

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

B A S E  I N F .	4.1 PATRIMONIO DI VIGILANZA	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	Q U A L I F I C A	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoc						
Y	PATRIMONIO DI BASE (TIER 1).....	59502						
	-ELEMENTI POSITIVI:							
	-CAPITALE.....	02	3	1	1		T	XD
	-SOVRAPPREZZI DI EMISSIONE.....	04	3	1	1		T	XD
	-RISERVE.....	06	3	1	1		T	XD
	-STRUMENTI INNOVATIVI DI CAPITALE E STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE CON SCADENZA.....	XX	3	1	1		T	XD
	-STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE:							
	-STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE COMPUTABILI FINO AL 35%.....	XX	3	1	1		T	XD
	-STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE COMPUTABILI FINO AL 50%.....	XX	3	1	1		T	XD
	-STRUMENTI OGGETTO DI DISPOSIZIONI TRANSITORIE (GRANDFATHERING).....	XX	3	1	1		T	XD
	-UTILE DEL PERIODO.....	12	3	1	1		T	XD
	-FILTRI PRUDENZIALI: INCREMENTI DEL PATRIMONIO DI BASE:							
	-FAIR VALUE OPTION: VARIAZIONI DEL PROPRIO MERITO CREDITIZIO.....	14	3	1	1		T	XD
	-AZIONI RIMBORSABILI.....	16	3	1	1		T	XD
	-RISORSE PATRIMONIALI OGGETTO DI IMPEGNI DI ACQUISTO A TERMINE COMPUTABILI NEL PATRIMONIO DI BASE.....	18	3	1	1		T	XD
	-ALTRI FILTRI PRUDENZIALI POSITIVI.....	20	3	1	1		T	XD
	-TOTALE DEGLI ELEMENTI POSITIVI DEL PATRIMONIO DI BASE...	28	3	1	1		T	XD
	-ELEMENTI NEGATIVI:							
	-AZIONI O QUOTE PROPRIE.....	30	3	1	1		T	XD
	-AVVIAMENTO.....	32	3	1	1		T	XD
	-ALTRE IMMOBILIZZAZIONI IMMATERIALI.....	34	3	1	1		T	XD
	-PERDITA DEL PERIODO.....	36	3	1	1		T	XD
	-ALTRI ELEMENTI NEGATIVI:							
	-RETTIFICHE DI VALORE SU CREDITI.....	37	3	1	1		T	XD
	-RETTIFICHE DI VALORE DI VIGILANZA RELATIVE AL "PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA".....	38	3	1	1		T	XD
	-ALTRI.....	40	3	1	1		T	XD
	-FILTRI PRUDENZIALI: DEDUZIONI DEL PATRIMONIO DI BASE:							
	-FAIR VALUE OPTION: VARIAZIONI DEL PROPRIO MERITO CREDITIZIO.....	42	3	1	1		T	XD
	-RISERVE NEGATIVE SU TITOLI DISPONIBILI PER LA VENDITA							
	-TITOLI DI CAPITALE E QUOTE DI O.I.C.R.....	44	3	1	1		T	XD
	-TITOLI DI DEBITO.....	46	3	1	1		T	XD
	-PLUSVALENZA CUMULATA NETTA SU ATTIVITA' MATERIALI.....	48	3	1	1		T	XD
	-RISORSE PATRIMONIALI OGGETTO DI IMPEGNI DI ACQUISTO A TERMINE NON COMPUTABILI NEL PATRIMONIO DI BASE.....	50	3	1	1		T	XD
	-ALTRI FILTRI NEGATIVI.....	52	3	1	1		T	XD
	-TOTALE DEGLI ELEMENTI NEGATIVI DEL PATRIMONIO DI BASE...	60	3	1	1		T	XD
	-PATRIMONIO DI BASE AL LORDO DEGLI ELEMENTI DA DEDURRE:							
	-VALORE POSITIVO.....	90	3	1	1		T	XD
	-VALORE NEGATIVO.....	92	3	1	1		T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

B A S E  I N F .	4.1 PATRIMONIO DI VIGILANZA	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	Q U A L I F I C A	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoc						
Y	PATRIMONIO DI BASE - ELEMENTI DA DEDURRE.....	59504						
	-INTERESSENZE AZIONARIE IN ENTI CREDITIZI E FINANZIARI SUPERIORI AL 10% DEL CAPITALE DELL'ENTE PARTECIPATO							
	-INTERESSENZE AZIONARIE.....	03	3	1	1		T	XD
	-STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE.....	05	3	1	1		T	XD
	-STRUMENTI INNOVATIVI DI CAPITALE E STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE CON SCADENZA.....	XX	3	1	1		T	XD
	-STRUMENTI IBRIDI DI PATRIMONIALIZZAZIONE.....	09	3	1	1		T	XD
	-STRUMENTI SUBORDINATI.....	11	3	1	1		T	XD
	-INTERESSENZE AZIONARIE IN ENTI CREDITIZI E FINANZIARI PARI O INFERIORI AL 10% DEL CAPITALE DELL'ENTE PARTECIPATO							
	-INTERESSENZE AZIONARIE.....	30	3	1	1		T	XD
	-STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE.....	32	3	1	1		T	XD
	-STRUMENTI INNOVATIVI DI CAPITALE E STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE CON SCADENZA.....	XX	3	1	1		T	XD
	-STRUMENTI IBRIDI DI PATRIMONIALIZZAZIONE.....	36	3	1	1		T	XD
	-STRUMENTI SUBORDINATI.....	38	3	1	1		T	XD
	-PARTECIPAZIONI IN SOCIETA' DI ASSICURAZIONE:							
	-PARTECIPAZIONI.....	44	3	1	1		T	XD
	-STRUMENTI SUBORDINATI.....	46	3	1	1		T	XD
	-ECCEDENZA DELLE PERDITE ATTESE RISPETTO ALLE RETTIFICHE DI VALORE COMPLESSIVE.....	50	3	1	1		T	XD
	-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	XD
	-DEDUZIONI DERIVANTI DA CARTOLARIZZAZIONI.....	52	3	1	1		T	XD
	-DEDUZIONI RELATIVE AL RISCHIO DI REGOLAMENTO SU TRANSAZIONI NON DVP.....	54	3	1	1		T	XD
	-TOTALE ELEMENTI DA DEDURRE.....	90	3	1	1		T	XD
Y	PATRIMONIO DI BASE.....	59506						
	-VALORE POSITIVO.....	02	3	1	1		T	XD
	-VALORE NEGATIVO.....	12	3	1	1		T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

B A S E  I N F .	4.1 PATRIMONIO DI VIGILANZA	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	Q U A L I F I C A	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoc						
Y	-PATRIMONIO SUPPLEMENTARE (TIER 2).....	59508						
	-ELEMENTI POSITIVI:							
	-RISERVE DA VALUTAZIONE:							
	-ATTIVITA' MATERIALI:							
	-LEGGI SPECIALI DI RIVALUTAZIONE.....	02	3	1	1		T	XD
	-ATTIVITA' MATERIALI AD USO FUNZIONALE.....	04	3	1	1		T	XD
	-TITOLI DISPONIBILI PER LA VENDITA:							
	-TITOLI DI CAPITALE E QUOTE DI O.I.C.R.....	06	3	1	1		T	XD
	-TITOLI DI DEBITO.....	08	3	1	1		T	XD
	-STRUMENTI INNOVATIVI DI CAPITALE E STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE CON SCADENZA NON COMPUTABILI NEL PATRIMONIO DI BASE.....	XX	3	1	1		T	XD
	-STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE NON COMPUTABILI NEL PATRIMONIO DI BASE:							
	-STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE COMPUTABILI FINO AL 35%.....	XX	3	1	1		T	XD
	-STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE COMPUTABILI FINO AL 50%.....	XX	3	1	1		T	XD
	-STRUMENTI IBRIDI DI PATRIMONIALIZZAZIONE.....	14	3	1	1		T	XD
	-PASSIVITA' SUBORDINATE DI 2° LIVELLO.....	16	3	1	1		T	XD
	-ECCEDENZA RETTIFICHE DI VALORE COMPLESSIVE RISPETTO ALLE PERDITE ATTESE.....	18	3	1	1		T	XD
	-PLUSVALENZE NETTE SU PARTECIPAZIONI.....	20	3	1	1		T	XD
	-ALTRI ELEMENTI POSITIVI.....	22	3	1	1		T	XD
	-FILTRI PRUDENZIALI: INCREMENTI DEL PATRIMONIO SUPPLEMENTARE							
	-PLUSVALENZA CUMULATA NETTA SU ATTIVITA' MATERIALI.....	24	3	1	1		T	XD
	-RISORSE PATRIMONIALI OGGETTO DI IMPEGNI DI ACQUISTO A TERMINE COMPUTABILI NEL PATRIMONIO SUPPLEMENTARE....	26	3	1	1		T	XD
	-ALTRI FILTRI POSITIVI.....	28	3	1	1		T	XD
	-TOTALE DEGLI ELEMENTI POSITIVI DEL PATRIMONIO SUPPLEMENTARE.....	36	3	1	1		T	XD
	-ELEMENTI NEGATIVI:							
	-MINUSVALENZE NETTE SU PARTECIPAZIONI.....	38	3	1	1		T	XD
	-CREDITI.....	40	3	1	1		T	XD
	-ALTRI ELEMENTI NEGATIVI.....	42	3	1	1		T	XD
	-FILTRI PRUDENZIALI: DEDUZIONI DAL PATRIMONIO SUPPLEMENTARE:							
	-QUOTA NON COMPUTABILE DELLA RISERVA DA VALUTAZIONE SU ATTIVITA' MATERIALI AD USO FUNZIONALE.....	44	3	1	1		T	XD
	-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		T	XD
	-TITOLI DI DEBITO.....	48	3	1	1		T	XD
	-PASSIVITA' SUBORDINATE DI 2° LIVELLO E STRUMENTI IBRIDI DI PATRIMONIALIZZAZIONE OGGETTO DI IMPEGNI DI ACQUISTO A TERMINE NON COMPUTABILI NEL PATRIMONIO SUPPLEMENTARE.....	52	3	1	1		T	XD
	-ALTRI FILTRI NEGATIVI.....	53	3	1	1		T	XD
	-TOTALE DEGLI ELEMENTI NEGATIVI DEL PATRIMONIO							

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

BASE INF.	4.1 PATRIMONIO DI VIGILANZA	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	Q U A L I F I C A	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoc						
	SUPPLEMENTARE.....	60	3	1	1		T	XD
	-PATRIMONIO SUPPLEMENTARE AL LORDO DEGLI ELEMENTI DA DEDURRE:							
	-VALORE POSITIVO.....	80	3	1	1		T	XD
	-ECCEDENZA RISPETTO AL PATRIMONIO DI BASE AL LORDO DEGLI ELEMENTI DA DEDURRE.....	84	3	1	1		T	XD
	-VALORE POSITIVO AMMESSO.....	90	3	1	1		T	XD
	-VALORE NEGATIVO.....	94	3	1	1		T	XD
<b>Y</b>	<b>PATRIMONIO SUPPLEMENTARE - ELEMENTI DA DEDURRE.....</b>	<b>59510</b>						
	-INTERESSENZE AZIONARIE IN ENTI CREDITIZI E FINANZIARI SUPERIORI AL 10% DEL CAPITALE DELL'ENTE PARTECIPATO							
	-INTERESSENZE AZIONARIE.....	03	3	1	1		T	XD
	-STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE.....	05	3	1	1		T	XD
	-STRUMENTI INNOVATIVI DI CAPITALE E STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE CON SCADENZA.....	XX	3	1	1		T	XD
	-STRUMENTI IBRIDI DI PATRIMONIALIZZAZIONE.....	09	3	1	1		T	XD
	-STRUMENTI SUBORDINATI.....	11	3	1	1		T	XD
	-INTERESSENZE AZIONARIE IN ENTI CREDITIZI E FINANZIARI PARI O INFERIORI AL 10% DEL CAPITALE DELL'ENTE PARTECIPATO							
	-INTERESSENZE AZIONARIE.....	30	3	1	1		T	XD
	-STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE.....	32	3	1	1		T	XD
	-STRUMENTI INNOVATIVI DI CAPITALE E STRUMENTI NON INNOVATIVI DI CAPITALE CON SCADENZA.....	XX	3	1	1		T	XD
	-STRUMENTI IBRIDI DI PATRIMONIALIZZAZIONE.....	36	3	1	1		T	XD
	-STRUMENTI SUBORDINATI.....	38	3	1	1		T	XD
	-PARTECIPAZIONI IN SOCIETA' DI ASSICURAZIONE							
	-PARTECIPAZIONI.....	44	3	1	1		T	XD
	-STRUMENTI SUBORDINATI.....	46	3	1	1		T	XD
	-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	XD
	-ECCEDENZA DELLE PERDITE ATTESE RISPETTO ALLE RETTIFICHE DI VALORE COMPLESSIVE.....	50	3	1	1		T	XD
	-DEDUZIONI DERIVANTI DA CARTOLARIZZAZIONI.....	52	3	1	1		T	XD
	-DEDUZIONI RELATIVE AL RISCHIO DI REGOLAMENTO SU TRANSAZIONI NON DVP.....	54	3	1	1		T	XD
	-TOTALE ELEMENTI DA DEDURRE.....	90	3	1	1		T	XD
<b>Y</b>	<b>PATRIMONIO SUPPLEMENTARE.....</b>	<b>59512</b>						
	-VALORE POSITIVO.....	02	3	1	1		T	XD
	-VALORE NEGATIVO.....	12	3	1	1		T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

B A S E  I N F .	4.1 PATRIMONIO DI VIGILANZA	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	Q U A L I F I C A	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoc						
Y	ELEMENTI DA DEDURRE DAL PATRIMONIO DI BASE E DAL							
	PATRIMONIO SUPPLEMENTARE.....	<b>59514</b>						
	-PARTECIPAZIONI IN SOCIETA' DI ASSICURAZIONE:							
	-PARTECIPAZIONI.....	<b>02</b>	3	1	1		T	XD
	-STRUMENTI SUBORDINATI.....	<b>04</b>	3	1	1		T	XD
	-TOTALE ELEMENTI DA DEDURRE DAL PATRIMONIO DI BASE E DAL							
	PATRIMONIO SUPPLEMENTARE.....	<b>06</b>	3	1	1		T	XD
Y	PATRIMONIO DI VIGILANZA.....	<b>59516</b>						
	-VALORE POSITIVO.....	<b>02</b>	3	1	1		T	XD
	-VALORE NEGATIVO.....	<b>12</b>	3	1	1		T	XD
Y	PATRIMONIO DI 3° LIVELLO (TIER 3).....	<b>59518</b>						
	-ELEMENTI POSITIVI:							
	-PASSIVITA' SUBORDINATE DI 2° LIVELLO NON COMPUTABILI							
	NEL PATRIMONIO SUPPLEMENTARE.....	<b>02</b>	3	1	1		T	XD
	-PASSIVITA' SUBORDINATE DI 3° LIVELLO.....	<b>04</b>	3	1	1		T	XD
	-TOTALE ELEMENTI POSITIVI PATRIMONIO DI 3° LIVELLO.....	<b>06</b>	3	1	1		T	XD
	-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.....	<b>12</b>	3	1	1		T	XD
	-PATRIMONIO DI 3° LIVELLO:							
	-VALORE POSITIVO.....	<b>20</b>	3	1	1		T	XD
	-ECCEDENZA RISPETTO ALL'AMMONTARE COMPUTABILE.....	<b>22</b>	3	1	1		T	XD
	-VALORE POSITIVO AMMESSO.....	<b>24</b>	3	1	1		T	XD
Y	PATRIMONIO DI VIGILANZA INCLUSO IL PATRIMONIO DI 3°							
	LIVELLO.....	<b>59520</b>						
	-VALORE POSITIVO.....	<b>02</b>	3	1	1		T	XD
	-VALORE NEGATIVO.....	<b>12</b>	3	1	1		T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

B A S E  I N F .	4.1 PATRIMONIO DI VIGILANZA	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	Q U A L I F I C A	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoc						
Y	ALTRE INFORMAZIONI.....	59522						
	-PASSIVITA' SUBORDINATE DI 2° LIVELLO NON COMPUTABILI NEL PATRIMONIO SUPPLEMENTARE E NEL PATRIMONIO DI 3° LIVELLO.....	02	3	1	1		T	XD
	-PRESTITI SUBORDINATI DI 3° LIVELLO NON COMPUTABILI NEL PATRIMONIO DI 3° LIVELLO.....	04	3	1	1		T	XD
	-RISERVE DA VALUTAZIONE: COPERTURA DEI FLUSSI FINANZIARI:							
	-TITOLI DI DEBITO DISPONIBILI PER LA VENDITA:							
	-RISERVA POSITIVA.....	10	3	1	1		T	XD
	-RISERVA NEGATIVA.....	12	3	1	1		T	XD
	-TITOLI DI CAPITALE DISPONIBILI PER LA VENDITA:							
	-RISERVA POSITIVA.....	14	3	1	1		T	XD
	-RISERVA NEGATIVA.....	16	3	1	1		T	XD
	-ALTRI:							
	-RISERVA POSITIVA.....	18	3	1	1		T	XD
	-RISERVA NEGATIVA.....	20	3	1	1		T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

BASE INF.	4.2 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE	VOCE	DURATA	DIVISA	RESIDENZA	QUALIFICA	TIPO IMPORTO	FATTORE DI CONV	FATTORE DI POND	PORTAFOLIO	TIPO GARANZIA	CLAS. MERITO CRED	METODOL APPLIC	TIPOLOG ESPOSIZ	TIPO CARTOLARIZZ	RUOLO CARTOLARIZ	PERIODICITA'	NOTE
Y	METODOLOGIA STANDARDIZZATA: ATTIVITA' DI RISCHIO.....	59526																
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI E BANCHE CENTRALI.....	02	3	1	1		X	X	X								T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA ENTI TERRITORIALI.....	04	3	1	1		X	X	X								T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA ENTI SENZA SCOPO DI LUCRO ED ENTI DEL SETTORE PUBBLICO.....	06	3	1	1		X	X	X								T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA BANCHE MULTILATERALI DI SVILUPPO.....	08	3	1	1		X	X	X								T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA ORGANIZZAZIONI INTERNAZIONALI.....	10	3	1	1		X	X	X								T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA INTERMEDIARI VIGILATI.....	12	3	1	1		X	X	X								T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA IMPRESE.....	14	3	1	1		X	X	X								T	XD
	-ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO.....	16	3	1	1		X	X	X								T	XD
	-ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI.....	18	3	1	1		X	X	X								T	XD
	-ESPOSIZIONI SCADUTE.....	20	3	1	1		X	X	X								T	XD
	-ESPOSIZIONI AD ALTO RISCHIO.....	22	3	1	1		X	X	X								T	XD
	-ESPOSIZIONI SOTTO FORMA DI OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE.....	24	3	1	1		X	X	X								T	XD
	-ESPOSIZIONI A BREVE TERMINE VERSO IMPRESE.....	26	3	1	1		X	X	X								T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO DEL RISPARMIO (OICR).....	28	3	1	1		X	X	X								T	XD
	-ALTRE ESPOSIZIONI.....	30	3	1	1		X	X	X								T	XD
	-TOTALE ATTIVITA' DI RISCHIO																	
	-ATTIVITA' DI RISCHIO PER CASSA.....	50	3	1	1		X		X								T	XD
	-GARANZIE RILASCIATE E IMPEGNI A EROGARE FONDI.....	52	3	1	1		X		X								T	XD
	-CONTRATTI DERIVATI.....	54	3	1	1		X		X								T	XD
	-OPERAZIONI SFT E OPERAZIONI CON REGOLAMENTO A LUNGO TERMINE.....	56	3	1	1		X		X								T	XD
	-COMPENSAZIONE TRA PRODOTTI DIVERSI.....	58	3	1	1		X		X								T	XD
Y	METODOLOGIA STANDARDIZZATA: TECNICHE DI ATTENUAZIONE DEL RISCHIO DI CREDITO: AMMONTARE PROTETTO.....	59528																
	-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	XD
	-GARANZIE RILASCIATE E IMPEGNI A EROGARE FONDI.....	04	3	1	1		X		X	X							T	XD
	-CONTRATTI DERIVATI.....	06	3	1	1		X		X	X							T	XD
	-OPERAZIONI SFT E OPERAZIONI CON REGOLAMENTO A LUNGO TERMINE.....	08	3	1	1		X		X	X							T	XD
	-STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO REALE (METODO INTEGRALE)																	
	-ESPOSIZIONI GARANTITE																	
	-ATTIVITA' DI RISCHIO PER CASSA.....	12	3	1	1		X		X								T	XD
	-GARANZIE RILASCIATE E IMPEGNI A EROGARE FONDI.....	14	3	1	1		X		X								T	XD
	-CONTRATTI DERIVATI.....	16	3	1	1		X		X								T	XD
	-OPERAZIONI SFT E OPERAZIONI CON REGOLAMENTO A LUNGO TERMINE.....	18	3	1	1		X		X								T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

BASE INF.	4.2 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE	VOCE	SOTVOC	DURATA	DIVISA	RESIDENZA	QUALIFICA	TIPO IMPORTO	FATTORE DI CONV	FATTORE DI POND	PORTAFOLIO	TIPO GARANZIA	CLAS. MERITO CRED	METODOL APPLIC	TIPOLOG ESPOSIZ	TIPO CARTOLARIZZ	RUOLO CARTOLARIZ	PERIODICITA'	NOTE	
Y	METODOLOGIA BASATA SUI RATING INTERNI: PROBABILITA' DI																			
	DEFAULT (*).....	59530																		
	-RISCHIO DI CREDITO																			
	-AMMINISTRAZIONI CENTRALI E BANCHE CENTRALI.....	02	3	1	1								X					T	XD	
	-INTERMEDIARI VIGILATI, ENTI PUBBLICI E TERRITORIALI E ALTRI SOGGETTI.....	04	3	1	1								X					T	XD	
	-IMPRESE E FINANZIAMENTI SPECIALIZZATI																			
	-FINANZIAMENTI SPECIALIZZATI.....	06	3	1	1								X					T	XD	
	-ALTRI.....	08	3	1	1								X					T	XD	
	-POSIZIONI AL DETTAGLIO																			
	-ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI RESIDENZIALI.....	10	3	1	1								X					T	XD	
	-ESPOSIZIONI ROTATIVE AL DETTAGLIO QUALIFICATE.....	12	3	1	1								X					T	XD	
	-ALTRE ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO.....	14	3	1	1								X					T	XD	
	-METODO PD/LGD.....	XX	3	1	1								X					T	XD	
	-RISCHIO DI DILUIZIONE.....	16	3	1	1													T	XD	
	(*) La probabilità di default deve essere segnalata valorizzando il campo importo su 5 posizioni, con 2 cifre decimali senza l'indicazione della virgola.																			
Y	METODOLOGIA BASATA SUI RATING INTERNI: ATTIVITA' DI																			
	RISCHIO.....	59532																		
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI E BANCHE CENTRALI.....	02	3	1	1			X					X	X				T	XD	
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA INTERMEDIARI VIGILATI, ENTI PUBBLICI E TERRITORIALI E ALTRI SOGGETTI																			
	-INTERMEDIARI VIGILATI.....	04	3	1	1			X					X	X				T	XD	
	-ENTI PUBBLICI E TERRITORIALI.....	06	3	1	1			X					X	X				T	XD	
	-ALTRI.....	08	3	1	1			X					X	X				T	XD	
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA IMPRESE																			
	-FINANZIAMENTI SPECIALIZZATI.....	12	3	1	1			X					X	X				T	XD	
	-PMI.....	14	3	1	1			X					X	X				T	XD	
	-ALTRE IMPRESE.....	16	3	1	1			X					X	X				T	XD	
	-ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO																			
	-ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI RESIDENZIALI: PMI.....	20	3	1	1			X					X					T	XD	
	-ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI RESIDENZIALI: PERSONE FISICHE.....	22	3	1	1			X					X					T	XD	
	-ESPOSIZIONI ROTATIVE AL DETTAGLIO QUALIFICATE.....	24	3	1	1			X					X					T	XD	
	-ALTRE ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO: PMI.....	26	3	1	1			X					X					T	XD	
	-ALTRE ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO: PERSONE FISICHE.....	28	3	1	1			X					X					T	XD	
	-CREDITI COMMERCIALI ACQUISTATI - RISCHIO DI DILUIZIONE....	32	3	1	1			X						X				T	XD	
	-ALTRE ATTIVITA'.....	34	3	1	1			X										T	XD	
	-FINANZIAMENTI SPECIALIZZATI - SLOTTING CRITERIA.....	36	3	1	1			X	X					X				T	XD	
	-TRATTAMENTO ALTERNATIVO DELLE IPOTECHE IMMOBILIARI.....	38	3	1	1			X						X				T	XD	
	-RISCHIO DI REGOLAMENTO: ESPOSIZIONI PER TRANSAZIONI NON DVP CON FATTORI DI PONDERAZIONE REGOLAMENTARI.....	40	3	1	1			X	X					X				T	XD	
	-TOTALE ATTIVITA' DI RISCHIO																			
	-ATTIVITA' DI RISCHIO PER CASSA.....	60	3	1	1			X		X				X				T	XD	
	-GARANZIE RILASCIATE E IMPEGNI A EROGARE FONDI.....	62	3	1	1			X		X				X				T	XD	
	-CONTRATTI DERIVATI.....	64	3	1	1			X		X				X				T	XD	
	-OPERAZIONI SFT E OPERAZIONI CON REGOLAMENTO A LUNGO																			
	TERMINE.....	66	3	1	1			X		X				X				T	XD	
	-COMPENSAZIONE TRA PRODOTTI DIVERSI.....	68	3	1	1			X		X				X				T	XD	

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

BASE INF.	4.2 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE	VOCE	SOTVOC	DURATA	DIVISA	RESIDENZA	QUALIFICA	TIPO IMPORTO	FATTORE DI CONV	FATTORE DI POND	PORTAFOGLIO	TIPO GARANZIA	CLAS. MERITO CRED	METODOL APP LIC	TIPOLOG ESPOSIZ	TIPO CARTOLARIZZ	RUOLO CARTOLARIZ	PERIODICITA'	NOTE	
Y	METODOLOGIA BASATA SUI RATING INTERNI: ESPOSIZIONI IN																			
	STRUMENTI DI CAPITALE.....	59534																		
	-METODO PD/LGD: ATTIVITA' DI RISCHIO.....	02	3	1	1			X					X						T	XD
	-METODO DELLA PONDERAZIONE SEMPLICE: ATTIVITA' DI																			
	RISCHIO.....	04	3	1	1			X	X										T	XD
	-METODO DEI MODELLI INTERNI: ATTIVITA' DI RISCHIO.....	06	3	1	1			X											T	XD
Y	CARTOLARIZZAZIONI: METODOLOGIA STANDARDIZZATA: POSIZIONI																			
	VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE.....	59536																		
	-ATTIVITA' DI RISCHIO PER CASSA:																			
	-POSIZIONI VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE.....	02	3	1	1			X	X					X	X	X			T	XD
	-ATTIVITA' DI RISCHIO FUORI BILANCIO:																			
	-POSIZIONI VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE.....	04	3	1	1			X	X	X					X	X			T	XD
	-CLAUSOLE DI RIMBORSO ANTICIPATO.....	06	3	1	1			X	X						X	X			T	XD
	-TOTALE ESPOSIZIONI.....	20	3	1	1			X								X			T	XD
Y	CARTOLARIZZAZIONI: METODOLOGIA STANDARDIZZATA: POSIZIONI																			
	VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE: AMMONTARE PROTETTO.....	59538																		
	-ATTIVITA' DI RISCHIO																			
	-STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO REALE -																			
	METODO SEMPLIFICATO.....	02	3	1	1			X							X				T	XD
	-STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO REALE -																			
	METODO INTEGRALE.....	12	3	1	1			X							X	X			T	XD
Y	CARTOLARIZZAZIONI: METODOLOGIA BASATA SUI RATING INTERNI:																			
	POSIZIONI VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE.....	59540																		
	-ATTIVITA' DI RISCHIO PER CASSA																			
	-METODO BASATO SUI RATING.....	02	3	1	1			X	X					X	X	X			T	XD
	-METODO FORMULA DI VIGILANZA.....	04	3	1	1			X						X	X	X			T	XD
	-METODO DELLA VALUTAZIONE INTERNA.....	06	3	1	1			X						X	X	X			T	XD
	-ATTIVITA' DI RISCHIO FUORI BILANCIO																			
	-METODO BASATO SUI RATING.....	12	3	1	1			X	X	X					X	X			T	XD
	-METODO FORMULA DI VIGILANZA.....	14	3	1	1			X	X						X	X			T	XD
	-METODO DELLA VALUTAZIONE INTERNA.....	16	3	1	1			X	X						X	X			T	XD
	-CLAUSOLE DI RIMBORSO ANTICIPATO.....	20	3	1	1			X							X	X			T	XD
	-TOTALE ESPOSIZIONI.....	30	3	1	1			X								X			T	XD
Y	CARTOLARIZZAZIONI: METODOLOGIA BASATA SUI RATING INTERNI:																			
	POSIZIONI VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE: AMMONTARE PROTETTO.....	59542																		
	-ATTIVITA' DI RISCHIO:																			
	-STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO REALE -																			
	METODO INTEGRALE.....	00	3	1	1			X							X	X			T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

BASE INF.	4.3 GRANDI RISCHI	VOCE	DURATA	DIVISA	RESIDENZA	QUALIFICA	TIPO	COD	METODO	TIPO	PERIODICITA'	NOTE
		sotvoc					IMPORTO	TIPOLIA	UTILIZZAZIONE			
Y	PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA.....	05800 00	3	1	1		X	X	X	X	T	XD
Y	ALTRE ATTIVITA' DI RISCHIO PER CASSA.....	05804										
	-IMPIEGHI TOTALI.....	02	3	1	1		X	X	X	X	T	XD
	-PARTECIPAZIONI IN IMPRESE NON FINANZIARIE.....	12	3	1	1		X	X	X	X	T	XD
	-TITOLI DI CAPITALE: ALTRI.....	XX	3	1	1		X	X	X	X	T	XD
	-TITOLI OBBLIGAZIONARI.....	XX	3	1	1		X	X	X	X	T	XD
	-ALTRE ATTIVITA'.....	XX	3	1	1		X	X	X	X	T	XD
Y	ATTIVITA' DI RISCHIO FUORI BILANCIO.....	05806										
	-GARANZIE RILASCIATE E IMPEGNI.....	02	3	1	1		X	X	X	X	T	XD
	-CONTRATTI DERIVATI FINANZIARI.....	XX	3	1	1		X	X	X	X	T	XD
	-CONTRATTI DERIVATI CREDITIZI.....	XX	3	1	1		X	X	X	X	T	XD
Y	DETTAGLIO DEI GRANDI RISCHI.....	05808										
	-INCAGLI TOTALI.....	02	3	1	1		X	X		X	T	XD
	-SOFFERENZE TOTALI.....	12	3	1	1		X	X		X	T	XD
	-ATTIVITA' DI RISCHIO CON SCADENZA SUCCESSIVA AL 31.12.2001.....	22	3	1	1		X	X		X	T	XD
Y	SVALUTAZIONI ANALITICHE SU IMPIEGHI TOTALI.....	05810 00	3	1	1		X	X		X	T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

BASE INF.	4.4 REQUISITI PATRIMONIALI SUI RISCHI DI MERCATO	VOCE	DURATA	DIVISA	RESIDENZA	QUALIFICA	VALUTA	VITA RESIDUA A	VITA RESIDUA B	VITA RES LUNGHE	VITA RES CORTE	TIPO TASSO	TIPO IMPORTO	TIPO LOGIA EMITT	PAESE MERC QUOT	TEMPO INADEMPIM	PORTAF REGOLA MEN	PORTAF GESTION	DATA RIFERIMENTO	PERIODICITA'	NOTE
Y	PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA:																				
	METODOLOGIA STANDARDIZZATA - TITOLI DI DEBITO - RISCHIO																				
	GENERICO - METODO BASATO SULLA SCADENZA.....	59562																			
	-TITOLI DI PROPRIETA'																				
	-POSIZIONI LUNGHE.....	02	3	X	X		X	X	X			X	X							T	XD
	-POSIZIONI CORTE.....	08	3	X	X		X	X	X			X	X							T	XD
	-OPERAZIONI 'FUORI BILANCIO'																				
	-CONTRATTI DERIVATI CON TITOLO SOTTOSTANTE																				
	-POSIZIONI LUNGHE.....	12	3	X	X		X	X	X			X	X							T	XD
	-POSIZIONI CORTE.....	18	3	X	X		X	X	X			X	X							T	XD
	-CONTRATTI DERIVATI SENZA TITOLO SOTTOSTANTE																				
	-POSIZIONI LUNGHE.....	22	3	X	X		X	X	X			X	X							T	XD
	-POSIZIONI CORTE.....	28	3	X	X		X	X	X			X	X							T	XD
	-ALTRE OPERAZIONI 'FUORI BILANCIO'																				
	-POSIZIONI LUNGHE.....	32	3	X	X		X	X	X			X	X							T	XD
	-POSIZIONI CORTE.....	38	3	X	X		X	X	X			X	X							T	XD
	-TOTALE PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA																				
	-POSIZIONI LUNGHE.....	42	3	X	X		X	X	X			X	X							T	XD
	-POSIZIONI CORTE.....	48	3	X	X		X	X	X			X	X							T	XD
Y	PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA:																				
	METODOLOGIA STANDARDIZZATA - TITOLI DI DEBITO - RISCHIO																				
	GENERICO - METODO BASATO SULLA DURATA FINANZIARIA.....	59564																			
	-TOTALE PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA																				
	-POSIZIONI LUNGHE.....	42	3	X	X		X	X												T	XD
	-POSIZIONI CORTE.....	48	3	X	X		X	X												T	XD
Y	PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA:																				
	METODOLOGIA STANDARDIZZATA - TITOLI DI DEBITO - RISCHIO																				
	SPECIFICO.....	59566																			
	-POSIZIONI VERSO CARTOLARIZZAZIONI																				
	-POSIZIONI LUNGHE.....	02	3	1	1															T	XD
	-POSIZIONI CORTE.....	08	3	1	1															T	XD
	-ALTRE POSIZIONI																				
	-POSIZIONI LUNGHE.....	12	3	1	1		X						X							T	XD
	-POSIZIONI CORTE.....	18	3	1	1		X						X							T	XD
	-DERIVATI SU CREDITI DI COPERTURA DI:																				
	-POSIZIONI VERSO CARTOLARIZZAZIONI:																				
	-A FRONTE DI POSIZIONI LUNGHE.....	22	3	1	1															T	XD
	-A FRONTE DI POSIZIONI CORTE.....	28	3	1	1															T	XD
	-ALTRE POSIZIONI:																				
	-A FRONTE DI POSIZIONI LUNGHE.....	32	3	1	1		X						X							T	XD
	-A FRONTE DI POSIZIONI CORTE.....	38	3	1	1		X						X							T	XD
	-POSIZIONI COMPENSATE ESPOSTE AL RISCHIO SPECIFICO:																				
	-POSIZIONI VERSO CARTOLARIZZAZIONI:	42	3	1	1															T	XD
	-ALTRE POSIZIONI:	48	3	1	1		X						X							T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.4 REQUISITI PATRIMONIALI 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	Q U A L I F I C A	V A L U T A	V I T A R E S I D U A	V I T A R E S I D U A	V I T A R E S L U N G H E	V I T A R E S C O R T E	T I P O T A S S O	T I P O I M P O R T O	T I P O L O G I A E M I T T	P A E S E M E R C Q U O T	T E M P O I N A D E M P I M	P O R T A F R E G O L A M E N	P O R T A F R E G I O N	D A T A R I F E R I M E N T O	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		SOTVOC																			
Y	PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA:																				
	METODOLOGIA STANDARDIZZATA - TITOLI DI CAPITALE.....	59568																			
	-PORTAFOGLIO QUALIFICATO																				
	-TITOLI DI PROPRIETA'																				
	-POSIZIONI LUNGHE.....	04	3	1	1								X	X							T XD
	-POSIZIONI CORTE.....	06	3	1	1								X	X							T XD
	-OPERAZIONI 'FUORI BILANCIO'																				
	-POSIZIONI LUNGHE.....	08	3	1	1								X	X							T XD
	-POSIZIONI CORTE.....	10	3	1	1								X	X							T XD
	-PORTAFOGLIO NON QUALIFICATO																				
	-TITOLI DI PROPRIETA'																				
	-POSIZIONI LUNGHE.....	24	3	1	1								X	X							T XD
	-POSIZIONI CORTE.....	26	3	1	1								X	X							T XD
	-OPERAZIONI 'FUORI BILANCIO'																				
	-POSIZIONI LUNGHE.....	28	3	1	1								X	X							T XD
	-POSIZIONI CORTE.....	30	3	1	1								X	X							T XD
	-POSIZIONI COMPENSATE DI CONTRATTI DERIVATI SU INDICI AZIONARI DIVERSIFICATI																				
	-POSIZIONI LUNGHE.....	42	3	1	1								X	X							T XD
	-POSIZIONI CORTE.....	52	3	1	1								X	X							T XD
	-POSIZIONI NON COMPENSATE DI CONTRATTI DERIVATI SU INDICI AZIONARI DIVERSIFICATI																				
	-POSIZIONI LUNGHE.....	64	3	1	1								X	X							T XD
	-POSIZIONI CORTE.....	66	3	1	1								X	X							T XD
	-STRUMENTI FINANZIARI SENSIBILI A PIU' FATTORI DI RISCHIO																				
	-POSIZIONI LUNGHE.....	68	3	1	1								X	X							T XD
	-POSIZIONI CORTE.....	70	3	1	1								X	X							T XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

BASE INF.	4.4 REQUISITI PATRIMONIALI SUI RISCHI DI MERCATO	VOCE	DURATA	DIVISA	RESIDENZA	QUALIFICA	VALUTA	VITA RESIDUA A	VITA RESIDUA B	VITA RES LUNGHE	VITA RES CORTE	TIPO TASSO	TIPO IMPORTO	TIPOLOGIA EMITT	PAESE MERC QUOT	TEMPO INADEMPIM	PORTAF REGOLAMEN	PORTAF GESTION	DATA RIFERIMENTO	PERIODICITA'	NOTE	
																						SOTVOC
Y	TRATTAMENTO DEI CONTRATTI DI OPZIONE: METODOLOGIA																					
	STANDARDIZZATA - METODO 'DELTA PLUS'.....	59570																				
	-STRUMENTI SOTTOSTANTI																					
	-TITOLI DI DEBITO																					
	-FATTORE GAMMA																					
	-POSITIVO.....	02	3	1	1		X		X	X		X								T	XD	
	-NEGATIVO.....	04	3	1	1		X		X	X		X								T	XD	
	-FATTORE VEGA																					
	-POSITIVO.....	06	3	1	1		X		X	X		X								T	XD	
	-NEGATIVO.....	08	3	1	1		X		X	X		X								T	XD	
	-TITOLI DI CAPITALE																					
	-FATTORE GAMMA																					
	-POSITIVO.....	12	3	1	1							X	X							T	XD	
	-NEGATIVO.....	14	3	1	1							X	X							T	XD	
	-FATTORE VEGA																					
	-POSITIVO.....	16	3	1	1							X	X							T	XD	
	-NEGATIVO.....	18	3	1	1							X	X							T	XD	
	-VALUTE E ORO																					
	-FATTORE GAMMA																					
	-POSITIVO.....	22	3	1	1		X					X								T	XD	
	-NEGATIVO.....	24	3	1	1		X					X								T	XD	
	-FATTORE VEGA																					
	-POSITIVO.....	26	3	1	1		X					X								T	XD	
	-NEGATIVO.....	28	3	1	1		X					X								T	XD	
Y	PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA:																					
	METODOLOGIA STANDARDIZZATA - CERTIFICATI DI PARTECIPAZIONE																					
	A O.I.C.R. - TITOLI DI DEBITO - RISCHIO DI POSIZIONE.....	59572																				
	-POSIZIONI LUNGHE.....	02	3	1	1																T	XD
	-POSIZIONI CORTE.....	12	3	1	1																T	XD
Y	PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA:																					
	METODOLOGIA STANDARDIZZATA - CERTIFICATI DI PARTECIPAZIONE																					
	A O.I.C.R. - TITOLI DI CAPITALE - RISCHIO DI POSIZIONE.....	59574																				
	-POSIZIONI LUNGHE.....	02	3	1	1																T	XD
	-POSIZIONI CORTE.....	12	3	1	1																T	XD
Y	PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA: RISCHIO																					
	DI REGOLAMENTO PER LE TRANSAZIONI DVP - ESPOSIZIONE.....	59576	00	3	1	1										X					T	XD
Y	RISCHIO DI CAMBIO: METODOLOGIA STANDARDIZZATA: POSIZIONE																					
	NETTA APERTA IN CAMBI.....	59578																				
	-VALUTE																					
	-POSIZIONI LUNGHE.....	04	3	1	1		X														T	XD
	-POSIZIONI CORTE.....	08	3	1	1		X														T	XD
	-ORO																					
	-POSIZIONE LUNGA.....	12	3	1	1		X														T	XD
	-POSIZIONE CORTA.....	16	3	1	1		X														T	XD
	-ALTRE QUOTE DI O.I.C.R. - VALUTE DISTINTE.....	30	3	1	1																T	XD
	-POSIZIONE NETTA APERTA IN CAMBI.....	40	3	1	1																T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

BASE INF.	4.4 REQUISITI PATRIMONIALI SUI RISCHI DI MERCATO	VOCE	DURATA	DIVISA	RESIDENZA	QUALIFICA	VALUTA	VITA RESIDUA A	VITA RESIDUA B	VITA RESIDUA LUNGHE	VITA RESCORTE	TIPOTASSO	TIPORTO	TIPOLOGIA EMITT	PAESE MERC QUOT	TEMPO INADEMPIM	PORTAF REGOLAMEN	PORTAF GESTION	DATARIFERIMENTO	PERIODICITA'	NOTE	
		SOTVOC																				
Y	MODELLI INTERNI SUI RISCHI DI MERCATO: INFORMAZIONI SUL																					
	VAR.....	59580																				
	-VAR REGOLAMENTARE DECADALE																					
	-MEDIA RELATIVA AGLI ULTIMI 60 GIORNI MOLTIPLICATA PER IL FATTORE BETA.....	02	3	1	1												X			T	XD	
	-VAR T-1.....	04	3	1	1												X			T	XD	
	-VAR REGOLAMENTARE A FRONTE DEL RISCHIO SPECIFICO																					
	-MEDIA RELATIVA AGLI ULTIMI 60 GIORNI.....	06	3	1	1												X			T	XD	
	-VAR T-1.....	08	3	1	1												X			T	XD	
	-REQUISITO PER IL RISCHIO DI DEFAULT.....	10	3	1	1												X			T	XD	
	-NUMERO DI SCOSTAMENTI.....	12	3	1	1															T	XD	
	-FATTORE MOLTIPLICATIVO.....	14	3	1	1															T	XD	
	-VAR GESTIONALE																					
	-INTERVALLO DI CONFIDENZA.....	16	3	1	1															T	XD	
	-ORIZZONTE TEMPORALE DI RIFERIMENTO.....	18	3	1	1															T	XD	
Y	MODELLI INTERNI SUI RISCHI DI MERCATO: INFORMAZIONI SUL																					
	BACKTESTING.....	59582																				
	-VAR REGOLAMENTARE																					
	-DECADALE.....	02	3	1	1													X	X	T	XD	
	-GIORNALIERO.....	04	3	1	1													X	X	T	XD	
	-VAR GESTIONALE.....	06	3	1	1													X	X	T	XD	
	-VAR A FRONTE DEL RISCHIO SPECIFICO.....	08	3	1	1														X	T	XD	
	-REQUISITO PER IL RISCHIO DI DEFAULT.....	10	3	1	1														X	T	XD	
	-BACKTESTING: UTILI E PERDITE																					
	-EFFETTIVI (*).....	20	3	1	1													X	X	T	XD	
	-IPOTETICI (*).....	22	3	1	1													X	X	T	XD	
	-LIMITI DEL VAR GESTIONALE.....	30	3	1	1													X	X	T	XD	

(119) - (\*) segnalazioni che possono assumere valore negativo

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

BASE INF.	4.4 REQUISITI PATRIMONIALI SUI RISCHI DI MERCATO	VOCE	DURATA	DIVISA	RESIDENZA	QUALIFICA	VALUTA	VITA RESIDUA A	VITA RESIDUA B	VITA RES LUNGHE	VITA RES CORTE	TIPO TASSO	TIPO IMPORTO	TIPOLOGIA EMITT	PAESE MERC QUOT	TEMPO INADEMPIM	PORTAF REGOLAMEN	PORTAF GESTION	DATA RIFERIMENTO	PERIODICITA'	NOTE
Y	PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA - METODOLOGIA STANDARDIZZATA - RISCHIO DI POSIZIONE SU TITOLI DI DEBITO, TITOLI DI CAPITALE E QUOTE DI O.I.C.R., OPZIONI: REQUISITI PATRIMONIALI.....	59584																			
	-RISCHIO GENERICO																				
	-TITOLI DI DEBITO																				
	-METODO BASATO SULLA SCADENZA.....	02	3	1	1															T	XD
	-METODO BASATO SULLA DURATA FINANZIARIA.....	04	3	1	1															T	XD
	-TITOLI DI CAPITALE.....	10	3	1	1															T	XD
	-RISCHIO SPECIFICO																				
	-TITOLI DI DEBITO.....	12	3	1	1															T	XD
	-TITOLI DI CAPITALE.....	14	3	1	1															T	XD
	-RISCHIO DI POSIZIONE DEI CERTIFICATI DI PARTECIPAZIONE A O.I.C.R.																				
	-METODO DELLA SCOMPOSIZIONE SEMPLIFICATA.....	22	3	1	1															T	XD
	-METODO DELLA SCOMPOSIZIONE PARZIALE.....	24	3	1	1															T	XD
	-METODO RESIDUALE.....	26	3	1	1															T	XD
	-OPZIONI																				
	-METODO SEMPLIFICATO.....	32	3	1	1															T	XD
	-METODO 'DELTA-PLUS':																				
	-FATTORE GAMMA.....	34	3	1	1															T	XD
	-FATTORE VEGA.....	36	3	1	1															T	XD
	-METODO DI SCENARIO.....	38	3	1	1															T	XD
Y	PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA - RISCHIO DI REGOLAMENTO PER LE TRANSAZIONI DVP: REQUISITO PATRIMONIALE.....	59586	00	3	1	1														T	XD
Y	RISCHIO DI CAMBIO - METODOLOGIA STANDARDIZZATA - REQUISITO PATRIMONIALE.....	59588	00	3	1	1														T	XD
Y	RISCHIO SULLE POSIZIONI IN MERCI: METODOLOGIA STANDARDIZZATA - REQUISITO PATRIMONIALE.....	59590																			
	-METODO BASATO SULLE FASCE DI SCADENZA.....	02	3	1	1															T	XD
	-METODO BASATO SULLE FASCE DI SCADENZA AMPLIATO.....	04	3	1	1															T	XD
	-METODO SEMPLIFICATO.....	06	3	1	1															T	XD
Y	MODELLI INTERNI SUI RISCHI DI MERCATO - REQUISITO PATRIMONIALE.....	59592																			
	-VAR.....	02	3	1	1															T	XD
	-ALTRI REQUISITI.....	04	3	1	1															T	XD
Y	PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA: REQUISITO PATRIMONIALE SU STRUMENTI FINANZIARI ESPOSTI A FATTORI DI RISCHIO NON CONTEMPLATI DALLA NORMATIVA.....	59594	00	3	1	1														T	XD
Y	RISCHI DI MERCATO: SEGNALAZIONE NEGATIVA.....	59596	00	3	1	1														T	

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

B A S E  I N F .	4.5 REQUISITO PATRIMONIALE 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	Q U A L I F I C A	L I N E E	E V E N T I	T I P O	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoci									
Y	MARGINE DI INTERMEDIAZIONE.....	59610									
	-METODO BASE										
	-MARGINE INTERMEDIAZIONE 31.12 ANNO T.....	02	3	1	1					T	XD
	-MARGINE INTERMEDIAZIONE 31.12 ANNO T-1.....	04	3	1	1					T	XD
	-MARGINE INTERMEDIAZIONE 31.12 ANNO T-2.....	06	3	1	1					T	XD
	-METODO STANDARDIZZATO										
	-MARGINE INTERMEDIAZIONE 31.12 ANNO T (*).....	12	3	1	1		X			T	XD
	-MARGINE INTERMEDIAZIONE 31.12 ANNO T-1 (*).....	14	3	1	1		X			T	XD
	-MARGINE INTERMEDIAZIONE 31.12 ANNO T-2 (*).....	16	3	1	1		X			T	XD
	-METODI AVANZATI										
	-MARGINE INTERMEDIAZIONE 31.12 ANNO T (*).....	22	3	1	1		X			T	XD
	-MARGINE INTERMEDIAZIONE 31.12 ANNO T-1 (*).....	24	3	1	1		X			T	XD
	-MARGINE INTERMEDIAZIONE 31.12 ANNO T-2 (*).....	26	3	1	1		X			T	XD
	(119) - (*) segnalazioni che possono assumere valore negativo										
Y	METODI AVANZATI.....	59612									
	-REQUISITO PATRIMONIALE LORDO.....	02	3	1	1					T	XD
	-RIDUZIONI DEL REQUISITO PATRIMONIALE LORDO										
	-POLIZZE ASSICURATIVE: QUOTA DEDUCIBILE.....	04	3	1	1					T	XD
	-ALTRI MECCANISMI DI TRASFERIMENTO: QUOTA DEDUCIBILE.....	06	3	1	1					T	XD
	-ACCANTONAMENTI A FRONTE DEL RISCHIO OPERATIVO.....	08	3	1	1					T	XD
	-CORRELAZIONE TRA LE PERDITE.....	10	3	1	1					T	XD
	-RIDUZIONI DEL REQUISITO PATRIMONIALE LORDO: QUOTA NON DEDUCIBILE.....	12	3	1	1					T	XD
Y	RIPARTIZIONE DELLE PERDITE OPERATIVE PER LINEE DI BUSINESS E PER EVENTI DI PERDITA.....	59614									
	-NUMERO DI EVENTI DI PERDITA.....	02	3	1	1		X	X		S	XD
	-PERDITE										
	-IMPORTO TOTALE.....	06	3	1	1		X	X		S	XD
	-PERDITA MASSIMA.....	08	3	1	1		X	X		S	XD
	-PERDITA MEDIANA.....	10	3	1	1		X	X		S	XD
	-RECUPERI TOTALI DA:										
	-POLIZZE ASSICURATIVE E ALTRI MECCANISMI DI TRASFERIMENTO DEL RISCHIO OPERATIVO.....	16	3	1	1		X	X		S	XD
	-ALTRI.....	18	3	1	1		X	X		S	XD
	-SOGLIA MINIMA DI PERDITA.....	20	3	1	1		X	X		S	XD
	-SOGLIA MINIMA DI PERDITA: SEGNALE NEGATIVA.....	30	3	1	1					S	

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

B A S E  I N F .	4.6 POSIZIONE PATRIMONIALE	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	Q U A L I F I C A	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoc						
Y	REQUISITI PATRIMONIALI.....	59620						
	-RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE							
	-METODOLOGIA STANDARDIZZATA.....	02	3	1	1		T	XD
	-METODOLOGIA BASATA SU RATING INTERNI							
	-DI BASE.....	04	3	1	1		T	XD
	-AVANZATA.....	06	3	1	1		T	XD
	-RISCHI DI MERCATO							
	-METODOLOGIA STANDARDIZZATA.....	10	3	1	1		T	XD
	-MODELLI INTERNI.....	12	3	1	1		T	XD
	-RISCHIO DI CONCENTRAZIONE.....	16	3	1	1		T	XD
	-RISCHIO OPERATIVO							
	-METODO BASE.....	24	3	1	1		T	XD
	-METODO STANDARDIZZATO.....	26	3	1	1		T	XD
	-METODI AVANZATI.....	28	3	1	1		T	XD
	-INTEGRAZIONE PER 'FLOOR'.....	30	3	1	1		T	XD
	-RIDUZIONE DEI REQUISITI PATRIMONIALI PER BANCHE							
	APPARTENENTI A GRUPPI BANCARI.....	32	3	1	1		T	XD
	-ALTRI REQUISITI.....	34	3	1	1		T	XD
Y	REQUISITI PATRIMONIALI SPECIFICI.....	59622	00	3	1	1		T XD
Y	REQUISITI PATRIMONIALI TOTALI.....	59624	00	3	1	1		T XD
Y	POSIZIONE PATRIMONIALE.....	59626						
	-ECEDENZA.....	02	3	1	1		T	XD
	-DEFICIENZA.....	12	3	1	1		T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI

B A S E  I N F .	4.6bis POSIZIONE PATRIMONIALE "ex Basilea1"	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	Q U A L I F I C A	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoc						
Y	REQUISITI PATRIMONIALI.....	<b>05850</b>						
	-RISCHI DI CREDITO							
	-REQUISITO 7%.....	<b>02</b>	3	1	1		T	XD
	-REQUISITO 8%.....	<b>04</b>	3	1	1		T	XD
	-RISCHI DI MERCATO							
	-RISCHI DEL PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA (METODO STANDARD).....	<b>08</b>	3	1	1		T	XD
	-RISCHI SULLE POSIZIONI IN MERCI (METODO STANDARD).....	<b>10</b>	3	1	1		T	XD
	-RISCHI DI CAMBIO (METODO STANDARD).....	<b>12</b>	3	1	1		T	XD
	-RISCHI DI MERCATO - MODELLI INTERNI.....	<b>13</b>	3	1	1		T	XD
	-RISCHIO DI CONCENTRAZIONE.....	<b>14</b>	3	1	1		T	XD
	-PRESTITI SUBORDINATI UTILIZZABILI A 'COPERTURA' DEI RISCHI DI MERCATO.....	<b>18</b>	3	1	1		T	XD
	-RISCHI DI MERCATO 'NETTI'.....	<b>22</b>	3	1	1		T	XD
	-ALTRI REQUISITI.....	<b>26</b>	3	1	1		T	XD
Y	REQUISITI PATRIMONIALI SPECIFICI.....	<b>05854 00</b>	3	1	1		T	XD
Y	REQUISITI PATRIMONIALI TOTALI.....	<b>05858 00</b>	3	1	1		T	XD