

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 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	F A T T O R E P O N D E R A Z I O N E	T I P O L O G I A S O T T O S T A N T E	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 E N S I T O	P E R I O D I C I T A .	N O T E
		S0TV0C																		
					0 4 0	0 0 7	5 5 1	5 5 2	5 5 8	5 5 4	5 5 5	5 5 9	0 1 1 3 6	0 1 2 1 2	3 5 0	3 5 7	3 6 3	2 1 2		
CODICE VARIABILE																				
S	TITOLI DI DEBITO 0%.	44252																		
	- POSIZIONI LUNGHE	02	1	1																M
	- POSIZIONI CORTE.	04	1	1																M
S	TITOLI DI DEBITO QUALIFICATI	44255																		
	- POSIZIONI LUNGHE	02	1	1	X															M
	- POSIZIONI CORTE.	04	1	1	X															M
S	TITOLI DI DEBITO AD ALTO RISCHIO:	44257																		
	- POSIZIONI LUNGHE	02	1	1																M
	- POSIZIONI CORTE.	04	1	1																M
S	ALTRI TITOLI DI DEBITO:	44277																		
	- POSIZIONI LUNGHE	02	1	1																M
	- POSIZIONI CORTE.	04	1	1																M
S	CARTOLARIZZAZIONI:	44278																		
	METODOLOGIA STANDARDIZZATA																			
	- POSIZIONI LUNGHE VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE	02	1	1									X							M
	- POSIZIONI CORTE VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE.	04	1	1									X							M
	- POSIZIONI LUNGHE VERSO LA RI-CARTOLARIZZAZIONE	06	1	1									X							M
	- POSIZIONI CORTE VERSO LA RI-CARTOLARIZZAZIONE.	08	1	1									X							M
	ALTRE METODOLOGIE																			
	- POSIZIONI LUNGHE VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE	10	1	1									X							M
	- POSIZIONI CORTE VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE.	12	1	1									X							M
	- POSIZIONI LUNGHE VERSO LA RI-CARTOLARIZZAZIONE	14	1	1									X							M
	- POSIZIONI CORTE VERSO LA RI-CARTOLARIZZAZIONE.	16	1	1									X							M
	TOTALE																			
	TOTALE POSIZIONI VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE E																			
S	LA RI-CARTOLARIZZAZIONE	18	1	1										X						M
S	SOTTO PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE DI CORRELAZIONE:	44279																		
	METODOLOGIA STANDARDIZZATA																			
	- POSIZIONI LUNGHE VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE	02	1	1									X							M
	- POSIZIONI CORTE VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE.	04	1	1									X							M
	ALTRE METODOLOGIE																			
	- POSIZIONI LUNGHE VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE	06	1	1									X							M
	- POSIZIONI CORTE VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE.	08	1	1									X							M
	POSIZIONI IN DERIVATI CREDITIZI N-T0-DEFAULT																			
	- POSIZIONI LUNGHE	10	1	1									X							M
	- POSIZIONI CORTE.	12	1	1									X							M
	ALTRE POSIZIONI																			

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 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	F A T T O R E P O N D E R A Z I O N E	T I P O L O G I A S O T T O S T A N T E	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 E N S I T O	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	0 1 1 3 6	0 1 2 1 2	3 5 0	3 5 7	3 6 3	2 1 2				
	- POSIZIONI LUNGHE								14	1	1								X						M		
	- POSIZIONI CORTE.								16	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 .	5.4 RISCHIO GENERICO E SPECIFICO SU TITOLI DI CAPITALE	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 I C E C E N S I T O	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	2 1 2					
S	RISCHIO GENERICO:	44230																						
	- POSIZIONI LUNGHE	02	1	1			X1														M			
	- POSIZIONI CORTE.	04	1	1			X1														M			
S	RISCHIO SPECIFICO.	44248																						
	- POSIZIONI LUNGHE	02	1	1			X1														M			
	- POSIZIONI CORTE.	04	1	1			X1														M			
S	POSIZIONI COMPENSATE DI CONTRATTI DERIVATI SU INDICI	44233	02	1	1																M			

SEGNALAZIONI CONSOLIDATE DELLE SIM

IV SEZIONE: COEFFICIENTI PATRIMONIALI CONSOLIDATI

B A S E I N F .	4.1 RISCHIO DI CONCENTRAZIONE	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 .	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 .	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	T I P O	C O D I C E	P E R I O D I C I T A	N O T E
		S0TVOC																				
					0	0	5	5	5	5	5	5	5	5	9	2	3	3	3	2		
					4	0	5	5	5	5	5	5	5	5	0	9	5	5	6	1		
					0	7	1	2	8	4	5	5	5	9	6	4	0	7	3	2		
	PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE DI VIGILANZA:																					
V2	POSIZIONI LUNGHE NETTE IN TITOLI	45650	00	1	1												X		X	X	T	
	PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE DI VIGILANZA:																					
V2	POSIZIONI RELATIVE AL RISCHIO DI CONTROPARTE.	45654	00	1	1												X		X	X	T	
	PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE DI VIGILANZA:																					
V2	POSIZIONI RELATIVE AL RISCHIO DI REGOLAMENTO.	45658	00	1	1												X		X	X	T	
	ATTIVITA' DIVERSE DAL PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE DI																					
V2	VIGILANZA: ATTIVITA' IN BILANCIO.	45662	00	1	1												X		X	X	T	
	ATTIVITA' DIVERSE DAL PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE DI																					
V2	VIGILANZA: GARANZIE RILASCIATE E IMPEGNI	45666	00	1	1												X		X	X	T	
	ATTIVITA' DIVERSE DAL PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE DI																					
V2	VIGILANZA: CONTRATTI DERIVATI E SIMILARI	45670	00	1	1												X		X	X	T	
V2	DETTAGLIO DEI GRANDI RISCHI: SOFFERENZE	45674	00	1	1														X	X	T	
V2	COPERTURA PATRIMONIALE AGGIUNTIVA	45676	00	1	1																T	
V2	RAPPORTO GRANDE RISCHIO/PATRIMONIO	45678	00	1	1														X	X	T	

SEGNALAZIONI CONSOLIDATE DELLE SIM

IV SEZIONE: COEFFICIENTI PATRIMONIALI CONSOLIDATI

B A S E I N F .	4.2 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 . 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 I C E C E N S I T O	P E R I O D I C I T A	N O T E
						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	2 1 2	
	CODICE VARIABLE																			
	COPERTURA PATRIMONIALE PER RISCHIO GENERICO SU TITOLI																			
V2	DI DEBITO - METODO BASATO SULLA SCADENZA	45688	00	1	1															T
	COPERTURA PATRIMONIALE PER RISCHIO GENERICO SU TITOLI																			
V2	DI DEBITO - METODO BASATO SULLA DURATA FINANZIARIA	45690	00	1	1															T
	COPERTURA PATRIMONIALE PER RISCHIO SPECIFICO																			
V2	SU TITOLI DI DEBITO	45692	00	1	1															T
	COPERTURA PATRIMONIALE PER RISCHIO GENERICO E SPECIFICO																			
V2	SU TITOLI DI CAPITALE	45694	00	1	1															T
	COPERTURA PATRIMONIALE PER RISCHIO DI POSIZIONE																			
V2	SU PARTI DI O.I.C.R.	45696	00	1	1															T
V2	COPERTURA PATRIMONIALE PER RISCHIO DI CAMBIO	45698	00	1	1															T
V2	COPERTURA PATRIMONIALE PER RISCHIO DI REGOLAMENTO.	45700	00	1	1															T
	COPERTURA PATRIMONIALE PER RISCHIO DI CREDITO																			
V2	E DI CONTROPARTE.	45704	00	1	1															T
	COPERTURA PATRIMONIALE AGGIUNTIVA PER RISCHIO																			
V2	DI CONCENTRAZIONE	45708	00	1	1															T
	COPERTURA PATRIMONIALE PER RISCHIO SULLE POSIZIONI																			
V2	IN MERCI:	45712																		
	- METODO BASATO SULLE FASCE DI SCADENZA		02	1	1															T
	- METODO BASATO SULLE FASCE DI SCADENZA AMPLIATO		03	1	1															T
	- METODO SEMPLIFICATO.		04	1	1															T
V2	COPERTURA PATRIMONIALE PER LE OPZIONI:	45716																		
	- METODO DELTA-PLUS		02	1	1															T
	- APPROCCIO SEMPLIFICATO.		06	1	1															T
V2	COPERTURA PATRIMONIALE PER RISCHIO OPERATIVO	45720																		
	METODO BASE.		02	1	1															T
	METODO STANDARDIZZATO.		04	1	1															T
	METODI AVANZATI.		06	1	1															T
	COPERTURA PATRIMONIALE PER MODELLI INTERNI SU RISCHI DI																			
V2	MERCATO.	45724	00	1	1															T
	COPERTURA PATRIMONIALE PER GARANZIA SU FONDI PENSIONE																			
V2	GESTITI.	45728	00	1	1															T

SEGNALAZIONI CONSOLIDATE DELLE SIM																					
IV SEZIONE: COEFFICIENTI PATRIMONIALI CONSOLIDATI																					
B A S E I N F .	4.2 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 . 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 I C E C E N S I T O	P E R I O D I C I T A '	N O T E	
		S0TV0C																			
CODICE VARIABLE					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	2 1 2			

	COPERTURE PATRIMONIALI COMPLESSIVE RICHIESTE DALLA																			
V2	NORMATIVA PRUDENZIALE..	45732	00	1	1														T	
V2	CASI PARTICOLARI: COPERTURA PATRIMONIALE COMPLESSIVA.	45736	00	1	1														T	