

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

| B A S E I N F . | 4.1 PATRIMONIO DI VIGILANZA CONSOLIDATO | VOCE | D U R A T A | D I V I S A | R E S I D E N Z A | A P P A R T E N E N A | P E R I O D I C I T A' | N O T E |
|--|---|--------------|----------------------------|----------------------------|---|---|--|------------------|
| | | sotvoc | | | | | | |
| 1 | PATRIMONIO DI BASE (TIER 1)..... | 36502 | | | | | | |
| | -ELEMENTI POSITIVI: | | | | | | | |
| | -CAPITALE..... | 02 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -SOVRAPPREZZI DI EMISSIONE..... | 04 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -RISERVE..... | 06 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -STRUMENTI INNOVATIVI DI CAPITALE E STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE CON SCADENZA..... | XX | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE: | | | | | | | |
| | -STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE COMPUTABILI FINO AL 35%..... | XX | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE COMPUTABILI FINO AL 50%..... | XX | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -STRUMENTI OGGETTO DI DISPOSIZIONI TRANSITORIE (GRANDFATHERING)..... | XX | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -UTILE DEL PERIODO..... | 12 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -FILTRI PRUDENZIALI: INCREMENTI DEL PATRIMONIO DI BASE: | | | | | | | |
| | -FAIR VALUE OPTION: VARIAZIONI DEL PROPRIO MERITO CREDITIZIO..... | 14 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -AZIONI RIMBORSABILI..... | 16 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -RISORSE PATRIMONIALI OGGETTO DI IMPEGNI DI ACQUISTO A TERMINE COMPUTABILI NEL PATRIMONIO DI BASE..... | 18 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -ALTRI FILTRI PRUDENZIALI POSITIVI..... | 20 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -TOTALE DEGLI ELEMENTI POSITIVI DEL PATRIMONIO DI BASE... | 28 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -ELEMENTI NEGATIVI: | | | | | | | |
| | -AZIONI O QUOTE PROPRIE..... | 30 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -AVVIAMENTO..... | 32 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -ALTRE IMMOBILIZZAZIONI IMMATERIALI..... | 34 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -PERDITA DEL PERIODO..... | 36 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -ALTRI ELEMENTI NEGATIVI: | | | | | | | |
| | -RETTIFICHE DI VALORE SU CREDITI..... | XX | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -RETTIFICHE DI VALORE DI VIGILANZA RELATIVE AL PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA..... | 38 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -ALTRI..... | XX | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -FILTRI PRUDENZIALI: DEDUZIONI DAL PATRIMONIO DI BASE: | | | | | | | |
| | -FAIR VALUE OPTION: VARIAZIONI DEL PROPRIO MERITO CREDITIZIO..... | 42 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -RISERVE NEGATIVE SU TITOLI DISPONIBILI PER LA VENDITA | | | | | | | |
| | -TITOLI DI CAPITALE E QUOTE DI O.I.C.R..... | 44 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -TITOLI DI DEBITO..... | 46 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -PLUSVALENZA CUMULATA NETTA SU ATTIVITA' MATERIALI..... | 48 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -RISORSE PATRIMONIALI OGGETTO DI IMPEGNI DI ACQUISTO A TERMINE NON COMPUTABILI NEL PATRIMONIO DI BASE..... | 50 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -ALTRI FILTRI NEGATIVI..... | 52 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -TOTALE DEGLI ELEMENTI NEGATIVI DEL PATRIMONIO DI BASE... | 60 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -PATRIMONIO DI BASE AL LORDO DEGLI ELEMENTI DA DEDURRE: | | | | | | | |
| | -VALORE POSITIVO..... | 90 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -VALORE NEGATIVO..... | 92 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

| B A S E I N F . | 4.1 PATRIMONIO DI VIGILANZA CONSOLIDATO | VOCE | D U R A T A | D I V I S A | R E S I D E N Z A | A P P A R T E N E N A | P E R I O D I C I T A' | N O T E |
|--|---|--------------|----------------------------|----------------------------|---|---|--|------------------|
| | | sotvoc | | | | | | |
| 1 | PATRIMONIO DI BASE - ELEMENTI DA DEDURRE..... | 36504 | | | | | | |
| | -INTERESSENZE AZIONARIE IN ENTI CREDITIZI E FINANZIARI PARI O SUPERIORI AL 20% DEL CAPITALE DELL'ENTE PARTECIPATO: | | | | | | | |
| | -INTERESSENZE AZIONARIE..... | 02 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE..... | 04 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -STRUMENTI INNOVATIVI DI CAPITALE E STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE CON SCADENZA..... | XX | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -STRUMENTI IBRIDI DI PATRIMONIALIZZAZIONE..... | 08 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -STRUMENTI SUBORDINATI..... | 10 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -INTERESSENZE AZIONARIE IN ENTI CREDITIZI E FINANZIARI SUPERIORI AL 10% MA INFERIORI AL 20% DEL CAPITALE DELL'ENTE PARTECIPATO: | | | | | | | |
| | -INTERESSENZE AZIONARIE..... | 16 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE..... | 18 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -STRUMENTI INNOVATIVI DI CAPITALE E STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE CON SCADENZA..... | XX | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -STRUMENTI IBRIDI DI PATRIMONIALIZZAZIONE..... | 22 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -STRUMENTI SUBORDINATI..... | 24 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -INTERESSENZE AZIONARIE IN ENTI CREDITIZI E FINANZIARI PARI O INFERIORI AL 10% DEL CAPITALE DELL'ENTE PARTECIPATO: | | | | | | | |
| | -INTERESSENZE AZIONARIE..... | 30 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE..... | 32 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -STRUMENTI INNOVATIVI DI CAPITALE E STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE CON SCADENZA..... | XX | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -STRUMENTI IBRIDI DI PATRIMONIALIZZAZIONE..... | 36 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -STRUMENTI SUBORDINATI..... | 38 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -PARTECIPAZIONI IN SOCIETÀ DI ASSICURAZIONE: | | | | | | | |
| | -PARTECIPAZIONI..... | 44 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -STRUMENTI SUBORDINATI..... | 46 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -ECCEDENZA DELLE PERDITE ATTESE RISPETTO ALLE RETTIFICHE DI VALORE COMPLESSIVE..... | 48 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -PERDITE ATTESE RELATIVE AGLI STRUMENTI DI CAPITALE E ALLE ESPOSIZIONI VERSO OICR NEL CASO DI SOTTOSTANTI RELATIVI A/O TRATTATI COME STRUMENTI DI CAPITALE..... | XX | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -DEDUZIONI DERIVANTI DA CARTOLARIZZAZIONI..... | 50 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -DEDUZIONI RELATIVE AL RISCHIO DI REGOLAMENTO SU TRANSAZIONI NON DVP..... | 52 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -TOTALE ELEMENTI DA DEDURRE..... | 90 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| 1 | PATRIMONIO DI BASE..... | 36506 | | | | | | |
| | -VALORE POSITIVO..... | 02 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -VALORE NEGATIVO..... | 12 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

| B A S E I N F . | 4.1 PATRIMONIO DI VIGILANZA CONSOLIDATO | VOCE | D U R A T A | D I V I S A | R E S I D E N Z A | A P P A R T E N E N A | P E R I O D I C I T A' | N O T E |
|--|--|--------------|----------------------------|----------------------------|---|---|--|------------------|
| | | sotvoc | | | | | | |
| 1 | -PATRIMONIO SUPPLEMENTARE (TIER 2)..... | 36508 | | | | | | |
| | -ELEMENTI POSITIVI: | | | | | | | |
| | -RISERVE DA VALUTAZIONE: | | | | | | | |
| | -ATTIVITÀ MATERIALI: | | | | | | | |
| | -LEGGI SPECIALI DI RIVALUTAZIONE..... | 02 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -ATTIVITÀ MATERIALI AD USO FUNZIONALE..... | 04 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -TITOLI DISPONIBILI PER LA VENDITA: | | | | | | | |
| | -TITOLI DI CAPITALE E QUOTE DI O.I.C.R..... | 06 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -TITOLI DI DEBITO..... | 08 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -STRUMENTI INNOVATIVI DI CAPITALE E STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE CON SCADENZA NON COMPUTABILI NEL PATRIMONIO DI BASE..... | XX | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE NON COMPUTABILI NEL PATRIMONIO DI BASE: | | | | | | | |
| | -STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE COMPUTABILI FINO AL 35%..... | XX | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE COMPUTABILI FINO AL 50%..... | XX | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -STRUMENTI IBRIDI DI PATRIMONIALIZZAZIONE..... | 14 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -PASSIVITÀ SUBORDINATE DI 2° LIVELLO..... | 16 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -ECCEDENZA RETTIFICHE DI VALORE COMPLESSIVE RISPETTO ALLE PERDITE ATTESE..... | 18 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -PLUSVALENZE NETTE SU PARTECIPAZIONI..... | 20 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -ALTRI ELEMENTI POSITIVI..... | 22 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -FILTRI PRUDENZIALI: INCREMENTI DEL PATRIMONIO SUPPLEMENTARE: | | | | | | | |
| | -PLUSVALENZA CUMULATA NETTA SU ATTIVITÀ MATERIALI..... | 24 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -RISORSE PATRIMONIALI OGGETTO DI IMPEGNI DI ACQUISTO A TERMINE COMPUTABILI NEL PATRIMONIO SUPPLEMENTARE.... | 26 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -ALTRI FILTRI POSITIVI..... | 28 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -TOTALE DEGLI ELEMENTI POSITIVI DEL PATRIMONIO SUPPLEMENTARE..... | 36 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -ELEMENTI NEGATIVI: | | | | | | | |
| | -MINUSVALENZE NETTE SU PARTECIPAZIONI..... | 38 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -CREDITI..... | 40 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -ALTRI ELEMENTI NEGATIVI..... | 42 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -FILTRI PRUDENZIALI: DEDUZIONI DAL PATRIMONIO SUPPLEMENTARE: | | | | | | | |
| | -QUOTA NON COMPUTABILE DELLA RISERVA DA VALUTAZIONE SU ATTIVITÀ MATERIALI AD USO FUNZIONALE..... | 44 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -QUOTA NON COMPUTABILE DELLE RISERVE POSITIVE SU TITOLI DISPONIBILI PER LA VENDITA: | | | | | | | |
| | -TITOLI DI CAPITALE E QUOTE DI O.I.C.R..... | 46 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -TITOLI DI DEBITO..... | 48 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -RISORSE PATRIMONIALI OGGETTO DI IMPEGNI DI ACQUISTO A TERMINE NON COMPUTABILI NEL PATRIMONIO SUPPLEMENTARE..... | 50 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -PASSIVITÀ SUBORDINATE DI 2° LIVELLO E STRUMENTI IBRIDI DI PATRIMONIALIZZAZIONE OGGETTO DI IMPEGNI DI ACQUISTO A TERMINE NON COMPUTABILI NEL | | | | | | | |

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

| B A S E I N F . | 4.1 PATRIMONIO DI VIGILANZA CONSOLIDATO | VOCE | D U R A T A | D I V I S A | R E S I D E N Z A | A P P A R T E N E N Z A | P E R I O D I C I T A' | N O T E |
|--|--|-----------|----------------------------|----------------------------|---|--|--|------------------|
| | | sotvoc | | | | | | |
| | PATRIMONIO SUPPLEMENTARE..... | 52 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -ALTRI FILTRI NEGATIVI..... | 54 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -TOTALE DEGLI ELEMENTI NEGATIVI DEL PATRIMONIO SUPPLEMENTARE..... | 60 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -PATRIMONIO SUPPLEMENTARE AL LORDO DEGLI ELEMENTI DA DEDURRE: | | | | | | | |
| | -VALORE POSITIVO..... | 80 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -ECCEDENZA RISPETTO AL PATRIMONIO DI BASE AL LORDO DEGLI ELEMENTI DA DEDURRE..... | 84 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -VALORE POSITIVO AMMESSO..... | 90 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -VALORE NEGATIVO..... | 94 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

| B A S E I N F . | 4.1 PATRIMONIO DI VIGILANZA CONSOLIDATO | VOCE | D U R A T A | D I V I S A | R E S I D E N Z A | A P P A R T E N E N A | P E R I O D I C I T A' | N O T E |
|--|---|--------------|----------------------------|----------------------------|---|---|--|------------------|
| | | sotvoc | | | | | | |
| 1 | PATRIMONIO SUPPLEMENTARE - ELEMENTI DA DEDURRE..... | 36510 | | | | | | |
| | -INTERESSENZE AZIONARIE IN ENTI CREDITIZI E FINANZIARI PARI O SUPERIORI AL 20% DEL CAPITALE DELL'ENTE PARTECIPATO: | | | | | | | |
| | -INTERESSENZE AZIONARIE..... | 02 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE..... | 04 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -STRUMENTI INNOVATIVI DI CAPITALE E STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE CON SCADENZA..... | XX | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -STRUMENTI IBRIDI DI PATRIMONIALIZZAZIONE..... | 08 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -STRUMENTI SUBORDINATI..... | 10 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -INTERESSENZE AZIONARIE IN ENTI CREDITIZI E FINANZIARI SUPERIORI AL 10% MA INFERIORI AL 20% DEL CAPITALE DELL'ENTE PARTECIPATO: | | | | | | | |
| | -INTERESSENZE AZIONARIE..... | 16 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE..... | 18 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -STRUMENTI INNOVATIVI DI CAPITALE E STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE CON SCADENZA..... | XX | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -STRUMENTI IBRIDI DI PATRIMONIALIZZAZIONE..... | 22 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -STRUMENTI SUBORDINATI..... | 24 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -INTERESSENZE AZIONARIE IN ENTI CREDITIZI E FINANZIARI PARI O INFERIORI AL 10% DEL CAPITALE DELL'ENTE PARTECIPATO: | | | | | | | |
| | -INTERESSENZE AZIONARIE..... | 30 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE..... | 32 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -STRUMENTI INNOVATIVI DI CAPITALE E STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE CON SCADENZA..... | XX | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -STRUMENTI IBRIDI DI PATRIMONIALIZZAZIONE..... | 36 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -STRUMENTI SUBORDINATI..... | 38 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -PARTECIPAZIONI IN SOCIETÀ DI ASSICURAZIONE: | | | | | | | |
| | -PARTECIPAZIONI..... | 44 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -STRUMENTI SUBORDINATI..... | 46 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -ECCEDENZA DELLE PERDITE ATTESE RISPETTO ALLE RETTIFICHE DI VALORE COMPLESSIVE..... | 48 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -PERDITE ATTESE RELATIVE AGLI STRUMENTI DI CAPITALE E ALLE ESPOSIZIONI VERSO OICR NEL CASO DI SOTTOSTANTI RELATIVI A/O TRATTATI COME STRUMENTI DI CAPITALE..... | XX | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -DEDUZIONI DERIVANTI DA CARTOLARIZZAZIONI..... | 50 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -DEDUZIONI RELATIVE AL RISCHIO DI REGOLAMENTO SU TRANSAZIONI NON DVP..... | 52 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -TOTALE ELEMENTI DA DEDURRE..... | 90 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| 1 | PATRIMONIO SUPPLEMENTARE..... | 36512 | | | | | | |
| | -VALORE POSITIVO..... | 02 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -VALORE NEGATIVO..... | 12 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

| B A S E I N F . | 4.1 PATRIMONIO DI VIGILANZA CONSOLIDATO | VOCE | D U R A T A | D I V I S A | R E S I D E N Z A | A P P A R T E N E N A | P E R I O D I C I T A' | N O T E |
|--|--|--------------|----------------------------|----------------------------|---|---|--|------------------|
| | | sotvoc | | | | | | |
| 1 | ELEMENTI DA DEDURRE DAL PATRIMONIO DI BASE E DAL | | | | | | | |
| | PATRIMONIO SUPPLEMENTARE:..... | 36514 | | | | | | |
| | -PARTECIPAZIONI IN SOCIETA' DI ASSICURAZIONE: | | | | | | | |
| | -PARTECIPAZIONI..... | 02 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -STRUMENTI SUBORDINATI..... | 04 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -TOTALE ELEMENTI DA DEDURRE DAL PATRIMONIO DI BASE E DAL | | | | | | | |
| | PATRIMONIO SUPPLEMENTARE..... | 06 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| 1 | PATRIMONIO DI VIGILANZA..... | 36516 | | | | | | |
| | -VALORE POSITIVO..... | 02 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -VALORE NEGATIVO..... | 12 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| 1 | PATRIMONIO DI 3° LIVELLO (TIER 3)..... | 36518 | | | | | | |
| | -ELEMENTI POSITIVI: | | | | | | | |
| | -PASSIVITA' SUBORDINATE DI 2° LIVELLO NON COMPUTABILI | | | | | | | |
| | NEL PATRIMONIO SUPPLEMENTARE..... | 02 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -PASSIVITA' SUBORDINATE DI 3° LIVELLO..... | 04 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -TOTALE ELEMENTI POSITIVI PATRIMONIO DI 3° LIVELLO..... | 06 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -ELEMENTI NEGATIVI: | | | | | | | |
| | -FILTRI PRUDENZIALI: DEDUZIONI DAL PATRIMONIO DI 3° | | | | | | | |
| | LIVELLO | | | | | | | |
| | -PASSIVITA' SUBORDINATE DI 2° E 3° LIVELLO OGGETTO | | | | | | | |
| | DI IMPEGNI DI ACQUISTO A TERMINE NON COMPUTABILI | | | | | | | |
| | NEL PATRIMONIO DI 3° LIVELLO..... | 12 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -ALTRE DEDUZIONI..... | 14 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -PATRIMONIO DI 3° LIVELLO: | | | | | | | |
| | -VALORE POSITIVO..... | 20 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -ECCEDENZA RISPETTO ALL'AMMONTARE COMPUTABILE..... | 22 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -VALORE POSITIVO AMMESSO..... | 24 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| 1 | PATRIMONIO DI VIGILANZA INCLUSO IL PATRIMONIO DI 3° | | | | | | | |
| | LIVELLO..... | 36520 | | | | | | |
| | -VALORE POSITIVO..... | 02 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |
| | -VALORE NEGATIVO..... | 12 | 3 | 1 | 1 | X | T | 1 |

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

| B A S E I N F . | 4.1 PATRIMONIO DI VIGILANZA CONSOLIDATO | VOCE | D U R A T A | D I V I S A | R E S I D E N Z A | A P P A R T E N E N Z A | P E R I O D I C I T A' | N O T E |
|--|---|--------------|----------------------------|----------------------------|---|--|--|------------------|
| | | sotvoc | | | | | | |
| 1 | ALTRE INFORMAZIONI..... | 36522 | | | | | | |
| | -PASSIVITÀ SUBORDINATE DI 2° LIVELLO NON COMPUTABILI NEL PATRIMONIO SUPPLEMENTARE E NEL PATRIMONIO DI 3° LIVELLO... | 02 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -PRESTITI SUBORDINATI DI 3° LIVELLO NON COMPUTABILI NEL PATRIMONIO DI 3° LIVELLO..... | 04 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -RISERVE DA VALUTAZIONE: COPERTURA DEI FLUSSI FINANZIARI: | | | | | | | |
| | -TITOLI DI DEBITO DISPONIBILI PER LA VENDITA: | | | | | | | |
| | -RISERVA POSITIVA..... | 10 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -RISERVA NEGATIVA..... | 12 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -TITOLI DI CAPITALE DISPONIBILI PER LA VENDITA: | | | | | | | |
| | -RISERVA POSITIVA..... | 14 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -RISERVA NEGATIVA..... | 16 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -ALTRI: | | | | | | | |
| | -RISERVA POSITIVA..... | 18 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| | -RISERVA NEGATIVA..... | 20 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

| BASE INF. | 4.2 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE SU BASE CONSOLIDATA | VOCE | DURATA | DIVISA | RESIDENZA | TIPO IMPORTO | FATTORE CONVERSIONE | FATTORE PONDERAZIONE | PORTAFOLIO | TIPO GARANZIA | CLASSE MERITO CRE | METODOLOGIA APPLICATA | TIPO CARATTERIZZAZIONE | RUOLO CARATTERIZZAZIONE | PERIODICITA' | NOTE |
|-----------|--|-------|--------|--------|-----------|--------------|---------------------|----------------------|------------|---------------|-------------------|-----------------------|------------------------|-------------------------|--------------|------|
| | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1 | METODOLOGIA STANDARDIZZATA - ATTIVITA' DI RISCHIO..... | 36526 | | | | | | | | | | | | | | |
| | -ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI E BANCHE CENTRALI..... | 02 | 3 | 1 | 1 | X | X | X | | | | | | | T | 1 |
| | -ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA ENTI TERRITORIALI..... | 04 | 3 | 1 | 1 | X | X | X | | | | | | | T | 1 |
| | -ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA ENTI SENZA SCOPO DI LUCRO ED ENTI DEL SETTORE PUBBLICO..... | 06 | 3 | 1 | 1 | X | X | X | | | | | | | T | 1 |
| | -ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA BANCHE MULTILATERALI DI SVILUPPO..... | 08 | 3 | 1 | 1 | X | X | X | | | | | | | T | 1 |
| | -ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA ORGANIZZAZIONI INTERNAZIONALI..... | 10 | 3 | 1 | 1 | X | X | X | | | | | | | T | 1 |
| | -ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA INTERMEDIARI VIGILATI..... | 12 | 3 | 1 | 1 | X | X | X | | | | | | | T | 1 |
| | -ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA IMPRESE..... | 14 | 3 | 1 | 1 | X | X | X | | | | | | | T | 1 |
| | -ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO..... | 16 | 3 | 1 | 1 | X | X | X | | | | | | | T | 1 |
| | -ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI..... | 18 | 3 | 1 | 1 | X | X | X | | | | | | | T | 1 |
| | -ESPOSIZIONI SCADUTE..... | 20 | 3 | 1 | 1 | X | X | X | | | | | | | T | 1 |
| | -ESPOSIZIONI AD ALTO RISCHIO..... | 22 | 3 | 1 | 1 | X | X | X | | | | | | | T | 1 |
| | -ESPOSIZIONI SOTTO FORMA DI OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE..... | 24 | 3 | 1 | 1 | X | X | X | | | | | | | T | 1 |
| | -ESPOSIZIONI A BREVE TERMINE VERSO IMPRESE..... | 26 | 3 | 1 | 1 | X | X | X | | | | | | | T | 1 |
| | -ESPOSIZIONI VERSO ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO DEL RISPARMIO (OICR)..... | 28 | 3 | 1 | 1 | X | X | X | | | | | | | T | 1 |
| | -ALTRE ESPOSIZIONI..... | 30 | 3 | 1 | 1 | X | X | X | | | | | | | T | 1 |
| | -TOTALE ATTIVITA' DI RISCHIO | | | | | | | | | | | | | | | |
| | -ATTIVITA' DI RISCHIO PER CASSA..... | 50 | 3 | 1 | 1 | X | | | X | | | | | | T | 1 |
| | -GARANZIE RILASCIATE E IMPEGNI A EROGARE FONDI..... | 52 | 3 | 1 | 1 | X | | | X | | | | | | T | 1 |
| | -CONTRATTI DERIVATI..... | 54 | 3 | 1 | 1 | X | | | X | | | | | | T | 1 |
| | -OPERAZIONI SFT E OPERAZIONI CON REGOLAMENTO A LUNGO TERMINE..... | 56 | 3 | 1 | 1 | X | | | X | | | | | | T | 1 |
| | -COMPENSAZIONE TRA PRODOTTI DIVERSI..... | 58 | 3 | 1 | 1 | X | | | X | | | | | | T | 1 |
| 1 | METODOLOGIA STANDARDIZZATA: TECNICHE DI ATTENUAZIONE DEL RISCHIO DI CREDITO: AMMONTARE PROTETTO..... | 36528 | | | | | | | | | | | | | | |
| | -STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO PERSONALE E REALE (METODO SEMPLIFICATO) | | | | | | | | | | | | | | | |
| | -ESPOSIZIONI GARANTITE | | | | | | | | | | | | | | | |
| | -ATTIVITA' DI RISCHIO PER CASSA..... | 02 | 3 | 1 | 1 | X | | | X | X | | | | | T | 1 |
| | -GARANZIE RILASCIATE E IMPEGNI A EROGARE FONDI..... | 04 | 3 | 1 | 1 | X | | | X | X | | | | | T | 1 |
| | -CONTRATTI DERIVATI..... | 06 | 3 | 1 | 1 | X | | | X | X | | | | | T | 1 |
| | -OPERAZIONI SFT E OPERAZIONI CON REGOLAMENTO A LUNGO TERMINE..... | 08 | 3 | 1 | 1 | X | | | X | X | | | | | T | 1 |
| | -STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO REALE - METODO INTEGRALE | | | | | | | | | | | | | | | |
| | -ESPOSIZIONI GARANTITE | | | | | | | | | | | | | | | |
| | -ATTIVITA' DI RISCHIO PER CASSA..... | 12 | 3 | 1 | 1 | X | | | X | | | | | | T | 1 |
| | -GARANZIE RILASCIATE E IMPEGNI A EROGARE FONDI..... | 14 | 3 | 1 | 1 | X | | | X | | | | | | T | 1 |
| | -CONTRATTI DERIVATI..... | 16 | 3 | 1 | 1 | X | | | X | | | | | | T | 1 |
| | -OPERAZIONI SFT E OPERAZIONI CON REGOLAMENTO A LUNGO TERMINE..... | 18 | 3 | 1 | 1 | X | | | X | | | | | | T | 1 |

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

| BASE INF. | 4.2 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE SU BASE CONSOLIDATA | VOCE | DURATA | DIVISA | RESIDENZA | TIPO IMPORTO | FATTORE CONVERSIONE | FATTORE PONDERAZIONE | TIPO GARANZIA | CLASSE MERITO CRE | METODOLOGIA APPLICATA | TIPO LOG ESPOSIZIONE | TIPO CARATTERIZZAZIONE | RULLO CARATTERIZZAZIONE | PERIODICITA' | NOTE |
|-----------|---|-------|--------|--------|-----------|--------------|---------------------|----------------------|---------------|-------------------|-----------------------|----------------------|------------------------|-------------------------|--------------|------|
| | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1 | METODOLOGIA BASATA SUI RATING INTERNI: PROBABILITA' DI DEFAULT..... | 36530 | | | | | | | | | | | | | | |
| | -RISCHIO DI CREDITO | | | | | | | | | | | | | | | |
| | -AMMINISTRAZIONI CENTRALI E BANCHE CENTRALI..... | 02 | 3 | 1 | 1 | | | | | X | | | | | T | 1 |
| | -INTERMEDIARI VIGILATI, ENTI PUBBLICI E TERRITORIALI E ALTRI SOGGETTI..... | 04 | 3 | 1 | 1 | | | | | X | | | | | T | 1 |
| | -IMPRESE E FINANZIAMENTI SPECIALIZZATI | | | | | | | | | | | | | | | |
| | -FINANZIAMENTI SPECIALIZZATI..... | 06 | 3 | 1 | 1 | | | | | X | | | | | T | 1 |
| | -ALTRI..... | 08 | 3 | 1 | 1 | | | | | X | | | | | T | 1 |
| | -POSIZIONI AL DETTAGLIO | | | | | | | | | | | | | | | |
| | -ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI RESIDENZIALI..... | 10 | 3 | 1 | 1 | | | | | X | | | | | T | 1 |
| | -ESPOSIZIONI ROTATIVE AL DETTAGLIO QUALIFICATE..... | 12 | 3 | 1 | 1 | | | | | X | | | | | T | 1 |
| | -ALTRE ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO..... | 14 | 3 | 1 | 1 | | | | | X | | | | | T | 1 |
| | -METODO PD/LGD..... | XX | 3 | 1 | 1 | | | | | X | | | | | T | 1 |
| | -RISCHIO DI DILUIZIONE..... | 16 | 3 | 1 | 1 | | | | | | | | | | T | 1 |
| 1 | METODOLOGIA BASATA SUI RATING INTERNI: ATTIVITA' DI RISCHIO..... | 36532 | | | | | | | | | | | | | | |
| | -ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI E BANCHE CENTRALI..... | 02 | 3 | 1 | 1 | X | | | | X | X | | | | T | 1 |
| | -ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA INTERMEDIARI VIGILATI, ENTI PUBBLICI E TERRITORIALI E ALTRI SOGGETTI | | | | | | | | | | | | | | | |
| | -INTERMEDIARI VIGILATI..... | 04 | 3 | 1 | 1 | X | | | | X | X | | | | T | 1 |
| | -ENTI PUBBLICI E TERRITORIALI..... | 06 | 3 | 1 | 1 | X | | | | X | X | | | | T | 1 |
| | -ALTRI..... | 08 | 3 | 1 | 1 | X | | | | X | X | | | | T | 1 |
| | -ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA IMPRESE | | | | | | | | | | | | | | | |
| | -FINANZIAMENTI SPECIALIZZATI..... | 12 | 3 | 1 | 1 | X | | | | X | X | | | | T | 1 |
| | -PMI..... | 14 | 3 | 1 | 1 | X | | | | X | X | | | | T | 1 |
| | -ALTRE IMPRESE..... | 16 | 3 | 1 | 1 | X | | | | X | X | | | | T | 1 |
| | -ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO | | | | | | | | | | | | | | | |
| | -ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI RESIDENZIALI: PMI..... | 20 | 3 | 1 | 1 | X | | | | X | | | | | T | 1 |
| | -ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI RESIDENZIALI: PERSONE FISICHE..... | 22 | 3 | 1 | 1 | X | | | | X | | | | | T | 1 |
| | -ESPOSIZIONI ROTATIVE AL DETTAGLIO QUALIFICATE..... | 24 | 3 | 1 | 1 | X | | | | X | | | | | T | 1 |
| | -ALTRE ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO: PMI..... | 26 | 3 | 1 | 1 | X | | | | X | | | | | T | 1 |
| | -ALTRE ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO: PERSONE FISICHE..... | 28 | 3 | 1 | 1 | X | | | | X | | | | | T | 1 |
| | -CREDITI COMMERCIALI ACQUISTATI - RISCHIO DI DILUIZIONE.... | 32 | 3 | 1 | 1 | X | | | | | X | | | | T | 1 |
| | -ALTRE ATTIVITA'..... | 34 | 3 | 1 | 1 | X | | | | | | | | | T | 1 |
| | -FINANZIAMENTI SPECIALIZZATI - SLOTTING CRITERIA..... | 36 | 3 | 1 | 1 | X | | X | | | X | | | | T | 1 |
| | -TRATTAMENTO ALTERNATIVO DELLE IPOTECHE IMMOBILIARI..... | 38 | 3 | 1 | 1 | X | | | | | X | | | | T | 1 |
| | -RISCHIO DI REGOLAMENTO: ESPOSIZIONI PER TRANSAZIONI NON DVP CON FATTORI DI PONDERAZIONE REGOLAMENTARI..... | 40 | 3 | 1 | 1 | X | | X | | | X | | | | T | 1 |
| | -TOTALE ATTIVITA' DI RISCHIO | | | | | | | | | | | | | | | |
| | -ATTIVITA' DI RISCHIO PER CASSA..... | 60 | 3 | 1 | 1 | X | | | X | | X | | | | T | 1 |
| | -GARANZIE RILASCIATE E IMPEGNI A EROGARE FONDI..... | 62 | 3 | 1 | 1 | X | | | X | | X | | | | T | 1 |
| | -CONTRATTI DERIVATI..... | 64 | 3 | 1 | 1 | X | | | X | | X | | | | T | 1 |
| | -OPERAZIONI SFT E OPERAZIONI CON REGOLAMENTO A LUNGO TERMINE..... | 66 | 3 | 1 | 1 | X | | | X | | X | | | | T | 1 |
| | -COMPENSAZIONE TRA PRODOTTI DIVERSI..... | 68 | 3 | 1 | 1 | X | | | X | | X | | | | T | 1 |

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

| B A S E I N F . | 4.2 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE SU BASE CONSOLIDATA | VOCE | D U R A T A | D I V I S A | R E S I D E N Z A | T I P O I M P O R T O | F A T T O R E C O N V E R S | F A T T O R E P O N D E R A Z | P O R T A F O G L I O | T I P O G A R A N Z I A | C L A S S M E R I T O C R E | M E T O D O L O G A P P L I C | T I P O L O G E S P O S I Z | T I P O C A R T O L A R I Z | R U O L O C A R T O L A R I Z | P E R I O D I C I T A' | N O T E | |
|--|--|--------------|----------------------------|----------------------------|---|---|--|---|---|--|--|---|--|--|---|--|------------------|--------|
| | | | | | | | | | | | | | | | | | | sotvoc |
| 1 | METODOLOGIA BASATA SUI RATING INTERNI: ESPOSIZIONI IN STRUMENTI DI CAPITALE..... | 36534 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | -METODO PD/LGD: ATTIVITA' DI RISCHIO..... | 02 | 3 | 1 | 1 | X | | | | | X | | | | | | T | 1 |
| | -METODO DELLA PONDERAZIONE SEMPLICE: ATTIVITA' DI RISCHIO..... | 04 | 3 | 1 | 1 | X | | X | | | | | | | | | T | 1 |
| | -METODO DEI MODELLI INTERNI: ATTIVITA' DI RISCHIO..... | 06 | 3 | 1 | 1 | X | | | | | | | | | | | T | 1 |
| 1 | CARTOLARIZZAZIONI: METODOLOGIA STANDARDIZZATA: POSIZIONI VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE..... | 36536 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | -ATTIVITA' DI RISCHIO PER CASSA: -POSIZIONI VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE..... | 02 | 3 | 1 | 1 | X | | X | | | | | X | X | X | | T | 1 |
| | -ATTIVITA' DI RISCHIO FUORI BILANCIO: -POSIZIONI VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE..... | 04 | 3 | 1 | 1 | X | X | X | | | | | | X | X | | T | 1 |
| | -CLAUSOLE DI RIMBORSO ANTICIPATO..... | 06 | 3 | 1 | 1 | X | | X | | | | | | X | X | | T | 1 |
| | -TOTALE ESPOSIZIONI..... | 20 | 3 | 1 | 1 | X | | | | | | | | | X | | T | 1 |
| 1 | CARTOLARIZZAZIONI: METODOLOGIA STANDARDIZZATA: POSIZIONI VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE: AMMONTARE PROTETTO..... | 36538 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | -ATTIVITA' DI RISCHIO -STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO REALE - METODO SEMPLIFICATO..... | 02 | 3 | 1 | 1 | X | | | | | | | | X | | | T | 1 |
| | -STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO REALE - METODO INTEGRALE..... | 12 | 3 | 1 | 1 | X | | | | | | | | X | X | | T | 1 |
| 1 | CARTOLARIZZAZIONI: METODOLOGIA BASATA SUI RATING INTERNI: POSIZIONI VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE..... | 36540 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | -ATTIVITA' DI RISCHIO PER CASSA -METODO BASATO SUI RATING..... | 02 | 3 | 1 | 1 | X | | X | | | | | X | X | X | | T | 1 |
| | -METODO FORMULA DI VIGILANZA..... | 04 | 3 | 1 | 1 | X | | | | | | | X | X | X | | T | 1 |
| | -METODO DELLA VALUTAZIONE INTERNA..... | 06 | 3 | 1 | 1 | X | | | | | | | X | X | X | | T | 1 |
| | -ATTIVITA' DI RISCHIO FUORI BILANCIO -METODO BASATO SUI RATING..... | 12 | 3 | 1 | 1 | X | X | X | | | | | | X | X | | T | 1 |
| | -METODO FORMULA DI VIGILANZA..... | 14 | 3 | 1 | 1 | X | X | | | | | | | X | X | | T | 1 |
| | -METODO DELLA VALUTAZIONE INTERNA..... | 16 | 3 | 1 | 1 | X | X | | | | | | | X | X | | T | 1 |
| | -CLAUSOLE DI RIMBORSO ANTICIPATO..... | 20 | 3 | 1 | 1 | X | | | | | | | | X | X | | T | 1 |
| | -TOTALE ESPOSIZIONI..... | 30 | 3 | 1 | 1 | X | | | | | | | | | X | | T | 1 |
| 1 | CARTOLARIZZAZIONI: METODOLOGIA BASATA SUI RATING INTERNI: POSIZIONI VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE: AMMONTARE PROTETTO..... | 36542 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | -ATTIVITA' DI RISCHIO: -STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO REALE - METODO INTEGRALE..... | 00 | 3 | 1 | 1 | X | | | | | | | | X | X | | T | 1 |

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

| B A S E I N F . | 4.3 GRANDI RISCHI SU BASE CONSOLIDATA | VOCE | D U R A T A | D I V I S A | R E S I D E N Z A | T I P O I M P O R T O | C O D C E N S T I P O A | C O D C E N S T I P O B | M E T O D O U T I L I Z Z A T O | C A T E G O R I A E S P O S I Z | T I P O L O G I A P O S I Z | P E R I O D I C I T A' | N O T E | |
|--|---------------------------------------|---|----------------------------|----------------------------|---|---|--|--|--|--|--|--|------------------|--------|
| | | | | | | | | | | | | | | sotvoc |
| 1 | | PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA..... | 34800 00 | 3 | 1 | 1 | X | X | | X | X | X | T | 1 |
| 1 | | ALTRE ATTIVITA' DI RISCHIO PER CASSA..... | 34802 | | | | | | | | | | | |
| | | -IMPIEGHI TOTALI..... | 02 | 3 | 1 | 1 | X | X | | X | X | X | T | 1 |
| | | -PARTECIPAZIONI IN IMPRESE NON FINANZIARIE..... | 06 | 3 | 1 | 1 | X | X | | X | X | X | T | 1 |
| | | -TITOLI DI CAPITALE: ALTRI..... | XX | 3 | 1 | 1 | X | X | | X | X | X | T | 1 |
| | | -TITOLI OBBLIGAZIONARI..... | XX | 3 | 1 | 1 | X | X | | X | X | X | T | 1 |
| | | -ALTRE ATTIVITA'..... | XX | 3 | 1 | 1 | X | X | | X | X | X | T | 1 |
| 1 | | ATTIVITA' DI RISCHIO FUORI BILANCIO..... | 34804 | | | | | | | | | | | |
| | | -GARANZIE RILASCIATE E IMPEGNI..... | 02 | 3 | 1 | 1 | X | X | | X | X | X | T | 1 |
| | | -CONTRATTI DERIVATI FINANZIARI..... | XX | 3 | 1 | 1 | X | X | | X | X | X | T | 1 |
| | | -CONTRATTI DERIVATI CREDITIZI..... | XX | 3 | 1 | 1 | X | X | | X | X | X | T | 1 |
| 1 | | DETTAGLIO DEI GRANDI RISCHI: STATUS ESPOSIZIONE..... | 34806 | | | | | | | | | | | |
| | | -INCAGLI TOTALI..... | 02 | 3 | 1 | 1 | X | X | | | | X | T | 1 |
| | | -SOFFERENZE TOTALI..... | 06 | 3 | 1 | 1 | X | X | | | | X | T | 1 |
| | | -ATTIVITA' DI RISCHIO CON SCADENZA SUCCESSIVA AL 31.12.2001..... | 10 | 3 | 1 | 1 | X | X | | | | X | T | 1 |
| 1 | | DETTAGLIO DEI GRANDI RISCHI PER SOGGETTO EROGANTE..... | XXXXX | | | | | | | | | | | |
| | | -BANCHE - FILIALI ESTERE..... | XX | 3 | 1 | 1 | | X | | | | | T | 1 |
| | | -BANCHE - FILIAZIONI ESTERE..... | XX | 3 | 1 | 1 | | X | | | | | T | 1 |
| | | -SOCIETA' FINANZIARIE (FILIALI E FILIAZIONI ESTERE)..... | XX | 3 | 1 | 1 | | X | | | | | T | 1 |
| 1 | | COMPOSIZIONE DEI GRUPPI DI CLIENTI CONNESSI..... | XXXXX | | | | | | | | | | | |
| | | -CONTROPARTI..... | XX | 3 | 1 | 1 | | X | X | | | | T | 1 |
| 1 | | SVALUTAZIONI ANALITICHE SU IMPIEGHI TOTALI..... | 34808 00 | 3 | 1 | 1 | X | X | | | | X | T | 1 |

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

| B A S E I N F . | 4.4 REQUISITI PATRIMONIALI CONSOLIDATI SUI RISCHI DI MERCATO | VOCE | D U R A T A | D I V I S A | R E S I D E N Z A | P E R I O D I C I T A' | N O T E |
|--|--|--------------|----------------------------|----------------------------|---|--|------------------|
| | | sotvoc | | | | | |
| 1 | RISCHI DI MERCATO: REQUISITI PATRIMONIALI..... | 36562 | | | | | |
| | -METODOLOGIA STANDARDIZZATA | | | | | | |
| | -RISCHIO GENERICO | | | | | | |
| | -TITOLI DI DEBITO | | | | | | |
| | -METODO BASATO SULLA SCADENZA..... | 02 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| | -METODO BASATO SULLA DURATA FINANZIARIA..... | 04 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| | -TITOLI DI CAPITALE..... | 08 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| | -RISCHIO SPECIFICO | | | | | | |
| | -TITOLI DI DEBITO..... | 12 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| | -TITOLI DI CAPITALE..... | 14 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| | -RISCHIO DI POSIZIONE DEI CERTIFICATI DI PARTECIPAZIONE A O.I.C.R. | | | | | | |
| | -METODO DELLA SCOMPOSIZIONE SEMPLIFICATA..... | 20 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| | -METODO DELLA SCOMPOSIZIONE PARZIALE..... | 22 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| | -METODO RESIDUALE..... | 24 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| | -OPZIONI | | | | | | |
| | -METODO SEMPLIFICATO..... | 32 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| | -METODO 'DELTA-PLUS' | | | | | | |
| | -FATTORE GAMMA..... | 34 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| | -FATTORE VEGA..... | 36 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| | -METODO DI SCENARIO..... | 38 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| | -RISCHIO DI CAMBIO..... | 42 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| | -RISCHIO SULLE POSIZIONI IN MERCI | | | | | | |
| | -METODO BASATO SULLE FASCE DI SCADENZA..... | 46 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| | -METODO BASATO SULLE FASCE DI SCADENZA AMPLIATO..... | 48 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| | -METODO SEMPLIFICATO..... | 50 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| | -MODELLI INTERNI | | | | | | |
| | -VAR..... | 54 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| | -ALTRI REQUISITI..... | 56 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| | -RISCHIO DI REGOLAMENTO PER LE TRANSAZIONI DVP..... | 60 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| | -REQUISITO PATRIMONIALE SU STRUMENTI FINANZIARI ESPOSTI A FATTORI DI RISCHIO NON CONTEMPLATI DALLA NORMATIVA..... | 62 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| 1 | RISCHI DI MERCATO: SEGNALAZIONE NEGATIVA..... | 36564 | 00 | 3 | 1 | 1 | T |

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

| B A S E I N F . | 4.5 REQUISITI PATRIMONIALI CONSOLIDATI PER IL RISCHIO OPERATIVO | VOCE | D U R A T A | D I V I S A | R E S I D E N Z A | L I N E E D I B U S I N E S | E V E N T I D I P E R D I T A' | P E R I O D I C I T A' | N O T E |
|--|--|--------------|----------------------------|----------------------------|---|--|--|--|------------------|
| | | sotvoc | | | | | | | |
| 1 | MARGINE DI INTERMEDIAZIONE..... | 36570 | | | | | | | |
| | -METODO BASE | | | | | | | | |
| | -MARGINE INTERMEDIAZIONE 31.12 ANNO T..... | 02 | 3 | 1 | 1 | | | T | 1 |
| | -MARGINE INTERMEDIAZIONE 31.12 ANNO T-1..... | 04 | 3 | 1 | 1 | | | T | 1 |
| | -MARGINE INTERMEDIAZIONE 31.12 ANNO T-2..... | 06 | 3 | 1 | 1 | | | T | 1 |
| | -METODO STANDARDIZZATO | | | | | | | | |
| | -MARGINE INTERMEDIAZIONE 31.12 ANNO T (*)..... | 12 | 3 | 1 | 1 | X | | T | 1 |
| | -MARGINE INTERMEDIAZIONE 31.12 ANNO T-1 (*)..... | 14 | 3 | 1 | 1 | X | | T | 1 |
| | -MARGINE INTERMEDIAZIONE 31.12 ANNO T-2 (*)..... | 16 | 3 | 1 | 1 | X | | T | 1 |
| | -METODI AVANZATI | | | | | | | | |
| | -MARGINE INTERMEDIAZIONE 31.12 ANNO T (*)..... | 22 | 3 | 1 | 1 | X | | T | 1 |
| | -MARGINE INTERMEDIAZIONE 31.12 ANNO T-1 (*)..... | 24 | 3 | 1 | 1 | X | | T | 1 |
| | -MARGINE INTERMEDIAZIONE 31.12 ANNO T-2 (*)..... | 26 | 3 | 1 | 1 | X | | T | 1 |
| | (745) - segnalazioni che possono assumere valore negativo | | | | | | | | |
| 1 | METODI AVANZATI..... | 36572 | | | | | | | |
| | -REQUISITO PATRIMONIALE LORDO..... | 02 | 3 | 1 | 1 | | | T | 1 |
| | -RIDUZIONI DEL REQUISITO PATRIMONIALE LORDO | | | | | | | | |
| | -POLIZZE ASSICURATIVE: QUOTA DEDUCIBILE..... | 04 | 3 | 1 | 1 | | | T | 1 |
| | -ALTRI MECCANISMI DI TRASFERIMENTO: QUOTA DEDUCIBILE..... | 06 | 3 | 1 | 1 | | | T | 1 |
| | -ACCANTONAMENTI A FRONTE DEL RISCHIO OPERATIVO..... | 08 | 3 | 1 | 1 | | | T | 1 |
| | -CORRELAZIONE TRA LE PERDITE..... | 10 | 3 | 1 | 1 | | | T | 1 |
| | -RIDUZIONI DEL REQUISITO PATRIMONIALE LORDO: QUOTA NON DEDUCIBILE..... | 12 | 3 | 1 | 1 | | | T | 1 |
| 1 | RIPARTIZIONE DELLE PERDITE OPERATIVE PER LINEE DI BUSINESS E PER EVENTI DI PERDITA..... | 36574 | | | | | | | |
| | -NUMERO DI EVENTI DI PERDITA..... | 02 | 3 | 1 | 1 | X | X | T | 1 |
| | -PERDITE | | | | | | | | |
| | -IMPORTO TOTALE..... | 06 | 3 | 1 | 1 | X | X | T | 1 |
| | -PERDITA MASSIMA..... | 08 | 3 | 1 | 1 | X | X | T | 1 |
| | -PERDITA MEDIANA..... | 10 | 3 | 1 | 1 | X | X | T | 1 |
| | -RECUPERI TOTALI DA: | | | | | | | | |
| | -POLIZZE ASSICURATIVE E ALTRI MECCANISMI DI TRASFERIMENTO DEL RISCHIO OPERATIVO..... | 16 | 3 | 1 | 1 | X | X | T | 1 |
| | -ALTRI..... | 18 | 3 | 1 | 1 | X | X | T | 1 |
| | -SOGLIA MINIMA DI PERDITA..... | 20 | 3 | 1 | 1 | X | X | T | 1 |
| | -SOGLIA MINIMA DI PERDITA: SEGNALAZIONE NEGATIVA..... | 30 | 3 | 1 | 1 | | | T | |

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

| B A S E I N F . | 4.6 POSIZIONE PATRIMONIALE CONSOLIDATA | VOCE | D U R A T A | D I V I S A | R E S I D E N Z A | N O M I N A T I V O C N P | P E R I O D I C I T A' | N O T E | |
|--|--|--------------|----------------------------|----------------------------|---|---|--|------------------|---|
| | | sotvoc | | | | | | | |
| 1 | REQUISITI PATRIMONIALI..... | 36580 | | | | | | | |
| | -RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE | | | | | | | | |
| | -METODOLOGIA STANDARDIZZATA..... | 02 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 | |
| | -METODOLOGIA BASATA SU RATING INTERNI | | | | | | | | |
| | -DI BASE..... | 04 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 | |
| | -AVANZATA..... | 06 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 | |
| | -RISCHI DI MERCATO | | | | | | | | |
| | -METODOLOGIA STANDARDIZZATA..... | 10 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 | |
| | -MODELLI INTERNI..... | 12 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 | |
| | -RISCHIO DI CONCENTRAZIONE..... | 16 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 | |
| | -AGGIUSTAMENTO DEI REQUISITI PATRIMONIALI PER RAPPORTI | | | | | | | | |
| | INFRAGRUPPO (*)..... | 20 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 | |
| | -RISCHIO OPERATIVO | | | | | | | | |
| | -METODO BASE..... | 24 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 | |
| | -METODO STANDARDIZZATO..... | 26 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 | |
| | -METODI AVANZATI..... | 28 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 | |
| | -INTEGRAZIONE PER 'FLOOR'..... | 30 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 | |
| | -ALTRI REQUISITI..... | 34 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 | |
| | <i>(745) - segnalazioni che possono assumere valore negativo</i> | | | | | | | | |
| 1 | REQUISITI PATRIMONIALI SPECIFICI..... | 36582 | 00 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| 1 | REQUISITI PATRIMONIALI TOTALI..... | 36584 | 00 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 |
| 1 | POSIZIONE PATRIMONIALE..... | 36586 | | | | | | | |
| | -ECEDENZA..... | 02 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 | |
| | -DEFICIENZA..... | 12 | 3 | 1 | 1 | | T | 1 | |
| 1 | DATI NOMINATIVI..... | 36588 | | | | | | | |
| | -REQUISITI PATRIMONIALI | | | | | | | | |
| | -RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE..... | 02 | 3 | 1 | 2 | X | T | 1 | |
| | -RISCHI DI MERCATO | | | | | | | | |
| | -RISCHIO DI REGOLAMENTO PER LE TRANSAZIONI DVP..... | 06 | 3 | 1 | 2 | X | T | 1 | |
| | -ALTRI..... | 08 | 3 | 1 | 2 | X | T | 1 | |
| | -RISCHIO OPERATIVO..... | 12 | 3 | 1 | 2 | X | T | 1 | |
| | -ALTRI REQUISITI..... | 14 | 3 | 1 | 2 | X | T | 1 | |
| | -REQUISITI PATRIMONIALI SPECIFICI..... | 16 | 3 | 1 | 2 | X | T | 1 | |
| | -REQUISITI PATRIMONIALI TOTALI..... | 18 | 3 | 1 | 2 | X | T | 1 | |

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

| B A S E I N F . | 4.6bis POSIZIONE PATRIMONIALE CONSOLIDATA "ex Basilea1" | VOCE | D U R A T A | D I V I S A | R E S I D E N Z A | P E R I O D I C I T A' | N O T E |
|--|--|-----------------|----------------------------|----------------------------|---|--|------------------|
| | | sotvoc | | | | | |
| 1 | REQUISITI PATRIMONIALI..... | 34860 | | | | | |
| | -RISCHI DI CREDITO..... | 02 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| | -RISCHI DI MERCATO | | | | | | |
| | -RISCHI DEL PORTAFOGLIO TITOLI NON IMMOBILIZZATO (METODO STANDARD)..... | 08 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| | -RISCHI DI POSIZIONI IN MERCI (METODO STANDARD)..... | 10 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| | -RISCHI DI CAMBIO (METODO STANDARD)..... | 12 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| | -RISCHI DI MERCATO - MODELLI INTERNI..... | 14 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| | -RISCHIO DI CONCENTRAZIONE..... | 16 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| | -PRESTITI SUBORDINATI UTILIZZABILI A 'COPERTURA' DEI RISCHI DI MERCATO..... | 18 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| | -RISCHI DI MERCATO 'NETTI'..... | 24 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| | -ALTRI REQUISITI..... | 32 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| 1 | REQUISITI PATRIMONIALI SPECIFICI..... | 34864 00 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |
| 1 | REQUISITI PATRIMONIALI TOTALI..... | 34868 00 | 3 | 1 | 1 | T | 1 |