

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SULL'ATTIVITA' DEGLI OPERATORI DEL MERCATO MOBILIARE

I SEZIONE: DATI PATRIMONIALI

B A S E I N F .	1.1 ATTIVO	VOCE	R	D	V	V	S	T	T	C	M	C	T	C	C	T	T	P	N
		SOTVOC	E	I	A	I	T	I	A	E	R	A	I	A	O	D	I	E	O
			0	0	0	0	3	3	5	5	5	5	5	5	9	9	9		
	CODICE VARIABILE		7	4	7	5	0	3	6	1	4	5	8	9	0	4	1		
	- CREDITI PER OPERAZIONI DI PRONTI CONTRO TERMINE.	04	X	X		X													T
	- CREDITI PER FINANZIAMENTI.	06	X	X		X													T
	- ALTRI CREDITI.	10	X	X		X													T
T	CREDITI VERSO PROMOTORI FINANZIARI	43818	00	X	X		X												T
T	DERIVATI DI COPERTURA.	43820	00	1	1														T
	ADEGUAMENTO DI VALORE DELLE ATTIVITA' OGGETTO DI																		
T	COPERTURA GENERICA. (501).	43822	00	1	1														T
	<small>(501) segnalazioni che possono assumere il segno negativo</small>																		
T	PARTECIPAZIONI:	43824																	
	- IMPRESE CONTROLLATE IN VIA ESCLUSIVA.	02	X	1															T
	- IMPRESE CONTROLLATE IN MODO CONGIUNTO.	04	X	1															T
	- IMPRESE SOTTOPOSTE A INFLUENZA NOTEVOLE.	06	X	1															T
T	ATTIVITA' MATERIALI:	43826																	
	- TERRENI	02	1	1															T
	- FABBRICATI	04	1	1															T
	- MOBILI.	06	1	1															T
	- STRUMENTALI.	08	1	1															T
	- ALTRE ATTIVITA'.	10	1	1															T
T	ATTIVITA' IMMATERIALI:	43828																	
	- AVVIAMENTO	02	1	1															T
	- SOFTWARE.	04	1	1															T
	- ALTRE ATTIVITA'.	06	1	1															T
T	ATTIVITA' FISCALI:	43830																	
	- CORRENTI.	02	1	1															T
	- ANTICIPATE.	04	1	1															T
T	CAPITALE SOTTOSCRITTO E NON VERSATO.	43832	00	1	1														T
T	AZIONI PROPRIE	43834	00	1	1														T
	ATTIVITA' NON CORRENTI E GRUPPI DI ATTIVITA' IN VIA DI																		
T	DISMISSIONE.	43836	00	1	1														T
T	ALTRE ATTIVITA':	43838																	
	- DEPOSITI PRESSO ORGANISMI DI COMPENSAZIONE																		
	E GARANZIA.	02	X	X															T
	- ALTRE.	04	1	X															T
T	DISAVANZI DI ESERCIZI PRECEDENTI	43840	00	1	1														T
T	PERDITA DELL'ESERCIZIO	43842	00	1	1														T

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SULL'ATTIVITA' DEGLI OPERATORI DEL MERCATO MOBILIARE

II SEZIONE: DATI DI CONTO ECONOMICO E ALTRE INFORMAZIONI

B A S E	I N F .	2.2 COMPONENTI POSITIVE DI REDDITO	VOCE	R E S I D E N Z A	D I V I S A	V A L U T A	V I T A R E S I D U A	S T A T O R E S I D U O	T I P O I M P O R T O	T I P O P O S I T I O N E	C A T E G O R I E M O B I L I .	M E R C O N E G O Z I A Z I O N E	C A T E G O R I E M O B I L I .	T I P O L O C A T I O N E	C A T E G O R I E M O B I L I .	C O D I C O N T R O P A R T E	C O D I C O N T R O P A R T E	T I P O G E S T I O N E	T I P O S O G G E T T O	P E R I O D I C I T A	N O T E																	
																						SOTVOC																
CODICE VARIABILE																	0 7	0 4	0 7	0 5	3 5	3 0	5 1	5 4	5 5	5 8	5 9	9 0	9 0	9 4								
T		PROFITTI GENERATI DALL'ATTIVITA' DI NEGOZIAZIONE:	43950																																			
		- SU TITOLI DI STATO.	02	1	1																		S															
		- SU ALTRI TITOLI DI DEBITO.	04	1	1																		S															
		- SU TITOLI DI CAPITALE.	06	1	1																		S															
		- SU QUOTE DI O.I.C.R.	08	1	1																		S															
		- SU STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI.	10	1	1																		S															
		- SU ALTRE ATTIVITA' FINANZIARIE.	12	1	1																		S															
		- SU PASSIVITA' FINANZIARIE	14	1	1																		S															
T		PLUSVALENZE GENERATE DALL'ATTIVITA' DI NEGOZIAZIONE:	43952																																			
		- SU TITOLI DI STATO.	02	1	1																		S															
		- SU ALTRI TITOLI DI DEBITO.	04	1	1																		S															
		- SU TITOLI DI CAPITALE.	06	1	1																		S															
		- SU QUOTE DI O.I.C.R.	08	1	1																		S															
		- SU STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI.	10	1	1																		S															
		- SU ALTRE ATTIVITA' FINANZIARIE.	12	1	1																		S															
		- SU PASSIVITA' FINANZIARIE	14	1	1																		S															
T		PROFITTI GENERATI DALL'ATTIVITA' DI COPERTURA	43954	00	1	1																	S															
T		PROFITTI GENERATI DA ATTIVITA' FINANZIARIE VALUTATE AL FAIR VALUE:	43956																																			
		- SU TITOLI DI STATO.	02	1	1																		S															
		- SU ALTRI TITOLI DI DEBITO.	04	1	1																		S															
		- SU TITOLI DI CAPITALE.	06	1	1																		S															
		- SU QUOTE DI O.I.C.R.	08	1	1																		S															
		- SU ALTRE ATTIVITA' FINANZIARIE.	10	1	1																		S															
T		PROFITTI GENERATI DA PASSIVITA' FINANZIARIE VALUTATE AL FAIR VALUE:	43958																																			
		- SU DEBITI.	02	1	1																		S															
		- SU TITOLI.	04	1	1																		S															
		- SU ALTRE PASSIVITA'	06	1	1																		S															
T		PROFITTI GENERATI DALLA CESSIONE O DAL RIACQUISTO DI:	43960																																			
		- ATTIVITA' DISPONIBILI PER LA VENDITA.	02	1	1																		S															
		- ATTIVITA' DETENUTE SINO A SCADENZA.	04	1	1																		S															
		- ALTRE ATTIVITA' FINANZIARIE.	06	1	1																		S															
		- PASSIVITA' FINANZIARIE.	08	1	1																		S															
T		COMMISSIONI ATTIVE:	43962																																			
		- NEGOZIAZIONE STRUMENTI FINANZIARI.	02	X	1																		S															
		- COLLOCAMENTO CON GARANZIA.	04	X	1																		S															
		- COLLOCAMENTO SENZA GARANZIA.	06	X	1																		S															
		- GESTIONI PROPRIE.	10	X	1														X				S															
		- GESTIONI DI TERZI.	12	X	1														X				S															
		- RACCOLTA ORDINI.	14	X	1																		S															

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SULL'ATTIVITA' DEGLI OPERATORI DEL MERCATO MOBILIARE

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA

B A S E I N F .	4.1 PATRIMONIO DI VIGILANZA	VOCE	R E S I D E N Z A	D I V I S A	V I T A	V A L U T A	C A T E G .	I N D .	T I P O L .	M E R C .	C A T .	T I P O G E S T I O N E	T E M P O	T I P O	T I P O	C O D .	P E R I O D I C I T A	N O T E	
																			SOTVOC
	CODICE VARIABILE																		
	PATRIMONIO DI BASE - ELEMENTI POSITIVI					0	0	5	5	5	5	5	9	2	3	3	9		
S	CAPITALE SOCIALE SOTTOSCRITTO.	44170	02	1	1													M	
	PATRIMONIO DI BASE - ELEMENTI POSITIVI																		
S	RISERVE:(501)	44224	02	1	1													M	
	<small>(501) - segnalazioni che possono assumere il segno negativo</small>																		
	PATRIMONIO DI BASE - ELEMENTI POSITIVI																		
S	UTILE DEL PERIODO.	44243	02	1	1													M	
	PATRIMONIO DI BASE - ELEMENTI POSITIVI																		
S	STRUMENTI INNOVATIVI E NON INNOVATIVI DI CAPITALE. . .	44244	02	1	1													M	
	PATRIMONIO DI BASE - ELEMENTI POSITIVI																		
S	ALTRI ELEMENTI POSITIVI DEL PATRIMONIO DI BASE	44225	02	1	1													M	
	PATRIMONIO DI BASE - ELEMENTI NEGATIVI																		
S	IMPORTI DA VERSARE A SALDO AZIONI	44182	02	1	1													M	
	PATRIMONIO DI BASE - ELEMENTI NEGATIVI:																		
S	AZIONI PROPRIE	44183	02	1	1													M	
	PATRIMONIO DI BASE - ELEMENTI NEGATIVI:																		
S	AVVIAMENTO	44184	02	1	1													M	
	PATRIMONIO DI BASE - ELEMENTI NEGATIVI:																		
S	ALTRE ATTIVITA' IMMATERIALI	44185	02	1	1													M	
	PATRIMONIO DI BASE - ELEMENTI NEGATIVI:																		
S	PERDITE DI ESERCIZI PRECEDENTI	44186	02	1	1													M	
	PATRIMONIO DI BASE - ELEMENTI NEGATIVI:																		
S	PERDITE DI RILEVANTE ENTITA' DELL'ESERCIZIO IN CORSO	44200	02	1	1													M	
	PATRIMONIO DI BASE - ELEMENTI NEGATIVI:																		
S	RISERVE NEGATIVE DA VALUTAZIONE SU ATTIVITA' DISPONIBILI PER LA VENDITA	44226	02	1	1													M	
	PATRIMONIO DI BASE - ELEMENTI NEGATIVI:																		
S	PLUSVALENZA CUMULATA NETTA SU ATTIVITA' MATERIALI.	44227	02	1	1													M	
	PATRIMONIO DI BASE - ELEMENTI NEGATIVI:																		
S	ALTRI ELEMENTI NEGATIVI DEL PATRIMONIO DI BASE.	44228	02	1	1													M	
	PATRIMONIO SUPPLEMENTARE DI SECONDO LIVELLO																		
	RISERVE POSITIVE DA VALUTAZIONE SU ATTIVITA' DISPONIBILI																		
S	PER LA VENDITA (QUOTA COMPUTABILE).	44236	02	1	1													M	

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SULL'ATTIVITA' DEGLI OPERATORI DEL MERCATO MOBILIARE

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA

B A S E	I N F .	4.1 PATRIMONIO DI VIGILANZA	VOCE	R E S I D E N Z A	D I V I S A	V I T A	V A L U T A	C A T E G V A L	I N D Q U O T A Z I O N E	T I P O L O P P E R A Z I O N E	M E R C N E G O Z I A Z .	C A T E G E M I T T E N T I	C A T C O N T R O P A R T E	T I P O G E S T I O N E	T E M P O I N A D E M P .	T I P O I M P O R T O	T I P O T A S S O	C O D N U M C O N T R O P .	P E R I O D I C I T A '	N O T E		
			SOTVOC																			
		CODICE VARIABILE					0 4 0	0 0 7	5 5 1	5 5 2	5 5 8	5 5 4	5 5 5	5 5 9	9 0 6	2 9 4	3 5 0	3 5 7	3 6 3	9 0 4		
		PATRIMONIO SUPPLEMENTARE DI SECONDO LIVELLO																				
		RISERVE POSITIVE DA VALUTAZIONE: ALTRE COMPONENTI																				
S		COMPUTABILI	44237	02	1	1																M
		PATRIMONIO SUPPLEMENTARE DI SECONDO LIVELLO																				
		STRUMENTI INNOVATIVI E NON INNOVATIVI DI CAPITALE NON																				
S		COMPUTATI NEL PATRIMONIO DI BASE.	44245	02	1	1																M
		PATRIMONIO SUPPLEMENTARE DI SECONDO LIVELLO																				
		PASSIVITA' SUBORDINATE DI SECONDO LIVELLO E STRUMENTI																				
S		IBRIDI DI PATRIMONIALIZZAZIONE.	44202	02	1	1																
		PATRIMONIO SUPPLEMENTARE DI SECONDO LIVELLO																				
		PLUSVALENZA CUMULATA NETTA SU ATTIVITA' MATERIALI (QUOTA																				
S		COMPUTABILE).	44238	02	1	1																M
		PATRIMONIO SUPPLEMENTARE DI SECONDO LIVELLO																				
S		ALTRI ELEMENTI POSITIVI DEL PATRIMONIO SUPPLEMENTARE.	44239	02	1	1																M
		PATRIMONIO SUPPLEMENTARE DI SECONDO LIVELLO																				
S		ECCEDEXENZA.	44204	02	1	1																M
		PATRIMONIO SUPPLEMENTARE DI TERZO LIVELLO																				
S		PROVENTI/PERDITE NETTI DA NEGOZIAZIONE. (501)	44178	02	1	1			X1													
		<small>(501) - segnalazioni che possono assumere il segno negativo</small>																				
		PATRIMONIO SUPPLEMENTARE DI TERZO LIVELLO. (501)																				
S		PLUS/MINUSVALENZE NETTE.	44179	02	1	1			X1													M
		<small>(501) - segnalazioni che possono assumere il segno negativo</small>																				
		PATRIMONIO SUPPLEMENTARE DI TERZO LIVELLO																				
S		PASSIVITA' SUBORDINATE DI TERZO LIVELLO	44205																			
		- 150 per cento		02	1	1																M
		- 250 per cento		04	1	1																M
		PASSIVITA' SUBORDINATE DI TERZO LIVELLO																				
		EFFETTO FISCALE, AMMONTARE STIMATO DI DIVIDENDI																				
S		E ALTRI PREVEDIBILI ONERI	44181	02	1	1																M
		ELEMENTI DA DEDURRE																				
		PARTECIPAZIONI, ATTIVITA' SUBORDINATE E																				
S		STRUMENTI IBRIDI DI PATRIMONIALIZZAZIONE.	44188	02	1	1																M
		ELEMENTI DA DEDURRE																				
		COMPONENTI NON NEGOZIABILI DELL'ATTIVO E																				
S		ALTRI ELEMENTI DA DEDURRE.	44206	02	1	1																M
		ELEMENTI DA DEDURRE																				
S		ALTRI ELEMENTI DA DEDURRE.	44242	02	1	1																M

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SULL'ATTIVITA' DEGLI OPERATORI DEL MERCATO MOBILIARE

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA

B A S E I N F .	4.1 PATRIMONIO DI VIGILANZA	VOCE	R E S I D E N Z A	D I V I S A	V I T A	V A L U T A	C A T E G .	I N D .	T I P O L .	M E R C .	C A T E G .	C A T .	T I P O	T E M P O	T I P O	T I P O	C O D .	P E R I O D I C I T A	N O T E			
		SOTVOC																		RESIDUA	VALUTAZIONE	OPERAZIONE
	CODICE VARIABILE					0 4 0	0 7	5 1	5 2	5 8	5 4	5 5	5 9	9 6	2 4	3 0	3 5	3 7	3 6	9 0	4	
S	TOTALI - TOTALE PATRIMONIO DI BASE (501)	44208	02	1	1																	
	(501) - segnalazioni che possono assumere il segno negativo																					
	TOTALI																					M
S	TOTALE PATRIMONIO SUPPLEMENTARE DI SECONDO LIVELLO.	44209	02	1	1																	
	TOTALI																					
S	TOTALE PATRIMONIO SUPPLEMENTARE DI TERZO LIVELLO. . . (501)	44213	02	1	1																	M
	(501) - segnalazioni che possono assumere il segno negativo																					
S	TOTALI - TOTALE ELEMENTI DA DEDURRE	44214	02	1	1																	M
	TOTALI - PATRIMONIO DI VIGILANZA(501)	44215	02	1	1																	M
	(501) - segnalazioni che possono assumere il segno negativo																					
S	TOTALI - PATRIMONIO RETTIFICATO DI SECONDO LIVELLO . . (501)	44216	02	1	1																	M
	(501) - segnalazioni che possono assumere il segno negativo																					
	ALTRE INFORMAZIONI																					
S	CAPITALE DELIBERATO	44197	02	1	1																	M
	ALTRE INFORMAZIONI																					
S	ALTRE POSTE DI NATURA PATRIMONIALE. (501)	44198	02	1	1																	M
	(501) - segnalazioni che possono assumere il segno negativo																					
	ALTRE INFORMAZIONI																					
	COMPOSIZIONE DEI PROVENTI/PERDITE NETTE E DELLE																					
S	PLUS/MINUSVALENZE NETTE RELATIVI ALL'ESERCIZIO IN CORSO(501)	44218	02	1	1			X1														M
	(501) - segnalazioni che possono assumere il segno negativo																					

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SULL'ATTIVITA' DEGLI OPERATORI DEL MERCATO MOBILIARE

V SEZIONE: COEFFICIENTI PATRIMONIALI

B A S E I N F .	5.3 RISCHIO SPECIFICO SU TITOLI DI DEBITO	VOCE	R E S I D E N Z A	D I V I S A	V I T A	V A L U T A	C A T E G .	I N D .	I N D .	T I P O L .	M E R C .	C A T E G .	C A T E G .	T I P O	T E M P O	T I P O	T I P O	T I P O	C O D .	P E R I O D I C I T A	N O T E
		SOTVOC																			
CODICE VARIABLE																					
S	TITOLI DI DEBITO 0%	44252																			
	- POSIZIONI LUNGHE	02	1	1																	M
	- POSIZIONI CORTE.	04	1	1																	M
S	TITOLI DI DEBITO QUALIFICATI	44253																			
	- POSIZIONI LUNGHE	02	1	1	X																M
	- POSIZIONI CORTE.	04	1	1	X																M
S	TITOLI DI DEBITO AD ALTO RISCHIO:	44254																			
	- POSIZIONI LUNGHE	02	1	1																	M
	- POSIZIONI CORTE.	04	1	1																	M
S	ALTRI TITOLI DI DEBITO:	44256																			
	- POSIZIONI LUNGHE	02	1	1																	M
	- POSIZIONI CORTE.	04	1	1																	M

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SULL'ATTIVITA' DEGLI OPERATORI DEL MERCATO MOBILIARE

V SEZIONE: COEFFICIENTI PATRIMONIALI

B A S E I N F .	5.5 RISCHIO DI POSIZIONE SU PARTI DI O.I.C.R.	VOCE	R E S I D E N Z A	D I V I S A	V I T A	V A L U T A	C A T E G V A L	I N D Q U O T A Z I O N E	T I P O L O P P E R A Z I O N E	M E R C O N E G O Z I A Z.	C A T E G E M I T T E N T I	C A T C O N T R O P A R T E	T I P O G E S T I O N E	T E M P O I N A D D E M P	T I P O I M P O R T O	T I P O T A S S O	T I P O L P O S I Z I O N E	C O D N U M C O N T R O P	P E R I O D I C I T A	N O T E
		SOTVOC																		
					0	0	5	5	5	5	5	5	9	2	3	3	3	9		
					4	0	5	5	5	5	5	5	0	6	4	0	7	0		
CODICE VARIABLE																				
S	TITOLI DI DEBITO	44262																		
	- POSIZIONI LUNGHE	02	1	1																M
	- POSIZIONI CORTE.	04	1	1																M
S	TITOLI DI CAPITALE	44263																		
	- POSIZIONI LUNGHE	02	1	1																M
	- POSIZIONI CORTE.	04	1	1																M

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SULL'ATTIVITA' DEGLI OPERATORI DEL MERCATO MOBILIARE

V SEZIONE: COEFFICIENTI PATRIMONIALI

B A S E I N F .	5.6 RISCHIO DI CAMBIO	VOCE	R E S I D E N Z A	D I V I S A	V I T A R E S I D U A	V A L U T A	C A T E G - V A L - M O B I L .	I N D - Q U O T A Z I O N E	T I P O L - O P E R A Z I O N E	M E R C - N E G O Z I A Z .	C A T E G - E M I T T E N T I	C A T - C O N T R O P A R T E	T I P O G E S T I O N E	T E M P O I N A D E M P .	T I P O I M P O R T O	T I P O T A S S O	T I P O L - P O S I Z I O N E	C O D - N U M - C O N T R O P .	P E R I O D I C I T A '	N O T E	
		SOTVOC																			
CODICE VARIABLE						0 4 0 7	0 0 7	5 5 1	5 5 2	5 5 8	5 5 4	5 5 5	5 5 9	9 0 6	2 9 4	3 5 0	3 5 7	3 6 3	9 0 4		
S	ATTIVITA' E PASSIVITA' IN VALUTA E ORO:	44250																			
	- POSIZIONI LUNGHE IN VALUTA	02	1	1		X															M
	- POSIZIONI CORTE IN VALUTA	04	1	1		X															M
	- POSIZIONE NETTA IN ORO	06	1	1																	M
	- ALTRE QUOTE DI OICR - VALUTE DISTINTE.	08	1	1																	M

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SULL'ATTIVITA' DEGLI OPERATORI DEL MERCATO MOBILIARE

V SEZIONE: COEFFICIENTI PATRIMONIALI

B A S E I N F .	5.7 RISCHIO DI REGOLAMENTO	VOCE	R E S I D E N Z A	D I V I S A	V I T A R E S I D U A	V A L U T A	C A T E G . V A L . M O B I L .	I N D . Q U O T A Z I O N E	T I P O L . O P E R A Z I O N E	M E R C . N E G O Z I A Z .	C A T E G . E M I T T E N T I	C A T . C O N T R O P A R T E	T I P O . G E S T I O N E	T E M P O . I N A D E M P .	T I P O . I M P O R T O	T I P O . T A S S O	T I P O L . P O S I Z I O N E	C O D . N U M . C O N T R O P .	P E R I O D I C I T A .	N O T E	
		SOTVOC																			
CODICE VARIABLE					0	0	5	5	5	5	5	5	9	2	3	3	3	9			
					4	0	7	5	5	5	5	5	9	0	4	5	7	6	0		
S	OPERAZIONI NON REGOLATE:	44260																			
	- DIFFERENZIALE		02	1	1									X							M

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SULL'ATTIVITA' DEGLI OPERATORI DEL MERCATO MOBILIARE

V SEZIONE: COEFFICIENTI PATRIMONIALI

B A S E I N F .	5.8 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE	VOCE	R E S I D E N Z A	D I V I S A	V I T A R E S I D U A	V A L U T A	C A T E G V A L M O B I L .	I N D Q U O T A Z I O N E	T I P O L O P E R A Z I O N E	M E R C N E G O Z I A Z .	C A T E G E M I T T E N T I	C A T C O N T R O P A R T E	T I P O G E S T I O N E	T E M P O I N A D D E M P .	T I P O I M P O R T O	T I P O T A S S O	T I P O L P O S I Z I O N E	C O D N U M C O N T R O P .	P E R I O D I C I T A	N O T E																	
		SOTVOC																																			
CODICE VARIABLE																			0	0	5	5	5	5	5	5	5	5	5	9	2	3	3	3	9		
		4	0	7	0																																
<input checked="" type="checkbox"/>	ATTIVITA' DI RISCHIO PER CASSA	44264	00	1	1											X				M																	
<input checked="" type="checkbox"/>	GARANZIE RILASCIATE E IMPEGNI A EROGARE FONDI	44265	00	1	1											X				M																	
<input checked="" type="checkbox"/>	CONTRATTI DERIVATI	44266	00	1	1											X				M																	
<input type="checkbox"/>	OPERAZIONI SFT E OPERAZIONI CON REGOLAMENTO A LUNGO																																				
<input checked="" type="checkbox"/>	TERMINE	44267	00	1	1											X				M																	
<input checked="" type="checkbox"/>	COMPENSAZIONE TRA PRODOTTI DIVERSI	44268	00	1	1											X				M																	

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SULL'ATTIVITA' DEGLI OPERATORI DEL MERCATO MOBILIARE

V SEZIONE: COEFFICIENTI PATRIMONIALI

B A S E I N F .	5.9 RISCHIO DI CONCENTRAZIONE	VOCE	R E S I D E N Z A	D I V I S A	V I T A R E S I D U A	V A L U T A	C A T E G V A L .	I N D I C E Q U O T A Z I O N E	T I P O L O P E R A Z I O N E	M E R C O N E G O Z I A Z I O N E	C A T E G E M I T T E N T I	C A T E C O N T R O P A R T E	T I P O G E S T I O N E	T E M P O I N A D E M P .	T I P O I M P O R T O	T I P O T A S S O	T I P O L P O S I Z I O N E	C O D I C E C R	P E R I O D I C I T A	N O T E																	
		SOTVOC																																			
CODICE VARIABILE																		0	0	5	5	5	5	5	5	5	5	5	9	2	3	3	3	2			
			4			0		5	5	5	5	5	0	6	4	5	6	1																			
S	PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE DI VIGILANZA:	44292																																			
	- POSIZIONI LUNGHE NETTE IN TITOLI	02	1	1											X		X	X	M																		
	- POSIZIONI RELATIVE AL RISCHIO DI CONTROPARTE.	04	1	1											X		X	X	M																		
	- POSIZIONI RELATIVE AL RISCHIO DI REGOLAMENTO.	06	1	1											X		X	X	M																		
	ATTIVITA' DIVERSE DAL PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE																																				
S	DI VIGILANZA:	44293																																			
	- CREDITI E TITOLI	02	1	1											X		X	X	M																		
	- GARANZIE RILASCIATE E IMPEGNI.	04	1	1											X		X	X	M																		
	- CONTRATTI DERIVATI E SIMILARI.	06	1	1											X		X	X	M																		
S	DETTAGLIO DEI GRANDI RISCHI: SOFFERENZE	44294	02	1	1													X	X	M																	
S	COPERTURA PATRIMONIALE AGGIUNTIVA	44295	02	1	1													X	X	M																	
S	RAPPORTO GRANDE RISCHIO/PATRIMONIO	44296	02	1	1													X	X	M																	
S	TOTALE GRANDI RISCHI/PATRIMONIO	44297	02	1	1															M																	

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SULL'ATTIVITA' DEGLI OPERATORI DEL MERCATO MOBILIARE

V SEZIONE: COEFFICIENTI PATRIMONIALI

B A S E I N F .	5.10 TRATTAMENTO DELLE OPZIONI	VOCE	R E S I D E N Z A	D I V I S A	V I T A	V A L U T A	C A T E G .	I N D .	T I P O L.	M E R C .	C A T E G .	C A T .	T I P O	T E M P O	T I P O	T I P O	C O D .	P E R I O D I C I T A	N O T E	
		SOTVOC	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A	A	NUM M.	CON TRO P.	
CODICE VARIABILE					0	0	5	5	5	5	5	5	9	2	3	3	9			
					4	0	7	1	2	8	5	5	0	6	4	7	0			
S	METODO DELTA PLUS	44306																		
	OPZIONI SU TITOLI DI CAPITALE																			
	FATTORE GAMMA	02	1	1																M
	FATTORE VEGA	04	1	1																M
	OPZIONI SU TITOLI DI DEBITO																			
	FATTORE GAMMA	06	1	1																M
	FATTORE VEGA	08	1	1																M
	ALTRE OPZIONI																			
	FATTORE GAMMA	10	1	1																M
	FATTORE VEGA	12	1	1																M
S	METODO SEMPLIFICATO	44307																		
	OPZIONI ASSOCIATE AD ALTRE POSIZIONI	02	1	1																M
	OPZIONI NON ASSOCIATE AD ALTRE POSIZIONI	04	1	1																M

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SULL'ATTIVITA' DEGLI OPERATORI DEL MERCATO MOBILIARE

V SEZIONE: COEFFICIENTI PATRIMONIALI

B A S E I N F .	5.11 ALTRI RISCHI	VOCE	R E S I D E N Z A	D I V I S A	V I T A R E S I D U A	V A L U T A	C A T E G . V A L . M O B I L .	I N D . Q U O T A Z I O N E	T I P O L . O P E R A Z I O N E	M E R C . N E G O Z I A Z .	C A T E G . E M I T T E N T I	C A T . C O N T R O P A R T E	T I P O . G E S T I O N E	T E M P O . I N A D E M P .	T I P O . I M P O R T O	T I P O . T A S S O	T I P O L . P O S S I Z I O N E	C O D . N U M . C O N T R O P .	P E R I O D I C I T A .	N O T E	
		SOTVOC																			
CODICE VARIABILE					0	0	5	5	5	5	5	5	9	2	3	3	3	9			
					4	0	7	5	5	5	5	5	5	0	6	4	5	7	6	0	
S	COSTI OPERATIVI FISSI	44290	00	1	1																M

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SULL'ATTIVITA' DEGLI OPERATORI DEL MERCATO MOBILIARE

V SEZIONE: COEFFICIENTI PATRIMONIALI

B A S E I N F .	5.12 RISCHIO OPERATIVO	VOCE	R E S I D E N Z A	D I V I S A	V I T A R E S I D U A	V A L U T A	C A T E G . V A L . M O B I L .	I N D . Q U O T A Z I O N E	T I P O L . O P E R A Z I O N E	M E R C . N E G O Z I A Z .	C A T E G . E M I T T E N T I	C A T . C O N T R O P P A R T E	T I P O G E S T I O N E	T E M P O I N A D D E M P .	T I P O I M P O R T O	T I P O T A S S O	T I P O L . P O S I Z I O N E	L I N E E B U S I N E S S	P E R I O D I C I T A ,	N O T E
		SOTVOC																		
CODICE VARIABLE					0	0	5	5	5	5	5	5	9	2	3	3	3	4		
					4	0	7	1	2	8	4	5	9	6	4	5	6	0	9	
S	MARGINE DI INTERMEDIAZIONE	44275																		
	METODO BASE:																			
	MARGINE INTERMEDIAZIONE 31.12 ANNO T	02	1	1																M
	MARGINE INTERMEDIAZIONE 31.12 ANNO T - 1	04	1	1																M
	MARGINE INTERMEDIAZIONE 31.12 ANNO T - 2	06	1	1																M
	METODO STANDARDIZZATO:																			
	MARGINE INTERMEDIAZIONE 31.12 ANNO T	10	1	1															X	M
	MARGINE INTERMEDIAZIONE 31.12 ANNO T - 1	12	1	1															X	M
	MARGINE INTERMEDIAZIONE 31.12 ANNO T - 2	14	1	1														X		M
	METODI AVANZATI:																			
	MARGINE INTERMEDIAZIONE 31.12 ANNO T	18	1	1															X	M
	MARGINE INTERMEDIAZIONE 31.12 ANNO T - 1	20	1	1															X	M
	MARGINE INTERMEDIAZIONE 31.12 ANNO T - 2	22	1	1															X	M

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SULL'ATTIVITA' DEGLI OPERATORI DEL MERCATO MOBILIARE

V SEZIONE: COEFFICIENTI PATRIMONIALI

B A S E I N F .	5.13 RIEPILOGO COPERTURE PATRIMONIALI	VOCE	R E S I D E N Z A	D I V I S A	V I T A R E S I D U A	V A L U T A	C A T E G V A L M O B I L .	I N D I C E Q U O T A Z I O N E	T I P O L O P P E R A Z I O N E	M E R C O N E G O Z I A Z I O N E	C A T E G E M I T E N T I	C A T E C O N T R O P A R T E	T I P O G E S T I O N E	T E M P O I N A D E M P .	T I P O I M P O R T O	T I P O T A S S O	T I P O L P O S I Z I O N E	C O D I C E C O N T R O P .	P E R I O D I C I T A	N O T E	
		SOTVOC																			
	CODICE VARIABILE				0	0	5	5	5	5	5	5	9	2	3	3	3	9			
	COPERTURA PATRIMONIALE PER RISCHIO				4	0	5	5	5	5	5	5	9	2	3	3	3	9			
S	GENERICO SU TITOLI DI DEBITO:	44211			4	0	5	5	5	5	5	5	9	2	3	3	3	9			
	- METODO BASATO SULLA SCADENZA		02	1	1																M
	- METODO BASATO SULLA DURATA FINANZIARIA.		04	1	1																M
	COPERTURA PATRIMONIALE PER RISCHIO																				
S	SPECIFICO SU TITOLI DI DEBITO.	44223	02	1	1																M
	COPERTURA PATRIMONIALE PER RISCHIO																				
S	GENERICO E SPECIFICO SU TITOLI DI CAPITALE.	44235	02	1	1																M
	COPERTURA PATRIMONIALE PER RISCHIO																				
S	DI POSIZIONE SU PARTI DI O.I.C.R.	44241	02	1	1																M
S	COPERTURA PATRIMONIALE PER RISCHIO DI CAMBIO	44251	02	1	1																M
S	COPERTURA PATRIMONIALE PER RISCHIO DI REGOLAMENTO	44261	02	1	1																M
	COPERTURA PATRIMONIALE PER RISCHIO																				
S	DI CREDITO E DI CONTROPARTE.	44276	02	1	1																M
	COPERTURA PATRIMONIALE AGGIUNTIVA PER RISCHIO																				
S	DI CONCENTRAZIONE	44286	02	1	1																M
	COPERTURA PATRIMONIALE PER RISCHIO																				
S	SULLE POSIZIONI IN MERCI:	44289																			
	- METODO BASATO SULLA SCADENZA		02	1	1																M
	- METODO BASATO SULLA SCADENZA AMPLIATO		03	1	1																M
	- METODO SEMPLIFICATO.		04	1	1																M
S	COPERTURA PATRIMONIALE PER LE OPZIONI:	44308																			
	- METODO DELTA-PLUS		02	1	1																M
	- METODO SEMPLIFICATO.		04	1	1																M
S	COPERTURA PATRIMONIALE PER ALTRI RISCHI.	44291	02	1	1																M
S	COPERTURA PATRIMONIALE PER RISCHIO OPERATIVO	44320	02	1	1																M
	COPERTURA PATRIMONIALE PER MODELLI INTERNI SU RISCHI DI																				
S	MERCATO.	44322	02	1	1																M
	COPERTURA PATRIMONIALE PER GARANZIA SU FONDI PENSIONE																				
S	GESTITI	44324	02	1	1																M

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SULL'ATTIVITA' DEGLI OPERATORI DEL MERCATO MOBILIARE

V SEZIONE: COEFFICIENTI PATRIMONIALI

B A S E I N F .	5.13 RIEPILOGO COPERTURE PATRIMONIALI	VOCE	R E S I D E N Z A	D I V I S A	V I T A R E S I D U A	V A L U T A	C A T E G V A L M O B I L .	I N D I C E Q U O T A Z I O N E	T I P O L O P P E R A Z I O N E	M E R C O N E G O Z I A Z I O N E	C A T E G I T E N T I	C A T C O N T R O P A R T E	T I P O G E S T I O N E	T E M P P O I N A D E M P .	T I P O I M P O R T O	T I P O T A S S O	T I P O L P O S I Z I O N E	C O D I C E N U M C O N T R O P .	P E R I O D I C I T A	N O T E	
		SOTVOC																			
CODICE VARIABLE					0	0	5	5	5	5	5	5	9	2	3	3	3	9			
	SOMMA DELLE COPERTURE PATRIMONIALI ESCLUSA				4	0	7	5	5	5	5	5	5	9	0	4					
S	QUELLA PER ALTRI RISCHI E RISCHIO OPERATIVO.....	44305	02	1	1																M
	COPERTURE PATRIMONIALI COMPLESSIVE RICHIESTE DALLA																				
S	NORMATIVA PRUDENZIALE.....	44326	02	1	1																M
S	CASI PARTICOLARI: COPERTURA PATRIMONIALE COMPLESSIVA.....	44309	02	1	1																M

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SULL'ATTIVITA' DEGLI OPERATORI DEL MERCATO MOBILIARE

VI SEZIONE: SEGNALAZIONI STATISTICHE

B A S E	I N F .	6.1 SEGNALAZIONI STATISTICHE	VOCE	R E S I D E N Z A	D I V I S A	V A L U T A	P R O V I N C I A	C O D I C E	C A T E G .	I N D .	M E R C .	C A T E G .	T I P O L .	C A T .	C O D .	T I P O	R A P P O R .	T I P O	C A N .	S E R V .	P E R I O D I C I T A	N O T E		
			SOTVOC																					
		CODICE VARIABILE						007	015	032	551	552	554	555	558	559	904	906	909	941	944	521	527	
		- OBBLIGAZIONI EMESSE DA ALTRI SOGGETTI.	10	1	1																			M
		- ALTRI STRUMENTI FINANZIARI.	12	1	1																			M
U		SERVIZI E PRODOTTI COLLOCATI:	41424																					
		- GESTIONI DI PORTAFOGLI DEL GRUPPO	02	1	1																X			M
		- GESTIONI DI PORTAFOGLI DI TERZI.	04	1	1																X			M
		- PRODOTTI ASSICURATIVI DEL GRUPPO.	06	1	1																X			M
		- PRODOTTI ASSICURATIVI DI TERZI.	08	1	1																X			M
		- NUMERO DI CLIENTI.	10	1	1																X			M
U		ATTIVITA' DI RICEZIONE E TRASMISSIONE DI ORDINI :	41426																					
		- NUMERO OPERAZIONI INTERMEDIE NEL PERIODO CON SOCIETA' DEL GRUPPO	02	1	1																X	X	X	M
		- NUMERO OPERAZIONI INTERMEDIE NEL PERIODO CON ALTRI SOGGETTI	04	1	1																X	X	X	M
		- CONTROVALORE OPERAZIONI DI ACQUISTO INTERMEDIE NEL PERIODO CON SOCIETA' DEL GRUPPO	06	1	1				X2								X				X	X	X	M
		- CONTROVALORE OPERAZIONI DI ACQUISTO INTERMEDIE NEL PERIODO CON ALTRI SOGGETTI	08	1	1				X2								X				X	X	X	M
		- CONTROVALORE OPERAZIONI DI VENDITA INTERMEDIE NEL PERIODO CON SOCIETA' DEL GRUPPO	10	1	1				X2								X				X	X	X	M
		- CONTROVALORE OPERAZIONI DI VENDITA INTERMEDIE NEL PERIODO CON ALTRI SOGGETTI	12	1	1				X2								X				X	X	X	M
		- NUMERO DI CLIENTI.	14	1	1																			M
		- INOPERATIVITA' NEL MESE.	99	1	1																			M
U		ATTIVITA' DI CONSULENZA:	41428																					
		- NUMERO CONTRATTI IN ESSERE	02	1	1																			M
		- NUMERO CONTRATTI IN ESSERE PER CONSULENZA ALLE IMPRESE IN MATERIA DI STRUTTURA FINANZIARIA	04	1	1																			M
		- NUMERO DI CLIENTI.	06	1	1																			M
		- INOPERATIVITA' NEL MESE.	99	1	1																			M
		NUMERO DI CLIENTI SERVITI DA PROMOTORI FINANZIARI DIPENDENTI.	41432	00	1	1																		M
		NUMERO DI CLIENTI SERVITI DA PROMOTORI FINANZIARI MANDATARI E AGENTI.	41434	00	1	1																		M
U		ATTIVITA' DI GESTIONE DI SISTEMI MULTILATERALI DI SCAMBIO:	41418																					
		- VOLUMI SCAMBIATI.	02	1	1																			M
		- INOPERATIVITA' NEL MESE.	99	1	1																			M
U		STRUMENTI FINANZIARI DELLA CLIENTELA:	41419																					
		- TITOLI DI DEBITO: VALORE NOMINALE.	02	1	1			X	X	X							X				X	X	M	
		- TITOLI DI CAPITALE E QUOTE DI OICR: QUANTITA'.	06	1	1			X	X	X							X				X	X	M	

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SULL'ATTIVITA' DEGLI OPERATORI DEL MERCATO MOBILIARE

VI SEZIONE: SEGNALAZIONI STATISTICHE

B A S E I N F .	6.1 SEGNALAZIONI STATISTICHE	VOCE	R E S I D E N Z A	D I V I S A	V A L U T A	P R O V I N C I A	C O D I C E T I T O L O	C A T E G O R I E M O B I L E	I N D I C E Q U O T A Z I O N E	M E R C O N E G O Z I A Z I O N E	C A T E G O R I E E M I T T E N T I	T I P O L O O P E R A Z I O N E	C A T O R I E P A R T E	C O D I C E N U M E R O C O N T R O P P O	T I P O G E S T I O N E	R A P P O R T O E M I T T E N T E	T I P O S O G G E T T O	C A N D I S T R I B U T I V I	C L I E N T E L A M I F I D	S E R V I C I C O N S U L E N Z A	P E R I O D I C I T A'	N O T E	
		SOTVOC																					
	CODICE VARIABLE				0 0 7	0 1 5	0 3 2	5 5 1	5 5 2	5 5 4	5 5 5	5 5 8	5 5 9	9 0 4	9 0 6	9 0 9	9 4 1	9 4 4	5 2 1	5 2 7			
	- TITOLI DI DEBITO, DI CAPITALE E QUOTE DI OICR:																						
	FAIR VALUE.....		10	1	1			X		X	X					X			X	X	M		
	DERIVATI:																						
	- VALORE NOZIONALE.....		14	1	1				X1	X	X				X				X	X	M		
	- FAIR VALUE.....		18	1	1				X1	X	X				X				X	X	M		
	- NUMERO CLIENTI.....		22	1	1														X		M		