 080

2.2.11.2.3 Titoli di debito emessi

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 090

2.2.11.2.3.1 Obbligazioni bancarie garantite

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 100

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.2.11.2.3.2 Titoli ABS

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 110

2.2.11.2.4 Impegni a erogare fondi ricevuti

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 130

2.2.11.2.5 Garanzie finanziarie ricevute

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 140

2.2.11.2.6 Titoli presi in prestito senza garanzia in contanti

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 150

2.2.11.2.7 Altre

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 160

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.2.12 ATTIVITÀ, GARANZIE RICEVUTE E PROPRI TITOLI DI DEBITO EMESSI DIVERSI DA OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE E ABS VINCOLATI**Garanzie Ricevute – Riutilizzate**

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.3, colonna 040

2.2.12.1 Derivati

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 020

2.2.12.1.1 Derivati *over the counter*

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 030

2.2.12.2 Depositi: pronti contro termine

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 050

2.2.12.3 Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 070

Propri titoli di debito emessi

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.3, colonna 050

2.2.12.4 Derivati

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 020

2.2.12.4.1 Derivati *over the counter*

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 030

2.2.12.5 Depositi: pronti contro termine

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 050

2.2.12.6 Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 2.4.2, riga 070

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.3 “ASPETTI INERENTI ALLA VITA RESIDUA DELLE OPERAZIONI”

2.3.1 PASSIVITÀ FINANZIARIE RIPARTITE PER VITA RESIDUA

Con riferimento alla presente voce, tra gli attributi informativi illustrati al paragrafo 3.1 trovano applicazione i seguenti: Vita residua dell’operazione e Tipo importo

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 3.2.2

2.3.1.1 Attività vincolate

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 3.2.1, riga 010

2.3.1.2 Garanzie ricevute riutilizzate (con riferimento all’operazione originaria)

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 3.2.1, riga 020

2.3.1.3 Garanzie ricevute riutilizzate (con riferimento all’operazione di riutilizzo)

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 3.2.1, riga 030

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.4 “ASPETTI RIGUARDANTI LE ATTIVITÀ VINCOLATE IN SITUAZIONI DI STRESS”

2.4.1 PASSIVITÀ ASSOCIATE ALLE ATTIVITÀ POTENZIALI VINCOLATE

Con riferimento alla presente voce, tra gli attributi informativi illustrati al paragrafo 3.1 trovano applicazione i seguenti: Valuta e Tipo importo

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 4.2.1 e 4.2.2

1. Derivati

1.1 Derivati *over the counter*

2. Depositi

2.1 Pronti contro termine

2.1.1 Pronti contro termine con banche centrali

2.2 Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine

2.2.1 Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine con banche centrali

3. Titoli di debito emessi

3.1 Obbligazioni bancarie garantite

3.2. Titoli ABS

4. Altre fonti di attività vincolate

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.5 “INFORMAZIONI SULLE EMISSIONI DI OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE”**2.5.1 PASSIVITÀ RELATIVE ALLE OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE**

Con riferimento alla presente voce, tra gli attributi informativi illustrati al paragrafo 3.1 trovano applicazione i seguenti: Codice identificativo cover pool, *Compliance* art. 129, Classe di attività primaria del cover pool, Nome CRA, *Rating*, Tipo importo

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.2

2.5.1.1 Ammontare alla data di segnalazione

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.3, colonna 020

2.5.1.2 T + 6 mesi

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.3, colonna 030

2.5.1.3 T + 12 mesi

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.3, colonna 040

2.5.1.4 T + 2 anni

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.3, colonna 050

2.5.1.5 T + 5 anni

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.3, colonna 060

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.5.1.6 T + 10 anni

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.3, colonna 070

2.5.1.7 Cover pool: posizioni in derivati con valore di mercato negativo

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.3, colonna 080

2.5.1.8 Agenzia di rating 1

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.3, colonna 090/100

2.5.1.9 Agenzia di rating 2

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.3, colonna 110/120

2.5.1.10 Agenzia di rating 3

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.3, colonna 130/140

Parte I	
Sezione:	17 – Attività vincolate su base individuale
Sottosezione:	2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.5.2 Cover pool

Con riferimento alla presente voce, tra gli attributi informativi illustrati al paragrafo 3.1 trovano applicazione i seguenti: Codice identificativo cover pool, *Compliance* art. 129, Classe di attività primaria del cover pool, Nome CRA, *Rating*, Tipo importo

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.2

1. Ammontare alla data di segnalazione

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.3, colonna 150

2. T + 6 mesi

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.3, colonna 160

3. T + 12 mesi

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.3, colonna 170

4. T + 2 anni

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.3, colonna 180

5. T + 5 anni

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.3, colonna 190

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

6. T + 10 anni

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.3, colonna 200

7. Cover pool: posizioni in derivati con valore di mercato positivo

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.3, colonna 210

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.5.3 Cover pool: ammontare in eccesso rispetto ai requisiti minimi di copertura

Con riferimento alla presente voce, tra gli attributi informativi illustrati al paragrafo 3.1 trovano applicazione i seguenti: Codice identificativo cover pool, Nome CRA, Tipo importo

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.2

2.5.3.1 Secondo il pertinente regime regolamentare delle Obbligazioni bancarie garantite

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.3, colonna 220

2.5.3.2 Secondo la metodologia delle agenzie di rating per assicurare l'attuale rating esterno delle Obbligazioni bancarie garantite – Agenzia di rating 1

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.3, colonna 230

2.5.3.3 Secondo la metodologia delle agenzie di rating per assicurare l'attuale rating esterno delle Obbligazioni bancarie garantite – Agenzia di rating 2

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.3, colonna 240

2.5.3.4 Secondo la metodologia delle agenzie di rating per assicurare l'attuale rating esterno delle Obbligazioni bancarie garantite – Agenzia di rating 3

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.3, colonna 250

Parte I	
Sezione:	17 – Attività vincolate su base individuale
Sottosezione:	2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.6 “Informazioni aggiuntive sulle attività vincolate e sulle passività associate”

2.6.1 Passività finanziarie associate alle attività vincolate - ripartite per forma tecnica

Con riferimento alla presente voce, tra gli attributi informativi illustrati al paragrafo 3.1 trovano applicazione i seguenti: Forma tecnica dell'attività, Tipo importo.

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.2

2.6.1.1 Finanziamenti da banca centrale

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.1 riga 020

2.6.1.2 Derivati su mercati regolamentati

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.1 riga 040

2.6.1.3 Derivati over the counter

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.1 riga 060

2.6.1.4 Pronti contro termine passivi

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.1 riga 080

2.6.1.5 Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine passivi

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.1 riga 100

2.6.1.6 Obbligazioni bancarie garantite emesse

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.1 riga 120

2.6.1.7 Titoli ABS emessi

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.1 riga 140

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.6.1.8 Titoli di debito emessi diversi dai Obbligazioni bancarie garantite e dagli ABS

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.1 riga 160

2.6.1.9 Altre passività finanziarie

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.1 riga 180

Parte I	
Sezione:	17 – Attività vincolate su base individuale
Sottosezione:	2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.6.2 Attività vincolate ripartite per forma tecnica

Con riferimento alla presente voce, tra gli attributi informativi illustrati al paragrafo 3.1 trovano applicazione i seguenti: Forma tecnica dell'attività, Forma tecnica della passività associata, Tipo importo.

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.1

2.6.2.1 Finanziamenti a vista

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.2 colonna 010

2.6.2.2 Titoli di capitale

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.2 colonna 020

2.6.2.3 Titoli di debito

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.2 colonna 030

2.6.2.3.1 Obbligazioni bancarie garantite

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.2 colonna 040

2.6.2.3.2 Obbligazioni bancarie garantite emesse da altre società appartenenti al gruppo

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.2 colonna 050

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.6.2.3.3 ABS

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.2 colonna 060

2.6.2.3.4 ABS emessi da altre società appartenenti al gruppo

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.2 colonna 070

2.6.2.3.5 Emessi da amministrazioni pubbliche

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.2 colonna 080

2.6.2.3.6 Emessi da intermediari finanziari

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.2 colonna 090

2.6.2.3.7 Emessi da società non finanziarie

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.2 colonna 100

2.6.2.4 Finanziamenti diversi da quelli a vista verso banche centrali e amministrazioni pubbliche

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.2 colonna 110

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.6.2.5 Finanziamenti diversi da quelli a vista: verso controparti finanziarie

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.2 colonna 120

2.6.2.6 Finanziamenti diversi da quelli a vista: verso controparti non finanziarie

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.2 colonna 130

2.6.2.6.1 Mutui ipotecari

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.2 colonna 140

2.6.2.7 Finanziamenti diversi da quelli a vista: famiglie

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.2 colonna 150

2.6.2.7.1 Mutui ipotecari

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.2 colonna 160

2.6.2.8 Altre attività

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.2 colonna 170

2.6.2.9 Totale delle attività vincolate – Ammissibili BCE

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.1e 6.2.2 riga 200

PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.6.3 Attività non vincolate

Con riferimento alla presente voce, tra gli attributi informativi illustrati al paragrafo 3.1 trovano applicazione i seguenti: Forma tecnica dell'attività, Tipo importo.

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.1

2.6.3.1 Attività non vincolate

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.1 riga 210

2.6.3.2 Attività non vincolate - Ammissibili BCE

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.1 riga 220

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.6.4 Passività finanziarie associate alle garanzie ricevute vincolate - ripartite per forma tecnica

Con riferimento alla presente voce, tra gli attributi informativi illustrati al paragrafo 3.1 trovano applicazione i seguenti: Forma tecnica dell'attività, Tipo importo.

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.1

2.6.4.1 Finanziamenti da banca centrale

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.2, riga 020

2.6.4.2 Derivati su mercati regolamentati

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.2, riga 040

2.6.4.3 Derivati *over the counter*

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.2, riga 060

2.6.4.4 Pronti contro termine passivi

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.2, riga 080

2.6.4.5 Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine passivi

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.2, riga 100

2.6.4.6 Obbligazioni bancarie garantite emesse

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.2, riga 120

2.6.4.7 Titoli ABS emessi

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.2, riga 140

2.6.4.8 Titoli di debito emessi diversi dalle obbligazioni bancarie garantite e dagli ABS

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.2, riga 160

2.6.4.9 Altre passività finanziarie

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.2, riga 180

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.6.5 Garanzie ricevute vincolate - ripartite per forma tecnica

Con riferimento alla presente voce, tra gli attributi informativi illustrati al paragrafo 3.1 trovano applicazione i seguenti: Forma tecnica dell'attività, Forma tecnica della passività associata, Tipo importo.

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.1

2.6.5.1 Finanziamenti a vista

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.2 colonna 010

2.6.5.2 Titoli di capitale

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.2 colonna 020

2.6.5.3 Titoli di debito

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.2 colonna 030

2.6.5.3.1 Obbligazioni bancarie garantite

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.2 colonna 040

2.6.5.3.1.1 Obbligazioni bancarie garantite emesse da altre società appartenenti al gruppo

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.2 colonna 050

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.6.5.3.2 ABS

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.2 colonna 060

2.6.5.3.2.1 ABS emessi da altre società appartenenti al gruppo

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.2 colonna 070

2.6.5.3.3 Emessi da amministrazioni pubbliche

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.2 colonna 080

2.6.5.3.4 Emessi da intermediari finanziari

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.2 colonna 090

2.6.5.3.5 Emessi da società non finanziarie

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.2 colonna 100

2.6.5.4 Finanziamenti diversi da quelli a vista verso banche centrali e amministrazioni pubbliche

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.2 colonna 110

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.6.5.5 Finanziamenti diversi da quelli a vista: verso controparti finanziarie

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.2 colonna 120

2.6.5.6 Finanziamenti diversi da quelli a vista: verso controparti non finanziarie

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.2 colonna 130

2.6.5.6.1 Mutui ipotecari

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.2 colonna 140

2.6.5.7 Finanziamenti diversi da quelli a vista: famiglie

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.2 colonna 150

2.6.5.8 Altre garanzie ricevute

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.2 colonna 160

2.6.5.9 Propri titoli di debito emessi diversi dalle Obbligazioni bancarie garantite e dagli ABS

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.2 colonna 170

2.6.5.10 Totale delle garanzie ricevute vincolate – Ammissibili BCE

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.1 riga 200

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2.6.6 Garanzie ricevute non vincolate

Con riferimento alla presente voce, tra gli attributi informativi illustrati al paragrafo 3.1 trovano applicazione i seguenti: Forma tecnica dell'attività, Tipo importo.

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.3.2

2.6.6.1 Garanzie ricevute non vincolate

2.6.6.2 Totale delle garanzie ricevute non vincolate - Ammissibili BCE

Parte I	
Sezione:	17 – Attività vincolate su base individuale
Sottosezione:	2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

3.1 **Attributi informativi**

I seguenti attributi informativi si applicano alle diverse voci sopra illustrate secondo quanto previsto nella Sezione 17, Sottosezione 1.

Tipo importo

I valori previsti per la variabile “tipo importo” sono i seguenti:

21 Valore contabile

24 Valore nominale

101 Valore contabile

102 Valore addizionale scenario 1

103 Valore addizionale scenario 2

104 Valore asset specific

105 Present value o market value

Forma tecnica dell’attività

I valori previsti per la variabile “Forma tecnica dell’attività” sono i seguenti:

260 “finanziamenti a vista”;

204 “titoli di capitale”;

203 “titoli di debito: totale”;

99 “titoli di debito: obbligazioni bancarie garantite”;

261 “titoli di debito: obbligazioni bancarie garantite emesse da altre società’ appartenenti al gruppo”;

262 “titoli di debito: ABS”;

263 “titoli di debito: ABS emessi da altre società appartenenti al gruppo”;

264 “titoli di debito: emessi da amministrazioni pubbliche”;

265 “titoli di debito: emessi da intermediari finanziari”;

266 “titoli di debito: emessi da società non finanziarie”;

267 “finanziamenti diversi da quelli a vista: verso banche centrali e amministrazioni pubbliche”;

268 “finanziamenti diversi da quelli a vista: verso intermediari finanziari”;

269 “finanziamenti diversi da quelli a vista: verso controparti non finanziarie”;

270 “finanziamenti diversi da quelli a vista verso controparti non finanziarie: mutui ipotecari”;

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

271 “finanziamenti diversi da quelli a vista: verso famiglie”;

272 “finanziamenti diversi da quelli a vista verso famiglie: mutui ipotecari”;

273 “altre attività”;

274 “altre garanzie ricevute”;

275 “propri titoli di debito emessi diversi da obbligazioni bancarie garantite o ABS”

Codice identificativo cover pool

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.1

Compliance art. 129

I valori previsti per la variabile “Compliance art. 129” sono i seguenti:

1. 1 “Si”
2. 2 “No”

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.3, colonna 010

Classe di attività primaria del cover pool

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.3, colonna 012

Nome CRA

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.3, colonna 090/110/130

Rating

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 5.2.3, colonna 100/120/140

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

Vita residua dell'operazione

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 3.2.2

I valori previsti per la variabile “Vita residua dell'operazione” sono i seguenti:

- 10 “a vista e a revoca”
- 46 “overnight”
- 25 “oltre 1 giorno a 7 giorni”
- 41 “da oltre 7 giorni a 15 giorni”
- 42 “da oltre 15 giorni a 1 mese”
- 40 “da oltre 1 mese a 3 mesi”
- 50 “da oltre 3 mesi a 6 mesi”
- 60 “da oltre 6 mesi a 12 mesi”
- 90 “da oltre 1 anno a 2 anni”
- 160 “da oltre 2 anni a 3 anni”
- 139 “da oltre 3 anni a 5 anni”
- 132 “da oltre 5 anni a 10 anni”
- 133 “da oltre 10 anni”

Forma tecnica della passività associata

Cfr. Regolamento della Commissione, Allegato XVII, paragrafo 6.2.1

I valori previsti per la variabile “Forma tecnica della passività associata” sono i seguenti:

- 276 “Finanziamenti da banca centrale”
- 277 “Derivati su mercati regolamentati”
- 278 “Derivati *over the counter*”
- 279 “Pronti contro termine passivi”
- 280 “Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine passivi”
- 281 “Obbligazioni bancarie garantite emesse”
- 282 “Titoli abs emessi”
- 283 “Titoli di debito emessi diversi da obbligazioni bancarie garantite e titoli abs”
- 284 “Altre passività finanziarie”

ESEMPI

A) Pronti contro termine passivi

Si ipotizzi che una banca abbia stipulato un PCT passivo per un importo di 500.000 euro postando come collateral un titolo di debito non ammissibile ai fini BCE emesso da società non finanziaria che ha un *fair value* pari a 600.000 euro e un valore contabile pari 580.000 euro.

La banca dovrà segnalare:

- nella voce “PASSIVITÀ FINANZIARIE, PASSIVITÀ POTENZIALI E TITOLI IN PRESTITO ASSOCIATI AD ATTIVITÀ VINCOLATE” - sottovoce 2.1 “Pronti contro termine” il valore contabile del PCT pari a 500.000;
- nella voce “ATTIVITÀ, GARANZIE RICEVUTE E PROPRI TITOLI DI DEBITO EMESSI VINCOLATI DIVERSI DA OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE E TITOLI ABS” – sottovoce 2.1 “Pronti contro termine” il valore contabile del titolo di debito pari a 580.000;
- nella voce “ATTIVITÀ FINANZIARIE” – sottovoce 3 “Titoli di debito” il valore contabile pari a 580.000 euro e il *fair value* pari a 600.000;
- nella voce “ATTIVITÀ FINANZIARIE” – sottovoce 3.5 “Titoli di debito – emessi da società non finanziarie” il valore contabile pari a 580.000 euro e il *fair value* pari a 600.000;

B) Deposito collateralizzato

Si ipotizzi che una banca abbia in essere un contratto di deposito collateralizzato per un importo di 300.000 euro postando come collateral un titolo di debito ricevuto in garanzia ammissibile ai fini BCE e emesso da amministrazioni centrali che ha un *fair value* pari a 450.000 euro.

La banca dovrà segnalare:

- nella voce “GARANZIE RICEVUTE” - sottovoce 3 “Titoli di debito” il *fair value* del titolo di debito pari a 450.000;

Parte I

Sezione: 17 – Attività vincolate su base individuale

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

- nella voce “GARANZIE RICEVUTE” - sottovoce 3 “Titoli di debito - Emessi da amministrazioni pubbliche” il fair value del titolo di debito pari a 450.000;
- nella voce “GARANZIE RICEVUTE – AMMISSIBILI BCE” - sottovoce 3 “Titoli di debito” il fair value del titolo di debito pari a 450.000;
- nella voce “GARANZIE RICEVUTE – AMMISSIBILI BCE” - sottovoce 3 “Titoli di debito - Emessi da amministrazioni pubbliche” il fair value del titolo di debito pari a 450.000;
- nella voce “PASSIVITÀ FINANZIARIE, PASSIVITÀ POTENZIALI E TITOLI IN PRESTITO ASSOCIATI AD ATTIVITÀ VINCOLATE” - sottovoce 2.2 “Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine” il valore contabile pari a 300.000 euro;
- nella voce “ATTIVITÀ, GARANZIE RICEVUTE E PROPRI TITOLI DI DEBITO EMESSI VINCOLATI DIVERSI DA OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE E TITOLI ABS” sottovoce 2.2 “Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine” il fair value del del titolo di debito pari a 450.000 euro;
- nella voce “ATTIVITÀ, GARANZIE RICEVUTE E PROPRI TITOLI DI DEBITO EMESSI DIVERSI DA OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE E ABS VINCOLATI - GARANZIE RICEVUTE - RIUTILIZZATE” sottovoce 3 “Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine” il fair value del del titolo di debito pari a 450.000 euro;

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

Sezione:

18 – ATTIVITÀ VINCOLATE SU BASE CONSOLIDATA

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

Sottosezione:

**1 – SCHEMA DELLA SEGNALAZIONE RELATIVA ALLE ATTIVITÀ
VINCOLATE SU BASE CONSOLIDATA**

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

ATTIVITÀ FINANZIARIE **Tipo Importo**

Vincolate

1. Finanziamenti a vista	21
2. Titoli di capitale	21/101
3. Titoli di debito	21/101
3.1 Obbligazioni bancarie garantite	21/101
3.2 ABS	21/101
3.3 Emessi da Amministrazioni Pubbliche	21/101
3.4 Emessi da Intermediari Finanziari	21/101
3.5. Emessi da Società non Finanziarie	21/101
4. Finanziamenti diversi da quelli a vista	21
4.1 Prestiti Ipotecari	21
5. Altre attività	21

Non Vincolate

6. Finanziamenti a vista	21
7. Titoli di capitale	21/101
8. Titoli di debito	21/101
8.1 Obbligazioni bancarie garantite	21/101
8.2 ABS	21/101

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

8.3 Emessi da Amministrazioni Pubbliche	21/101
8.4 Emesso da Intermediari Finanziari	21/101
8.5 Emesso da Società non Finanziaria	21/101
9. Finanziamenti diversi da quelli a vista	21
9.1 Prestiti Ipotecari	21
10. Altre attività	21

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

ATTIVITÀ FINANZIARIE - AMMISSIBILI BCE**Tipo importo****Vincolate**

1. Finanziamenti a vista	21
2. Titoli di capitale	21/101
3. Titoli di debito	21/101
3.1 Obbligazioni bancarie garantite	21/101
3.2 ABS	21/101
3.3 Emessi da Amministrazioni Pubbliche	21/101
3.4 Emesso da Intermediari Finanziari	21/101
3.5 Emesso da Società non Finanziaria	21/101
4. Finanziamenti diversi da quelli a vista	21
4.1 Prestiti Ipotecari	21
5. Altre attività	21

Non Vincolate

6. Finanziamenti a vista	21
7. Titoli di capitale	21/101
8. Titoli di debito	21/101
8.1 Obbligazioni bancarie garantite	21/101
8.2 ABS	21/101
8.3 Emessi da Amministrazioni Pubbliche	21/101

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

8.4 Emesso da Intermediari Finanziari	21/101
8.5 Emesso da Società non Finanziaria	21/101
9. Finanziamenti diversi da quelli a vista	21
9.1 Prestiti Ipotecari	21
10. Altre attività	21

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

GARANZIE RICEVUTE	Tipo importo
Vincolate	
1. Finanziamenti a vista	101
2. Titoli di capitale	101
3. Titoli di debito	101
3.1 Obbligazioni bancarie garantite	101
3.2 ABS	101
3.3 Emesso da amministrazioni pubbliche	101
3.4 Emesso da intermediari finanziari	101
3.5 Emesso da società non finanziaria	101
4. Finanziamenti diversi da quelli a vista	101
5. Altre garanzie ricevute	101
6. Propri titoli di debito emessi diversi dalle Obbligazioni bancarie garantite e dagli ABS	101
Non vincolate	
7. Finanziamenti a vista	101
8. Titoli di capitale	101
9. Titoli di debito	101
9.1 Obbligazioni bancarie garantite	101
9.2 ABS	101
9.3 Emesso da amministrazioni pubbliche	101

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

9.4 Emesso da intermediari finanziari	101
9.5 Emesso da società non finanziaria	101
10. Finanziamenti diversi da quelli a vista	101
11. Altre garanzie ricevute	101
12. Propri titoli di debito emessi diversi dalle obbligazioni bancarie garantite e dagli ABS	101

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

GARANZIE RICEVUTE – AMMISSIBILI BCE**Tipo importo****Vincolate**

1. Finanziamenti a vista	101
2. Titoli di capitale	101
3. Titoli di debito	101
3.1 Obbligazioni bancarie garantite	101
3.2 ABS	101
3.3 Emesso da amministrazioni pubbliche	101
3.4 Emesso da intermediari finanziari	101
3.5 Emesso da società non finanziaria	101
4. Finanziamenti diversi da quelli a vista	101
5. Altre garanzie ricevute	101
6. Propri titoli di debito emessi diversi dalle Obbligazioni bancarie garantite e dagli ABS	101

Non vincolate

7. Finanziamenti a vista	101
8. Titoli di capitale	101
9. Titoli di debito	101
9.1 Obbligazioni bancarie garantite	101
9.2 ABS	101
9.3 Emesso da amministrazioni pubbliche	101

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

9.4 Emesso da intermediari finanziari	101
9.5 Emesso da società non finanziaria	101
10. Finanziamenti diversi da quelli a vista	101
11. Altre garanzie ricevute	101
12. Propri titoli di debito emessi diversi dalle Obbligazioni bancarie garantite e dagli ABS	101

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

GARANZIE RICEVUTE E PROPRI TITOLI DI DEBITO EMESSI DIVERSI DALLE OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE E DAGLI ABS – NON VINCOLATE E NON DISPONIBILI ALL’IMPEGNO	Tipo importo
---	---------------------

1. Finanziamenti a vista	24
2. Titoli di capitale	24
3. Titoli di debito	24
3.1 Obbligazioni bancarie garantite	24
3.2 ABS	24
3.3 Emesso da amministrazioni pubbliche	24
3.4 Emesso da intermediari finanziari	24
3.5 Emesso da società non finanziaria	24
4. Finanziamenti diversi da quelli a vista	24
5. Altre garanzie ricevute	24
6. Propri titoli di debito emessi diversi dalle Obbligazioni bancarie garantite e dagli ABS	24

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

ATTIVITÀ SOTTOSTANTI A PROPRIE OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE EMESSE E NON VINCOLATE	Tipo importo
--	---------------------

1. Obbligazioni bancarie garantite emesse	21
---	----

2. Titoli ABS emessi	21
----------------------	----

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

TOTALE DEI TITOLI DI DEBITO EMESSI E NON VINCOLATI – DISPONIBILI ALL’IMPEGNO	Tipo importo
1. Obbligazioni bancarie garantite emesse	101
2. Titoli ABS emessi	101
2.1 Senior	101
2.2 Mezzanine	101
2.3 Junior	101
TITOLI DI DEBITO EMESSI E NON VINCOLATI – DISPONIBILI ALL’IMPEGNO – AMMISSIBILI BCE	
3. Obbligazioni bancarie garantite emesse	101
4. Titoli ABS emessi	101
4.1 Senior	101
4.2 Mezzanine	101
4.3 Junior	101

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

**TOTALE DEI TITOLI DI DEBITO EMESSI, NON
VINCOLATI E NON DISPONIBILI ALL'IMPEGNO****Tipo importo**

1. Obbligazioni bancarie garantite emesse	24
2. Titoli ABS emessi	24
2.1 Senior	24
2.2 Mezzanine	24
2.3 Junior	24

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

PASSIVITÀ FINANZIARIE, PASSIVITÀ POTENZIALI E TITOLI IN PRESTITO ASSOCIATI AD ATTIVITÀ VINCOLATE	Tipo importo
---	---------------------

1. Derivati	21
1.1 Derivati <i>over the counter</i>	21
2. Depositi	-
2.1 Pronti contro termine:	21
2.1.1 Pronti contro termine con banche centrali	21
2.2 Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine	21
2.2.1 Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine con banche centrali	21
3. Titoli di debito emessi	21
3.1 Obbligazioni bancarie garantite	21
3.2 Titoli ABS	21
4. Impegni a erogare fondi ricevuti	24
5. Garanzie finanziarie ricevute	24
6. Titoli presi a prestito senza garanzia in contanti	101
7. Altre	21/24/101

AVVERTENZE

Nella voce 7 la variabile “Tipo importo” deve assumere alternativamente i valori: “valore contabile - 21”, “fair value - 101” o “valore nominale - 24” in base alla tipologia di passività finanziaria

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

ATTIVITÀ, GARANZIE RICEVUTE E PROPRI TITOLI DI DEBITO EMESSI VINCOLATI DIVERSI DA OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE E TITOLI ABS	Tipo importo
---	---------------------

1. Derivati	21/101
1.1 Derivati <i>over the counter</i>	21/101
2. Depositi	-
2.1 Pronti contro termine:	21/101
2.1.1 Pronti contro termine con banche centrali	21
2.2 Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine:	21/101
2.2.1 Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine con banche centrali	21
3. Titoli di debito emessi	21
3.1 Obbligazioni bancarie garantite	21
3.2 Titoli ABS	21
4. Impegni a erogare fondi ricevuti	21
5. Garanzie finanziarie ricevute	101
6. Titoli presi a prestito senza garanzia in contanti	101
7. Altre	21/101

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

ATTIVITÀ, GARANZIE RICEVUTE E PROPRI TITOLI DI DEBITO EMESSI DIVERSI DA OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE E ABS VINCOLATI¹ **Tipo importo**

Garanzie Ricevute - Riutilizzate

1. Derivati	101
1.1 Derivati <i>over the counter</i>	101
2. Depositi: pronti contro termine	101
2.2 Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine	101

Propri titoli di debito emessi

1. Derivati	101
1.1 Derivati <i>over the counter</i>	101
2. Depositi: pronti contro termine	101
2.2 Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine	101

LEGENDA

TIPO IMPORTO

21	Valore contabile
24	Valore nominale
101	Fair value

¹ Nella presente voce sono compresi i propri titoli di debito emessi vincolati diversi dalle Obbligazioni bancarie garantite e titoli ABS.

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

PASSIVITÀ FINANZIARIE RIPARTITE PER VITA RESIDUA	Vita residua dell'operazione	Tipo importo
1. Attività vincolate	X	21/101
2. Garanzie ricevute riutilizzate (con riferimento all'operazione originaria)	X	101
3. Garanzie ricevute riutilizzate (con riferimento all'operazione di riutilizzo)	X	101

LEGENDA

TIPO IMPORTO

21	Valore contabile
101	Fair value

VITA RESIDUA

DELL'OPERAZIONE

10	a vista e a revoca
46	overnight
25	oltre 1 giorno a 7 giorni
41	da oltre 7 giorni a 15 giorni
42	da oltre 15 giorni a 1 mese
40	da oltre 1 mese a 3 mesi
50	da oltre 3 mesi a 6 mesi
60	da oltre 6 mesi a 12 mesi
90	da oltre 1 anno a 2 anni
160	da oltre 2 anni a 3 anni
139	da oltre 3 anni a 5 anni
132	da oltre 5 anni a 10 anni
133	da oltre 10 anni

Avvertenze

Nella sottovoce 1 la variabile “Tipo importo” deve assumere alternativamente i valori: “valore contabile - 21” o “fair value - 101” in base alla tipologia di attività.

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

PASSIVITÀ ASSOCIATE ALLE ATTIVITÀ POTENZIALI VINCOLATE	Valuta	Tipo importo
1. Derivati	X	21/102/103
1.1 Derivati <i>over the counter</i>	X	21/102/103
2. Depositi	-	-
2.1 Pronti contro termine	X	21/102/103
2.1.1 Pronti contro termine con banche centrali	X	21/102/103
2.2 Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine	X	21/102/103
2.2.1 Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine con banche centrali	X	102/103
3. Titoli di debito emessi	X	21/102/103
3.1 Obbligazioni bancarie garantite	X	21/102/103
3.2. Titoli ABS	X	21/102/103
4. Altre fonti di attività vincolate	X	24/101/102/103

LEGENDA**TIPO IMPORTO**

21	Valore contabile
24	Valore nominale
101	Fair value
102	Valore addizionale scenario 1
103	Valore addizionale scenario 2

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

VALUTA

Tutti i valori previsti, incluso 777

Avvertenze

L'informazione "Tipo importo: valore addizionale scenario 2" deve essere fornito solo in corrispondenza dell'informazione "Valuta: diversa da 777"

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

PASSIVITÀ RELATIVE ALLE OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE	Codice identificativo cover pool	Compliance art. 129	Classe di attività primaria del cover pool	Nome CRA	Rating	Tipo Importo
1. Ammontare alla data di segnalazione	X	X	X	-	-	21/24/105
2. T + 6 mesi	X	-	-	-	-	24
3. T + 12 mesi	X	-	-	-	-	24
4. T + 2 anni	X	-	-	-	-	24
5. T + 5 anni	X	-	-	-	-	24
6. T + 10 anni	X	-	-	-	-	24
7. Cover pool: posizioni in derivati con valore di mercato negativo	X	-	-	-	-	105
8. Agenzia di rating 1	X	-	-	X	X	-
9. Agenzia di rating 2	X	-	-	X	X	-
10. Agenzia di rating 3	X	-	-	X	X	-

Avvertenze

Nella voce 1, le variabili “Compliance art. 129” e “Classe di attività primaria del cover pool” vanno fornite esclusivamente in corrispondenza della variabile “Tipo importo=24)

E’ prevista l’indicazione per ciascun gruppo (variabile aperta: “codice identificativo cover pool”)

La variabile “rating” non va fornita in corrispondenza di “Nome: non disponibile”.

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

Le voci 8, 9 e 10 devono essere compilate riportando convenzionalmente il valore “1” in corrispondenza del campo importo.

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

COVER POOL	Codice identificativo cover pool	Tipo importo cover pool
1. Ammontare alla data di segnalazione	X	21/24/104/105
2. T + 6 mesi	X	24
3. T + 12 mesi	X	24
4. T + 2 anni	X	24
5. T + 5 anni	X	24
6. T + 10 anni	X	24
7. Cover pool: posizioni in derivati con valore di mercato positivo	X	105

Avvertenze

E' prevista l'indicazione per ciascun gruppo (variabile aperta: "codice identificativo cover pool")

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

COVER POOL: AMMONTARE IN ECCESSO RISPETTO AI REQUISITI MINIMI DI COPERTURA	Codice identificativo cover pool	Nome CRA	Tipo importo
1. Secondo il pertinente regime regolamentare delle Obbligazioni bancarie garantite	X	-	24/104/105
2. Secondo la metodologia delle agenzie di rating per assicurare l'attuale rating esterno delle Obbligazioni bancarie garantite – Agenzia di rating 1	X	X	24/104/105
3. Secondo la metodologia delle agenzie di rating per assicurare l'attuale rating esterno delle Obbligazioni bancarie garantite – Agenzia di rating 2	X	X	24/104/105
4. Secondo la metodologia delle agenzie di rating per assicurare l'attuale rating esterno delle Obbligazioni bancarie garantite – Agenzia di rating 3	X	X	24/104/105

LEGENDA

CODICE IDENTIFICATIVO COVER POOL

COMPLIANCE ART. 129

1 Si
2 No

CLASSE DI ATTIVITÀ PRIMARIA DEL COVER POOL

NOME CRA

RATING

TIPO IMPORTO

21 Valore contabile
24 Valore nominale
104 Valore asset specific

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

105 Market value

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

PASSIVITÀ FINANZIARIE ASSOCIATE ALLE ATTIVITÀ VINCOLATE - RIPARTITE PER FORMA TECNICA	Forma tecnica dell'attività	Tipo importo
1. Finanziamenti da banca centrale	X	21
2. Derivati su mercati regolamentati	X	21
3. Derivati <i>over the counter</i>	X	21
4. Pronti contro termine passivi	X	21
5. Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine passivi	X	21
6. Obbligazioni bancarie garantite emesse	X	21
7. Titoli ABS emessi	X	21
8. Titoli di debito emessi diversi dalle Obbligazioni bancarie garantite e dagli ABS	X	21
9. Altre passività finanziarie	X	21/24/101

LEGENDA**FORMA TECNICA
DELL'ATTIVITÀ**

260 finanziamenti a vista;

204 titoli di capitale;

203 titoli di debito: totale;

99 titoli di debito: obbligazioni bancarie garantite ;

261 titoli di debito: obbligazioni bancarie garantite emesse da altre
società' appartenenti al gruppo;

262 titoli di debito: ABS

– 18.1.26 –

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

- 263 titoli di debito: ABS emessi da altre società appartenenti al gruppo;
- 264 titoli di debito: emessi da amministrazioni pubbliche;
- 265 titoli di debito: emessi da intermediari finanziari;
- 266 titoli di debito: emessi da società non finanziarie;
- 267 finanziamenti diversi da quelli a vista: verso banche centrali e amministrazioni pubbliche;
- 268 finanziamenti diversi da quelli a vista: verso intermediari finanziari;
- 269 finanziamenti diversi da quelli a vista: verso controparti non finanziarie;
- 270 finanziamenti diversi da quelli a vista verso controparti non finanziarie: mutui ipotecari;
- 271 finanziamenti diversi da quelli a vista: verso famiglie;
- 272 finanziamenti diversi da quelli a vista verso famiglie: mutui ipotecari;
- 273 altre attività;

Tipo importo

- 21 Valore contabile
- 24 Valore nominale
- 101 Fair value
- 104 Valore asset specific
- 105 Market value

AVVERTENZE

Nella sottovoce 9 la variabile “Tipo importo” deve assumere alternativamente i valori: “valore contabile - 21” , “fair value - 101” o “valore nominale - 24” in base alla tipologia di passività finanziaria

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

ATTIVITÀ VINCOLATE RIPARTITE PER FORMA TECNICA	Forma tecnica dell'attività	Forma tecnica della passività associata	Tipo importo
1. Finanziamenti a vista	-	X	21
2. Titoli di capitale	-	X	21
3. Titoli di debito	-	X	21
3.1 Obbligazioni bancarie garantite	-	X	21
3.2 Obbligazioni bancarie garantite emesse da altre società appartenenti al gruppo	-	X	21
3.3 ABS	-	X	21
3.4 ABS emessi da altre società appartenenti al gruppo	-	X	21
3.5 Emessi da amministrazioni pubbliche	-	X	21
3.6 Emessi da intermediari finanziari	-	X	21
3.7 Emesso da società non finanziarie	-	X	21
4. Finanziamenti diversi da quelli a vista verso banche centrali e amministrazioni pubbliche	-	X	21
5. Finanziamenti diversi da quelli a vista: verso controparti finanziarie	-	X	21
6. Finanziamenti diversi da quelli a vista: verso controparti non finanziarie	-	X	21
6.1 Mutui ipotecari	-	X	21
7. Finanziamenti diversi da quelli a vista: famiglie	-	X	21
7.1 Mutui ipotecari	-	X	21

PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

8. Altre attività'	-	X	21
9. Totale delle attività vincolate – Ammissibili BCE	X	-	21

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

ATTIVITÀ NON VINCOLATE	Forma tecnica dell'attività	Tipo importo
1. Attività non vincolate	X	21
2. Attività non vincolate - Ammissibili BCE	X	21

LEGENDA**FORMA TECNICA DELLA PASSIVITÀ ASSOCIATA**

276	Finanziamenti da banca centrale
277	Derivati su mercati regolamentati
278	Derivati over the counter
279	Pronti contro termine passivi
280	Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine passivi
281	Obbligazioni bancarie garantite emesse
282	Titoli abs emessi
283	Titoli di debito emessi diversi da obbligazioni bancarie garantite e titoli abs
284	Altre passività finanziarie

FORMA TECNICA DELL'ATTIVITÀ

260	finanziamenti a vista;
204	titoli di capitale;
203	titoli di debito: totale;
99	titoli di debito: obbligazioni bancarie garantite ;
261	titoli di debito: obbligazioni bancarie garantite emesse da altre società' appartenenti al gruppo;
262	titoli di debito: ABS
263	titoli di debito: ABS emessi da altre società appartenenti al gruppo;
264	titoli di debito: emessi da amministrazioni pubbliche;
265	titoli di debito: emessi da intermediari finanziari;

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

- 266 titoli di debito: emessi da società non finanziarie;
- 267 finanziamenti diversi da quelli a vista: verso banche centrali e amministrazioni pubbliche;
- 268 finanziamenti diversi da quelli a vista: verso intermediari finanziari;
- 269 finanziamenti diversi da quelli a vista: verso controparti non finanziarie;
- 270 finanziamenti diversi da quelli a vista verso controparti non finanziarie: mutui ipotecari;
- 271 finanziamenti diversi da quelli a vista: verso famiglie;
- 272 finanziamenti diversi da quelli a vista verso famiglie: mutui ipotecari;
- 273 altre attività;

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

PASSIVITÀ FINANZIARIE ASSOCIATE ALLE GARANZIE RICEVUTE VINCOLATE - RIPARTITE PER FORMA TECNICA	Forma tecnica dell'attività	Tipo importo
1. Finanziamenti da banca centrale	X	21
2. Derivati su mercati regolamentati	X	21
3. Derivati <i>over the counter</i>	X	21
4. Pronti contro termine passivi	X	21
5. Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine passivi	X	21
6. Obbligazioni bancarie garantite emesse	X	21
7. Titoli ABS emessi	X	21
8. Titoli di debito emessi diversi dalle Obbligazioni bancarie garantite e dagli ABS	X	21
9. Altre passività finanziarie	X	21/24/101

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

GARANZIE RICEVUTE VINCOLATE - RIPARTITE PER FORMA TECNICA	Forma tecnica dell'attività	Forma tecnica della passività associata	Tipo importo
1. Finanziamenti a vista	-	X	101
2. Titoli di capitale	-	X	101
3. Titoli di debito	-	X	101
3.1 Obbligazioni bancarie garantite	-	X	101
3.2 Obbligazioni bancarie garantite emessi da altre società appartenenti al gruppo	-	X	101
3.3 ABS	-	X	101
3.4 ABS emessi da altre società appartenenti al gruppo	-	X	101
3.5 Emessi da amministrazioni pubbliche	-	X	101
3.6 Emessi da intermediari finanziari	-	X	101
3.7 Emesso da società non finanziarie	-	X	101
4. Finanziamenti diversi da quelli a vista verso banche centrali e amministrazioni pubbliche	-	X	101
5. Finanziamenti diversi da quelli a vista: verso controparti finanziarie	-	X	101
6. Finanziamenti diversi da quelli a vista: verso controparti non finanziarie	-	X	101
6.1 Mutui ipotecari	-	X	101
7. Finanziamenti diversi da quelli a vista: famiglie	-	X	101
7.1 Mutui ipotecari	-	X	101
8. Altre garanzie ricevute	-	X	101

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

9. Propri titoli di debito emessi diversi dalle Obbligazioni bancarie garantite e dagli ABS	-	X	101
10. Totale delle garanzie ricevute vincolate – Ammissibili BCE	X	-	101

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

GARANZIE RICEVUTE NON VINCOLATE	Forma tecnica dell'attività	Tipo importo
1. Garanzie ricevute non vincolate	X	101
2. Totale delle garanzie ricevute non vincolate - Ammissibili BCE	X	101

LEGENDA

FORMA TECNICA DELLA PASSIVITÀ ASSOCIATA

- 276 Finanziamenti da banca centrale
- 277 Derivati su mercati regolamentati
- 278 Derivati over the counter
- 279 Pronti contro termine passivi
- 280 Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine passivi
- 281 Obbligazioni bancarie garantite emesse
- 282 Titoli abs emessi
- 283 Titoli di debito emessi diversi da obbligazioni bancarie garantite e titoli abs
- 284 Altre passività finanziarie

FORMA TECNICA DELL'ATTIVITÀ

- 260 finanziamenti a vista;
- 204 titoli di capitale;
- 203 titoli di debito: totale;
- 99 titoli di debito: obbligazioni bancarie garantite ;
- 261 titoli di debito: obbligazioni bancarie garantite emesse da altre società' appartenenti al gruppo;
- 262 titoli di debito: ABS
- 263 titoli di debito: ABS emessi da altre società appartenenti al gruppo;
- 264 titoli di debito: emessi da amministrazioni pubbliche;
- 265 titoli di debito: emessi da intermediari finanziari;
- 266 titoli di debito: emessi da società non finanziarie;

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 1 – Schema della segnalazione relativa alle attività vincolate

- 267 finanziamenti diversi da quelli a vista: verso banche centrali e amministrazioni pubbliche;
- 268 finanziamenti diversi da quelli a vista: verso intermediari finanziari;
- 269 finanziamenti diversi da quelli a vista: verso controparti non finanziarie;
- 270 finanziamenti diversi da quelli a vista verso controparti non finanziarie: mutui ipotecari;
- 271 finanziamenti diversi da quelli a vista: verso famiglie;
- 272 finanziamenti diversi da quelli a vista verso famiglie: mutui ipotecari;
- 274 altre garanzie ricevute;
- 275 propri titoli di debito emessi diversi da Obbligazioni bancarie garantite o ABS

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

Sottosezione:

2 – ISTRUZIONI PER LA COMPILAZIONE DELLO SCHEMA DI RILEVAZIONE

PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione

2. ISTRUZIONI PER LA COMPILAZIONE DELLO SCHEMA DI RILEVAZIONE – ATTIVITA' VINCOLATE

2.1 Premessa

Nella compilazione degli schemi segnaletici occorre fare riferimento alle corrispondenti istruzioni fornite per le attività vincolate su base individuale (cfr. sezione 17 della presente circolare), opportunamente adattate per tenere conto delle specificità del calcolo su base consolidata.

PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

Parte I

Sezione: 18 – Attività vincolate su base consolidata

Sottosezione: 2 – Istruzioni per la compilazione dello schema di rilevazione
