



BANCA D'ITALIA
EUROSISTEMA

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

Firmato digitalmente da

GRAZIANI
PALMIERI LAURA

Firmato digitalmente da GRAZIANI PALMIERI LAURA
DN: cn=IT, o=Banca d'Italia/00950501007,
dnQualifier=1550, givenName=LAURA, sn=GRAZIANI
PALMIERI, serialNumber=IT.GRZLRA62P58H5011,
cn=GRAZIANI PALMIERI LAURA
Date: 2014.04.02 16:42:45 +02'00'



BANCA D'ITALIA
EUROSISTEMA

Segnalazioni di vigilanza delle istituzioni creditizie e finanziarie.

Schemi di rilevazione e istruzioni per l'inoltro dei flussi informativi

Circolare n. 154 del 22 novembre 1991

| 53° aggiornamento – aprile 2014

Servizio Rilevazioni Statistiche

Circolare n.154 del 22 novembre 1991

Aggiornamenti

AGGIORNAMENTO N.1 - GENNAIO 1992

Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:

1, 5, 6, A.1, A.2, A.3, A.4, A.7, A.8, C.1, C.2, F.3, F.4, L.1bis, L.1ter, L.11, L.12, L.13, L.14, L.19, L.20, L.21, L.22, L.23, L.24, M.1, M.2, M.5, M.6, M.7, M.8, M.9, M.10, P.3, P.4, P.9, P.10, Q.1, Q.3, Q.4, R.1, R.2, R.7, R.7bis, R.7ter, R.8, R.9, R.9bis, R.9ter, R.10, S.1, S.2.

TOMO II:

E.I.1, E.I.1bis, E.I.2, E.I.2bis, E.I.15, E.I.16, E.VI.9, E.VI.10.

Elenco delle pagine da eliminare

TOMO I:

L.25, L.26, L.27.

AGGIORNAMENTO N.2 - APRILE 1992

Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:

1, 5, 6, 7, 9, A.1, A.2, A.4, A.5, A.6, A.7, A.8, A.9, B.1, B.2, E.1, F.3, I.1, L.1ter, M.1, M.6, M.7, M.9, M.10, M.11, M.12, M.13, M.20, N.1, N.2, N.5, N.8, P.2, P.7, P.10, P.11, P.12, P.22, P.23, P.24, P.25, Q.1, Q.2, Q.3, R.1, R.6, R.7, R.8, R.9, R.10, R.11, R.12, R.13, R.14, T.1.

TOMO II:

A.4, A.I.3.1, A.I.3.2, A.I.3.3, A.I.3.4, A.I.3.5, A.I.3.6, A.I.3.7, A.I.3.8, A.III.2.6, A.III.3.1, A.III.3.2, A.III.6.2, A.III.7.1, A.III.7.2, A.III.7.3, A.III.7.4, A.III.7.5, A.III.7.6, A.III.7.7, A.III.7.8, A.III.9.2, A.III.10.6, A.III.10.7, A.III.10.8, A.III.10.9, A.IV.4.13, A.IX.2.1, A.IX.2.2, A.IX.2.3, A.IX.2.4, B.4, B.I.3.1, B.I.3.2, B.I.3.3, B.I.3.4, B.I.3.5, B.I.3.6, B.I.3.7, B.III.2.6, B.III.3.1, B.III.3.2, B.III.5.2, B.III.6.1, B.III.6.2, B.III.6.3, B.III.6.4, B.III.8.1, B.III.9.2, B.III.9.3, B.III.9.4, B.III.9.5, B.VIII.2.1, B.VIII.2.2, B.VIII.2.3, C.3, C.I.3.5, C.III.2.1, C.III.6.1, C.III.6.2, C.III.6.3, C.III.6.4, C.III.8.1, C.III.9.1, C.III.9.2, C.III.9.3, C.VII.2.1, C.VII.2.2, C.VII.2.3, C.VII.2.4, D.1, D.I.1, D.I.3, D.I.5, D.I.6, D.I.7, D.I.8, D.I.9, D.I.10, D.I.11, D.I.12, D.I.13, D.I.14, D.I.15, D.I.16, D.I.17, D.I.18, D.I.19, D.I.20, D.I.21, D.I.22, D.I.23, D.I.24, D.I.25, D.I.26, D.I.27, E.I.18, E.I.22, E.I.23, E.I.24, E.I.25, E.II.2, E.III.2, E.IV.2, E.V.2, E.VI.13, E.VI.17, F.IX.1, F.IX.2, F.IX.3, F.IX.4, F.IX.5, F.IX.6, F.IX.7.

Elenco delle pagine da eliminare

TOMO I:

R.7bis, R.7ter, R.9bis, R.9ter.

AGGIORNAMENTO N.3 - MAGGIO 1993

Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:

1, 5, 6, 7, 9, A.1, A.2, A.9, A.10, A.11, B.1, B.2, C.1, C.2, E.1, E.2, F.1, F.2, F.3, F.4, I.1, L.13, L.14, L.21, L.22, M.7, M.8, M.19, M.20, N.1, P.11, P.12, P.19, P.20, R.7, R.8, S.1, S.2, V.1, V.2, W.1, W.2, W.3, W.4, W.5, W.6, W.7, W.8, W.9, W.10, W.11, W.12, W.13, W.14, W.15, W.16, W.17, W.18, W.19, W.20, W.21, W.22.

TOMO II:

A.3, A.4; da A.I.1.3 a A.I.1.9; A.I.2.1, A.I.2.2, A.I.2.7, A.I.2.8, A.I.2.9, A.I.2.10; da A.I.3.5 a A.I.3.8; A.II.1.1; da A.III.1.3 a A.III.1.6; da A.III.2.3 a A.III.2.7; A.III.4.1, A.III.4.2, A.III.8.5, A.III.9.1, A.III.9.2; da A.III.9.5 a A.III.9.8; da A.III.10.7 a A.III.10.10; A.IV.2.3, A.IV.2.4; da A.IV.4.1 a A.IV.4.17; da A.VI.2.1 a A.VI.2.2; da A.VII.1.1 a A.VII.1.3; da A.VII.2.1 a A.VII.2.3; A.VII.4.3, A.VII.4.4; da A.VIII.1.1 a A.VIII.1.4; da A.VIII.2.1 a A.VIII.2.4; da A.VIII.3.1 a A.VIII.3.3; A.IX.1.3, B.3, B.4; da B.I.1.3 a B.I.1.9; B.I.2.1, B.I.2.2, B.I.2.7, B.I.2.8, B.I.2.9, B.I.2.10; da B.I.3.5 a B.I.3.7; da B.III.1.3 a B.III.1.6; da B.III.2.3 a B.III.2.7; B.III.7.5; da B.III.8.1 a B.III.8.8; da B.III.9.3 a B.III.9.6; da B.V.2.1 a B.V.2.2; da B.VI.1.1 a B.VI.1.2; da A.VI.2.1 a A.VI.2.3; B.VI.3.3, B.VI.3.4; da B.VII.1.1 a B.VII.1.4; da B.VII.2.1 a B.VII.2.4; da B.VII.3.1 a B.VII.3.3; B.VIII.1.3, C.3; da C.I.1.3 a C.I.1.7; da C.I.2.1 a C.I.2.5; da C.I.3.3 a C.I.3.5; C.II.1.1; da C.III.2.3 a C.III.2.6; C.III.7.1, C.III.7.2, C.III.7.3; da C.III.8.1 a C.III.8.7; da C.III.9.1 a C.III.9.4; C.IV.2.1, C.IV.2.2, C.IV.2.3; da C.V.1.1 a C.V.1.2; da C.V.2.1 a C.VI.2.3; C.V.3.3; da C.VI.1.1 a C.VI.1.4; da C.VI.2.1 a C.VI.2.4; da C.VI.3.1 a C.VI.3.3; C.VII.1.3; da C.bis.I a C.bis.IV.3.3; D.I.1; da D.I.5 a D.I.28; da E.I.9 a E.I.11; F.1, F.2.

Elenco delle pagine da eliminare

TOMO I:

N.2, N.3, N.4, N.5, N.6, N.7, N.8, N.9, N.10.

TOMO II:

A.II.1.2; A.VI.2.3; B.V.2.3; C.II.1.2; E.1.12; F.VIII.1, F.VIII.2, F.VIII.3, F.VIII.4, F.VIII.5, F.VIII.6, F.VIII.7, F.VIII.8, F.IX.1, F.IX.2, F.IX.3, F.IX.4, F.IX.5, F.IX.6, F.IX.7, F.IX.8.

AGGIORNAMENTO N.4 - NOVEMBRE 1993

Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:

A.1, A.2, A.3, A.4, B.1, B.2, B.3, F.1, F.2, F.3, F.4, I.1, M.7, M.8, M.19, M.20, P.5, P.6, P.7, P.8, P.9, P.10, P.11, P.12, P.25, P.26, R.7, R.8, Z.5.

TOMO II:

da A.5 a A.IX.2.4; da B.5 a B.VIII.2.3; da C.5 a C.VII.2.4; da C.bis.5 a C.bis.IV.3.3; da D.I.1 a D.I.24; E.I.1, E.I.1bis, E.I.2, E.I.2bis, E.I.9, E.I.10, E.I.11, E.II.1, E.II.2, E.III.1, E.III.2, E.IV.1, E.IV.2, E.V.1, E.V.2, E.VI.17, E.VI.18.

Elenco delle pagine da eliminare

TOMO II:

D.I.25, D.I.26, D.I.27.

AGGIORNAMENTO N.5 - FEBBRAIO 1994

Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:

1, 6, 9, A.11, B.3, B.4, C.1, E.1, F.2, F.3, G.1, I.1, M.1, M.7, M.14, M.20, M.21, P.22, P.27, P.28, P.29, P.30, Q.1, R.1, R.8, R.9, R.10, R.11, R.12, R.13, R.14, R.15, T.1.

TOMO II:

1ter, E.I.19, G.1, G.3, G.5, G.I.1.1, G.I.1.2, G.I.2.1, G.I.2.2, G.I.3.1, G.I.3.2, G.I.4.1, G.I.4.2, G.I.4.3, G.I.5.1, G.I.5.2, G.I.6.1, G.I.7.1, G.I.8.1, G.II.1.1, G.II.1.2, G.II.2.1, G.II.2.2, G.II.3.1, G.III.1.1, G.III.1.2, G.IV.1.1, G.IV.1.2, G.IV.1.3, G.IV.1.4, G.V.1.1, G.V.1.2, G.V.2.1, G.V.2.2, G.V.3.1, G.V.3.2.

Elenco delle pagine da eliminare

TOMO I:

T.2, T.3, T.4, T.5, T.6, T.7.

AGGIORNAMENTO N.6 - MAGGIO 1994

Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:

1, 5, 6, 7, 8, A.1, A.2, A.3, A.4, A.5, A.6, A.7, A.8, B.1, B.2, B.3, B.4, F.3, F.4, I.1, L.1, L.1bis, L.1ter, L.2, L.11, L.12, L.13, L.14, L.21, L.22, M.1, M.2, M.5, M.6, M.7, M.8, M.21, P.5, P.6, P.7, P.8, P.9, P.10, P.21, P.22, P.31, Q.1, Q.2, R.1, R.2, R.7, R.8, R.9, R.10, S.1, S.2.

TOMO II:

1ter, A.3, A.4, B.3, B.4, C.3, C.bis.3, D.I.1, D.I.21, D.I.22, D.I.23, D.I.24, D.I.25, D.I.26, E.I.11, E.I.13, E.I.14, E.I.25, E.I.26, da F.V.1 a F.X.2.

AGGIORNAMENTO N.7 - OTTOBRE 1994

Ristampa completa in tre tomi

AGGIORNAMENTO N.8 - MAGGIO 1995

Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:

1, 5, 7, A.3, A.4, B.2, B.3, B.4, E.1, F.2, F.3, L.1, da M.7 a M.12, M.19, da O.1 a O.6, da P.7 a P.13, Q.1, R.7, R.8, R.10, R.11, R.18, R.19, R.21, R.22.

TOMO II:

1, 3, da A.3 a A.28, F.1, F.I.1.

TOMO III:

1, da A.3 a A.20, B.3, B.4, B.5, da B.I.1.1 a B.VIII.15.1.

Elenco delle pagine da eliminare

TOMO I:

O.7, P.14, P.15, P.16

TOMO III:

da B.I.1 a B.X.2.

AGGIORNAMENTO N.9 - MAGGIO 1996

Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:

1, 2, 5, 6, A.3, A.4, da B.1 a B.6, E.1, E.2, L.1, L.2, da M.9 a M.14, P.11, P.12, R.9, R.10, R.21, R.22.

TOMO II:

da 1 a 4, da A.3 a A.30, da B.3 a B.6, da B.I.3 a B.I.10, B.II.9, B.II.10, da B.III.1 a B.III.8, da B.V.1 a B.V.8, da B.VI.3 a B.VI.8, B.VII.3, B.VII.4, B.IX.1, B.IX.2, da B.X.1 a B.X.4, da B.XI.1 a B.XI.6, da B.XII.1 a B.XII.6, da B.XIII.1 a B.XIII.10, da B.XIV.1 a B.XIV.14, da B.XV.1 a B.XV.4, B.XVII.1, B.XVII.2, da B.XVIII.1 a B.XVIII.18, B.XXI.1, B.XXI.2, B.XXII.1, B.XXII.2, B.XXIII.1, B.XXIII.2, B.XXIV.1, B.XXIV.2, da B.XXVI.1 a B.XXVI.4, da B.XXVII.1 a B.XXVII.4, da B.XXVIII.1 a B.XXVIII.6, da B.XXIX.1 a B.XXIX.4, da B.XXX.1 a B.XXX.4, B.XXXI.1, B.XXXI.2, da C.3 a C.6, C.I.1, C.I.2, da C.I.5 a C.I.8, C.II.3, C.II.4, da C.III.1 a C.III.6, da C.V.1 a C.V.6, da C.VI.1 a C.VI.8, C.IX.1, C.IX.2, da C.X.1 a C.X.6, da C.XI.1 a C.XI.6, da C.XII.1 a C.XII.8, da C.XIII.1 a C.XIII.10, C.XV.1, C.XV.2, da C.XVIII.1 a C.XVIII.6, da C.XIX.1 a C.XIX.4, da C.XX.1 a C.XX.4, C.XXIV.1, C.XXIV.2, C.XXV.1, C.XXV.2, da D.3 a D.6, da D.I.3 a D.I.8, da D.II.7 a D.II.10, da D.III.1 a D.III.8, da D.IV.1 a D.IV.8, da D.V.1 a D.V.6, D.VI.3, D.VI.4, da D.VIII.1 a D.VIII.4, da D.IX.1 a D.IX.6, da D.X.1 a D.X.4, da D.XI.1 a D.XI.10, da D.XII.1 a D.XII.14, D.XIII.1, D.XIII.2, da D.XV.1 a D.XV.6, da D.XVI.1 a D.XVI.4, da D.XVII.1 a D.XVII.4, da E.I.13 a E.I.16, E.V.1, E.V.2.

TOMO III:

1, 2, da A.15 a A.18.

Elenco delle pagine da eliminare

TOMO II:
F.1, F.I.1.

AGGIORNAMENTO N.10 - GIUGNO 1996
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:
1, 3, 5, A.4, B.4, E.1, F.2, L.1, L.2, M.2, M.14, M.20, R.13, R.14.
TOMO II:
1, A.3, A.11, A.12
TOMO III:
1, 3, A.3, A.15, da A.17 a A.23, da C.1 a C.VIII.1.1

AGGIORNAMENTO N.11 - GENNAIO 1997
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:
1, 2, B.1, B.2, B.3, B.4, L.1, L.2
TOMO II:
1, 2, 3, 4, A.3, A.4, A.5, A.6, A.7, A.8, A.9, A.10, A.11, A.12, A.13, A.14, A.15, A.16, A.17, A.18, A.19, A.20, da B.I.3 a B.I.10, da B.II.7 a B.II.12, da B.III.5 a B.III.6, da B.VI.1 a B.VI.8, da B.X.3 a B.X.4, da B.XI.1 a B.XI.6, da B.XII.1 a B.XII.6, da B.XIII.3 a B.XIII.12, da B.XIV.1 a B.XIV.14, da B.XVI.3 a B.XVI.6, da B.XVIII.1 a B.XVIII.20, da B.XXI.1 a B.XXI.4, da B.XXIII.1 a B.XXIII.2, da B.XXVI.5 a B.XXVI.6, da B.XXVII.1 a B.XXVII.6, da B.XXVIII.3 a B.XXVIII.6, da B.XXXI.1 a B.XXXI.2, da B.XXXII.1 a B.XXXII.2, da B.XXXIII.1 a B.XXXIII.2, da B.XXXV.1 a B.XXXV.4, da B.XXXVI.1 a B.XXXVI.2, da C.I.3 a C.I.8, da C.II.1 a C.II.6, da C.VI.1 a C.VI.8, da C.X.3 a C.X.6, da C.XI.1 a C.XI.6, da C.XII.3 a C.XII.12, da C.XIII.1 a C.XIII.8, da C.XIV.1 a C.XIV.2, da C.XV.1 a C.XV.2, da C.XVIII.5 a C.XVIII.6, da C.XIX.1 a C.XIX.6, da C.XX.3 a C.XX.4, da C.XXI.1 a C.XXI.2, da C.XXII.1 a C.XXII.2, da C.XXIV.1 a C.XXIV.4, da C.XXV.1 a C.XXV.2, da D.I.3 a D.I.10, da D.II.5 a D.II.12, da D.III.5 a D.III.6, da D.V.1 a D.V.6, da D.VIII.3 a D.VIII.4, da D.IX.1 a D.IX.6, da D.X.1 a D.X.16, da D.XII.1 a D.XII.14, da D.XV.5 a D.XV.6, da D.XVI.1 a D.XVI.6, da D.XVII.3 a D.XVII.4, E.3, E.4, da E.I.1 a E.I.20, da E.II.1 a E.II.4, da E.III.1 a E.III.4, da E.IV.1 a E.IV.2, da E.V.1 a E.V.2, E.VI.1, E.VI.2.

Elenco delle pagine da eliminare

TOMO II:
A.21, A.22, A.23, A.24, A.25, A.26, A.27, A.28, A.29, A.30.

AGGIORNAMENTO N.12 - APRILE 1997

Ristampa completa del Tomo I

AGGIORNAMENTO N.13 - LUGLIO 1997
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:
A4, A6, A7, B3, B6, E3, N3, N4, R23, R39, R40, R41, R42
TOMO II:
ristampa completa
TOMO III:
Capitolo I: Ristampa completa
Capitolo II: B.III.1.1, B.IV.1.1, B.V.1.1., B.V.2.1, B.V.3.1, B.V.4.1, B.V.5.1, B.V.6.1, B.V.7.1, B.V.8.1., B.V.9.1, B.V.10.1, B.V.11.1

AGGIORNAMENTO N.14 - FEBBRAIO 1998
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:
A.4, A.5, A.6, C.3, E.3, F.4, F.5, da O.1 a O.10, P.1, P.3, P.4, P.5, Q.3, Q.4, R.2, R.9, R.10, da R.16 a R.24, da S.2 a S.8.
TOMO II:
A.5, A.10, A.12, A.18, A.20, B.5, B.1.2, B.1.6, B.5.1, B.6.4, B.6.5, B.16.5, B.17.5, B.17.6, B.21.3, B.23.3, B.23.6, B.28.1, B.29.1, B.30.1, B.31.1, B.32.1, B.33.1, B.41.4, B.51.1, C.5, C.1.6, C.5.1, C.6.4, C.6.5, C.17.4, C.18.5, C.26.1, C.27.1, C.28.1, D.3, D.I.14.

Elenco delle pagine da eliminare

TOMO I:
da O.11 a O.15, da R.40 a R.42, da S.9 a S.11.

AGGIORNAMENTO N.15 - APRILE 1998
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:
A.9, A.10, da B.7 a B.10, E.3, E.4, da N.1 a N.6, O.1, O.2, O.5, O.6, O.11, O.12, da P.1 a P.6.
TOMO III:
da 1 a 4, da A1 a A.4, da A.29 a A.42, da D.1 a D.4, da D.I.1.1 a D.IX.2, da E.I.1.1 a E.VIII.2

AGGIORNAMENTO N.16 - LUGLIO 1998
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:

A.5, A.6, C.3, O.3, O.4, da P.3 a P.6, R.2, da R.19 a R.24, S.7, S.8.

TOMO II:

Da A.3 a A.10, da A.13 A.26,

B.5, B.1.1, B.1.2, B.1.5, B.1.6, da B.4.1 a B.4.4, da B.6.1 a B.6.6, B.8.3, B.8.4, da B.9.3 a B.9.6, da B.13.1 a B.13.5, B.14.1, B.14.2, B.16.5, B.17.7, da B.18.3 a B.18.8, da B.19.1 a B.19.3, da B.21.1 a B.21.3, da B.24.1 a B.24.4, B.28.1, B.28.2, B.29.1, B.30.1, B.31.1, B.31.2, B.37.1, B.38.1, da B.39.1 a B.39.4, B.40.1, B.40.2, B.45.1, B.45.2, B.51.1, B.51.2.

C.5, C.1.1, C.1.2, C.1.5, C.1.6, da C.4.1 a C.4.4, da C.6.1 a C.6.6, da C.10.1 a C.10.4, da C.14.1 a C.14.4, da C.15.1 a C.15.3, da C.17.1 a C.17.4, da C.18.1 a C.18.6, da C.19.3 a C.19.10, da C.20.1 a C.20.3, C.21.1, C.22.1, da C.23.1 a C.23.24, da C.24.1 a C.24.4, C.26.1, C.27.1, C.28.1.

Ristampa completa degli schemi segnaletici delle segnalazioni su base consolidata (da D.I.1 a D.VI.1).

TOMO III:

Da A.1 a A.8, da A.11 a A.22, A.25, A.26.

Ristampa completa degli schemi segnaletici delle segnalazioni sull'attività degli operatori del mercato mobiliare (da B.1 a B.VIII.15.1).

Ristampa completa degli schemi segnaletici delle segnalazioni sull'attività degli intermediari finanziari ex art. 107 d.lgs. 385/93 (da C.1 a C.30.1).

AGGIORNAMENTO N.17 - APRILE 1999
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:

C.3, da R.25 a R.40.

TOMO II:

A.5, A.6, A.11, A.12, A.17, A.18, B.5, B.1.1, B.1.2, da B.6.1 a B.6.6, B.8.3, B.8.4, da B.13.1 a B.13.4, da B.14.1 a B.14.3, B.23.3, B.23.4, B.27.1, B.29.1, B.30.1, B.30.2, da B.39.1 a B.39.4, da B.40.1 a B.40.4, C.5, da C.1.1 a C.1.7, da C.6.1 a C.6.6, C.10.3, C.10.4, da C.14.1 a C.14.4, da C.15.1 a C.15.3, da C.23.1 a C.24.4, C.27.1, C.29.1.

AGGIORNAMENTO N.18 - SETTEMBRE 1999
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:

A.7, A.8, B.5, B.6, da N.1 a N.4, da P.1 a P.4.

TOMO III:

da 1 a 4, da A.3 a A.16, da B.1 a B.4, B.IX.1.1

AGGIORNAMENTO N.19 - APRILE 2000
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:

A.5, A.6, B.3, B.4, C.3, C.4, D.3, D.4, da E.1 a E.4, da F.3 a F.6, G.3, G.4, N.3, N.4, O.1, O.2, O.7, O.8, da P.3 a P.6, R.1, R.2, R.5, R.6, S.1, S.2

TOMO II:

Ristampa completa

TOMO III:

Ristampa completa degli schemi segnaletici delle segnalazioni sull'attività degli operatori del mercato mobiliare (da B.1.1 a B.41.1).

Ristampa completa degli schemi segnaletici delle segnalazioni degli organismi di investimento collettivo del risparmio (O.I.C.R.) (da D.1.1 a E.13.2).

AGGIORNAMENTO N.20 - GIUGNO 2000
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO III:

A.3, A.4, A.15, A.16, B.7.1, B.7.2, B.8.1, B.8.2, B.24.1, B.24.2, B.25.1, B.25.2

AGGIORNAMENTO N.21 - GIUGNO 2001
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO II:

A.5, A.6, da B.1.1 a B.1.6, da B.4.1 a B.4.5, da B.6.1 a B.6.6, da B.8.1 a B.8.5, da B.9.1 a B.9.7, da B.10.1 a B.10.3, B.11.1, da B.13.1 a B.13.5, da B.14.1 a B.14.3, da B.16.1 a B.16.8, da B.17.1 a B.17.12, B.18.3, B.18.4, da B.19.1 a B.19.4, da B.20.1 a B.20.60, B.21.1, B.21.2, da B.22.1 a B.22.4, B.23.1, B.23.2, da B.24.1 a B.24.14, da B.25.1 a B.25.4, da B.28.1 a B.28.4, B.29.1, B.29.2, da B.31.1 a B.31.3, B.32.1, B.32.2, B.33.1, B.33.2, da B.35.1 a B.35.3, B.39.1, B.39.2, da B.42.1 a B.42.5, da B.43.1 a B.43.5, da B.44.1 a B.44.6, da B.44.1 a B.45.3, da B.46.1 a B.46.3, da B.47.1 a B.47.3, B.50.1, B.51.1, da B.54.1 a B.54.4, da C.1.1 a C.1.6, da C.4.3 a C.4.5, da C.6.3 a C.6.6, da C.7.1 a C.7.5, da C.8.1 a C.8.4, C.9.3, da C.11.1 a C.11.5, da C.12.1 a C.12.3, da C.14.1 a C.14.7, da C.15.1 a C.15.10, C.16.3, C.16.4, da C.17.1 a C.17.4, da C.18.1 a C.18.6, da C.21.1 a C.21.5, da C.22.1 a C.22.5, da C.23.1 a C.23.5, da C.26.1 a C.26.4, C.27.1, C.27.2, D.1.1, D.1.2, D.2.1, D.2.2, D.3.1, DA D.4.1 a D.4.3, D.5.1, D.5.2, da D.6.1 a D.6.18, D.8.1, D.9.1, D.10.1, da D.13.1 a D.13.3.

AGGIORNAMENTO N.22 - FEBBRAIO 2002
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:

da A.1 a A.10, da B.1 a B.10, da E.1 a E.4, da F.1 a F.6, da N.1 a N.6, da P.1 a P.6, da R.1 a R.36

TOMO II:

da A.1 a A.28, da B.1 a B.6, B.14.3, B.17.3, B.17.4, B.17.7, B.17.8, B.18.3, B.18.4, B.21.1, B.21.2, B.22.3, B.22.4, B.23.1, B.23.2, B.24.1, B.24.2, B.24.3, B.24.4, B.24.9, B.24.10, B.31.1, B.31.2, B.35.1, B.35.2, B.35.3, B.48.1, B.48.2, B.49.1, B.50.1, B.51.1, B.53.1, B.54.1, B.54.2, B.54.3, da C.1 a C.6, C.12.3, C.14.5, C.14.6, C.15.3, C.15.4, C.15.5, C.15.6, C.16.3, C.16.4, C.26.1, C.26.2, C.26.3, C.27.1, C.27.2, da D.1 a D.6, D.7.1, D.7.2, D.8.1, D.9.1, D.10.1, D.12.1, D.13.1, D.13.2, D.13.3.

TOMO III:

Ristampa integrale

Elenco delle pagine da eliminare

TOMO I:

da R.37 a R.40.

AGGIORNAMENTO N.23 - LUGLIO 2002
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:

B.3, B.4, N.4, N.5

TOMO II:

da A.5 a A.7, A.9, A.13, A.17, da A.19 a A.20, A.25, B.4.5, B.8.3, da B.9.2 a B.9.8, B.10.3, B.11.1, B.14.2, B.14.3, da B.16.1 a B.16.9, da B.17.4 a B.17.11, B.18.1, da B.18.4 a B.18.10, B.19.2, da B.21.1 a B.57.1, C.4.5, da C.7.3 a C.7.5, C.8.1, C.8.3, C.8.4, da C.14.2 a C.14.7, da C.15.6 a C.15.9, C.16.1, da C.16.4 a C.16.9, C.17.2, da C.19.1 a C.29.1, da D.4.1 a D.4.3, da D.5.1 a D.5.3, da D.6.3 a D.6.18, da D.7.2 a D.7.4, D.13.2.

AGGIORNAMENTO N.24 - MARZO 2003
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:

A.9, A.10, da B.8 a B.12, da N.3 a N.5, da O.4 a O.9, O.11, da P.3 a P.6, da S.5 a S.7.

TOMO II:

da A.5 a A.29, B.4.5, B.18.5, C.4.5, C.16.5.

TOMO III:

da A.3 a A.50, da D.3 a D.5; ristampa completa degli schemi segnaletici degli organismi di investimento collettivo del risparmio (O.I.C.R.) (da D.1.1 a F.11.1).

AGGIORNAMENTO N.25 - FEBBRAIO 2004
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:

da A.1 a A.12, da B.1 a B.12, da N.1 a N.6, da O.1 a O.12.

TOMO III:

da A.1 a A.50, da C.1 a C.6; ristampa completa degli schemi segnaletici degli intermediari finanziari ex art. 107 d.lgs. 385/93 (da C.1.1 a C.43.1); da D.1 a D.6, da D.1.1 a D.8.1, da E.1.1 a E.14.2.

AGGIORNAMENTO N.26 - GENNAIO 2005
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:

da B.1 a C.4, da N.1 a N.6.

TOMO II:

da B.9.1 a B.9.8, da B.13.1 a B.13.5, da B.16.1 a B.16.11, da B.25.1 a B.25.14, da B.26.1 a B.26.4, B.27.1, da B.28.1 a B.28.7, da B.29.1 a B.29.4, da C.8.1 a C.8.4, da C.11.1 a C.11.5, da C.14.1 a C.14.4, da D.6.1 a D.6.21.

TOMO III:

da C.6.1 a C.6.3, da C.9.1 a C.11.4, D.19.1, F.8.1.

Elenco delle pagine da eliminare

TOMO II:

da C.14.5 a C.14.7.

AGGIORNAMENTO N.27 - GIUGNO 2005
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:

da A.1 a C.4, da N.1 a N.6, da P.1 a P.6.

TOMO III:

da A.1 a A.50, da D.1 a D.6, G.1.1.

AGGIORNAMENTO N.28 - FEBBRAIO 2006
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:
da A.1 a A.12, da B.1 a B.14, da O.1 a O.12.
TOMO II:
da A.1 a A.30, da D.1 a D.6, da D.1.1 a D.21.1.

AGGIORNAMENTO N.29 - LUGLIO 2006
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO II:
da B.30.1 a B.38.1, da B.50.1 a B.56.1, da D.1.1 a D.3.1, da D.6.1 a D.13.5, da D.14.1 a D.21.1.

AGGIORNAMENTO N.30- DICEMBRE 2006
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:
da B.1 a B.12, da E.1 a E.4, da N.1 a N.5, da P.1 a P.6, da Q.1 a Q.3, da R.1 a R.36, da S.1 a S.8.
TOMO II:
da A.1 a C.29.1.

AGGIORNAMENTO N.31- GENNAIO 2007
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:
da B.1 a B.12, da C.1 a C.4.
TOMO III:
da A.1 a A.50, da D.1.1 a D.8.1, da D.21.1 a D.23.2, E.3.1, E.11.1, da E.13.1 a E.14.2, da F.4.1 a F.4.3, da F.10.1 a F.11.1.
Elenco delle pagine da eliminare

TOMO III:
D.2.2.

AGGIORNAMENTO N.32- GIUGNO 2007
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:
da A.1 a A.12, da B.1 a B.12, da C.1 a C.4, da E.1 a E.4, da F.1 a F.6, da N.1 a N.6, da O.1 a O.12, da P.1 a P.6, da R.1 a R.36
TOMO III:
da A.1 a A.50, da B.1 a B.6, da B.1.1 a B.33.1, da D.1.1 a D.6.3, D.21.1, da E.4.1 a E.10.1, F.10.1.
Elenco delle pagine da eliminare

TOMO III:
da B.34.1. a B.41.1

AGGIORNAMENTO N.33- FEBBRAIO 2008
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:
da B.1 a B.12, da N.1 a N.6, da O.1 a O.12, da P.1 a P.6, da S.1 a S.8.
TOMO II:
da A.1 a A.34, da B.1 a B.6, da B.1.1 a B.21.2, da B.39.1 a B.46.4, da B.52.1 a B.58.1, da C.1.1 a C.19.2, da D.1 a D.6, da D.6.1 a D.20.1

AGGIORNAMENTO N.34- FEBBRAIO 2008
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:
da A.1 a A.12, da B.1 a B.12, da N.1 a N.6, da P.1 a P.6.
TOMO III:
da A.1 a A.58, da C.1. a C.6, da C.1.1 a C.35.1

Elenco delle pagine da eliminare

TOMO III:
da C.36.1. a C.43.1

AGGIORNAMENTO N.35- LUGLIO 2008
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:
da A.1 a A.12, da B.1 a B.12, da C.1 a C.4, da E.1 a E.4, da F.1 a F.6, da O.1 a O.12, da P.1 a P.6, da R.31 a R.36.
TOMO III:
da A.1 a A.60, da D.1. a D.6, da D.1.1 a D.20.1, da E.1.1 a E.20.1, da F.1.1 a F.3.1, da F.5.1 a F.9.1.

AGGIORNAMENTO N.36 - LUGLIO 2008
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:
da A.1 a A.12, da B.1 a B.14, da E.1 a E.4, da G.1 a G.4, da N.1 a N.6, da O.1 a O.12, da P.1 a P.6, da Q.1 a Q.4, da R.1 a R.34.
TOMO II:

da A.1 a A.38, da B.1 a B.37.1, da C.1.1 a C.6.2, D.3, da D.6.1 a D.21.1.

Elenco delle pagine da eliminare

TOMO I:

da R.35 a R.36.

TOMO II:

da B.38.1 a B.58.1., da C.6.3 a C.30.1.

AGGIORNAMENTO N.37- FEBBRAIO 2009

Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:

da A.1 a A.12, da B.1 a B.14, da C.1 a C.4, da E.1 a E.4, da F.1 a F.6, da N.1 a N.6, da P.1 a P.6, da R.1 a R.34.

TOMO II:

da A.1 a A.38, da B.1 a B.6, da B.1.1 a B.1.3, da B.3.1 a B.3.4, da B.5.1 a B.5.5, da B.6.1 a B.6.4, da B.7.1 a B.7.4, B.8.1, B.8.2, B.9.1, da B.10.1 a B.10.3, B.12.1, B.12.2, da B.13.1 a B.13.4, B.17.1.

TOMO III:

da A.1 a A.62, da C.1.1 a C.13.1, da C.23.1 a C.24.3, da H.1 a H.6.2.

AGGIORNAMENTO N.38 - NOVEMBRE 2009

Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:

da A.1 a A.13, da B.1 a B.13, da C.1 a C.4, da E.1 a E.4, da F.1 a F.6, da G.1 a G.4, da N.1 a N.6, da O.1 a O.12, da P.1 a P.6, da Q.1 a Q.4, da R.1 a R.34, da Z.1 a Z.8.

TOMO III:

da A.1 a A.64, da C.1 a C.6, da H.1 a H.6, da H.1.1 a H.15.1

Elenco delle pagine da eliminare

TOMO III:

da C.25.1 a C.35.1

AGGIORNAMENTO N.39 - DICEMBRE 2009

Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:

da B.1 a B.13, da N.1 a N.6, da P.1 a P.6.

TOMO I (parte riservata alle filiali della Banca d'Italia) :

da Z.9 a Z.12.

TOMO II:

ristampa integrale

AGGIORNAMENTO N.40 - DICEMBRE 2009

Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:

da A.1 a A.14, da B.1 a B.14.

TOMO III:

da A.1 a A.66, da B.1 a B.4, da B.1.1 a B.32.1, da C.1 a C.6, da C.1.1 a C.24.3, da D.1 a D.6, da D.1.1 a D.6.2, da D.13.1 a D.14.1, da D.15.1 a D.19.1, da E.4.1 a E.10.1, da F.5.1 a F.8.1

Elenco delle pagine da eliminare

TOMO III:

B.33.1

AGGIORNAMENTO N.41 - OTTOBRE 2010

Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I:

da A.1 a A.14, da B.1 a B.15, da C.1 a C.4, da D.1 a D.4, da E.1 a E.4, da F.1 a F.6, da N.1 a N.6, da P.1 a P.6.

TOMO II:

da A.1 a A.40, da B.1 a B.5, da B.1.3.1 a B.1.4.2, da B.2.1.1.1 a B.2.1.3.5, da B.2.2.1 a B.2.4.2.5, da B.3.3.2.1 a B.3.3.2.16, da B.3.3.4.1 a B.3.3.4.7, B.4.6.2.1, da C.3.3.1 a C.3.5.5

TOMO III:

da A.1 a A.67, da B.1 a B.5, da B.1.1 a B.37.1, da C.1.1 a C.13.1, da C.23.1 a C.24.3, da D.1.1 a D.6.3, da D.12.1 a D.14.1, da D.20.1 a D.21.1, da E.1.1 a E.3.1, da E.11.1 a E.12.1, da F.9.1 a F.10.1, da H.13.1 a H.15.2

AGGIORNAMENTO N.42 - FEBBRAIO 2011
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I: da A.1 a A.14, da B.1 a B.14, da C.1 a C.4, da D.1 a D.4, da N.1 a N.6, da O.1 a O.12, da P.1 a P.6,

TOMO II: da A.1 a A.42, da B.1 a B.6, da B.2.1.2.1 a B.2.1.2.5, da B.3.1.1 a B.3.1.5, da B.3.3.2.1 a B.3.3.2.16, da B.3.3.4.1 a B.3.3.4.7, da B.4.1.1 a B.4.1.6, da B.4.2.1 a B.4.2.3, B.4.3.1, da C.3.5.1 a C.3.5.5, da C.4.1.1 a C.4.1.7, da C.4.2.1 a C.4.2.3, C.4.3.1.

TOMO III: da A.1 a A.70, da C.1 a C.6, da C.1.1 a C.26.3

AGGIORNAMENTO N.43 - MARZO 2011
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO III: da A.1 a A.70, da B.1 a B.6, da B.13.1 a B.13.3, da B.34.1 a B.38.1

AGGIORNAMENTO N.44 - APRILE 2011
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I: da A.1 a A.14, da B.1 a B.14, da N.1 a N.6, da P.1 a P.6

TOMO III: da A.1 a A.67, da H.1 a H.4

Elenco delle pagine da eliminare

TOMO III: da A.68 a A.70, da H.5 a H.6, da H.7.1 a H.15.2

AGGIORNAMENTO N.45 - DICEMBRE 2011
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO II: da A.1 a A.44, da B.1 a B.6, da B.1.3.1 a B.1.3.20, da B.2.1.1.1 a B.2.1.1.4, da B.2.1.3.1 a B.2.1.3.3, da B.2.1.4.1 a B.2.1.4.5, da B.2.1.5.1 a B.2.1.5.3, B.2.1.6.1, da B.2.3.1 a B.2.3.10, da B.2.4.2.1 a B.2.4.2.5, da B.3.3.2.1 a B.3.3.2.17, da B.4.1.1 a B.4.1.6, da B.4.2.1 a B.4.2.4, da B.4.4.1 a B.4.4.6, da C.1 a C.6, da C.3.1.1 a C.3.1.12, da C.3.5.1.1 a C.3.5.1.3, da C.3.5.2.1 a C.3.5.2.5, da C.4.1.1 a C.4.1.7, da C.4.2.1 a C.4.2.4, C.4.4.1, C.4.6.1.1.

AGGIORNAMENTO N.46 - GENNAIO 2012
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I: da A.1 a A.14

TOMO III: da A.1 a A.68, da B.14.1 a B.26.2, da B.35.1 a B.36.2.

AGGIORNAMENTO N.47 - MAGGIO 2012
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I: da A.1 a A.16, da B.1 a B.16

TOMO III: da A.1 a A.68, da D.1 a D.6, da D.1.1 a F.12.1.

AGGIORNAMENTO N.48 – LUGLIO 2012
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I: da A.1 a A.16, da B.1 a B.16, da C.1 a C.4, da D.1 a D.4, da E.1 a E.4, da F.1 a F.6, da N.1 a N.6, da O.1 a O.12, da P.1 a P.6

TOMO III: da A.1 a A.70, da C.1 a C.6, da C.1.1 a C.26.3

AGGIORNAMENTO N.49 – DICEMBRE 2012
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I: da O.1 a O.12

TOMO II: da A.1 a A.44, da B.1.1.1 a b.1.1.3, da B.1.2.1 a B.1.2.2, da B.1.3.1 a B.1.3.20, da B.2.1.1.1 a B.2.1.1.4, da B.2.1.3.1 a B.2.1.3.4, da B.2.4.2.1 a B.2.4.2.5, da B.2.5.1.1 a B.2.5.1.2, da B.2.5.2.1 a B.2.5.2.2, B.2.5.3.1, da B.3.1.1 a B.3.1.5, da B.3.3.2.1 a B.3.3.2.17.

TOMO III: da A.1 a A.70, da B.1.1 a B.6.1, da B.28.1 a B.30.1, da C.15.1 a C.17.2, da D.1 a D.6, da D.1.1 a G.1.1

AGGIORNAMENTO N.50 – MARZO 2013
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO II: da A.1 a A.46, da B.3.3.2.1 a B.3.3.2.17, B.4.7.1, B.4.7.2, da C.1.1.1 a C.1.1.6, da C.3.1.1 a C.3.1.12, da C.3.5.1.1 a C.3.5.1.4, C.4.7.1

AGGIORNAMENTO N.51 – LUGLIO 2013
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I: da A.1 a A.16, da B.1 a B.16, da C.1 a C.4, da E.1 a E.4, da F.1 a F.6, da H.1 a H.4, da N.1 a N.6, da P.1 a P.6

TOMO II: da A.1 a A.50, da B.1 a B.6, da B.1.3.1 a B.1.3.22, da B.2.1.1.1 a B.2.1.1.5, da B.2.3.1 a B.2.3.13, da B.3.3.2.1 a B.3.3.2.17, da B.3.3.4.1 a B.3.3.4.7, B.3.7.1, B.4.7.1, B.4.7.2

TOMO III: da A.1 a A.82, da C.1 a C.6, da C.1.1 a C.27.3

AGGIORNAMENTO N.52 – DICEMBRE 2013
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I: da A.1 a A.16, da B.1 a B.16, da N.1 a N.6, da P.1 a P.6

TOMO II: da A.1 a A.58, da B.1 a B.6, da B.4.1.1 a B.4.9.2, da C.1 a C.6, da C.4.1.1 a C.4.9.1

TOMO III: da A.1 a A.82, da B.1 a B.6, da B.10.1 a B.23.1

AGGIORNAMENTO N.53 – APRILE 2014
Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre

TOMO I: da A.1 a A.16, da B.1 a B.16, da C.1 a C.4, da E.1 a E.4, da F.1 a F.6, da G.1 a G.4, da N.1 a N.6, da O.1 a O.12, da P.1 a P.6, da Q.1 a Q.4, da R.1 a R.34, da Z.1 a Z.12

TOMO II: da A.1 a A.56, da B.1 a B.6, da B.4.1.1.1 a B.4.4.5, da B.4.6.1 a B.4.7.5.2, B.4.10.1, da C.4.1.1.1 a C.4.4.5, da C.4.6.1 a C.4.7.5.2

TOMO III: da A.1 a A.82, da C.1 a C.6

Elenco delle pagine da eliminare

TOMO I:
da S.1 a S.8.

INDICE

Premessa

TOMO I

Parte generale

Capitolo 1	Schemi di segnalazione	A.1
Capitolo 2	Termini di produzione dei dati	B.1
Capitolo 3	Modalità tecnico-operative per l'inoltro delle informazioni	C.1
Capitolo 4	Sistema delle codifiche.....	D.1
Capitolo 5	Verifiche sulla affidabilità delle segnalazioni	E.1
Capitolo 6	Segnalazioni di rettifica/conferma.....	F.1
Capitolo 7	Flusso di ritorno alle banche	G.1
Capitolo 8	Crittografia dei dati	H.1

Allegati

Allegato 1	Descrizione delle basi informative	N.1
Allegato 2	Caratteristiche e specifiche tecniche per l'invio delle segnalazioni.....	O.1
Allegato 3	Glossario dei termini e delle codifiche.....	P.1
Allegato 4	Istruzioni tecniche per la crittografia dei dati.....	Q.1
Allegato 5	Rilievi sulle segnalazioni e altre comunicazioni in materia segnaletica - rettifiche e conferma ai dati trasmessi	R.1

TOMO II

Capitolo 1	Sistema delle codifiche (banche e gruppi bancari).....	A.1
Capitolo 2	Schemi di segnalazione matrice dei conti	B.1
Capitolo 3	Schemi delle segnalazioni su base consolidata dei gruppi di banche.....	C.1

TOMO III

Capitolo 1	Sistema delle codifiche (enti finanziari non bancari e gruppi di SIM).....	A.1
Capitolo 2	Schemi segnaletici: attività' degli operatori del mercato mobiliare	B.1
Capitolo 3	Schemi segnaletici: attività' degli intermediari finanziari ex art. 107 d.lgs. 385/93, degli istituti di pagamento e degli istituti di moneta elettronica	C.1
Capitolo 4	Schemi segnaletici: organismi di investimento collettivo del risparmio (O.I.C.R.).....	D.1
Capitolo 5	Schemi segnaletici: attività' degli intermediari finanziari ex art. 106 d.lgs. 385/93	H.1

Premessa

La presente normativa, organizzata in tre tomi, disciplina gli schemi di segnalazione, le modalità di inoltro e gli altri aspetti a questo connessi relativi ai principali flussi informativi dovuti dalle banche e dagli enti finanziari, ed in particolare alle:

- segnalazioni di vigilanza delle banche (cfr. Matrice dei conti);
- segnalazioni di vigilanza su base consolidata delle banche (cfr. Istruzioni per la compilazione delle segnalazioni su base consolidata delle banche);
- segnalazioni statistiche e di vigilanza sull'attività di intermediazione mobiliare (cfr. Manuale delle segnalazioni statistiche e di vigilanza per gli intermediari del mercato mobiliare);
- segnalazioni statistiche di vigilanza degli intermediari finanziari ex art. 107 D.lgs. 385/93, degli istituti di pagamento e degli istituti di moneta elettronica (cfr. Manuale per la compilazione delle segnalazioni di vigilanza per gli intermediari finanziari, gli istituti di pagamento e gli istituti di moneta elettronica);
- segnalazioni statistiche e di vigilanza degli organismi di investimento collettivo del risparmio - O.I.C.R. (cfr. Manuale delle segnalazioni statistiche e di vigilanza per gli organismi di investimento collettivo del risparmio);
- segnalazioni statistiche degli intermediari finanziari ex art. 106 D.lgs 385/93 (cfr. Segnalazioni degli intermediari finanziari iscritti nell' "elenco generale" di cui all'art. 106 del Testo Unico Bancario).

Essa regola altresì il "flusso di ritorno" offerto alle banche, ottenuto mediante elaborazioni statistiche prodotte dalla base dati alimentata dalle citate segnalazioni.

In particolare:

- nel Tomo I sono compendiate le istruzioni amministrative e tecnico-operative generali;
- nel Tomo II sono riportati il sistema delle codifiche e gli schemi di segnalazione in vigore per le banche e per i gruppi creditizi (1);
- nel Tomo III sono riportati il sistema delle codifiche e gli schemi di segnalazione in vigore per gli enti finanziari, gli istituti di pagamento, gli istituti di moneta elettronica e per i gruppi di SIM (1).

1) Fanno eccezione gli schemi segnaletici ed il relativo sistema delle codifiche riferiti alle segnalazioni prudenziali delle SIM e dei gruppi di SIM che sono riportati nel Tomo II in quanto comuni a quelli delle banche e dei gruppi bancari.

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA DELLE
ISTITUZIONI CREDITIZIE E FINANZIARIE

ISTRUZIONI PER LA PRODUZIONE E L'INOLTRO
DELLE SEGNALAZIONI

TOMO I

PARTE GENERALE

(Circolare n. 154 del 22 novembre 1991)

Capitolo 1

Schemi di segnalazione

Premessa

I flussi informativi sono suddivisi in basi informative, che rappresentano un insieme di dati omogenei dal punto di vista del contenuto, della data di riferimento e dei termini di inoltro. La descrizione del contenuto delle basi informative è riportata nell'[allegato 1](#).

1 Segnalazioni statistiche di vigilanza delle banche.

Le istituzioni segnalanti, in relazione al grado di dettaglio delle segnalazioni periodiche da produrre, sono suddivise nei due seguenti raggruppamenti:

- istituzioni tenute a inviare il flusso informativo integrale;
- filiali italiane di banche comunitarie tenute ad inviare il flusso informativo privo di talune aree informative.

Le informazioni, organizzate secondo gli schemi riprodotti nel [Tomo II](#), devono essere trasmesse secondo le modalità indicate nel [capitolo 3](#).

2 Segnalazioni di vigilanza su base consolidata dei gruppi di banche

Le segnalazioni di vigilanza su base consolidata devono essere prodotte dalle banche e dagli enti finanziari a capo di gruppi bancari, ove ricorrano le condizioni previste dalle vigenti Istruzioni di vigilanza.

Le informazioni, organizzate secondo gli schemi riprodotti nel Tomo II, devono essere trasmesse dagli intermediari secondo le modalità indicate al [capitolo 3](#).

Qualora l'esercizio della facoltà di non procedere al consolidamento dei conti comporti l'esonero dall'obbligo di inviare le segnalazioni consolidate, la capogruppo o la singola banca partecipante deve comunicare al Servizio Rilevazioni Statistiche e alla Filiale della Banca d'Italia territorialmente competente che non trasmetterà le segnalazioni relative alla data per la quale si esercita la facoltà sopra indicata.

La comunicazione, che deve essere sottoscritta dal soggetto abilitato in base al sistema interno di deleghe a rappresentare l'azienda in materia di segnalazioni di vigilanza, va effettuata entro 2 mesi dalla data di riferimento delle rilevazioni che per effetto dell'esonero non vengono prodotte. Essa vale anche per i successivi periodi, fin quando le condizioni di esclusione sono soddisfatte. Qualora tali condizioni non siano più verificate, l'azienda deve comunicare, sempre nel termine di 2 mesi dalla data di riferimento, che invierà nuovamente le segnalazioni.

3 Segnalazioni statistiche e prudenziali sull'attività di intermediazione mobiliare.

3.1 SIM - Segnalazioni statistiche

In relazione alla categoria di appartenenza, gli enti devono produrre le informazioni di seguito indicate secondo gli schemi riportati nel [Tomo III](#).

3.1.1 SIM - Segnalazioni su base individuale

3.1.1.1 SIM che esercitano le attività di negoziazione in conto proprio e/o di collocamento con assunzione di garanzia

Con periodicità mensile:

- Strumenti finanziari in portafoglio e pronti contro termine - [sez. III](#);

Con periodicità trimestrale:

- Dati patrimoniali - [sez. I](#);
- Segnalazioni sui servizi d'investimento - [sez. IV](#) (dati riferiti a ciascun mese del trimestre);

Con periodicità semestrale:

- Dati di conto economico e altre informazioni - [sez. II](#).

3.1.1.2 SIM che esercitano le attività di gestione di sistemi multilaterali di negoziazione

Con periodicità trimestrale:

- Dati patrimoniali - sez. I;
- Segnalazioni sui servizi d'investimento - sez. IV (dati riferiti a ciascun mese del trimestre).

Con periodicità semestrale:

- Dati di conto economico e altre informazioni - sez. II.

3.1.1.3 SIM che esercitano le attività di consulenza e/o di raccolta ordini (senza detenzione)

Con periodicità trimestrale:

- Dati patrimoniali - sez. I;
- Segnalazioni sui servizi d'investimento - sez. IV (dati riferiti a ciascun mese del trimestre);

Con periodicità semestrale:

- Dati di conto economico e altre informazioni - sez. II.

3.1.1.4 Rimanenti SIM

Con periodicità trimestrale:

- Dati patrimoniali - sez. I;
- Segnalazioni sui servizi d'investimento - sez. IV (dati riferiti a ciascun mese del trimestre);

Con periodicità semestrale:

- Dati di conto economico e altre informazioni - sez. II.

3.1.2 Gruppi di SIM - Segnalazioni su base consolidata

Le segnalazioni statistiche e di vigilanza su base consolidata dei gruppi di SIM devono essere prodotte dalle società capogruppo dei gruppi di SIM.

Con periodicità semestrale:

- Dati patrimoniali - sez. I;
- Dati di conto economico e altre informazioni - sez. II;
- Segnalazioni sui servizi d'investimento - sez. III.

3.2 SIM e gruppi di SIM - Segnalazioni prudenziali

In relazione alla categoria di appartenenza, gli enti devono produrre le informazioni di seguito indicate secondo gli schemi riportati nel Tomo II – Matrice dei conti: sez. IV ed al Tomo II – Segnalazioni di vigilanza su base consolidata: sez. IV.

3.2.1 SIM e gruppi di SIM soggette al regime CRR/CRD IV

Con riferimento all'ambito di applicazione e alle frequenze segnaletiche si rinvia al Regolamento della Commissione Europea sulle norme tecniche di attuazione (ITS) in materia di segnalazioni prudenziali armonizzate delle banche e delle imprese di investimento (1)

3.2.2 SIM non soggette al regime CRR/CRD IV

Le SIM che prestano esclusivamente i servizi di "ricezione e trasmissione di ordini" e di "consulenza in materia di investimenti" senza detenzione dei beni della clientela segnalano con periodicità trimestrale la sezione 4.10 "SIM escluse dall'ambito di applicazione del pacchetto CRR/CRDIV" sui fondi propri.

1) Le SIM e i gruppi di SIM soggette al regime CRR/CRD IV, in ogni caso, non devono segnalare la sottosezione 4.9 relativa ai "Soggetti Collegati" e la sottosezione 4.10 relativa alle "SIM escluse dall'ambito di applicazione del pacchetto CRR/CRDIV – Informazioni sui requisiti patrimoniali minimi".

4 Segnalazioni statistiche di vigilanza degli intermediari finanziari ex art. 107 D.lgs. 385/93, degli istituti di pagamento (IP) e degli istituti di moneta elettronica (IMEL).

Le informazioni, organizzate secondo i rispettivi schemi riportati nel Tomo III, devono essere trasmesse tramite il canale Internet, con le periodicità di seguito indicate.

Con periodicità mensile:

- altre informazioni: sez. II, limitatamente alle voci 58208, 58210, 58212, 58214 e 58216.

Con periodicità trimestrale:

- dati patrimoniali: [sez. I](#);
- altre informazioni: [sez. II](#) (3), ad eccezione delle voci mensili (di cui sopra), semestrali ed annuali (cfr. oltre);
- patrimonio di vigilanza e requisiti patrimoniali: [sez. IV](#) (4);

Con periodicità semestrale:

- dati di conto economico: [sez. III](#);
- altre informazioni: sez. II, limitatamente alle voci 40728, 40756, 40758, 46436, 46440, 46442, 46444, 46464, 46468, 46545, 46550, 52120, 52170, 52174, 52178, 52182, 52186, 52212, 52232, 52264, 52280, 52282, 52288, 52292, 52298, 52363, 52365, 52367, 52369, 52376, 52380, 52382, 52384, 52386, 52388, 52390, 52392, 52396, 52515, 58555, 58595, 58620, 58630, 58640, 58650, 58670 e 58675.

Con periodicità annuale:

- dati di fine esercizio: [sez. V](#);
- altre informazioni: sez. II, limitatamente alle voci 3229, 46452, 46456, 46460, 52430, 58590, 58607 e 58610;
- limitatamente agli intermediari finanziari ex art. 107 d.lgs. 385/93, i dati sulle "perdite storicamente registrate sulle posizioni in *default*": sez. II.13.

3) Gli IP e gli IMEL "puri" e "ibridi finanziari" non inviano la sottosezione 11 "Rischio di tasso di interesse".

4) Gli IP e gli IMEL "puri" e "ibridi non finanziari" devono trasmettere esclusivamente le sottosezioni 1 "Patrimonio di vigilanza", 2 "Rischio di credito e di controparte", 6 "Requisito patrimoniale a fronte dei servizi di credito prestati" e 7 "Posizione patrimoniale". Gli IP e gli IMEL ad operatività limitata sono tenuti ad inviare solo la sottosezione 1 "Patrimonio di vigilanza".

5 Segnalazioni statistiche e di vigilanza degli organismi di investimento collettivo del risparmio (O.I.C.R.).

Le informazioni, organizzate secondo i rispettivi schemi riportati nel Tomo III, devono essere trasmesse tramite il canale Internet.

5.1 Società di gestione (escluse quelle di cui al successivo par. 5.2).

Con periodicità trimestrale:

- patrimonio di vigilanza e requisiti patrimoniali - [sez. II](#);
- informazioni statistiche - [sez. III](#) (dati riferiti a ciascun mese del trimestre) (5).

Con periodicità semestrale:

- situazione dei conti - [sez. I](#).

5.2 Società di gestione che gestiscono esclusivamente fondi chiusi mobiliari riservati a investitori qualificati.

Con periodicità trimestrale:

- patrimonio di vigilanza e requisiti patrimoniali - [sez. II](#).

Con periodicità semestrale:

- situazione dei conti - [sez. I](#) ad eccezione della sottosezione 6.

Con periodicità annuale:

- dati integrativi e altre informazioni - [sez. I sottosez. 6](#).

5) La sezione III va segnalata escludendo la sottosezione 4.

5.3 Fondi comuni di investimento aperti istituiti in Italia (6).

Con periodicità mensile:

- dati patrimoniali - [sez. I](#);
- informazioni sulla composizione del portafoglio - [sez. II](#);
- situazione quote - [sez. III](#);
- valore delle quote - [sez. IV](#).

Con periodicità semestrale:

- informazioni sulle commissioni e provvigioni - [sez. V](#).

Con periodicità annuale o inferiore in relazione alla distribuzione dei proventi:

- rendiconto di gestione - [sez. VI](#).

Nell'ipotesi di distinzione tra "SGR promotore" e "SGR gestore" deve essere comunicato alla Banca d'Italia, secondo le previste modalità, il soggetto designato a produrre le segnalazioni.

5.4 Fondi comuni di investimento chiusi (esclusi quelli di cui ai successivi par. 5.5 e 5.6).

Con periodicità semestrale (7):

- dati patrimoniali - [sez. I](#);
- informazioni sulla composizione del portafoglio - [sez. II](#);
- situazione quote - [sez. III](#);
- valore delle quote - [sez. IV](#).

Con periodicità annuale o inferiore in relazione alla distribuzione dei proventi:

- rendiconto di gestione - [sez. VI](#).

6) Sono ricompresi nella categoria anche i fondi istituiti in Italia da società di gestione comunitarie.

7) In occasione della riapertura delle sottoscrizioni, del rimborso delle quote, della liquidazione ovvero della costituzione del fondo, potranno essere richieste dalla Banca d'Italia alla SGR incaricata delle segnalazioni, anche in via informale, informazioni di dettaglio infrasemestrali atte a soddisfare le specifiche esigenze segnaletiche previste dal Regolamento BCE/2007/8 relativo alle segnalazioni statistiche dei fondi comuni di investimento.

Nell'ipotesi di distinzione tra "SGR promotore" e "SGR gestore" deve essere comunicato alla Banca d'Italia, secondo le previste modalità, il soggetto designato a produrre le segnalazioni.

5.5 Fondi comuni di investimento chiusi immobiliari.

Con periodicità semestrale (8):

- dati patrimoniali - [sez. I](#);
- informazioni sulla composizione del portafoglio - [sez. II](#);
- situazione quote - [sez. III](#);
- valore delle quote - [sez. IV](#);
- informazioni sui flussi finanziari - [sez. V](#).

Con periodicità annuale o inferiore in relazione alla distribuzione dei proventi:

- rendiconto di gestione - [sez. VI](#).

Nell'ipotesi di distinzione tra "SGR promotore" e "SGR gestore" deve essere comunicato alla Banca d'Italia, secondo le previste modalità, il soggetto designato a produrre le segnalazioni.

8) In occasione della riapertura delle sottoscrizioni, del rimborso delle quote, della liquidazione ovvero della costituzione del fondo, potranno essere richieste dalla Banca d'Italia alla SGR incaricata delle segnalazioni, anche in via informale, informazioni di dettaglio infrasemestrali atte a soddisfare le specifiche esigenze segnaletiche previste dal Regolamento BCE/2007/8 relativo alle segnalazioni statistiche dei fondi comuni di investimento.

5.6 Fondi comuni di investimento chiusi mobiliari riservati a investitori qualificati.

Con periodicità semestrale:

- il valore complessivo netto (voce 50486 00) - [sez. I](#) (9);
- dati patrimoniali - [sez. I](#);
- informazioni sulla composizione del portafoglio - [sez. II](#);
- situazione quote - [sez. III](#);
- valore delle quote - [sez. IV](#).

Con periodicità annuale o inferiore in relazione alla distribuzione dei proventi:

- rendiconto di gestione - [sez. VI](#).

Nell'ipotesi di distinzione tra "SGR promotore" e "SGR gestore" deve essere comunicato alla Banca d'Italia, secondo le previste modalità, il soggetto designato a produrre le segnalazioni.

5.7 Fondi comuni di investimento di diritto estero istituiti da SGR italiane.

Con periodicità trimestrale:

- segnalazioni relative ai fondi di diritto estero istituiti da SGR - [sez. III](#) sottosez. 4 (dati riferiti a ciascun mese del trimestre)

5.8 SICAV.

Con periodicità mensile:

- dati patrimoniali - [sez. I](#);
- informazioni sulla composizione del portafoglio - [sez. III](#);
- situazione delle azioni - [sez. IV](#);

9) Entro il 24° giorno lavorativo successivo alla data di riferimento deve essere trasmesso solo il "valore complessivo netto"; con invio successivo, entro i termini di inoltro attualmente previsti, dovranno essere trasmesse tutte le informazioni semestrali, compresa la voce relativa al "valore complessivo netto".

- valore delle azioni - [sez. V](#).

Con periodicità semestrale:

- dati di conto economico - [sez. II](#);
- informazioni sulle commissioni e provvigioni - [sez. VI](#) ;

5.9 Organismi di investimento collettivo del risparmio esteri.

Con periodicità semestrale:

- informazioni statistiche - [sez. I](#) (dati riferiti a ciascun mese del semestre).

6 Segnalazioni statistiche degli intermediari finanziari ex art. 106 D.lgs. 385/93.

Le informazioni, organizzate secondo i rispettivi schemi riportati nel Tomo III, devono essere trasmesse tramite il canale Internet.

Con periodicità semestrale:

- dati patrimoniali (10): Parte I sez. I;
- crediti di firma, impegni e rischi e conti d'ordine: Parte I sez. II;
- altre informazioni (11): Parte I sez. IV;

Con periodicità annuale:

- dati di conto economico: Parte I sez. III.

10) Tranne le voci 64060 00 ("Perdita d'esercizio") e 64136 00 ("Utile d'esercizio") da segnalare con cadenza annuale.

11) Tranne la voce 64370 00 ("Bilancio IAS"), che va segnalata a cadenza annuale.

Capitolo 2

Termini di produzione dei dati

1 Termini relativi alle segnalazioni delle banche (matrice).

Le segnalazioni di vigilanza devono pervenire entro i termini di seguito indicati:

- la sezione prima deve essere prodotta, mensilmente, entro il 12° giorno lavorativo successivo alla data di riferimento;

- la sezione seconda, ad eccezione delle sottosezioni relative ai servizi di investimento (2.2), ai servizi di pagamento (2.3), ai canali distributivi (2.4 parte prima), delle voci relative alla traslazione del rischio (2.1 parte prima voci 58352, 58354, 58356), della voce 58885 (2.4 parte seconda) e della voce relativa al numero dei depositi trasferibili (58890), deve essere prodotta, con cadenza trimestrale, entro il 25 del mese successivo a quello di riferimento;

- le sottosezioni relative ai servizi di investimento (2.2), ai servizi di pagamento (2.3), ai canali distributivi (2.4 parte prima) e le voci relative alla traslazione del rischio (2.1 parte prima voci 58352, 58354, 58356, 58358, 58359) devono essere prodotte, trimestralmente, entro il 25 del secondo mese successivo a quello di riferimento;

- la voce relativa al numero dei depositi trasferibili (58890) deve essere prodotta annualmente entro il 25 del mese successivo a quello di riferimento;

- la sezione terza (dati di bilancio), ad eccezione della sottosezione 7, deve essere prodotta due volte l'anno:
 - 1) i dati riferiti al primo semestre entro il 25 del terzo mese successivo alla fine del periodo di riferimento (1);
 - 2) i dati riferiti all'intero esercizio entro il 5 del quarto mese successivo alla fine dell'esercizio;

- la sottosezione III.7 ("perdite storicamente registrate sulle posizioni in *default*"), con periodicità annuale entro il 25 marzo successivo alla data di riferimento (31 dicembre).

1) Le filiali italiane di banche estere sono esonerate dall'invio dei dati semestrali .

- i "dati di bilancio" delle banche assoggettate alla procedura di amministrazione straordinaria" devono essere prodotti entro il 25 del mese successivo a quello di approvazione del bilancio della amministrazione stessa;

- La sezione quarta: dati relativi ai fondi propri su base individuale, al rischio di credito e di controparte su base individuale, alle grandi esposizioni su base individuale, ai requisiti patrimoniali individuali sui rischi di mercato, ai requisiti patrimoniali individuali per il rischio operativo, alla posizione patrimoniale individuale, al rischio di liquidità su base individuale, alla leva finanziaria su base individuale, ai soggetti collegati su base individuale e la voce 58885 (2.4 parte seconda) devono essere prodotti secondo le frequenze segnaletiche e i termini d'inoltro previsti dal Regolamento della Commissione Europea sulle norme tecniche di attuazione (ITS) in materia di segnalazioni prudenziali armonizzate delle banche e delle imprese di investimento.

Ove il termine indicato fosse festivo, le segnalazioni devono pervenire entro il primo giorno lavorativo successivo.

2 Termini relativi alle segnalazioni di vigilanza su base consolidata dei gruppi di banche.

Segnalazioni statistiche (cadenza semestrale): devono pervenire entro il 25 del 4° mese successivo a quello di riferimento (di regola entro il 25 aprile e il 25 ottobre rispettivamente per le segnalazioni di dicembre e giugno (2)).

Rapporti di stato patrimoniale tra le imprese del gruppo bancario (cadenza trimestrale) (voce 36381 sottovoci 2, 4, 6 o, in alternativa, sottovoce 16): quelli riferiti alla data di chiusura del bilancio e della successiva segnalazione semestrale, vanno trasmessi in uno con le segnalazioni statistiche; gli altri devono pervenire entro il 25 del 2° mese successivo a quello di riferimento (di regola entro il 25 maggio e il 25 novembre rispettivamente per le segnalazioni di marzo e settembre).

In particolare la voce 36381 - sottovoce 16 (Rapporti intragruppo: segnalazione negativa) va compilata - indicando convenzionalmente il valore 1 - solo se alla data di riferimento della segnalazione tutti i rapporti tra le imprese del gruppo bancario presentano importi nulli. Stessi criteri vengono utilizzati per la compilazione delle voci negative previste per i rapporti tra le imprese del gruppo bancario e le altre imprese incluse nel consolidamento (voci 36383.88, 36385.30, 36387.26, 36389.30, 36391.46, 36393.46).

Segnalazioni riferite ai fondi propri su base consolidata, al rischio di credito e di controparte su base consolidata, alle grandi esposizioni su base consolidata, ai requisiti patrimoniali consolidati sui rischi di mercato, ai requisiti patrimoniali consolidati per il rischio operativo e alla posizione patrimoniale consolidata, al rischio di liquidità su base consolidata, alla leva finanziaria su base consolidata e ai soggetti collegati su base consolidata: devono pervenire secondo le frequenze segnaletiche e i termini d'oltro previsti dal Regolamento della Commissione Europea sulle norme tecniche di attuazione (ITS) in materia di segnalazioni prudenziali armonizzate delle banche e delle imprese di investimento.

Segnalazioni riferite alle informazioni per Paese di controparte (sezione 3.8): devono essere trasmesse trimestralmente entro il 25 del secondo mese successivo a quello di riferimento.

2) Se la data di riferimento del bilancio consolidato è diversa dal 31 dicembre, la segnalazione statistica riguardante l'intero esercizio va riferita alla data del bilancio consolidato. Conseguentemente si spostano anche i termini di riferimento delle altre segnalazioni.

3 Termini relativi alle segnalazioni sull'attività di intermediazione mobiliare

3.1 SIM - Segnalazioni statistiche individuali

Le segnalazioni delle SIM devono pervenire nel rispetto dei seguenti termini:

- le segnalazioni di cui alle sezioni I e II entro i seguenti termini:
 - 25 aprile: per i dati riferiti al 31 marzo;
 - 25 agosto: per i dati riferiti al 30 giugno;
 - 25 ottobre: per i dati riferiti al 30 settembre;
 - 25 febbraio dell'anno successivo: per i dati riferiti al 31 dicembre.
- le segnalazioni di cui alla sezione III entro il giorno 25 del mese successivo alla data di riferimento.
- le segnalazioni di cui alle sezione IV entro i seguenti termini:
 - 25 aprile: per i dati riferiti a gennaio, febbraio e marzo;
 - 25 luglio: per i dati riferiti a aprile, maggio e giugno;
 - 25 ottobre: per i dati riferiti a luglio, agosto e settembre;
 - 25 gennaio dell'anno successivo: per i dati riferiti a ottobre, novembre e dicembre.

Gli enti segnalanti che chiudono il bilancio in data diversa dal 31 dicembre dovranno inviare le segnalazioni di cui alle Sezioni I e II riferite all'anno solare e non all'esercizio sociale.

3.2 Gruppi di SIM – Segnalazioni statistiche consolidate

Le segnalazioni consolidate dei gruppi di SIM devono pervenire nel rispetto dei seguenti termini:

- le segnalazioni di cui alle sezioni I, II e III entro i seguenti termini:
 - 25 agosto: per i dati riferiti al 30 giugno;
 - 25 febbraio dell'anno successivo: per i dati riferiti al 31 dicembre.

3.3 SIM e gruppi di SIM – Segnalazioni prudenziali su base individuale e consolidata

3.3.1 SIM e gruppi di SIM soggette al regime CRR/CRD IV

Le segnalazioni delle SIM e dei gruppi di SIM devono pervenire nel rispetto dei termini d'inoltro indicati dal Regolamento della Commissione Europea sulle norme tecniche di attuazione (ITS) in materia di segnalazioni prudenziali armonizzate delle banche e delle imprese di investimento.

3.3.2 SIM non soggette al regime CRR/CRD IV

Le segnalazioni delle SIM che prestano esclusivamente i servizi di "ricezione e trasmissione di ordini" e di "consulenza in materia di investimenti" senza detenzione dei beni della clientela devono pervenire nel rispetto dei seguenti termini:

- 12 maggio: per i dati riferiti al 31 marzo;
- 11 agosto: per i dati riferiti al 30 giugno;
- 11 novembre: per i dati riferiti al 30 settembre;
- 11 febbraio dell'anno successivo: per i dati riferiti al 31 dicembre.

4 Termini relativi alle segnalazioni degli intermediari finanziari ex art. 107 D.lgs. 385/93, degli istituti di pagamento e degli istituti di moneta elettronica.

Le segnalazioni devono pervenire nel rispetto dei seguenti termini:

- dati patrimoniali ([sez. I](#)) e altre informazioni ([sez. II](#)), ad esclusione delle voci 46442, 46444, 40728, 40756, 40758, 52120, 52170, 52174, 52178, 52182, 52186, 52212, 52264, 52280, 52282, 52288, 52292, 52298, 52363, 52365, 52367, 52369, 52376, 52380, 52382, 52384, 52386, 52388, 52398, 52392, 52396, 52515, 58670 e 58675 e della sottosezione II.13: entro il giorno 25 del mese successivo alla data di riferimento;
- dati di conto economico ([sez. III](#)): la segnalazione, da riferire al primo semestre dell'anno solare (30 giugno) e al periodo 1° gennaio - 31 dicembre, va inviata rispettivamente entro il 25 settembre e il 5 aprile. Lo stesso criterio deve essere inoltre seguito per le voci 46442, 46444, 40728, 40756, 40758, 52120, 52170, 52174, 52178, 52182, 52186, 52212, 52264, 52280, 52282, 52288, 52292, 52298, 52363, 52365, 52367, 52369, 52376, 52380, 52382, 52384, 52386, 52388, 52398, 52392, 52396, 52515, 58670 e 58675 della Sezione II;
- segnalazioni sulle “perdite storicamente registrate sulle posizioni in *default*” (sottosezione II.13): con periodicità annuale, entro il 25 marzo successivo alla data di riferimento (31 dicembre).
- dati di fine esercizio ([sez. V](#)): entro il giorno 5 del quarto mese successivo a quello di chiusura del bilancio d'esercizio;
- segnalazioni relative al patrimonio di vigilanza e requisiti patrimoniali ([sez. IV](#)): entro il giorno 25 del terzo mese successivo a quello di riferimento per le segnalazioni di dicembre e giugno ed entro il giorno 25 del mese successivo a quello di riferimento per le segnalazioni di marzo e settembre.

5 Termini relativi alle segnalazioni statistiche e di vigilanza degli organismi di investimento collettivo del risparmio (O.I.C.R.).

5.1 Società di gestione (escluse quelle di cui al successivo par. 5.2).

Le segnalazioni delle società di gestione diverse da quelle che gestiscono esclusivamente fondi chiusi mobiliari riservati a investitori qualificati devono pervenire nel rispetto dei seguenti termini:

- il patrimonio di vigilanza e i requisiti patrimoniali di cui alla [sez. II](#) entro:
 - 25 aprile: per i dati riferiti al 31 marzo;
 - 25 luglio: per i dati riferiti al 30 giugno;
 - 25 ottobre: per i dati riferiti al 30 settembre;
 - 25 gennaio: per i dati riferiti al 31 dicembre;

- le informazioni statistiche di cui alla [sez. III](#) entro:
 - 25 aprile: per i dati riferiti a gennaio, febbraio e marzo;
 - 25 luglio: per i dati riferiti a aprile, maggio e giugno;
 - 25 ottobre: per i dati riferiti a luglio, agosto e settembre;
 - 25 gennaio: per i dati riferiti a ottobre, novembre e dicembre;

- la situazione dei conti di cui alla [sez. I](#) entro:
 - 25 agosto: per i dati riferiti al 30 giugno;
 - 10 marzo: per i dati riferiti al 31 dicembre.

Gli enti segnalanti che chiudono il bilancio in data diversa dal 31 dicembre dovranno inviare le segnalazioni relative alla [sez. I](#) con riferimento all'anno solare e non all'esercizio sociale.

5.2 Società di gestione che gestiscono esclusivamente fondi chiusi mobiliari riservati a investitori qualificati.

Le segnalazioni delle società di gestione che gestiscono esclusivamente fondi chiusi mobiliari riservati a investitori qualificati devono pervenire nel rispetto dei seguenti termini:

- il patrimonio di vigilanza e i requisiti patrimoniali di cui alla [sez. II](#) entro:
 - 25 aprile: per i dati riferiti al 31 marzo;
 - 25 luglio: per i dati riferiti al 30 giugno;
 - 25 ottobre: per i dati riferiti al 30 settembre;
 - 25 gennaio: per i dati riferiti al 31 dicembre;

- la situazione dei conti di cui alla [sez. I](#), fatta eccezione per la sottosezione 6, entro:
 - 25 agosto: per i dati riferiti al 30 giugno;
 - 10 marzo: per i dati riferiti al 31 dicembre.

- I dati integrativi e le altre informazioni di cui alla [sez. I](#) sottosez. 6 entro:
 - 10 marzo: per i dati riferiti al 31 dicembre.

5.3 Fondi comuni di investimento aperti istituiti in Italia (diversi dai fondi monetari e dai fondi speculativi) (3).

Le segnalazioni dei fondi comuni di investimento aperti (diversi dai fondi monetari e dai fondi speculativi) devono pervenire nel rispetto dei seguenti termini:

- le segnalazioni di cui alle sezioni [I](#), [II](#), [III](#), [IV](#), [V](#) entro il giorno 25 del mese successivo alla data di riferimento;

- il rendiconto di gestione di cui alla [sez. VI](#) entro il 25 del mese successivo a quello di approvazione del rendiconto.

3) Sono ricompresi nella categoria anche i fondi istituiti in Italia da società di gestione comunitarie.

5.4 Fondi comuni di investimento aperti monetari istituiti in Italia (4).

Le segnalazioni dei fondi comuni di investimento aperti monetari devono pervenire nel rispetto dei seguenti termini:

- le segnalazioni di cui alle sezioni I, II, III, IV, V entro il 12° giorno lavorativo del mese successivo alla data di riferimento;
- il rendiconto di gestione di cui alla sez. VI entro il 25 del mese successivo a quello di approvazione del rendiconto.

5.5 Fondi comuni di investimento aperti speculativi istituiti in Italia (5).

Le segnalazioni dei fondi comuni di investimento aperti speculativi devono pervenire nel rispetto dei seguenti termini:

- le segnalazioni di cui alle sezioni I, II, III, IV, V entro il 24° giorno lavorativo del mese successivo alla data di riferimento;
- il rendiconto di gestione di cui alla sez. VI entro il 25 del mese successivo a quello di approvazione del rendiconto.

5.6 Fondi comuni di investimento chiusi (esclusi quelli di cui ai successivi par. 5.7 e 5.8).

Le segnalazioni dei fondi comuni di investimento chiusi diversi da quelli immobiliari e dai mobiliari riservati a investitori qualificati devono pervenire nel rispetto dei seguenti termini:

- le segnalazioni di cui alle sezioni I, II, III, IV entro il 24° giorno lavorativo del mese successivo alla data di riferimento;

4) Sono ricompresi nella categoria anche i fondi istituiti in Italia da società di gestione comunitarie.

5) Sono ricompresi nella categoria anche i fondi istituiti in Italia da società di gestione comunitarie.

- il rendiconto di gestione di cui alla [sez. VI](#) entro il 25 del mese successivo a quello di approvazione del rendiconto.

5.7 Fondi comuni di investimento chiusi immobiliari.

Le segnalazioni dei fondi comuni di investimento chiusi immobiliari devono pervenire nel rispetto dei seguenti termini:

- le segnalazioni di cui alle sezioni [I](#), [II](#), [III](#), [IV](#) entro il 24° giorno lavorativo del mese successivo alla data di riferimento;
- le informazioni sui flussi finanziari di cui alla [sez. V](#) entro:
 - 25 agosto: per i dati riferiti al 30 giugno;
 - 25 febbraio: per i dati riferiti al 31 dicembre;
- il rendiconto di gestione di cui alla [sez. VI](#) entro il 25 del mese successivo a quello di approvazione del rendiconto.

5.8 Fondi comuni di investimento chiusi mobiliari riservati a investitori qualificati.

Le segnalazioni dei fondi comuni di investimento chiusi mobiliari riservati a investitori qualificati devono pervenire nel rispetto dei seguenti termini:

1. la segnalazione del valore complessivo netto (voce 5048600), contenuta nella sezione I, entro il 24° giorno lavorativo del mese successivo alla data di riferimento (6);
2. le segnalazioni di cui alle sezioni I, II, III, IV (comprehensive nuovamente della voce 5048600) entro (3):
 - 25 agosto: per i dati riferiti al 30 giugno;
 - 25 marzo: per i dati riferiti al 31 dicembre.
3. il rendiconto di gestione di cui alla sez. VI entro il 25 del mese successivo a quello di approvazione del rendiconto.

5.9 Fondi comuni d'investimento di diritto estero istituiti da sgr italiane.

Le segnalazioni dei fondi comuni di diritto estero istituiti da sgr (sez. III sottosez. 4) devono pervenire nel rispetto dei seguenti termini:

- 25 aprile: per i dati riferiti a gennaio, febbraio e marzo;
- 25 luglio: per i dati riferiti a aprile, maggio e giugno;
- 25 ottobre: per i dati riferiti a luglio, agosto e settembre;
- 25 gennaio: per i dati riferiti a ottobre, novembre e dicembre;

5.10 SICAV – comparti non monetari.

Le segnalazioni dei comparti non monetari delle SICAV devono pervenire nel rispetto dei seguenti termini:

-
- 6) Le segnalazioni del valore complessivo netto (voce 5048600) e delle sezioni I, II, III, IV dei fondi chiusi dovranno essere effettuate utilizzando il seguente criterio:
In occasione del primo invio della base informativa "TA", da effettuare entro il 24° giorno lavorativo successivo alla data di riferimento, dovrà essere segnalata esclusivamente la voce relativa al valore complessivo netto. Successivamente, entro i termini stabiliti, dovranno essere inoltrate tutte le voci della base informativa stessa (compresa la voce 5048600), avendo cura di impostare nel campo "numero invio" un valore successivo a quello impostato in occasione del precedente invio.

- le segnalazioni di cui alle sezioni I, III, IV, V, VI entro il giorno 25 del mese successivo alla data di riferimento;
- i dati di conto economico di cui alla sez. II entro:
 - 25 agosto: per i dati riferiti al 30 giugno;
 - 10 marzo: per i dati riferiti al 31 dicembre.

5.11 SICAV – comparti monetari.

Le segnalazioni dei comparti monetari delle SICAV devono pervenire nel rispetto dei seguenti termini:

- le segnalazioni di cui alle sezioni I, III, IV, V, VI entro il 12° giorno lavorativo del mese successivo alla data di riferimento;
- i dati di conto economico di cui alla sez. II entro:
 - 25 agosto: per i dati riferiti al 30 giugno;
 - 10 marzo: per i dati riferiti al 31 dicembre.

5.12 Organismi di investimento collettivo del risparmio esteri.

Le segnalazioni degli organismi di investimento collettivo del risparmio esteri devono pervenire nel rispetto dei seguenti termini:

- 25 agosto: per i dati riferiti a gennaio, febbraio, marzo, aprile, maggio e giugno;
- 25 febbraio: per i dati riferiti a luglio, agosto, settembre, ottobre, novembre e dicembre.

6 Termini relativi alle segnalazioni degli intermediari finanziari ex art. 106 D.lgs. 385/93.

Le segnalazioni degli intermediari finanziari ex art. 106 D.lgs. 385/93 devono pervenire nel rispetto dei seguenti termini:

- dati patrimoniali (Parte I sez. I), crediti di firma, impegni e rischi e conti d'ordine (Parte I sez. II) e altre informazioni (Parte I sez. IV):
 - entro il giorno 15 aprile per le segnalazioni riferite al 31 dicembre;
 - entro il giorno 25 luglio per le segnalazioni riferite al 30 giugno;
- dati di conto economico (Parte I sez. III), riferiti al 31 dicembre, entro il giorno 15 aprile dell'anno successivo.

Gli enti segnalanti che chiudono il bilancio in data diversa dal 31 dicembre dovranno inviare le segnalazioni riferite al primo semestre dell'esercizio entro il giorno 25 del mese successivo alla fine del semestre e quelle riferite all'intero anno dell'esercizio entro il giorno 15 del quarto mese successivo alla fine dell'esercizio.

Capitolo 3

Modalità tecnico-operative per l'inoltro delle informazioni

Per la predisposizione delle informazioni, le banche e gli enti finanziari possono servirsi di un centro di elaborazione dati esterno, fermo restando che la responsabilità esclusiva per l'affidabilità delle informazioni fornite e per l'osservanza degli adempimenti previsti per la loro trasmissione rimane a totale carico dell'istituzione tenuta ad effettuare le segnalazioni.

Le modalità di registrazione delle informazioni nonché le specifiche tecniche per l'inoltro delle stesse sono riportate nell'[allegato 2](#).

1 Le segnalazioni delle banche.

Le segnalazioni delle banche, complete di tutte le informazioni previste alle diverse scadenze, vanno trasmesse tramite rete interbancaria (con modalità "file transfer") (1)

Per le segnalazioni relative alla sottosezione III.7 ("perdite storicamente registrate sulle posizioni in *default*"), deve essere utilizzata l'applicazione INFOSTAT (vers.2).

Le banche dovranno comunicare al Servizio Rilevazioni Statistiche - Divisione segnalazioni creditizie e finanziarie se la trasmissione su "file transfer" avviene in modo diretto o tramite centro applicativo. In quest'ultimo caso dovrà essere indicato il nome di tale centro.

Le banche che abbiano manifestato, con lettera da inviare al Servizio Rilevazioni Statistiche, difficoltà di utilizzo della rete interbancaria potranno utilizzare il canale internet mediante l'applicazione "Raccolta Dati Via Internet – R.D.V.I." (vers.1) secondo le modalità previste per gli enti finanziari non bancari.

2 Le segnalazioni degli enti finanziari non bancari, degli istituti di pagamento e degli istituti di moneta elettronica.

Le segnalazioni degli enti finanziari non bancari, degli istituti di pagamento e degli istituti di moneta elettronica vanno trasmesse di norma mediante l'applicazione INFOSTAT (vers.2); limitatamente alla survey "T9" relativa agli organismi di investimento collettivo del risparmio esteri, la segnalazione va invece

1) E' in corso una graduale migrazione sulla infrastruttura INFOSTAT delle segnalazioni individuali e su base consolidata secondo la tempistica che viene resa nota con apposite comunicazioni e pubblicata sul sito internet della Banca d'Italia all'indirizzo:

http://www.bancaditalia.it/statistiche/racc_datser/intermediari/RDVI/banche/calendario_infostat.pdf

effettuata mediante l'applicazione "Raccolta Dati Via Internet – R.D.V.I." (vers.1). Entrambe le applicazioni utilizzano il canale Internet.

Propedeutica all'utilizzo di entrambe le applicazioni è la richiesta delle credenziali di accesso da parte dell'ente segnalante. Gli enti dovranno quindi preventivamente scaricare il modulo di adesione all'applicazione INFOSTAT oppure R.D.V.I., dal sito della Banca d'Italia (www.bancaditalia.it > Statistiche > Raccolta dati e servizi > Raccolta dati presso gli intermediari > Raccolta dati via internet) (2) compilarlo ed inviarlo all'indirizzo di posta elettronica 'rdvi.helpdesk@bancaditalia.it'. Una copia del modulo dovrà comunque essere stampata, firmata e inviata al Servizio Rilevazioni Statistiche via fax al numero 0647926713.

Sulla base delle informazioni contenute nel modulo, la Banca d'Italia provvederà a trasmettere in busta sigillata le credenziali di accesso all'ente segnalante. Per una maggiore tempestività e sicurezza nella ricezione, le credenziali saranno inviate all'attenzione del destinatario indicato nel modulo, fermo restando che esse sono attribuite all'ente di appartenenza.

Gli enti segnalanti si dovranno altresì dotare di un indirizzo di posta elettronica, non nominativo, destinato esclusivamente allo scambio di informazioni con la Banca d'Italia (3).

Nel caso in cui circostanze eccezionali determinino l'indisponibilità dell'applicazione INFOSTAT di raccolta dati, la Banca d'Italia fornirà ove del caso specifiche istruzioni per l'inoltro dei dati.

Gli enti che utilizzano l'applicazione R.D.V.I. e abbiano manifestato, con lettera da inviare al Servizio Rilevazioni Statistiche, momentanee difficoltà di utilizzo del canale internet potranno far ricorso all'utilizzo del supporto magnetico (3).

2) Al medesimo indirizzo è possibile consultare i manuali utente per le specifiche tecniche relative all'utilizzo delle due piattaforme informatiche.

3) Le comunicazioni di rilievi agli enti vengono trasmesse dall'Istituto, di norma, mediante posta elettronica e notifica all'indirizzo internet "<https://infostat.bancaditalia.it>" (per gli intermediari che utilizzano la piattaforma INFOSTAT) o "<http://racdati.bancaditalia.it>" (per gli enti finanziari che utilizzano la piattaforma R.D.V.I.).

3) Per la trasmissione delle segnalazioni su supporto magnetico possono essere utilizzati cd-rom e cartucce tipo "IBM 3480/3490". I supporti, da trasmettere chiusi in apposita custodia vanno recapitati all'indirizzo indicato nelle disposizioni in materia di "Modalità di scambio delle informazioni".

Capitolo 5

Verifiche sulla affidabilità delle segnalazioni

Gli enti segnalanti devono trasmettere le informazioni dovute nel rispetto delle coerenze, delle modalità di rappresentazione dei fenomeni e degli standard tecnici indicati nella normativa segnaletica.

L'attivazione di efficaci sistemi di controllo preventivo dei dati presso le istituzioni segnalanti è strumento essenziale per assicurare la massima affidabilità delle informazioni prodotte. È cura dei responsabili aziendali predisporre adeguati presidi organizzativi al processo di produzione delle informazioni.

Per agevolare l'attività di verifica la Banca d'Italia mette a disposizione degli intermediari una griglia di controlli che verificano le coerenze logiche e andamentali tra le informazioni presenti nei flussi. I controlli vengono comunicati agli intermediari con modalità che ne facilitano l'applicazione elettronica.

In particolare: per le banche vengono diffusi con il protocollo in uso per la distribuzione della documentazione prodotta dal gruppo interbancario PUMA 2; per gli intermediari finanziari con i programmi di "diagnostica" distribuiti dalla Banca d'Italia.

Gli intermediari devono sottoporre le informazioni ai suddetti controlli. Gli eventuali errori devono essere sanati prima dell'invio della segnalazione, senza documento per il rispetto delle scadenze previste.

Per taluni controlli vengono utilizzate le informazioni contenute nell'anagrafe titoli della Banca d'Italia. Un estratto dell'anagrafe viene messo a disposizione degli enti segnalanti, previo accreditamento e rilascio di credenziali da parte della Banca d'Italia, all'indirizzo <https://racdati.bancaditalia.it>.

Il Servizio Rilevazioni Statistiche sottopone comunque le informazioni ricevute ai medesimi controlli; eventuali esiti negativi formeranno oggetto di comunicazione agli enti segnalanti. Questi dovranno provvedere alla **immediata sistemazione** degli errori rilevati ovvero, relativamente alle anomalie statistiche che trovano spiegazione nella operatività aziendale, alla conferma dei dati; in quest'ultimo caso l'azienda dovrà essere in grado, ove richiesto, di fornire opportuni chiarimenti.

Le segnalazioni possono essere sottoposte ad ulteriori controlli in relazione alle diverse necessità di utilizzo. Gli eventuali esiti negativi di tali controlli vengono portati a conoscenza degli enti con una **comunicazione di rilievi**. Gli enti devono provvedere alla sistemazione degli errori con la massima tempestività e comunque non oltre i termini specificati nelle relative comunicazioni.

Le comunicazioni avvengono :

- per le banche, di norma, attraverso l'utilizzo della rete interbancaria;
- per gli enti finanziari non bancari, gli istituti di pagamento, gli istituti di moneta elettronica e i gruppi di SIM e per le banche che utilizzano la piattaforma INFOSTAT, di norma, mediante posta elettronica e notifica all'indirizzo <https://infostat.bancaditalia.it>.
- per gli enti finanziari non bancari che utilizzano la piattaforma R.D.V.I., di norma, mediante posta elettronica e notifica all'indirizzo <http://racdati.bancaditalia.it>;

Le tipologie dei controlli eseguiti sui flussi segnaletici nonché le modalità tecniche utilizzate per la comunicazione agli enti degli errori o anomalie sono riportate nell'allegato 5 - parte prima.

Per agevolare una rapida interazione sulle problematiche connesse con le segnalazioni, le banche e gli enti finanziari devono comunicare al Servizio Rilevazioni Statistiche con apposita lettera i nominativi, i recapiti telefonici e l'indirizzo di posta elettronica dei funzionari preposti alla produzione e all'invio delle segnalazioni nonché il numero del telefax. Eventuali successive variazioni alle informazioni richieste devono essere prontamente comunicate.

Capitolo 6

Segnalazioni di rettifica/conferma

Premessa

Le rettifiche devono essere effettuate nei termini indicati nel capitolo precedente. La mancata o ritardata produzione delle rettifiche costituisce un elemento negativo di valutazione della situazione organizzativa aziendale e configura un inadempimento sanzionabile ai sensi della normativa vigente.

La correzione delle informazioni può essere effettuata o attraverso la riproposizione dell'intera segnalazione originaria (vedi paragrafo 1) o con specifici interventi correttivi sulle parti delle segnalazioni inficiate da errori o anomalie (cfr. paragrafo 2).

Nell'approntamento delle rettifiche, gli enti devono tenere in debito conto tutte le interrelazioni presenti all'interno delle "basi informative".

1 Riproposizione dell'intera segnalazione

Le banche e gli enti finanziari possono riproporre l'intera segnalazione allorquando, in relazione alla numerosità delle rettifiche da apportare, lo ritengano opportuno.

L'intera segnalazione deve essere comunque riprodotta nel caso in cui l'istituzione abbia inviato in precedenza una segnalazione incompleta (ad esempio mancanza di una o più sezioni di una base informativa).

La riproduzione dell'intera segnalazione può essere altresì richiesta dalla Banca d'Italia per ragioni di ordine tecnico.

Per quanto riguarda la modalità di trasmissione si rimanda al [capitolo 3](#) e alle specifiche tecniche contenute nell'[allegato 2](#).

Si rammenta che ad ogni successivo invio andrà incrementato in stretta sequenza il campo NUMINV (numero invio) nel record di testa e di coda del file contenente le informazioni (cfr. in proposito [allegato 2](#)).

2 Invio delle segnalazioni di rettifica

Le banche dovranno effettuare le segnalazioni di rettifica utilizzando la rete interbancaria (1).

Per le segnalazioni relative alla sottosezione III.7 (“perdite storicamente registrate sulle posizioni in *default*”) deve essere utilizzata l’applicazione INFOSTAT (vers.2).

Le altre istituzioni dovranno utilizzare il canale internet.

Non è previsto l’utilizzo del supporto cartaceo.

Le specifiche tecniche per il confezionamento delle rettifiche sono riportate nell’[allegato 5](#) - Parte seconda.

Agli enti finanziari non bancari, agli istituti di pagamento, agli istituti di moneta elettronica e ai gruppi di SIM e alle banche che utilizzano l’applicazione INFOSTAT, nel caso in cui circostanze eccezionali determinino l’indisponibilità di tale applicazione di raccolta dati, la Banca d’Italia fornirà ove del caso specifiche istruzioni per l’inoltro dei dati.

Gli enti finanziari che utilizzano l’applicazione R.D.V.I. che abbiano manifestato, con lettera da inviare al Servizio Rilevazioni Statistiche, momentanee difficoltà di gestione rispettivamente della rete interbancaria o del canale internet potranno utilizzare il supporto magnetico.

1) E’ in corso una graduale migrazione sulla infrastruttura INFOSTAT delle segnalazioni individuali e su base consolidata secondo la tempistica che viene resa nota con apposite comunicazioni e pubblicata sul sito internet della Banca d’Italia all’indirizzo:

http://www.bancaditalia.it/statistiche/racc_datser/intermediari/RDVI/banche/calendario_infostat.pdf

3 Invio delle segnalazioni di conferma

Le banche e gli enti finanziari che, in seguito a comunicazioni di anomalie sulle segnalazioni prodotte, accertino la correttezza dei dati così come segnalati, devono provvedere a una apposita segnalazione di conferma, nei termini previsti nel [cap. 5](#).

Le specifiche tecniche per il confezionamento delle conferme sono riportate nell'[allegato 5](#) - Parte seconda. Per quanto riguarda i mezzi di trasmissione si rinvia alle indicazioni contenute nel paragrafo precedente.

Le conferme e le rettifiche riconducibili alla stessa segnalazione potranno trovare collocazione nel medesimo file di risposta ai rilievi. Qualora, peraltro, le istituzioni provvedano alla modifica dei dati riproducendo l'intero flusso informativo, le stesse devono far tenere le eventuali conferme mediante una separata segnalazione seguendo le modalità sopra riportate.

Capitolo 7

Flusso di ritorno alle banche

La Banca d'Italia elabora i flussi informativi trasmessi dalle banche per predisporre particolari prodotti statistici utili agli stessi enti segnalanti per le proprie scelte gestionali e come supporto alla definizione dei piani strategici aziendali.

Al fine di consentire una agevole interpretazione e un efficiente utilizzo della base informativa di cui trattasi, i flussi sono corredati di una apposita documentazione che descrive analiticamente i contenuti e fornisce i chiarimenti necessari per la lettura dei dati. Tale documentazione viene resa disponibile unitamente alla base statistica ed è strutturata in modo da poter essere sfruttata elettronicamente.

Sempre congiuntamente ai flussi vengono messi a disposizione dei destinatari sia le informazioni di ordine tecnico necessarie per l'utilizzo del file sia il "dizionario degli aggregati statistici"; quest'ultimo – fondamentale strumento di comunicazione interno all'Istituto e tra questo e l'esterno – documenta i concetti e gli indicatori comunemente impiegati nell'esame delle situazioni aziendali e nelle pubblicazioni concernenti l'andamento delle variabili monetarie e creditizie.

I flussi in questione vengono altresì distribuiti, previa richiesta da inoltrare direttamente al Servizio Rilevazioni Statistiche, alle associazioni di categoria.

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA DELLE
ISTITUZIONI CREDITIZIE E FINANZIARIE

ISTRUZIONI PER LA PRODUZIONE E L'INOLTRO
DELLE SEGNALAZIONI

TOMO I

ALLEGATI

(Circolare n. 154 del 22 novembre 1991)

Allegato 1

Descrizione delle basi informative

- “A1”= Matrice dei conti – dati statistici mensili - sezione prima.
- “A2”= Matrice dei conti – altri dati statistici (parte A) - sezione seconda (ad eccezione delle sottosezioni relative ai servizi di investimento (2.2), ai servizi di pagamento (2.3), ai canali distributivi (2.4 parte prima), della voce 58885 (2.4 parte seconda) e delle voci relative alla traslazione del rischio (2.1 parte prima - voci 58352, 58354, 58356).
- “A3”= Matrice dei conti – altri dati statistici (parte B) - sezione seconda: limitatamente alle sottosezioni relative ai servizi di investimento (2.2), ai servizi di pagamento (2.3), ai canali distributivi (2.4 parte prima) e alle voci relative alla traslazione del rischio (2.1 parte prima - voci 58352, 58354, 58356).
- “A4”= Matrice dei conti – altri dati statistici (parte C) – sezione seconda: voci 58397, 58468, 58890.
- “EP”= Vigilanza consolidata: informazioni per Paese di controparte (sezione 3.8).
- “LD”= Perdite storicamente registrate sulle posizioni in *default*: per le banche sezione III.7; per gli intermediari finanziari ex art. 107 d.lgs. 385/93 sezione II.13.
- “LY” = Banche e SIM - sezione quarta: dati di monitoraggio del rischio di liquidità - copertura della liquidità (LCR) su base individuale.
- “L1”= Gruppi bancari e gruppi di SIM - vigilanza consolidata - sezione quarta: dati di monitoraggio del rischio di liquidità - copertura della liquidità (LCR) su base consolidata.
- “M”= Vigilanza consolidata: segnalazione statistica - sezioni prima, seconda e terza (ad eccezione della sezione 3.8).
- “S”= Attività di intermediazione mobiliare: SIM – Strumenti finanziari in portafoglio e pronti contro termine: Sez. III.
- “T”= Attività di intermediazione mobiliare: SIM - Dati patrimoniali: Sez. I; Dati di conto economico e altre informazioni: Sez. II;
- “T1”= Organismi di investimento collettivo del risparmio: società di gestione - Situazione dei conti: sez. I.
- “T2”= Organismi di investimento collettivo del risparmio: società di gestione - Patrimonio di vigilanza e requisiti patrimoniali, informazioni statistiche: sezz. II-III.
- “T3”= Organismi di investimento collettivo del risparmio: fondi comuni di investimento aperti diversi dai fondi monetari e dai fondi speculativi- Dati patrimoniali, informazioni sulla composizione del portafoglio, situazione quote, valore delle quote, informazioni sulle commissioni e provvigioni: sezz. I-II-III-IV-V.
- “T4”= Organismi di investimento collettivo del risparmio: fondi comuni di investimento aperti - Rendiconto di gestione: sez. VI.
- “TA”= Organismi di investimento collettivo del risparmio: fondi comuni di investimento chiusi - Dati patrimoniali, informazioni sulla composizione del portafoglio, situazione quote, valore delle quote, informazioni sulle commissioni e provvigioni: sezz. I-II-III-IV-V.
- “TB”= Organismi di investimento collettivo del risparmio: fondi comuni di investimento chiusi - Rendiconto di gestione: sez. VI.

- "T5"= Organismi di investimento collettivo del risparmio: comparti non monetari delle SICAV - Dati patrimoniali, informazioni sulla composizione del portafoglio, situazione delle azioni, valore delle azioni, informazioni sulle commissioni e provvigioni: sezz. I-III-IV-V-VI.
- "T6"= Organismi di investimento collettivo del risparmio: SICAV - Dati di conto economico: sez. II.
- "T7"= Organismi di investimento collettivo del risparmio: fondi comuni di investimento aperti monetari - Dati patrimoniali, informazioni sulla composizione del portafoglio, situazione quote, valore delle quote, informazioni sulle commissioni e provvigioni: sezz. I-II-III-IV-V.
- "T8"= Organismi di investimento collettivo del risparmio: comparti monetari delle SICAV - Dati patrimoniali, informazioni sulla composizione del portafoglio, situazione delle azioni, valore delle azioni, informazioni sulle commissioni e provvigioni: sezz. I-III-IV-V-VI.
- "T9"= Organismi di investimento collettivo del risparmio esteri - Informazioni statistiche.
- "TS"= Organismi di investimento collettivo del risparmio: fondi comuni di investimento aperti speculativi- Dati patrimoniali, informazioni sulla composizione del portafoglio, situazione quote, valore delle quote, informazioni sulle commissioni e provvigioni: sezz. I-II-III-IV-V.
- "U"= Attività di intermediazione mobiliare: SIM - Segnalazioni sui servizi d'investimento: Sez. IV;
- "V2"= Attività di intermediazione mobiliare: SIM – Segnalazioni consolidate: Dati patrimoniali, dati di conto economico e altre informazioni, segnalazioni sui servizi d'investimento: sezz. I-II-III;
- "W"= Matrice dei conti - sezione terza: dati di bilancio .
- "Y" = Banche e SIM- sezione quarta: fondi propri su base individuale, rischio di credito e di controparte su base individuale, grandi esposizioni su base individuale, requisiti patrimoniali individuali sui rischi di mercato, requisito patrimoniale individuale per il rischio operativo, posizione patrimoniale individuale, rischio di liquidità - finanziamento stabile (NSFR) su base individuale, leva finanziaria su base individuale, soggetti collegati su base individuale, SIM escluse dall'ambito di applicazione del pacchetto "CRR/CRDIV" – informazioni sui requisiti patrimoniali minimi e voce 58885 (2.4 parte seconda);
- "1"= Gruppi bancari e gruppi di SIM - vigilanza consolidata - sezione quarta: fondi propri su base consolidata, rischio di credito e di controparte su base consolidata, grandi esposizioni su base consolidata, requisiti patrimoniali a livello consolidato sui rischi di mercato, requisiti patrimoniali a livello consolidato per il rischio operativo, posizione patrimoniale consolidata, rischio di liquidità - finanziamento stabile (NSFR) su base consolidata, leva finanziaria su base consolidata, soggetti collegati su base consolidata;
- "3"= Intermediari finanziari ex art. 107 D.lgs. 385/93, istituti di pagamento e istituti di moneta elettronica - Dati patrimoniali e Altre informazioni: sezz. I e II (ad esclusione delle voci 46442, 46444, 52120, 52170, 52174, 52178, 52182, 52186, 52212, 58670, 52264, 52280, 52282, 52288, 52292, 52298, 52363, 52365, 52367, 52369, 52376 e 52515);

- "4"= Intermediari finanziari ex art. 107 D.lgs. 385/93, istituti di pagamento e istituti di moneta elettronica - Dati di conto economico e Dati di fine esercizio: sezz. III e V; Altre informazioni: Sez. II (limitatamente alle voci 46442, 46444, 52120, 52170, 52174, 52178, 52182, 52186, 52212, 58670, 52264, 52280, 52282, 52288, 52292, 52298, 52363, 52365, 52367, 52369, 52376 e 52515);
- "5"= Intermediari finanziari ex art. 107 D.lgs. 385/93, istituti di pagamento e istituti di moneta elettronica - Patrimonio di vigilanza e requisiti patrimoniali: sez. IV ;
- "6"= Dati di bilancio delle banche assoggettate alla procedura di amministrazione straordinaria: matrice dei conti sezione terza;
- "3A"= Intermediari finanziari ex art. 106 D.lgs. 385/93 – Dati patrimoniali; Crediti di firma, Impegni e rischi e conti d'ordine; Conto economico; Altre informazioni: Parte I - sezz. I, II, III e IV;

Allegato 2

Caratteristiche e specifiche tecniche per l'invio delle segnalazioni

1 Le modalità di trasmissione

Le segnalazioni vengono inoltrate attraverso l'utilizzo della rete interbancaria ("file transfer"), del canale internet o del supporto magnetico (1).

Le indicazioni di carattere generale sulla struttura dei file sono contenute nelle disposizioni in materia di "MODALITÀ DI SCAMBIO DELLE INFORMAZIONI" distribuite al Sistema creditizio e finanziario da parte del Servizio Rilevazioni Statistiche.

Si riportano di seguito le specifiche tecniche relative alla trasmissione tramite il canale internet, la rete interbancaria e il supporto magnetico.

1.1 Trasmissione delle segnalazioni tramite il canale internet o su supporto magnetico (2).

1.1.1 Specifiche tecniche inerenti all'invio delle informazioni

La lunghezza dei record da inviare è di 116 byte.

1.1.1.1 Record testa (Cardinalità 1/1)

La struttura del record di testa è descritta nelle disposizioni in materia di "Modalità di scambio delle informazioni". Nel Glossario ([allegato n. 3](#)) vengono riportate le informazioni di maggiore dettaglio per la valorizzazione dei campi CODICE APPLICAZIONE, TIPO MESSAGGIO, DATA CONTABILE e ZONA APPLICATIVA.

1.1.1.2 Record movimento

La struttura del record movimento è articolata in: "progressivo record", "tipo record" e "contenuto applicativo".

-
- 1) Le modalità di archiviazione delle segnalazioni inviate al Servizio RST non prevedono la conservazione fisica dei supporti trasmessi dagli intermediari, ma unicamente la loro duplicazione negli archivi magnetici della Banca d'Italia.
 - 2) Le specifiche tecniche sulla struttura dei file trasmessi su supporto magnetico, ove non espressamente specificato, devono ritenersi valide anche per le segnalazioni trasmesse tramite internet.
L'indirizzo cui trasmettere i supporti magnetici è riportato nelle disposizioni in materia di "Modalità di scambio delle informazioni".

La descrizione dei campi “progressivo record” e “tipo record” è contenuta nelle disposizioni in materia di "Modalità di scambio delle informazioni".

Il contenuto applicativo del record movimento è così articolato:

- a) record “identificativo movimento” (tipo record 001);
- b) record “segnalazione” (tipo record 003 - tipo record 053 - tipo record 054) (3).

Si precisa che ogni invio deve contenere **un solo** record “identificativo movimento” e da **uno a ”n”** record “segnalazioni”.

Nell’ambito dei record "movimento" le occorrenze debbono essere ordinate in modo crescente relativamente all’attributo "tipo record" e alla chiave di selezione (cfr. Glossario - allegato n. 3).

Non sono consentiti record con la stessa chiave di selezione.

I tracciati relativi alle diverse tipologie di record sono descritti di seguito.

Record “identificativo-movimento” (tipo record 001) - Cardinalità 1/1

POS	NOME CAMPO	PIC	LNG	DESCRIZIONE	DOMINIO
1-7	PROGRESSIVO RECORD	9	7	progressivo record	cfr. “Modalità di scambio delle informazioni”
8-10	TIPO RECORD	9	3	tipo record	001
11-12	TIPBAINF	X	2	base informativa	cfr. <i>Glossario</i>
13-14	NUMINV	9	2	numero invio	cfr. <i>Glossario</i>
15-22	FILLER	X	8	a disposizione	zero
23-38	CODFIS	X	16	codice fiscale	cfr. <i>Glossario</i>
39-106	FILLER	X	68	a disposizione	zero
107-108	TIPCOVAR	X	2	tipo codice variabile	cfr. <i>Glossario</i>
109-116	FILLER	X	8	a disposizione	zero

- 3) I tipi record 053 e 054 vanno utilizzati nei casi in cui è prevista la crittografia. Più in particolare:
- il tipo record 053 va utilizzato quando la crittografia interessa i soli importi (la specifica di crittografia per il campo “importo” (IMPO) è “K14p” (devono, cioè, essere crittografati i primi 14 caratteri));
 - il tipo record 054 va utilizzato quando la crittografia interessa gli importi e la zona di controparte (la specifica di crittografia per il campo “importo” (IMPO) è “K14p”, per il campo “zona di controparte” (ZONCON) è “K51p” (devono, cioè, essere crittografati i primi 51 caratteri)).

La crittografia va effettuata sul flusso ordinato per “codice record”.

Record "segnalazione" (tipo record 003 o 053 o 054) - Cardinalità 1/n

POS	NOME CAMPO	PIC	LNG	DESCRIZIONE	DOMINIO
1-7	PROGRESSIVO RECORD	9	7	progressivo record	cfr. "Modalità di scambio delle informazioni"
8-10	TIPO RECORD	9	3	tipo record	003 (053 o 054 nei casi previsti per la crittografia)
11-15	VOCE	9	5	voce	cfr. <i>Glossario</i>
16-17	SOTVOC	9	2	sottovoce	cfr. <i>Glossario</i>
18-18	RESI	9	1	residenza	cfr. <i>Glossario</i>
19-19	DIVI	9	1	divisa	cfr. <i>Glossario</i>
20-21	DURA	9	2	durata	cfr. <i>Glossario</i>
22-22	SEGNO	X	1	segno dell'importo	cfr. <i>Glossario</i>
23-37	IMPO	S9	15	importo (nei casi previsti, la specifica di crittografia è K14p)	cfr. <i>Glossario</i> e "Modalità di scambio delle informazioni"
38-110	ZONCON	X	73	zona di controparte (nei casi previsti, la specifica di crittografia è K51p)	cfr. <i>Glossario</i> e "Modalità di scambio delle informazioni"
111-116	FILLER	X	6	a disposizione	zero

1.1.1.3 Record coda (Cardinalità 1/1)

La struttura del record di coda è descritta nelle disposizioni in materia di "Modalità di scambio delle informazioni". Nel Glossario ([allegato n. 3](#)) vengono riportate le informazioni di maggiore dettaglio per la valorizzazione dei campi CODICE APPLICAZIONE e TIPO MESSAGGIO.

I campi VALORE CONTROLLO AUTENTICAZIONE INVIO e VERSIONE DIAGNOSTICO devono essere valorizzati con tutti "zeri".

1.2 Trasmissione su rete interbancaria (FILE TRANSFER) delle segnalazioni.

Le indicazioni di carattere generale per la trasmissione su rete interbancaria ("file transfer") sono riportate nelle disposizioni in materia di "Modalità di scambio delle informazioni". Si precisa che la sigla dell'applicazione è "PRI03".

Per gli aspetti connessi con la trasmissione delle segnalazioni sono valide le specifiche tecniche indicate per la trasmissione su supporto magnetico (cfr. paragrafo 1.1).

2 Modalità di registrazione della zona di controparte (campo ZONCON)

Il campo in oggetto, compreso nel record "segnalazione" è destinato a contenere i parametri di disaggregazione previsti dalla base informativa. Il contenuto è variabile in funzione della forma tecnica di riferimento. I codici "campo" previsti per ciascuna forma tecnica devono essere sempre segnalati, anche se il valore associato è zero.

A titolo esemplificativo vengono illustrate le modalità di riempimento del campo con riferimento ai flussi denominati:

- segnalazioni di "Vigilanza su base Consolidata";
- segnalazioni della "matrice dei conti";
- segnalazioni sulle attività di intermediazione mobiliare;
- segnalazioni degli intermediari finanziari ex art. 107 D.lgs. 385/93, degli istituti di pagamento e degli istituti di moneta elettronica;
- segnalazioni degli organismi di investimento collettivo del risparmio (O.I.C.R.)

2.1 Segnalazioni di vigilanza su base consolidata

Si riportano taluni esempi di riempimento della zona di controparte:

- a) presenza dei dettagli informativi "sottosistema di rilevazione" e "soggetto di riferimento":

02029	valore previsto	01165	codice soggetto	0_zeri_0
38..42	43..47	48..52	53..65	66..116

- b) presenza dei dettagli "sottosistema di rilevazione", "vita residua" e "soggetto di riferimento":

02029	valore	00040	valore	01165	codice soggetto	0_zeri_0
38..42	43..47	48..52	53..55	56..60	61..73	74..116

- c) presenza dei dettagli informativi "sottosistema di rilevazione", "soggetto di riferimento" e "sottosistema di appartenenza della controparte":

02029	valore	01013	valore	01165	codice soggetto	0_zeri_0
38..42	43..47	48..52	53..57	58..62	63..75	76..116

- d) presenza dei dettagli "sottosistema di rilevazione", "nominativo" e "soggetto di riferimento":

02029	valore	01165	codice soggetto	01172	codice censito	0_zeri_0
38..42	43..47	48..52	53..65	66..70	71..83	84..116

- e) presenza dei dettagli "settore", "sottosistema di rilevazione" e soggetto di riferimento:

00011	valore	02029	valore	01165	codice soggetto	0_zeri_0
38..42	43..45	46..50	51..55	56..60	61..73	74..116

2.2 Matrice dei conti

Nell'ambito della rilevazione concernente la "matrice di vigilanza" possono essere identificate numerose combinazioni di dettagli informativi che influenzano il riempimento della zona in oggetto. Al riguardo si elencano alcune tipologie a titolo esemplificativo:

- a) presenza del solo dettaglio informativo "codice ISIN dei titoli di proprietà"

00032	valore	0_zeri_0
38..42	43..54	55..116

- b) presenza dei dettagli informativi "stato di residenza della filiale estera"

00016	valore	0_zeri_0
38..42	43..45	46..116

- c) presenza del solo dettaglio "codice valuta"

00007	valore	0_zeri_0
38..42	43..45	46..116

- d) presenza dei dettagli informativi:
- codice valuta;
 - settore di appartenenza del debitore;
 - stato di residenza del debitore;
 - stato di residenza del garante;
 - settore di attività economica del garante;
 - finalità;
 - vita residua;
 - tipo garanzia.

00007	valore	00011	valore	00016	valore	00018	valore	00019	valore	00022	valore	00040	valore	00352	valore	0_zeri_0
38..42	43..45	46..50	51..53	54..58	59..61	62..66	67..69	70..74	75..77	78..82	83..85	86..90	91..93	94..98	99..100	101..116

- e) presenza dei dettagli informativi "settore e gruppo della controparte", "provincia di sportello della segnalante" e "provincia di residenza della controparte"

00011	valore	00012	valore	00013	valore	00015	valore	0_zeri_0
38..42	43..45	46..50	51..53	54..58	59..63	64..68	69..73	74..116

- f) presenza dei dettagli informativi "stato di residenza della controparte" e "stato di residenza della segnalante"

00016	valore	00063	valore	0_zeri_0
38..42	43..45	46..50	51..53	54..116

- g) presenza dei dettagli informativi "destinazione economica dell'investimento finanziato", "legge di incentivazione del credito" e "tipo tasso"

00022	valore	00113	valore	00181	valore	0_zeri_0
38..42	43..45	46..50	51..52	53..57	58..62	63..116

2.3 Attività di intermediazione mobiliare

Nell'ambito della rilevazione concernente le "attività di intermediazione mobiliare" possono essere identificate numerose combinazioni di dettagli informativi che influenzano il riempimento della zona in oggetto. Al riguardo si elencano alcune tipologie a titolo esemplificativo:

a) assenza di dettaglio informativo

0_zeri_0
38..116

b) presenza del solo dettaglio informativo "indicatore quotazione"

552	valore	0_zeri_0
38..40	41..43	44..116

c) presenza dei dettagli informativi "categoria valori mobiliari" e "indicatore di quotazione"

551	valore	552	valore	0_zeri_0
38..40	41..47	48..50	51..53	54..116

d) presenza dei dettagli informativi: "categoria valori mobiliari", "categoria emittente", "tipologia operazioni" e "categoria controparte"

551	valore	555	valore	558	valore	559	valore	0_zeri_0
38..40	41..47	48..50	51..53	54..56	57..59	60..62	63..65	66..116

2.4 Intermediari finanziari ex art. 107 d.lgs. 385/93, istituti di pagamento e degli istituti di moneta elettronica

Nell'ambito della rilevazione concernente le attività degli intermediari finanziari ex art. 107 D.lgs. 385/93, degli istituti di pagamento e degli istituti di moneta elettronica possono essere identificate numerose combinazioni di dettagli informativi che influenzano il riempimento della zona in oggetto. Al riguardo si elencano a titolo esemplificativo alcune tipologie:

a) presenza dei dettagli informativi "sottosettore di attività economica della controparte" e "branca di attività economica della controparte"

00011	valore	00012	valore	0_zeri_0
38..42	43..45	46..50	51..53	54..116

Nei record in cui sono presenti sottosettori di attività economica per i quali non è prevista la branca indicare comunque il cod. 00012 seguito da zeri.

b) nessun dettaglio informativo

0_zeri_0
38..116

- c) presenza dei dettagli informativi "controparte o garante", "equivalente creditizio" e "tipo importo"

00350	valore	00353	valore	00355	valore	0_zeri_0
38..42	43..44	45..49	50..51	52..56	57..58	59..116

2.5 Organismi di investimento collettivo del risparmio (O.I.C.R.).

Nell'ambito della rilevazione concernente le attività degli organismi di investimento collettivo del risparmio possono essere identificate numerose combinazioni di dettagli informativi che influenzano il riempimento della zona in oggetto. Al riguardo si elencano a titolo esemplificativo alcune tipologie:

a) nessun dettaglio informativo

0_zeri_0
38..116

b) presenza dei dettagli informativi "tipo gestione SGR" e "fondo/comparto"

513	valore	905	valore	0_zeri_0
38..40	41..44	45..47	48..54	55..116

c) presenza dei dettagli informativi "titoli", "tipo gestione SGR" e "fondo/comparto"

032	valore	513	valore	905	valore	0_zeri_0
38..40	41..52	53..55	56..59	60..62	63..69	70..116

Allegato 3

Glossario dei termini e delle codifiche

- **CARDINALITÀ'**: rappresenta la numerosità dei record che vengono trasmessi, oppure il numero delle occorrenze (minime e massime) ammesse all'interno di un record:
 - cardinalità 1/1: deve essere presente una e una sola occorrenza;
 - cardinalità 0/n: le occorrenze possono essere assenti, presenti una o più volte;
 - cardinalità 1/n: deve essere presente almeno una occorrenza.
- **CHIAVE DI SELEZIONE**: si intende il campo IDRIL per le conferme; i campi VOCE, SOTTOVOCE, RESIDENZA, DIVISA, DURATA e ZONA CONTROPARTE per le segnalazioni e le rettifiche.
- **CODAZI**: il campo CODAZI (CODice AZIenda) deve essere valorizzato con il valore del codice ABI dell'ente segnalante completo del codice di controllo.
- **CODFIS**: codice fiscale dell'ente segnalante.
- **CODICE APPLICAZIONE**: per la valorizzazione del campo si deve utilizzare la seguente tabella:

CODICE BASE INFORMATIVA (TIPBAINF)	DESCRIZIONE	CODICE APPLICAZIONE
SEGNALAZIONI ALLA BANCA D'ITALIA		
Segnalazioni Di Vigilanza		
A1	MATRICE DEI CONTI – DATI STATISTICI MENSILI - sezione I	429
A2	MATRICE DEI CONTI- ALTRI DATI STATISTICI (parte A) - sezione II	430
A3	MATRICE DEI CONTI - ALTRI DATI STATISTICI (parte B) – sezione II	457
A4	MATRICE DEI CONTI – ALTRI DATI STATISTICI (parte C) – sezione II	466
EP	VIGILANZA CONSOLIDATA – INFORMAZIONI PER PAESE DI CONTROPARTE	458
M	VIGILANZA CONSOLIDATA – SEGNALAZIONE STATISTICA	405
LD	PERDITE STORICAMENTE REGISTRATE SULLE POSIZIONI IN DEFAULT - BANCHE E INTERMEDIARI FINANZIARI EX ART. 107 D.LGS. 385/93	
LY	BANCHE E SIM – RISCHIO DI LIQUIDITA' (COPERTURA DELLA LIQUIDITA')	000
L1	GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM - RISCHIO DI LIQUIDITA' (COPERTURA DELLA LIQUIDITA') SU BASE CONSOLIDATA	000
S	SIM - SEGNALAZIONI MENSILI DI VIGILANZA	408
T	SIM - SEGNALAZIONI TRIMESTRALI/SEMESTRALI DI VIGILANZA	409
T1	ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO DEL RISPARMIO: SOCIETA' DI GESTIONE - SITUAZIONE DEI CONTI	433
T2	ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO DEL RISPARMIO: SOCIETA' DI GESTIONE - PATRIMONIO DI VIGILANZA, REQUISITI PATRIMONIALI E INFORMAZIONI STATISTICHE	434
T3	ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO DEL RISPARMIO: FONDI COMUNI DI INVESTIMENTO APERTI DIVERSI DAI FONDI MONETARI E DAI FONDI SPECULATIVI - DATI PATRIMONIALI	435
T4	ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO DEL RISPARMIO: FONDI COMUNI DI INVESTIMENTO APERTI - RENDICONTO DI GESTIONE	436
TA	ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO DEL RISPARMIO: FONDI COMUNI DI INVESTIMENTO CHIUSI - DATI PATRIMONIALI	446
TB	ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO DEL RISPARMIO: FONDI COMUNI DI INVESTIMENTO CHIUSI - RENDICONTO DI GESTIONE	447
T5	ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO DEL RISPARMIO: COMPARTI NON MONETARI DELLE SICAV – DATI PATRIMONIALI	437
T6	ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO DEL RISPARMIO: SICAV - DATI DI CONTO ECONOMICO	438
T7	ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO DEL RISPARMIO: FONDI COMUNI DI INVESTIMENTO APERTI MONETARI - DATI PATRIMONIALI	442
T8	ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO DEL RISPARMIO: COMPARTI MONETARI DELLE SICAV – DATI PATRIMONIALI	445
T9	ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO DEL RISPARMIO ESTERI – INFORMAZIONI STATISTICHE	453

TS	ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO DEL RISPARMIO: FONDI COMUNI DI INVESTIMENTO APERTI SPECULATIVI - DATI PATRIMONIALI	456
U	SIM - SEGNALAZIONI SUI SERVIZI D'INVESTIMENTO	410
V2	GRUPPI DI SIM - SEGNALAZIONI CONSOLIDATE	000
W	BANCHE - DATI DI BILANCIO – sezione III	412
Y	BANCHE E SIM – SEGNALAZIONI PRUDENZIALI SU BASE INDIVIDUALE - sez. IV	413
1	GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM - SEGNALAZIONI PRUDENZIALI SU BASE CONSOLIDATA	414
3A	INTERMEDIARI FINANZIARI EX ART.106 – DATI PATRIMONIALI, CREDITI DI FIRMA, IMPEGNI E RISCHI E CONTI D'ORDINE, CONTO ECONOMICO e ALTRE INFORMAZIONI	463
3	INTERMEDIARI FINANZIARI EX ART. 107, ISTITUTI DI PAGAMENTO E ISTITUTI DI MONETA ELETTRONICA - DATI PATRIMONIALI e ALTRE INFORMAZIONI	417
4	INTERMEDIARI FINANZIARI EX ART. 107, ISTITUTI DI PAGAMENTO E ISTITUTI DI MONETA ELETTRONICA - DATI DI CONTO ECONOMICO e DATI DI FINE ESERCIZIO	418
5	INTERMEDIARI FINANZIARI EX ART. 107, ISTITUTI DI PAGAMENTO E ISTITUTI DI MONETA ELETTRONICA - PATRIMONIO DI VIGILANZA E REQUISITI PATRIMONIALI	419
6	BANCHE - DATI DI BILANCIO E DI CONTO ECONOMICO DELLE BANCHE ASSOGGETTATE ALLA PROCEDURA DI AMMINISTRAZIONE STRAORDINARIA	420
Altre segnalazioni		
7	SEGNALAZIONI AI SENSI DELLA L.108/96 (USURA)	426

- CODICE DIVISA: il campo deve essere obbligatoriamente valorizzato con "EUR".
- DATA CONTABILE: il campo DATA CONTABILE deve essere obbligatoriamente valorizzato con la data cui si riferisce la segnalazione.
- DIVI: per la valorizzazione del campo DIVI (DIVI_{sa}) cfr. codifica TOMI II e III.
- DURA: per la valorizzazione del campo DURA (DUR_{Ata}) cfr. codifica TOMI II e III.
- IDRIL (IDentificativo RILievo): ogni rilievo individuato dalla Banca d'Italia e trasmesso all'ente segnalante è identificato, sulla comunicazione di errore, da un numero di riferimento (es. NUMIDRIL=2714). Tale numero deve essere utilizzato per valorizzare il campo IDRIL nelle eventuali segnalazioni di *conferma ai dati*.
- IMPO, IMPPRE e IMPATT: I campi IMPO, IMPPRE e IMPATT (IMPO_{Orto}, IMP_{Orto} PREcedente e IMP_{Orto} ATTuale) possono essere registrati nel formato "signed". Nella codifica EBCDIC gli importi positivi vanno segnalati ponendo a "F" o "C" il semibyte di "zonatura" dell'ultima cifra a destra; gli importi negativi, ove previsti, vanno segnalati ponendo tale semibyte a "D" o "E". Per la codifica ASCII il semibyte di zonatura conterrà '3' per gli importi positivi, '7' per quelli negativi.
- TIPCOVAR (TIPo CODici VARIabili): il campo deve essere valorizzato con:
 - "00" se i campi della "zona di controparte" sono identificati con codici della lunghezza di 3 posizioni;
 - "V5" se i campi della "zona di controparte" sono identificati con codici della lunghezza di 5 posizioni.

- NUMINV: il campo NUMINV (NUMero INVio) è un progressivo nell'ambito della data di riferimento, base informativa. Esso contiene il valore 01 in occasione del primo invio; 02, 03, etc. per ogni successivo invio. Il dominio del campo va da 01 a 99. Non sono ammessi salti di numerazione del numero invio.
- NUMLOT: il campo NUMLOT (NUMero LOTto) è un progressivo nell'ambito del "NUMINV" di riferimento: esso contiene il valore 01 in occasione del primo lotto; 02, 03, etc. per ogni successivo lotto. Non sono permessi salti di numerazione di un numero lotto nell'ambito dello stesso invio. Il dominio del campo va da 01 a 99.
- NUMPROT: il campo NUMPROT (NUMero PROTOcollo) rappresenta il protocollo di riferimento alla segnalazione di errore (in caso di rettifiche di iniziativa da parte dell'ente utilizzare il numero convenzionale 9999999999999).
- RESI: per la valorizzazione del campo RESI (RESIdenza) cfr. codifica TOMI II e III.
- SEGNO: il campo deve essere valorizzato nel caso di utilizzo del campo "IMPO" in formato non "signed". Può assumere i seguenti valori:
 - "+" nel caso di importo positivo;
 - "-" nel caso di importo negativo.
 Il valore "0" equivale a importo positivo.
- SOTVOC: per la valorizzazione del campo SOTVOC (SOTto VOCE) v.codifica TOMI II e III.
- TIPBAINF (TIPO Base INFormativa): il valore deve essere allineato a sinistra completandolo con blank a destra. Per la valorizzazione del campo TIPBAINF cfr. la tabella riportata sotto la voce "CODICE APPLICAZIONE" del presente glossario.
- TIPO COMUNICAZIONE: il campo può assumere i seguenti valori: 510 per le comunicazioni di rilievi, 520 per le comunicazioni generiche, 540 per le comunicazioni relative a errori su lotti di rettifiche e/o conferme, 550 per le comunicazioni relative a scarti di invii e di sollecito per ritardo nell'invio delle comunicazioni o nella risposta a rilievi.
- TIPO MESSAGGIO: il campo deve essere valorizzato con:
 - "001" per l'invio di una segnalazione;
 - "002" per l'invio di un lotto di rettifiche e/o conferme.
- TIPOPE: il campo TIPOPE (TIPO OPERazione) può assumere i seguenti valori: I=inserimento, C=cancellazione, V=variazione.
- VOCE: per la valorizzazione del campo cfr. codifica TOMI II e III.
- ZONA APPLICATIVA: contiene il campo CODICE DIVISA (cfr). Per la parte non utilizzata il campo deve essere valorizzato con tutti zeri.

- ZONCON: La zona di controparte (campo ZONCON) contiene gli elementi di dettaglio richiesti nelle diverse tipologie di rilevazioni in funzione della forma tecnica e pertanto può comportare strutture diversificate di informazioni. I parametri di disaggregazione previsti dalle forme tecniche vanno caratterizzati con codici identificativi i cui "valori" sono riportati nella tabella "codici di identificazione dei campi" contenuta nei TOMI II e III. Sotto il profilo informativo ogni parametro può identificare entità diverse (ad es. stato del debitore o stato del garante o stato del beneficiario) che vanno contraddistinte con codici "campo" specifici.

I codici "campo" previsti per ciascuna forma tecnica devono essere **sempre** segnalati anche se il valore associato assume il valore zero.

Al fine di garantire l'univocità e la sequenza delle segnalazioni si rende necessario selezionare le coppie "codice campo-valore" in ordine ascendente di codice campo.

La parte non utilizzata del campo ZONCON deve contenere il carattere blank ('40' in esadecimale per EBCDIC e '20' per ASCII) per le rettifiche e tutti zeri per le segnalazioni.

Allegato 4

Istruzioni tecniche per la crittografia dei dati

La funzione di crittografia viene applicata alle segnalazioni di invii "completi" e a quelle di "rettifica" e interessa l'intera base informativa "W" (dati di bilancio). Devono essere crittografati l'importo e la zona di controparte delle segnalazioni "nominative" (voce 40733/04); per le restanti voci deve essere crittografato solo l'importo.

Le caratteristiche dei programmi predisposti per le funzioni di crittografia e le modalità di installazione e di utilizzo sono contenute nelle disposizioni in materia di "Modalità di scambio delle informazioni" distribuite dal Servizio Rilevazioni Statistiche.

Tali istruzioni devono essere integrate così come di seguito indicato.

Per le segnalazioni di **invii completi** gli enti segnalanti dovranno:

- 1) impostare nel "record di testa" la data di crittografia in luogo della data di produzione del flusso informativo;
- 2) codificare il record "segnalazione" con i seguenti valori:
 - "053" - record "segnalazione" riferito a voci per le quali deve essere eseguita la crittografia del solo importo;
 - "054" - record "segnalazione" riferito a voci per le quali deve essere eseguita la crittografia dell'importo e della zona di controparte.
- 3) crittografare i primi 14 caratteri degli importi e, nel caso di tipo record "054", anche i primi 51 caratteri della zona di controparte.
- 4) applicare il programma di crittografia dopo aver ordinato il flusso informativo per "tipo record".(1).

Per le **segnalazioni di rettifica** gli enti segnalanti dovranno:

- 1) impostare nel "record di testa" la data di crittografia in luogo della data di produzione del flusso informativo;
- 2) codificare il record "rettifica" con i seguenti valori
 - "053" - record "rettifica" riferito a voci per le quali deve essere eseguita la crittografia del solo importo;
 - "054" - record "rettifica" riferito a voci per le quali deve essere eseguita la crittografia dell'importo e della zona di controparte.
- 3) crittografare i caratteri che vanno dall'ottavo al quattordicesimo di ciascuno dei due importi presenti nelle segnalazioni di rettifica e, nel caso di tipo record "054", i primi 51 caratteri della zona di controparte;
- 4) applicare il programma di crittografia dopo aver ordinato il flusso informativo per "tipo record"

1) In particolare, tra i parametri da fornire al programma di crittografia, il C.R.O. (codice di riferimento dell'operazione) dovrà essere avvalorato con il numero progressivo del record all'interno del flusso.

Allegato 5

Rilievi sulle segnalazioni e altre comunicazioni in
materia segnaletica

-

Rettifiche e conferma ai dati trasmessi

Le informazioni del presente allegato sono da considerare a integrazione delle disposizioni in materia di “MODALITÀ DI SCAMBIO DELLE INFORMAZIONI” distribuite al sistema creditizio e finanziario da parte del Servizio Rilevazioni Statistiche. Si rammenta, a tale proposito, che il termine “messaggio” si riferisce a informazioni inoltrate da un ente segnalante alla Banca d’Italia, mentre, con il termine “comunicazione”, ci si riferisce a informazioni inoltrate dalla Banca d’Italia agli enti segnalanti.

PARTE PRIMA

Caratteristiche e specifiche tecniche per la trasmissione di rilievi sulle segnalazioni e di altre comunicazioni in materia segnaletica

Premessa

I rilievi e le altre comunicazioni in materia segnaletica sono confezionate sotto forma di “testo” e non richiedono, pertanto, interventi di decodifica da parte degli enti riceventi.

1 I rilievi

I controlli effettuati sui flussi informativi inoltrati dalle banche e dagli enti finanziari avvengono su più livelli logici. In sintesi:

- 1) controlli di archiviazione: verificano che le informazioni trasmesse rispettino i protocolli tecnici previsti e siano in linea con le segnalazioni attese;
- 2) controlli formali: verificano la rispondenza dei dati alle caratteristiche dei fenomeni censiti e fanno emergere gli errori di codifica o di incompatibilità tra le varie informazioni che impediscono una corretta interpretazione dei dati segnalati;
- 3) controlli deterministici: verificano la coerenza tra le varie parti della singola segnalazione e tra questa e le altre segnalazioni concernenti fenomeni con i quali sussistono correlazioni;
- 4) controlli basati sull'utilizzo di tecniche statistiche.

Gli eventuali errori e/o anomalie che vengono riscontrati sono portati a conoscenza degli enti interessati secondo le modalità riportate al capitolo 5.

Per stabilire una perfetta coincidenza fra dati controllati e situazione portata a conoscenza degli enti segnalanti, nelle comunicazioni di errori e/o anomalie, verrà indicato, oltre alla "base informativa" e alla "data contabile", anche il "numero invio" a cui si riferisce l'elaborazione.

Le rettifiche apportate ai dati (cfr. [capitolo 6](#) e Parte seconda del presente allegato) saranno sottoposte a controlli anche di congruità con le segnalazioni in precedenza trasmesse.

La nuova situazione delle anomalie che dovessero persistere nei dati verrà portata a conoscenza dell'ente interessato per eventuali ulteriori interventi. La comunicazione farà riferimento, oltre alla "base informativa", "data contabile" e "numero invio", al "numero lotto rettifiche" elaborato (cfr. in proposito Parte seconda del presente allegato - paragrafo 5).

In relazione alle diverse casistiche dei rilievi, gli enti segnalanti devono attenersi alle indicazioni riportate di seguito.

- Rilievi di archiviazione: valutare la natura dell'anomalia riscontrata che ha impedito la corretta acquisizione dei dati e provvedere alla produzione di una nuova segnalazione corretta dei dati in parola (1).
- Rilievi formali e deterministici: verificare le cause degli errori e provvedere a inoltrare tutte le necessarie rettifiche.

1) Nel caso di rilievi di archiviazione derivanti dalla produzione di segnalazioni non dovute, non sarà necessario trasmettere alcun messaggio.

- Rilievi di natura statistica: verificare la congruità dei dati segnalati provvedendo a effettuare tutte le necessarie rettifiche. Qualora gli enti accertino la correttezza dei dati così come segnalati, devono effettuare un'apposita segnalazione di conferma (cfr. in proposito [capitolo 6](#) - paragrafo 3), facendo riferimento al “numero identificativo del rilievo” che identifica ciascun rilievo sui dati, trasmesso dalla Banca d'Italia (cfr. in proposito Parte seconda - paragrafo 4 del presente allegato).

2 Le comunicazioni in materia segnaletica

Le istituzioni creditizie e finanziarie verranno intrattenute con specifiche comunicazioni sulle problematiche che dovessero emergere in sede di analisi e di controllo dei flussi segnaletici.

3 Le modalità di trasmissione

I rilievi e le altre comunicazioni in materia segnaletica vengono notificati attraverso l'utilizzo della rete interbancaria, del canale internet, del supporto magnetico, del supporto cartaceo, del telefax o del telegramma (cfr. in proposito il [capitolo 5](#)).

Le indicazioni sulla struttura dei file di notifica trasmessi tramite il supporto magnetico o tramite la rete interbancaria sono riportate nelle disposizioni in materia di "Modalità di scambio delle informazioni"; ad integrazione di tali istruzioni, vengono di seguito riportate ulteriori specifiche tecniche per ciascuna delle due fattispecie.

Per le modalità di consultazione dei rilievi e delle altre comunicazioni notificati tramite internet va fatto riferimento ai relativi manuali utente (2).

3.1 Trasmissione su supporto magnetico

La lunghezza dei record è di 80 byte.

3.1.1 Record testa (Cardinalità 1/1)

La struttura del record di testa è descritta nelle disposizioni in materia di "Modalità di scambio delle informazioni". Nel Glossario ([allegato n. 3](#)) vengono riportate le informazioni di maggiore dettaglio sui campi CODICE APPLICAZIONE e TIPO COMUNICAZIONE.

3.1.2 Record movimento (Cardinalità 1/n)

Il tracciato del record movimento è di seguito descritto.

POS	NOME CAMPO	PIC	LNG	DESCRIZIONE	DOMINIO
1-7	PROGRESSIVO RECORD	9	7	progressivo record	
8-10	FILLER	9	3	a disposizione	blank
11-79	RIGA TESTO	X	69	riga di testo	
80-80	FILLER	X	1	a disposizione	blank

2) I manuali sono reperibili presso il sito internet della Banca d'Italia (www.bancaditalia.it > Statistiche > Raccolta dati e servizi > Raccolta dati presso gli intermediari > Raccolta dati via internet).

3.1.3 Record coda (Cardinalità 1/1)

La struttura del record di coda è descritta nelle disposizioni in materia di "Modalità di scambio delle informazioni". Nel Glossario ([allegato n. 3](#)) vengono riportate le informazioni di maggiore dettaglio sui campi CODICE APPLICAZIONE e TIPO COMUNICAZIONE.

3.2 Trasmissione su rete interbancaria (MESSAGE SWITCHING)

3.2.1 Caratteristiche tecniche generali

La struttura dei messaggi di rete viene in dettaglio descritta nelle disposizioni in materia di "Modalità di scambio delle informazioni".

Per il significato dei campi TIPO COMUNICAZIONE e CODICE APPLICAZIONE cfr. Glossario ([allegato n. 3](#)).

3.2.2 Specifiche tecniche inerenti all'invio delle informazioni (Campo CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO - IDC68A)

Il campo contiene la RIGA-TESTO, di lunghezza 69 byte, ripetuta sino a 17 volte per ogni messaggio rete.

3.3 Trasmissione su rete interbancaria (FILE TRANSFER)

3.3.1 Caratteristiche tecniche generali

Sono valide le stesse specifiche concernenti i tracciati record riportate nel paragrafo che descrive la trasmissione tramite supporto magnetico. Si precisa che la sigla dell'applicazione è "PRI02".

PARTE SECONDA

Caratteristiche e specifiche tecniche per l'invio delle rettifiche e delle conferme ai dati trasmessi

Premessa

Nell'amministrazione dei dati contenuti nelle segnalazioni statistiche creditizie e finanziarie, uno degli aspetti più delicati riguarda la tempestiva ed efficace sistemazione delle anomalie da parte degli enti segnalanti che rappresenta una condizione essenziale per assicurare la correttezza e la significatività dei flussi informativi.

Le istituzioni creditizie e gli enti finanziari possono intervenire sulle anomalie riscontrate o attraverso la riproposizione dell'intera segnalazione originaria (base informativa) o con specifici interventi correttivi sulle parti delle segnalazioni inficiate da errori e/o omissioni o con apposite conferme nel caso in cui accertino la correttezza dei dati così come segnalati.

Le modalità da seguire per la riproposizione dell'intera segnalazione sono riportate nel [capitolo 3](#); le relative specifiche tecniche sono indicate nell'[allegato 2](#).

Nel presente allegato vengono compendiate le modalità di trasmissione delle correzioni su singole parti delle segnalazioni e delle conferme.

1 Le tipologie di rettifica

Sono previste le seguenti tipologie di rettifica:

- INSERIMENTO - opzione "I": segnalazione di una informazione precedentemente assente;
- CANCELLAZIONE - opzione "C": eliminazione di una segnalazione precedentemente segnalata;
- VARIAZIONE - opzione "V": modifica di un importo (o quantità) precedentemente segnalato.

2 Contenuto delle rettifiche

Le segnalazioni di rettifica contengono i seguenti campi: voce, sottovoce, residenza, durata, divisa, importo precedente, importo attuale, tipo operazione e “zona di controparte”. Quest’ultima, in particolare, è strutturata con una sequenza “codice campo” (3) e “contenuto campo” (4) e deve essere confezionata secondo le seguenti modalità:

- 1) il codice campo, di lunghezza 5 byte, deve essere separato dal relativo valore tramite il carattere "=" (es.: 00040=010);
- 2) ogni singolo dettaglio informativo deve essere separato dal successivo tramite il carattere ";" (es.: 00011=043,00013=00032);
- 3) l'ultimo dettaglio informativo deve essere seguito dal carattere ";;" (es.:00011=043,00013=00032,00040=010;;);
- 4) il “valore” di una variabile di classificazione deve essere registrato accostato a destra; il campo va completato con “zeri” a sinistra. Tale modalità di registrazione va seguita sia per i campi definiti numerici sia per quelli definiti alfanumerici;
- 5) in assenza di dettagli informativi deve essere comunque riportato il carattere ";;".

-
- 3) Il codice campo, di lunghezza pari a 5 caratteri, identifica le variabili di classificazione. Le relative codifiche sono riportate nei tomi 2 e 3.
 - 4) I valori previsti per ciascuna variabile di classificazione e la relativa lunghezza del campo sono riportati nei tomi 2 e 3.

3 Modalità di rettifica

La segnalazione di una nuova informazione va effettuata mediante l'opzione "**I**" (**Inserimento**), compilando opportunamente tutte le informazioni previste dagli schemi di segnalazione (voce, sottovoce, residenza, divisa, durata, altri dettagli informativi). In questo caso il campo "importo precedente" dovrà essere avvalorato con zero, mentre l'"importo attuale" dovrà contenere il valore da segnalare.

L'annullamento di una informazione va effettuata mediante l'opzione "**C**" (**Cancellazione**), riportando tutte le informazioni precedentemente segnalate (voce, sottovoce, residenza, divisa, durata, altri dettagli informativi). In questo caso il campo "importo attuale" dovrà essere avvalorato con zero, mentre l'"importo precedente" dovrà contenere il valore in precedenza comunicato.

La variazione di un importo già segnalato, a parità di tutte le altre informazioni presenti in un record (voce, sottovoce, durata, residenza, divisa, altri dettagli informativi), deve essere effettuata utilizzando l'opzione "**V**" (**Variazione**); in tal caso dovrà essere riportato l'importo errato nel campo "importo precedente" e l'importo esatto nel campo "importo attuale".

Le modifiche ai dettagli informativi (es.: provincia, sportello, leggi, settorizzazione economica, etc.), nonché alla "voce", "sottovoce", "residenza", "divisa" e "durata" dovranno essere effettuate in due fasi: la prima cancellando la segnalazione errata (importo attuale uguale a zero) e valorizzando con "C" il campo "tipo operazione"; la seconda predisponendo la nuova segnalazione con i dettagli informativi esatti, il campo "importo attuale" valorizzato, il campo "importo precedente" a zero e il campo "tipo operazione" valorizzato con l'opzione "I". Nel caso in cui gli interventi di modifica ad uno qualsiasi degli attributi facenti parte della chiave di selezione (**5**) determinino la perfetta coincidenza della chiave del record modificato con quella di altro record già presente nella medesima segnalazione oggetto di rettifica, si dovrà effettuare:

- la **cancellazione** del record con attributo risultato errato secondo le modalità sopra descritte;
- la **variazione** dell'importo del record già presente. Il nuovo importo sarà determinato dalla somma algebrica dell'importo precedente con quello del record cancellato.

5) per chiave di selezione di una rettifica si intendono i campi VOCE, SOTTOVOCE, RESIDENZA, DIVISA, DURATA e ZONA CONTROPARTE

4 Conferme dei dati

Il messaggio di conferma contiene il campo “numero identificativo del rilievo” (IDRIL) nel quale andrà riportato il numero che identifica il rilievo comunicato dalla Banca d'Italia.

5 Predisposizione dei lotti di rettifiche/conferme

Le rettifiche/conferme inviate dagli enti in risposta alle comunicazioni di rilievi, o le rettifiche da questi inoltrate d'iniziativa, devono essere confezionate in "lotti" univocamente identificati.

Il "lotto" rappresenta un insieme di rettifiche e/o conferme riferite a un preciso momento del processo segnalatico, a una specifica base informativa e a una data contabile.

L'identificativo di ciascun "lotto" è formato - oltre che dalla base informativa, dalla data contabile e dal numero d'invio della segnalazione a cui si riferiscono le rettifiche/conferme - da un numero lotto che dovrà rispettare rigidamente la sequenza di spedizione nell'ambito di ciascuna segnalazione (ad es.: lotto 1.1 assume il significato di primo lotto spedito in riferimento alla segnalazione di primo invio; 2.1 primo lotto spedito in riferimento alla segnalazione di secondo invio; 2.2 secondo lotto spedito in riferimento alla segnalazione di secondo invio; e così via).**(6)**

In caso di errore di sequenza o di errore nei dati, il "lotto" verrà scartato e ne sarà data pronta comunicazione all'ente segnalante secondo le modalità descritte nella Parte prima del presente allegato. Nel primo caso (scarto per "errore di sequenza") l'ente segnalante dovrà riproporre un nuovo "lotto" con la **sequenza corretta**, nel secondo caso (scarto per "errore nei dati") dovrà invece predisporre un nuovo "lotto" con la **stessa numerazione di sequenza** del lotto scartato.

6) In sede di avvio della nuova modalità il primo lotto che verrà inviato dovrà assumere convenzionalmente il numero lotto (NUMLOT)=1, mentre il numero invio dovrà essere correttamente indicato con riferimento alla segnalazione cui il lotto si riferisce.

6 Le modalità di trasmissione

Le rettifiche e/o conferme vengono trasmesse mediante la rete nazionale interbancaria, il canale internet o in caso di momentanee difficoltà di gestione di tali canali, tramite supporto magnetico.

Le specifiche tecniche inerenti all'invio delle informazioni su supporto magnetico e rete interbancaria sono contenute nelle disposizioni in materia di "Modalità di scambio delle informazioni", quelle relative all'invio tramite il canale internet sui relativi manuali utente.

Di seguito sono riportate le ulteriori indicazioni necessarie per la gestione delle segnalazioni di rettifica e/o conferma ai flussi informativi oggetto della presente circolare. In particolare:

Nel paragrafo 6.1 sono contenute le indicazioni relative al supporto magnetico.

Nel paragrafo 6.2 sono contenute le indicazioni relative al canale internet.

Nei paragrafi 6.3 e 6.4 sono contenute le indicazioni per la rete interbancaria, rispettivamente con l'utilizzo del "message switching" e del "file transfer".

Per favorire una migliore comprensione delle modalità di confezionamento e di trasmissione delle rettifiche e delle conferme al paragrafo 6.5.1 viene indicato un esempio di "lotto" di rettifiche/conferme più volte riproposto a seconda del mezzo trasmissivo in ipotesi utilizzato.

6.1 Trasmissione su supporto magnetico di rettifiche e/o conferme

L'indirizzo cui trasmettere i supporti magnetici è riportato nelle disposizioni in materia di "Modalità di scambio delle informazioni".

6.1.1 Specifiche tecniche inerenti all'invio delle informazioni

La lunghezza dei record da inviare è di 163 byte.

6.1.1.1 Record testa (Cardinalità 1/1)

La struttura del record di testa è descritta nelle disposizioni in materia di "Modalità di scambio delle informazioni". Nel Glossario ([allegato n. 3](#)) vengono riportate le informazioni di maggiore dettaglio per la valorizzazione dei campi

CODICE APPLICAZIONE, TIPO MESSAGGIO, DATA CONTABILE e ZONA APPLICATIVA.

6.1.1.2 Record movimento

La struttura del record movimento è articolata in: “progressivo record”, “tipo record” e “contenuto applicativo”.

La descrizione dei campi “progressivo record” e “tipo record” è contenuta nelle disposizioni in materia di “Modalità di scambio delle informazioni”.

Nella segnalazione delle conferme e delle rettifiche possono essere presenti diverse tipologie di record movimento:

- a) record “identificativo movimento” (tipo record 001);
- b) record “conferma a rilievo” (tipo record 002);
- c) record “rettifica” (tipo record 003 - tipo record 053 - tipo record 054) (7)

Si precisa che ogni lotto deve contenere un solo record “identificativo movimento”, da 0 a n record “conferma a rilievo” e da 0 a n record “rettifica”.

Nell’ambito dei record “movimento” le occorrenze debbono essere ordinate in modo crescente relativamente all’attributo “tipo record”.

Non sono consentiti record con la stessa CHIAVE DI SELEZIONE (cfr. Glossario - [allegato n. 3](#)).

I tracciati relativi alle diverse tipologie di record sono descritti di seguito.

Record “identificativo-movimento” (tipo record 001) - Cardinalità 1/1

POS	NOME CAMPO	PIC	LNG	DESCRIZIONE	DOMINIO
1-7	PROGRESSIVO RECORD	9	7	progressivo record	cfr. “Modalità di scambio delle informazioni”
8-10	TIPO RECORD	9	3	tipo record	001
11-12	TIPBAINF	X	2	base informativa	cfr. <i>Glossario</i>
13-14	NUMINV	9	2	numero invio	cfr. <i>Glossario</i>
15-16	NUMLOT	9	2	numero lotto di rettifiche	cfr. <i>Glossario</i>
17-29	NUMPROT	9	13	numero protocollo	cfr. <i>Glossario</i>
30-163	FILLER	X	134	a disposizione	zero

- 7) I tipi record 053 e 054 vanno utilizzati nei casi in cui è prevista la crittografia. Più in particolare:
- il tipo record 053 quando la crittografia interessa i soli importi (la crittografia dovrà interessare i caratteri che vanno dall’ottavo al quattordicesimo di ciascuno dei due importi presenti nelle segnalazioni di rettifica (“IMPPRE” e “IMPATT”), il quindicesimo carattere, l’ultimo, non andrà pertanto crittografato)
 - il tipo record 054 quando la crittografia interessa gli importi e la zona di controparte (per gli importi si rimanda al punto precedente, per la “zona di controparte” (ZONCON) la specifica di crittografia è “K51P”).

Record "conferma a rilievo" (tipo record 002) - Cardinalità 0/n

POS	NOME CAMPO	PIC	LNG	DESCRIZIONE	DOMINIO
1-7	PROGRESSIVO RECORD	9	7	progressivo record	cfr. "Modalità di scambio delle informazioni"
8-10	TIPO RECORD	9	3	tipo record	002
11-19	IDRIL	9	9	numero identificativo del rilievo	cfr. <i>Glossario</i>
20-163	FILLER	X	144	a disposizione	zero

Record "rettifica" (tipo record 003 o 053 o 054) - Cardinalità 0/n

POS	NOME CAMPO	PIC	LNG	DESCRIZIONE	DOMINIO
1-7	PROGRESSIVO RECORD	9	7	progressivo record	cfr. "Modalità di scambio delle informazioni"
8-10	TIPO RECORD	9	3	tipo record	003 (053 o 054 nei casi previsti per la crittografia)
11-15	VOCE	9	5	voce	cfr. <i>Glossario</i>
16-17	SOTVOC	9	2	sottovoce	cfr. <i>Glossario</i>
18-18	RESI	9	1	residenza	cfr. <i>Glossario</i>
19-19	DIVI	9	1	divisa	cfr. <i>Glossario</i>
20-21	DURA	9	2	durata	cfr. <i>Glossario</i>
22-36	IMPPRE	S9	15	importo (nei casi in cui è prevista la crittografia, quest'ultima dovrà interessare i caratteri che vanno dall'ottavo al quattordicesimo. Il quindicesimo e ultimo carattere non andrà pertanto crittografato)	cfr. <i>Glossario</i> e "Modalità di scambio delle informazioni"
37-51	IMPATT	S9	15	importo (nei casi in cui è prevista la crittografia, quest'ultima dovrà interessare i caratteri che vanno dall'ottavo al quattordicesimo. Il quindicesimo e ultimo carattere non andrà pertanto crittografato)	cfr. <i>Glossario</i> e "Modalità di scambio delle informazioni"
52-52	TIPOPE	X	1	tipo di rettifica	cfr. <i>Glossario</i>
53-163	ZONCON	X	111	zona di controparte (nei casi previsti, la specifica di crittografia è K51P)	cfr. <i>Glossario</i> e "Modalità di scambio delle informazioni"

6.1.1.3 Record coda (Cardinalità 1/1)

La struttura del record di coda è descritta nelle disposizioni in materia di "Modalità di scambio delle informazioni". Nel Glossario ([allegato n. 3](#)) vengono riportate le informazioni di maggiore dettaglio per la valorizzazione dei campi CODICE APPLICAZIONE e TIPO MESSAGGIO.

I campi VALORE CONTROLLO AUTENTICAZIONE INVIO e VERSIONE DIAGNOSTICO devono essere valorizzati con tutti "zeri".

6.2 Trasmissione tramite il canale internet di rettifiche e/o conferme

Le indicazioni di carattere generale per la trasmissione mediante il canale internet sono riportate sul "Manuale utente internet".

Per gli aspetti connessi con la trasmissione delle rettifiche/conferme sono valide le specifiche tecniche indicate per la trasmissione su supporto magnetico (cfr. paragrafo 6.1).

6.3 Trasmissione su rete interbancaria (MESSAGE SWITCHING) di rettifiche e/o conferme

L'indirizzo di rete da utilizzare per la spedizione alla Banca d'Italia è riportato nelle disposizioni in materia di "Modalità di scambio delle informazioni".

6.3.1 Specifiche tecniche inerenti all'invio delle informazioni (campi data-contabile, tipo-messaggio-applicativo, contenuto-messaggio-applicativo)

Il confezionamento delle comunicazioni da inoltrare su RNI con modalità message switching non prevede un record di testa e un record di coda a differenza di quanto indicato per l'invio delle informazioni con supporto magnetico.

Ogni "messaggio rete" è composto di due parti: la testata messaggio e il contenuto applicativo.

La testata messaggio viene in dettaglio descritta nelle disposizioni in materia di "Modalità di scambio delle informazioni", cui si fa rimando per le modalità di compilazione.

All'interno del messaggio rete generalizzato "665", il campo IDC 177, che indica la divisa utilizzata per gli importi presenti nel contenuto del messaggio applicativo, deve assumere il valore EUR.

Non è richiesta l'impostazione del campo per i messaggi applicativi che non prevedono importi.

Il campo CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO (IDC68A) è strutturato nelle seguenti tre tipologie di record: "identificativo-movimento", "conferma a rilievo", "rettifica".

Ogni "messaggio rete" può essere composto da informazioni relative a un solo TIPO RECORD.

Il tipo record 001 (identificativo movimento) deve essere necessariamente segnalato. Ogni lotto deve contenere un solo record identificativo movimento.

Il tipo record 002 è utilizzato per la trasmissione delle conferme. Ciascun "messaggio rete" può contenere fino a un massimo di 99 conferme.

Il tipo record 003 (053 o 054 nei casi previsti per la crittografia) è utilizzato per le rettifiche. Ciascun "messaggio rete", che deve essere utilizzato separatamente per ogni singolo tipo record "rettifica", può contenere fino a un massimo di 7 rettifiche.

Nell'ambito dei record "movimento" le occorrenze debbono essere ordinate in modo crescente relativamente all'attributo "tipo record".

Non sono consentiti record con la stessa CHIAVE DI SELEZIONE.

Il campo DATA CONTABILE (IDC688) deve essere obbligatoriamente valorizzato.

Nel Glossario ([allegato n. 3](#)) vengono riportate le informazioni di maggiore dettaglio per la valorizzazione dei singoli campi del CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO.

I tracciati relativi alle diverse tipologie di record sono descritti di seguito.

Record "identificativo-movimento" (Tipo record 001) - Cardinalità 1/1

Testata messaggio

1-110					cfr. "Modalità di scambio delle informazioni"
-------	--	--	--	--	---

Contenuto applicativo

111-113	TIPREC	9	3	codice record	001
114-115	TIPBAINF	X	2	base informativa	cfr. Glossario
116-117	NUMINV	9	2	numero invio	cfr. Glossario
118-119	NUMLOT	9	2	numero lotto di rettifiche	cfr. Glossario
120-132	NUMPROT	9	13	numero protocollo	cfr. Glossario

Record "conferma a rilievo" (Tipo record 002) - Cardinalità 0/n

Testata messaggio

1-110					cfr. "Modalità di scambio delle informazioni"
-------	--	--	--	--	---

Contenuto applicativo

111-113	TIPREC	9	3	codice record	002
114-1310	CONTENUTO CONFERMA	cfr. sotto	cfr. sotto	Può essere ripetuto sino a 99 volte per ogni messaggio rete	

In particolare il campo CONTENUTO CONFERMA è, a sua volta, composto dal solo campo IDRIL, come di seguito descritto.

NOME CAMPO	PIC	LNG	DESCRIZIONE	DOMINIO
IDRIL	9	9	numero identificativo rilievo confermato	cfr. Glossario

Record "rettifica" (Tipo record 003) - Cardinalità 0/n

Testata messaggio

1-110					cfr. "Modalità di scambio delle informazioni"
-------	--	--	--	--	---

Contenuto applicativo

111-113	TIPREC	9	3	codice record	003 (053 o 054 nei casi previsti per la crittografia)
114-1309	CONTENUTO RETTIFICA	cfr. sotto	cfr. sotto	Può essere ripetuto sino a 7 volte per ogni messaggio rete	

In particolare il campo CONTENUTO RETTIFICA è composto come di seguito descritto.

NOME CAMPO	PIC	LNG	DESCRIZIONE	DOMINIO
VOCE	9	5	voce	cfr. Glossario
SOTVOC	9	2	sottovoce	cfr. Glossario
RESI	9	1	residenza	cfr. Glossario
DIVI	9	1	divisa	cfr. Glossario
DURA	9	2	durata	cfr. Glossario
IMPPRE	S9	15	importo (nei casi in cui è prevista la crittografia, quest'ultima dovrà interessare i caratteri che vanno dall'ottavo al quattordicesimo. Il quindicesimo e ultimo carattere non andrà pertanto crittografato)	cfr. <i>Glossario</i> e "Modalità di scambio delle informazioni"
IMPATT	S9	15	importo (nei casi in cui è prevista la crittografia, quest'ultima dovrà interessare i caratteri che vanno dall'ottavo al quattordicesimo. Il quindicesimo e ultimo carattere non andrà pertanto crittografato)	cfr. <i>Glossario</i> e "Modalità di scambio delle informazioni"
TIPOPE	X	1	tipo di rettifica	cfr. Glossario
ZONCON	X	111	zona di controparte (nei casi previsti, la specifica di crittografia è K51P)	cfr. <i>Glossario</i> e "Modalità di scambio delle informazioni"

Nel paragrafo 6.5.3 si riporta un esempio di invio di conferme e di rettifiche su rete (modalità "MESSAGE SWITCHING").

6.4 Trasmissione su rete interbancaria (FILE TRANSFER) di rettifiche e/o conferme

Le indicazioni di carattere generale per la trasmissione su rete interbancaria ("file transfer") sono riportate nelle disposizioni in materia di "Modalità di scambio delle informazioni". Si precisa che la sigla dell'applicazione è "PRI01".

Per gli aspetti connessi con la trasmissione delle rettifiche/conferme sono valide le specifiche tecniche indicate per la trasmissione su supporto magnetico (cfr. paragrafo 6.1).

6.5 Esempi

6.5.1 Esempio di invio di conferme e rettifiche a rilievi.

La banca 1234/5 deve inviare, in risposta alle comunicazioni di rilievi della Banca d'Italia, 3 conferme e 8 rettifiche dei dati trasmessi con la matrice dei conti (codice applicazione 429) riferita al 31.01.2009. Il messaggio viene prodotto in data 26.2.2009 alle ore 14.16.23. Precedentemente sono già stati inviati 2 "lotti" di rettifica all'invio n.1

- E1)** vengono confermati i dati oggetto dei rilievi con numero identificativo: 123, 4534, 62425;
- E2)** viene cancellato l'importo inviato alla voce 58000/02 (residenza = 1, divisa = 1, durata = 3, codice valuta=242) della matrice dei conti;
- E3)** viene modificato l'importo segnalato alla voce 58000/12 (residenza = 1, divisa = 1, durata = 3, codice valuta = 242) da 978.292 a 564.147;
- E4)** deve essere variata la durata da "0" a "3" alla voce 58045/24 per l'importo 1.478 e controparte "00007=242,00032=IT0000646962":
 - viene cancellato l'importo di 1.478 segnalato alla voce 58045/24 (residenza = 1, divisa = 1, durata = 0) con variabile di controparte "00007=242,00032=IT0000646962";
 - viene inserito l'importo di 1.478 alla voce 58045/24 (residenza = 1, divisa = 1, durata = 3) con variabile di controparte "00007=242,00032=IT0000646962";
- E5)** deve essere variato il codice titolo (campo 00032) segnalato alla voce 58045/24 (per un importo di 30.000) da IT0000000070 a IT0000650580:
 - viene cancellato l'importo di 30.000 segnalato alla voce 58045/24 (residenza = 1, divisa = 1, durata = 3) con variabile di controparte "00007=242,00032=IT0000000070";
 - viene inserito l'importo di 30.000 alla voce 58045/24 (residenza = 1, divisa = 1, durata = 3) con variabile di controparte "00007=242,00032=IT0000650580";
- E6)** viene inserito l'importo di 24.029 alla voce 58030/40 (residenza = 1, divisa = 1, durata = 5) con variabile di controparte "00007=242", "00011=600", e "00015=00165";

- E7)** deve essere variato lo stato di residenza della controparte (campo 00016) segnalato alla voce 58005/22 per un importo di 104.042 da **008** a **029**. Nella stessa segnalazione tuttavia è presente un record con la stessa chiave di selezione (VOCE/SOTTOVOCE=58005/22, RESIDENZA=2, DIVISA=1, DURATA=5, ZONA CONTROPARTE="00007=242, 00011=757, **00016=0029**") e con importo 1.096.124.
- viene cancellato l'importo di 104.042 segnalato alla voce 58005/22 (residenza=2, divisa=1, durata=5) con variabili di controparte "00007=242, 00011=757, **00016=008**";
 - viene modificato l'importo segnalato alla voce 58005/22 (residenza=2, divisa=1, durata=5) con variabili di controparte "00007=242, 00011=757, **00016=029**" da 1.096.124 a 1.200.166.

6.5.2 Trasmissione mediante l'utilizzo cassetta, cd-rom, internet o file transfer.

Record testa:

Valore fisso	ANABI
Codice applicazione	429
Tipo messaggio	002
Data contabile	20090131
Data Produzione	20090226
Filler	000000
Ente Corrispondente	012345
Filler	0000000000
Ente segnalante	012345
Ora produzione	141623
Sequenza sostituzione invio	00
costante crittografia	010009
zona applicativa: codice divisa	EUR
filler	tutti zeri sino a fine campo

Record identificativo movimento

Progressivo record	0000001
Tipo record	001
Tipo Base Informativa	A1
Numero Invio	01
Numero Lotto	03
Numero protocollo riferimento	999999999999
Filler	tutti zeri sino a fine campo

Record conferma a rilievo

E1)

Progressivo record	0000002
Tipo record	002
Identificativo Rilievo	000000123
Filler	tutti zeri sino a fine campo

E1)

Progressivo record	0000003
Tipo record	002
Identificativo Rilievo	000004534
Filler	tutti zeri sino a fine campo

E1)

Progressivo record	0000004
Tipo record	002
Identificativo Rilievo	000062425
Filler	tutti zeri sino a fine campo

Record rettifica

E2)

Progressivo record	0000005
Tipo record	003 (053 o 054 nei casi previsti per la crittografia)
Voce	58000
Sotvoc	02
Resi	1
Divi	1
Dura	03
Imppre	000000000005511
Impatt	000000000000000
Tipope	C
Zoncon	00007=242;(seguito da blank sino a fine campo)

E3)

Progressivo record	0000006
Tipo record	003 (053 o 054 nei casi previsti per la crittografia)
Voce	58000
Sotvoc	02
Resi	1
Divi	1
Dura	03
Imppre	000000000978292
Impatt	000000000564147
Tipope	V
Zoncon	00007=242;(seguito da blank sino a fine campo)

E4)

Progressivo record	0000007
Tipo record	003 (053 o 054 nei casi previsti per la crittografia)
Voce	58045
Sotvoc	24
Resi	1
Divi	1
Dura	00
Imppre	000000000001478
Impatt	000000000000000
Tipope	C
Zoncon	00007=242,00032=IT0000646962; (seguito da blank sino a fine campo)

E4)

Progressivo record	0000008
Tipo record	003 (053 o 054 nei casi previsti per la crittografia)
Voce	58045
Sotvoc	24
Resi	1
Divi	1
Dura	03
Imppre	000000000000000
Impatt	000000000001478
Tipope	I
Zoncon	00007=242,00032=IT0000646962; (seguito da blank sino a fine campo)

E5)

Progressivo record	0000009
Tipo record	003 (053 o 054 nei casi previsti per la crittografia)
Voce	58045
Sotvoc	24
Resi	1
Divi	1
Dura	03
Imppre	000000000030000
Impatt	000000000000000
Tipope	C
Zoncon	00007=242,00032=IT0000000070; (seguito da blank sino a fine campo)

E5)

Progressivo record	0000010
Tipo record	003 (053 o 054 nei casi previsti per la crittografia)
Voce	58045
Sotvoc	24
Resi	1
Divi	1
Dura	03
Imppre	000000000000000
Impatt	000000000030000
Tipope	I
Zoncon	00007=242,00032=IT0000650580; (seguito da blank sino a fine campo)

E6)

Progressivo record	0000011
Tipo record	003 (053 o 054 nei casi previsti per la crittografia)
Voce	58030
Sotvoc	40
Resi	1
Divi	1
Dura	05
Imppre	000000000000000
Impatt	000000000024029
Tipope	I
Zoncon	00007=242,00011=600,00015=00165; (seguito da blank sino a fine campo)

E7)

Progressivo record	0000012
Tipo record	003 (053 o 054 nei casi previsti per la crittografia)
Voce	58005
Sotvoc	22
Resi	2
Divi	1
Dura	05
Imppre	000000000104042
Impatt	000000000000000
Tipope	C
Zoncon	00007=242,00011=757,00016=008; (seguito da blank sino a fine campo)

E7)

Progressivo record	0000013
Tipo record	003 (053 o 054 nei casi previsti per la crittografia)
Voce	58005
Sotvoc	22
Resi	2
Divi	1
Dura	05
Imppre	000000001096124
Impatt	000000001200166
Tipope	V
Zoncon	00007=242,00011=757,00016=029; (seguito da blank sino a fine campo)

Record coda

Valore fisso	CODBI
Codice applicazione	429
Tipo messaggio	002
Data contabile	20090131
Data Produzione	20090226
Filler	000000
Ente Corrispondente	012345
Filler	0000000000
Ente segnalante	012345
Numero record movimento	0000013
Valore controllo autenticazione invio	0000000000
versione diagnostico	000000
filler	tutti zeri sino a fine campo

6.5.3 Esempio di utilizzo rete (MESSAGE SWITCHING)

Record identificativo-movimento:

TIPO MESSAGGIO RETE	665
MITTENTE	012345
DESTINATARIO	01000
DATA PRODUZIONE	20090226
ORA PRODUZIONE	141623
MAC	<i>Da non utilizzare</i>
CRO	02000001004
CRO ORIGINARIO	
DATA PRODUZIONE ORIGINARIA	
DATA CONTABILE	20090131
COLLEGAMENTO MESSAGGIO RETE: CAPO CATENA	02000001004
COLLEGAMENTO MESSAGGIO RETE: SEQUENZA CATENA	1
COLLEGAMENTO MESSAGGIO RETE: INDICATORE FINE CATENA	N
TIPO MESSAGGIO APPLICATIVO	429002
CODICE DIVISA OPERAZIONE	EUR
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO:TIPO RECORD	001
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: TIPBAINF	A1
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: NUMINV	01
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: NUMLOT	03
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO:NUMPROT	9999999999999

Record conferma a rilievo:

E1)

TIPO MESSAGGIO RETE	665
MITTENTE	012345
DESTINATARIO	01000
DATA PRODUZIONE	20090226
ORA PRODUZIONE	141623
MAC	<i>Da non utilizzare</i>
CRO	02000001103
CRO ORIGINARIO	
DATA PRODUZIONE ORIGINARIA	
DATA CONTABILE	20090131
COLLEGAMENTO MESSAGGIO RETE: CAPO CATENA	02000001004
COLLEGAMENTO MESSAGGIO RETE: SEQUENZA CATENA	2
COLLEGAMENTO MESSAGGIO RETE: INDICATORE FINE CATENA	N
TIPO MESSAGGIO APPLICATIVO	429002
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO:TIPO RECORD	002
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: IDRIL	000000123
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: IDRIL	000004534
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: IDRIL	000062425

TIPO MESSAGGIO RETE	665
MITTENTE	012345
DESTINATARIO	01000
DATA PRODUZIONE	20090226
ORA PRODUZIONE	141623
MAC	Da non utilizzare
CRO	02000001206
CRO ORIGINARIO	
DATA PRODUZIONE ORIGINARIA	
DATA CONTABILE	20090131
COLLEGAMENTO MESSAGGIO RETE: CAPO CATENA	02000001004
COLLEGAMENTO MESSAGGIO RETE: SEQUENZA CATENA	3
COLLEGAMENTO MESSAGGIO RETE: INDICATORE FINE CATENA	N
TIPO MESSAGGIO APPLICATIVO	429002
CODICE DIVISA OPERAZIONE	EUR
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO:TIPO RECORD	003 (053 o 054 nei casi previsti per la crittografia)
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: VOCE	58000
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: SOTVOC	02
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: RESI	1
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: DIVI	1
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: DURA	03
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: IMPPRE	000000000005511
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: IMPATT	000000000000000
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: TIPOPE	C
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: ZONCON	00007=242; (seguito da blank sino a fine campo)
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: VOCE	58000
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: SOTVOC	12
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: RESI	1
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: DIVI	1
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: DURA	03
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: IMPPRE	000000000978292
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: IMPATT	000000000564147
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: TIPOPE	V
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: ZONCON	00007=242; (seguito da blank sino a fine campo)
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: VOCE	58045
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: SOTVOC	24
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: RESI	1
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: DIVI	1
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: DURA	00
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: IMPPRE	000000000001478
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: IMPATT	000000000000000
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: TIPOPE	C
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: ZONCON	00007=242,00032=IT0000646962; (seguito da blank sino a fine campo)
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: VOCE	58045
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: SOTVOC	24
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: RESI	1
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: DIVI	1
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: DURA	03
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: IMPPRE	000000000000000
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: IMPATT	000000000001478
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: TIPOPE	I
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: ZONCON	00007=242,00032=IT0000646962; (seguito da blank sino a fine campo)

Record rettifica:

E5) - E6)

TIPO MESSAGGIO RETE	665
MITTENTE	012345
DESTINATARIO	01000
DATA PRODUZIONE	20090226
ORA PRODUZIONE	141623
MAC	<i>Da non utilizzare</i>
CRO	02000001307
CRO ORIGINARIO	
DATA PRODUZIONE ORIGINARIA	
DATA CONTABILE	20090131
COLLEGAMENTO MESSAGGIO RETE: CAPO CATENA	02000001004
COLLEGAMENTO MESSAGGIO RETE: SEQUENZA CATENA	4
COLLEGAMENTO MESSAGGIO RETE: INDICATORE FINE CATENA	N
TIPO MESSAGGIO APPLICATIVO	429002
CODICE DIVISA OPERAZIONE	EUR
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: TIPO RECORD	003 (053 o 054 nei casi previsti per la crittografia)
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: VOCE	58045
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: SOTVOC	24
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: RESI	1
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: DIVI	1
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: DURA	03
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: IMPPRE	00000000030000
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: IMPATT	00000000000000
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: TIPOPE	C
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: ZONCON	00007=242,00032=IT0000000070; (seguito da blank sino a fine campo)
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: VOCE	58045
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: SOTVOC	24
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: RESI	1
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: DIVI	1
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: DURA	03
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: IMPPRE	00000000000000
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: IMPATT	00000000030000
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: TIPOPE	I
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: ZONCON	00007=242,00032=IT0000650580; (seguito da blank sino a fine campo)
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: VOCE	58030
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: SOTVOC	40
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: RESI	1
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: DIVI	1
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: DURA	05
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: IMPPRE	00000000000000
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: IMPATT	000000000024029
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: TIPOPE	I
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: ZONCON	00007=242,00011=600,00015=00165; (seguito da blank sino a fine campo)

Record rettifica:

E7)

TIPO MESSAGGIO RETE	665
MITTENTE	012345
DESTINATARIO	01000
DATA PRODUZIONE	20090226
ORA PRODUZIONE	141623
MAC	<i>Da non utilizzare</i>
CRO	02000001307
CRO ORIGINARIO	

DATA PRODUZIONE ORIGINARIA	
DATA CONTABILE	20090131
COLLEGAMENTO MESSAGGIO RETE: CAPO CATENA	02000001004
COLLEGAMENTO MESSAGGIO RETE: SEQUENZA CATENA	5
COLLEGAMENTO MESSAGGIO RETE: INDICATORE FINE CATENA	S
TIPO MESSAGGIO APPLICATIVO	429002
CODICE DIVISA OPERAZIONE	EUR
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO:TIPO RECORD	003 (053 o 054 nei casi previsti per la crittografia)
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: VOCE	58005
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: SOTVOC	22
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: RESI	2
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: DIVI	1
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: DURA	05
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: IMPPRE	000000000104042
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: IMPATT	000000000000000
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: TIPOPE	C
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: ZONCON	00007=242,00011=757,00016=009; (seguito da blank sino a fine campo)
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: VOCE	58005
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: SOTVOC	22
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: RESI	2
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: DIVI	1
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: DURA	05
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: IMPPRE	000000001096124
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: IMPATT	000000001200166
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: TIPOPE	V
CONTENUTO MESSAGGIO APPLICATIVO: ZONCON	00007=242,00011=757,00016=029; (seguito da blank sino a fine campo)

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA
DEGLI ENTI E GRUPPI CREDITIZI FINANZIARI

ISTRUZIONI PER LA PRODUZIONE E L'INOLTRO
DELLE SEGNALAZIONI

TOMO II

SCHEMI DI RILEVAZIONE E SISTEMA DELLE
CODIFICHE

(Circolare n. 154 del 22 novembre 1991)

TOMO II

I N D I C E

Capitolo 1 Sistema delle codifiche (banche e gruppi creditizi)	
- Premessa.....	A.3
- Elenco generale dei codici di identificazione dei campi	A.5
- Matrice dei conti: basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4' e 'W'	A.8
- Matrice dei conti: basi informativa 'LD'	A.29
- Segnalazioni di vigilanza consolidata: base informativa 'M'	A.33
- Segnalazioni prudenziali individuali (banche e SIM) e consolidate (gruppi bancari e gruppi di SIM): basi informative 'Y', 'LY', 'I' e 'L1'	A.38
- Segnalazioni su base consolidata relative alle informazioni per Paese di controparte: base informativa 'EP'	A.56
Capitolo 2 Schemi di segnalazione	
Matrice dei conti	B.1
Capitolo 3 Schemi di segnalazione	
Segnalazioni su base consolidata.....	C.1

Capitolo 1

Sistema delle codifiche (banche e gruppi bancari)

Premessa

Il presente capitolo indica, per ciascun parametro di disaggregazione presente all'interno delle segnalazioni (Paesi, titoli, banche, ecc.), il sistema di codifica da utilizzare e l'ente preposto alla gestione delle codifiche stesse; ove necessario, vengono richiamate le pubblicazioni e la documentazione amministrativa dalle quali attingere tutte le necessarie informazioni nonché le istruzioni che regolano aspetti particolari della materia.

Si richiama l'attenzione sul fatto che le codifiche possono identificare, nella base dati, diversi profili di uno stesso parametro di disaggregazione (ad es. Stato di residenza della controparte, Stato del garante o Stato di ubicazione filiale/controllata) che, come riportato nella pagina successiva, vengono contraddistinte con codici "campo" specifici.

I dati vanno segnalati come segue:

- le informazioni di quantità (numero dei conti, numero dei movimenti, numero dei dipendenti, ecc.): in unità;
- le segnalazioni di importi nelle "voci" in cui sono richiesti il codice della singola valuta ed importi in valuta originaria: in unità di valuta;
- le segnalazioni di importi nelle "voci" in cui non è richiesto il codice della singola valuta oppure il codice valuta è richiesto ma gli importi devono pervenire controvalorizzati in euro: in unità di euro per le segnalazioni individuali (basi informative A1, A2, A3, A4, W, LD, LY, Y) e per quelle della sezione IV "Segnalazioni Prudenziali" delle segnalazioni di vigilanza su base consolidata (basi informative L1 e 1) e in migliaia di euro per le segnalazioni su base consolidata non prudenziali (basi informative EP, M);
- i valori espressi in percentuale richiesti con riferimento alla sezione IV "Segnalazioni Prudenziali" della matrice dei conti e delle segnalazioni di vigilanza su base consolidata (basi informative LY, Y, L1 e 1) dovranno essere riportati con tre cifre decimali senza indicazione della virgola. Gli arrotondamenti vanno effettuati per eccesso, se la quarta cifra decimale è superiore a 5, per difetto se è pari o inferiore a 5 (esempio: se si ha necessità di segnalare il valore 10,0045%, occorrerà inserire il valore 10004).
- per le voci nella cui descrizione è data indicazione del segno "meno" tra parentesi (-) è ammessa esclusivamente la segnalazione di un valore con segno negativo;
- per le periodicità fornite nell'ambito della sezione IV "Segnalazioni Prudenziali" della matrice dei conti e delle segnalazioni di vigilanza su base consolidata (basi informative LY, Y, L1 e 1 ad eccezione delle sottosezioni 4.9 "Soggetti collegati" e 4.10 "SIM escluse dall'ambito di applicazione del pacchetto CRR/CRDIV"), si rimanda al Regolamento della Commissione Europea sulle norme tecniche di attuazione (ITS) in materia di segnalazioni prudenziali armonizzate delle banche e delle imprese di investimento. Le informazioni riportate all'interno degli schemi sono puramente indicative.

ELENCO GENERALE DEI CODICI DI IDENTIFICAZIONE DEI CAMPI

codice campo	descrizione del campo	lunghezza del campo	matrice dei conti (basi A1,A2,A3,A4,W)	segnalazioni prudenziali (basi Y,LY,1,L1)	segnalazioni consolidate (basi EP, M)
00007	Codice Valuta	3	X	X	X
00011	Settore istituzionale	3	X		X
00013	Provincia di operatività	5	X		
00015	Provincia e area geografica residenza controparte	5	X		
00016	Stato residenza controparte. Aree geografiche	3	X	X	X
00018	Stato del garante	3	X		X
00019	Settore istituzionale del garante	3	X		X
00020	Causale operazione	4	X		
00022	Finalità del credito-Destinazione economica dell'investimento	3	X		
00024	Leggi di incentivazione credito agevolato	3	X		
00032	Codice del titolo	12	X		
00040	Scaglioni di vita residua tipo A	3	X	X	X
00042	Scaglioni di vita residua tipo B (con riferimento alla data di revisione dei rendimenti)	3	X		X
00063	Stato ubicazione filiale/controllata	3	X		X
00113	Tipo tasso (posizione o contratto)	2	X		X
00181	Provincia di destinazione economica dell'investimento	5	X		
00212	Codice censito tipo A	13	X	X	
00294	Tempo di inadempimento	2		X	
00350	Tipo importo	3		X	
00352	Tipo garanzia	3	X	X	
00353	Tipologia controparte	3		X	
00356	Tipo di rischio	3		X	
00522	Qualità del credito/In bonis – deteriorate	7	X		X
00551	Codice del raggruppamento titoli / derivati	7	X		X
00552	Indicatore quotazione	3	X		X
00554	Mercato di negoziazione	3	X		
00555	Categoria emittente	3	X		
00556	Tipologia di attività finanziaria	3	X		X
00594	Classe importo tipologia titolo	3	X		
00598	Provincia di esecuzione dell'operazione	5	X		
00599	Classe importo cliente	2	X		
00800	Clientela MIFID	3	X		
00806	Servizio consulenza	1	X		
00902	Tipo carta	2	X		
00903	Categoria esercizi convenzionati	3	X		
00906	Tipo gestione.	2	X		
00914	Numero operazione	5	X		
00934	Paese del mercato di quotazione	5		X	
00937	Rapporti con emittente	2	X		
00939	Periodo iniziale per la determinazione del tasso di interesse	3	X		
00940	Natura del contratto derivato	3	X		X
00941	Tipo soggetto delegante/delegato	5	X		
00944	Canali distributivi	3	X		
01006	Causale frode	4	X		
01013	Sottosistema di appartenenza della controparte	5			X
01014	Portafoglio contabile	3	X		X
01016	Natura attività sottostante dei contratti derivati	3	X		X
01017	Tipologia esposizione	6	X	X	X
01020	Appartenenza patrimonio	3		X	
01025	Eventi di perdita	3		X	
01059	Depositario	3	X		
01071	Causale trattamento	3	X		
01073	Tecnologia chip	2	X		
01118	Ramo di attività economica	5	X	X	
01125	Metodologia applicata	3		X	
01126	Tipo di cartolarizzazione	3		X	
01127	Ruolo nella cartolarizzazione	3		X	
01130	Portafoglio SA e IRB	3		X	
01133	Fattore di conversione	3		X	

codice campo	descrizione del campo	lunghezza del campo	matrice dei conti (basi A1,A2,A3,A4,W)	segnalazioni prudenziali (basi Y,LY,1,L1)	segnalazioni consolidate (basi EP, M)
01134	Classe di merito creditizio	3		X	
01136	Fattore di ponderazione	3		X	
01165	Soggetto di riferimento	13			X
01166	Tipo cessione/ Trattamento contabile/ Attività proprie/Cedute non cancellate	3	X	X	X
01167	Tipo prodotto/servizio	3	X		
01169	Accordo compensazione	1	X		X
01172	Codice censito tipo B	13	X	X	X
01175	Servizio in contropartita	4	X		
01184	Stato di residenza della società veicolo	3	X		
01185	Tipo servicer	5	X		
01186	Codice censito originator	13	X		
01190	Gerarchia del fair value	1	X		X
01191	Tipologia valutazione	3	X		X
01192	Tipo strumento finanziario	4	X		X
01193	Tipo scaduto	4	X		X
01206	Metodo utilizzato	3		X	
01209	Categoria esposizione	3		X	
01212	Tipologia sottostante	3		X	
01215	Stato emittente	5	X		X
01216	Fascia scaduto	3	X		
01217	Oggetto dei reclami	5	X		
01222	Metodologia di consolidamento	3		X	
01223	Grado di liquidità e qualità creditizia	3		X	
01224	Esposizione diretta/indiretta	3		X	
01225	Assimilate Amministrazioni Centrali	1		X	
01226	Categoria Intermediario	2		X	
01227	Modalità di calcolo segnaletico	3		X	
01228	Posizione diretta	1		X	
01229	Contributo di garanzia verso CCP	1		X	
01230	CCP qualificata	1		X	
01231	Valutazione del merito di credito	3		X	
01232	Garanzie rilasciate e impegni a erogare fondi	1		X	
01233	Tipologia soggetto finanziario	3		X	
01234	Forma tecnica	3		X	
01235	Classe di merito di credito originaria	3		X	
01236	Detrazione	1		X	
01237	Clausola di rimborso anticipato	1		X	
01238	Esposizione rotativa	3		X	
01239	Classe di ponderazione	3		X	
01240	Identificativo della cartolarizzazione	45		X	
01241	Trattamento prudenziale	3		X	
01242	Conformità alla normativa	1		X	
01243	Portafoglio di negoziazione di correlazione	1		X	
01244	Cartolarizzazione – posizioni fuori bilancio	3		X	
01245	PMI	1		X	
01246	Deposito garantito	1		X	
01247	Tipologia impegno	3		X	
01248	Codice interno operazione di cartolarizzazione	10		X	
01249	Vita residua rischio di mercato	3		X	
01250	Vita residua rischio di liquidità	3		X	
01251	Classe di merito di credito	3		X	
01252	Tipologia posizione – Tipo X	3		X	
01253	Tipologia posizione – Tipo Y	3		X	
01254	Forma giuridica societaria	4		X	
01255	Approccio	3		X	
01256	Interesse economico netto	3		X	
01257	Trattamento dei derivati	3		X	
01258	Data di creazione	8		X	
01259	Prima data di chiusura prevedibile	8		X	
01260	Data di scadenza finale legale	8		X	
01261	Identificativo dell'originator	45		X	

codice campo	descrizione del campo	lunghezza del campo	matrice dei conti (basi A1,A2,A3,A4,W)	segnalazioni prudenziali (basi Y,LY,1,L1)	segnalazioni consolidate (basi EP, M)
02017	Parte correlata	13		X	
02018	Soggetto connesso	13		X	
02019	Rilevanza	1		X	
02020	Operatività ordinaria	1		X	
02021	Urgenza	1		X	
02022	Parere positivo	1		X	
02023	Delibera quadro	1		X	
02024	Infra-gruppo	1		X	
02025	Tipologia parte correlata	2		X	
02026	Tipologia soggetto connesso	2		X	
02027	Condizioni di mercato	1		X	
02028	Codice sportello	5	X		
02029	Sottosistema di rilevazione	5		X	X
02064	Tipo Garanzia (Base EP)	2			X
04005	Tipo contratto	3	X		
04009	Linee di business	3		X	
04115	Deflussi/Afflussi	3		X	
04120	Tipo crediti	3	X		

MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4' 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	LUNGH CAMP O	CODIFICHE
Residenza	-	-	<p>Ai fini della classificazione va assunta la definizione vigente nell'ambito della disciplina valutaria italiana. L'informazione è richiesta nella parte fissa del record "movimento".</p> <ul style="list-style-type: none"> - rapporti con soggetti residenti in Italia 1 - rapporti con soggetti non residenti in Italia 2
Durata	-	-	<p>L'informazione è richiesta nella parte fissa del record "movimento".</p> <ul style="list-style-type: none"> - imprecisabile o irrilevante..... 3 - fino a un anno 5 - da oltre un anno fino a due anni..... 6 - oltre due anni 7 - fino a due anni..... 13 - fino a tre mesi..... 14 - oltre tre mesi 15 - da oltre un anno fino a cinque anni 16 - oltre cinque anni..... 17 - oltre un anno 28 - da oltre tre mesi fino a due anni..... 15 - da oltre cinque anni fino a sette anni 43 - da oltre sette anni fino a dieci anni 44 - da oltre dieci anni fino a quindici anni 45 - da oltre quindici anni fino a ventinove anni 46 - oltre ventinove anni 47
Divisa	-	-	<p>L'informazione è richiesta nella parte fissa del record "movimento". I codici da utilizzare sono:</p> <ul style="list-style-type: none"> - 1 = _euro - 2 = altre valute
Codice valuta	00007	3	<p>Unità di conto in cui sono espressi i fenomeni segnalati. I codici sono attribuiti dalla Banca d'Italia – Servizio RST.</p> <p>Nelle voci in cui viene richiesta la singola valuta, le operazioni di impiego finanziate con provvista in valuta assistita dalla garanzia pubblica sul rischio di cambio vanno segnalate come segue:</p> <ul style="list-style-type: none"> - importi in euro, codice valuta = 398, divisa = 2
Settore istituzionale	00011	3	<p>Le finalità ed i valori previsti nella classificazione adottata sono illustrati nelle istruzioni relative alla classificazione della clientela divulgate dalla Banca d'Italia (Circolare n. 140 dell'11 febbraio 1991).</p> <p>Codifica valida per la voce 58306 (indicata negli schemi con la lettera L):</p> <ul style="list-style-type: none"> - Amministrazioni pubbliche (sottogruppi 100, da 102 a 191)..... 1 - Imprese finanziarie e assicurative (sottogruppi da 249 a 256, da 258 a 264, 268, da 275 a 284, da 294 a 296, 329)..... 95 - Imprese non finanziarie (sottogruppi 430, 431, 450, da 470 a 492) 4 - Famiglie produttrici (sottogruppi 614, 615) 61 - Famiglie consumatrici, Istituzioni sociali private e unità non classificabili (sottogruppi 500, 501, 551, 552, 600)..... 96 - Autorità bancarie centrali e altre istituzioni finanziarie monetarie (sottogruppi 245, 247, 101, 248 e 300)..... 97
Settore istituzionale del garante	00019	3	<ul style="list-style-type: none"> - Società di intermediazione finanziaria (merchant banks), società di gestione di fondi comuni di investimento e società fiduciarie (sottogruppi 257, da 265 a 267, 270, 273)..... 98

MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4' 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	LUNGH CAMP O	CODIFICHE
Attività economica: ramo	01118	5	<p>Deve essere utilizzata la classificazione delle attività economiche ATECO 2007 predisposta dall'ISTAT. La classificazione prevede sei livelli. Gli schemi prevedono la segnalazione di quelli corrispondenti alle Divisioni ("D" negli schemi) e delle Sezioni ("S" negli schemi). I valori previsti in tale classificazione sono illustrati nelle istruzioni relative alla classificazione della clientela divulgate dalla Banca d'Italia (Circolare n. 140 dell'11 febbraio 1991).</p> <p>Campo alfanumerico con allineamento a sinistra. La parte non utilizzata del campo deve contenere il carattere "blank"</p>
Codice sportello	02028	5	<p>L'informazione viene richiesta nella matrice di vigilanza con riferimento agli stabilimenti residenti; il codice e' rappresentato secondo le modalità C.A.B. (5 posizioni numeriche senza utilizzo del carattere di controllo). La codifica è gestita dalla S.I.A.</p>

MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4' 'W')

VARIABLE DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	LUNGH. CAMPO	CODIFICHE
Stato di residenza della controparte	00016	3	<p>Viene utilizzata la codifica predisposta e gestita dalla Banca d'Italia – Servizio RST. Per ciò che concerne i rapporti con gli Organismi Internazionali, devono essere utilizzati gli specifici codici assegnati ai suddetti organismi.</p> <p>Codifica da utilizzare nella sezione II sottosez. 3 “Servizi di pagamento”:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Italia..... 86 - Paesi UME 703 - Altri Paesi UE (non UME)..... 704 - Extra UE 705
Stato di residenza del garante	00018	3	<p>Viene utilizzata la codifica predisposta e gestita dalla Banca d'Italia – Servizio RST. Per ciò che concerne i rapporti con gli Organismi Internazionali, devono essere utilizzati gli specifici codici assegnati ai suddetti organismi.</p>
Stato ubicazione filiale/controllata	00063	3	<p>Viene utilizzata la codifica predisposta e gestita dalla Banca d'Italia – Servizio RST. Per ciò che concerne i rapporti con gli Organismi Internazionali, devono essere utilizzati gli specifici codici assegnati ai suddetti organismi.</p> <p>Per le voci 40707, 40730, 40731, 40732, 40733, 40734, 40745, 40747, 40812, 40813, 40814, 40980, 40981, 40993 e 40994 della base informativa “W” e per per le voci 58360, 58365, 58370, 58381, 58810, 58875 e 58880 della base informativa “A2” i codici da utilizzare sono:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Italia..... 86 - Paesi diversi dall'Italia..... 706 <p>Per le voci 41402, 41403, 41404, 41405, 41419 della base informativa “A3” i codici da utilizzare sono:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Italia..... 86 - Paesi diversi dall'Italia..... 706 <p>L'informazione deve essere fornita solo se lo Stato del veicolo appartiene all'area UEM. In caso contrario la variabile deve essere appostata a zero</p>
Stato di residenza della società veicolo	01184	3	<p>L'informazione deve essere fornita solo se lo Stato del veicolo appartiene all'area UEM. In caso contrario la variabile deve essere appostata a zero</p>
Stato emittente	01215	5	<ul style="list-style-type: none"> - Italia..... 00086 - Paesi UEM diversi dall'Italia..... 00703 - Paesi UE non UEM 00704 - Paesi europei non UE 59001 - Asia 40220 - Africa 40230 - Oceania 40250 - America del Nord 40341 - America Centrale 40342 - America del Sud..... 40343 - Non classificabile 07777

MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4' 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	LUNGH CAMP O	CODIFICHE
Vita residua delle operazioni (A)	00040	3	Codifica valida per la sottosezione "2.1 Dati patrimoniali - Parte quarta - Vita residua: Rischio di tasso di interesse":
			- A vista e a revoca: 010
			- oltre 1 giorno a 7 giorni 025
			- da oltre 7 giorni a 1 mese 035
			- da oltre 1 mese a 3 mesi 040
			- da oltre 3 mesi a 6 mesi 050
			- da oltre 6 mesi a 12 mesi 060
			- da oltre 12 mesi fino a 18 mesi 070
			- da oltre 18 mesi fino a 24 mesi 080
			- da oltre 2 anni a 3 anni 160
Vita residua delle operazioni con riferimento alla data di revisione dei rendimenti (B)	00042	3	- da oltre 3 anni a 4 anni 170
			- da oltre 4 anni a 5 anni 180
			- da oltre 5 anni a 7 anni 310
			- da oltre 7 anni a 10 anni 330
			- da oltre 10 anni a 15 anni 430
			- da oltre 15 anni a 20 anni 460
			- oltre 20 anni 490
			- irredimibile 903
			- durata indeterminata 900
			-
Codifica da utilizzare per la voce 58455:			
- a vista e fino a 1 anno 068			
- da oltre 1 anno fino a 5 anni 073			
- da oltre 5 anni fino a 7 anni 310			
- da oltre 7 anni fino a 10 anni 330			
- da oltre 10 anni fino a 15 anni 430			
- da oltre 15 anni fino a 29 anni 491			
- oltre 29 anni 492			
- non applicabile 777			
-			
Codifica valida per le voci 58352, 58359 e 58468:			
- a vista e fino a 1 anno 68			
- da oltre 1 anno a 2 anni 90			
- oltre 2 anni 162			
- non applicabile 777			
-			
Codifica valida per la sottosezione "2.1 Dati patrimoniali - Parte terza - Vita residua: Rischio di liquidità":			
- A vista e a revoca: 010			
- oltre 1 giorno a 7 giorni 025			
- da oltre 7 giorni a 15 giorni 041			
- da oltre 15 giorni a 1 mese 042			
- da oltre 1 mese a 2 mesi 043			
- da oltre 2 mesi a 3 mesi 044			
- da oltre 3 mesi a 6 mesi 050			
- da oltre 6 mesi a 12 mesi 060			
- da oltre 12 mesi fino a 18 mesi 070			
- da oltre 18 mesi fino a 24 mesi 080			
- da oltre 2 anni a 3 anni 160			
- da oltre 3 anni a 4 anni 170			
- da oltre 4 anni a 5 anni 180			
- oltre 5 anni 300			
- irredimibile 903			
- durata indeterminata 900			

MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4' 'W')

VARIABLE DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	LUNGH. CAMPO	CODIFICHE					
Provincia di residenza della controparte	00015	5	00166	AGRIGENTO	00105	IMPERIA	00128	REGGIO EMILIA
			00104	ALESSANDRIA	00156	ISERNIA	00146	RIETI
			00026	ANCONA	00036	L'AQUILA	00242	RIMINI
			00012	AOSTA	00107	LA SPEZIA	00032	ROMA
			00141	AREZZO	00147	LATINA	00122	ROVIGO
Provincia di operatività	00013	5	00135	ASCOLI PICENO	00160	LECCE	00152	SALERNO
			00103	ASTI	00229	LECCO	00172	SASSARI
			00151	AVELLINO	00139	LIVORNO	00106	SAVONA
			00040	BARI	00203	LODI	00142	SIENA
			00206	BARLETTA-ANDRIA-TRANI	00137	LUCCA	00171	SIRACUSA
Provincia di destinazione economica dell'investimento	00181	5	00119	BELLUNO	00134	MACERATA	00110	SONDRIO
			00150	BENEVENTO	00115	MANTOVA	00158	TARANTO
			00111	BERGAMO	00136	MASSA CARRARA	00153	TERAMO
			00223	BIELLA	00161	MATERA	00144	TERNI
			00024	BOLOGNA	00178	MEDIO CAMPIDANO	00010	TORINO
Provincia di esecuzione dell'operazione	00598	5	00116	BOLZANO	00165	MESSINA	00164	TRAPANI
			00112	BRESCIA	00016	MILANO	00018	TRENTO
			00159	BRINDISI	00129	MODENA	00120	TREVISO
			00048	CAGLIARI	00204	MONZA-BRIANZA	00022	TRIESTE
			00167	CALTANISSETTA	00034	NAPOLI	00123	UDINE
			00038	CAMPOBASSO	00101	NOVARA	00108	VARESE
			00175	CARBONIA-IGLESIAS	00173	NUORO	00020	VENEZIA
			00149	CASERTA	00176	OGLIASTRA	00224	VERBANO-CUSIO- OSSOLA
			00169	CATANIA	00177	OLBIA -TEMPIO		
			00044	CATANZARO	00174	ORISTANO	00100	VERCELLI
			00155	CHIETI	00121	PADOVA	00117	VERONA
			00109	COMO	00046	PALERMO	00428	VIBO VALENTIA
			00162	COSENZA	00127	PARMA	00118	VICENZA
			00114	CREMONA	00113	PAVIA	00145	VITERBO
			00222	CROTONE	00030	PERUGIA		
			00102	CUNEO	00133	PESARO E URBINO		
			00168	ENNA	00154	PESCARA		
			00205	FERMO	00126	PIACENZA		
			00130	FERRARA	00140	PISA		
			00028	FIRENZE	00138	PISTOIA		
			00157	FOGGIA	00125	PORDENONE		
			00132	FORLI'	00042	POTENZA		
			00148	FROSINONE	00215	PRATO		
00014	GENOVA	00170	RAGUSA					
00124	GORIZIA	00131	RAVENNA					
00143	GROSSETO	00163	REGGIO CALABRIA					
Aree geografiche Italia	00015	5	Codifica valida per la voce 58306:					
			- nord-ovest.....				20001	
			- nord-est.....				20002	
			- centro.....				20003	
			- sud.....				20004	
- isole.....				20005				

MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4' 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	LUNGH CAMP O	CODIFICHE
Destinazione economica dell'investimento finanziato	00022	3	<p>Codifica valida per la voce 58320:</p> <p>INVESTIMENTI NON FINANZIARI</p> <p>costruzioni:</p> <ul style="list-style-type: none"> abitazioni 010 fabbricati non residenziali: <ul style="list-style-type: none"> rurali 020 altri 030 opere del Genio Civile 040 macchine, attrezzature, mezzi di trasporto e prodotti vari: <ul style="list-style-type: none"> rurali 050 altri 060 <p>ALTRI INVESTIMENTI</p> <p>acquisto di immobili:</p> <ul style="list-style-type: none"> abitazioni <ul style="list-style-type: none"> famiglie consumatrici 070 altri soggetti 080 altri immobili <ul style="list-style-type: none"> rurali 090 altri 105 acquisto di beni durevoli da parte delle famiglie consumatrici 110 investimenti finanziari 120 altre destinazioni 130 <p>Codifica valida per le voci 58005, 58007, 58080, 58083, 58086, 58202, 58204, 58208, 58210, 58212, 58214, 58216, 58300, 58301, 58397 (base inf. "A1" e "A2"):</p> <ul style="list-style-type: none"> - credito al consumo <ul style="list-style-type: none"> - finalizzato: <ul style="list-style-type: none"> - acquisto di beni durevoli 110 - acquisto di autoveicoli 116 - altro 119 - non finalizzato 204 - prestiti per acquisto abitazioni 212 - altro 222 <p>Codifica valida per le voci 40013, 40015, 40025, 40028, 40055 (base inf. "A1"), 40730, 40731, 40732, 40734, 40745, 40747 (base inf. "W") e 58365 (base inf. "A2"):</p> <ul style="list-style-type: none"> - credito al consumo 202 - prestiti per acquisto abitazioni 212 - altro 222
Finalità del credito			
Legge di incentivazione del credito agevolato	00024	3	<ul style="list-style-type: none"> - Mezzogiorno e altre aree depresse 610 - Industria - medie e piccole imprese 630 - Industria - altre imprese 650 - Commercio, attività finanziarie e assicurative, trasporti e comunicazioni, turismo, servizi vari 670 - Esportazioni 690 - Agricoltura, foresta e pesca 710 - Edilizia e abitazioni 750 - Artigianato 755 - Calamità naturali 765 - Altre destinazioni 770

MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4' 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	LUNGH CAMP O	CODIFICHE
Tipo tasso dell'opera- zione	00113	2	<p>I codici da utilizzare per la voce 58312 sono:</p> <ul style="list-style-type: none"> - tasso agevolato..... 80 - tasso fisso non agevolato 81 - tasso indicizzato non agevolato 82 <p>I codici da utilizzare per la voce 58320 sono:</p> <ul style="list-style-type: none"> - tasso agevolato..... 80 - tasso fisso non agevolato 81 - tasso indicizzato non agevolato con CAP 89 - tasso indicizzato non agevolato senza CAP 90 <p>Per le restanti voci i codici previsti sono:</p> <ul style="list-style-type: none"> - tasso fisso..... 83 - tasso indicizzato 84

MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4' 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	LUNGH CAMP O	CODIFICHE
INFORMAZIONI NOMINATIVE			<p>Per la classificazione nominativa della controparte deve essere utilizzato il "codice censito" (codice "Centrale dei rischi"). Il codice può essere richiesto attenendosi alle modalità previste dalla Circ. 139 dell'11/02/91 ("Centrale dei rischi – Istruzioni per gli intermediari creditizi"), cap. III sez. 2. Nel caso eccezionale in cui non si dovesse disporre del suddetto codice in tempo utile per le segnalazioni, è consentito l'utilizzo temporaneo del codice "999999999753". L'ente segnalante è tenuto ad effettuare le opportune rettifiche non appena il predetto codice diviene disponibile.</p> <p>Per gli intermediari non aderenti alla Rete Nazionale Interbancaria tale richiesta può essere effettuata tramite supporto cartaceo.</p> <p>Sino al mese di avvio del NewMIC, per l'indicazione delle controparti creditizie anonime in operazioni effettuate nel Mercato Interbancario Collateralizzato (MIC) occorre utilizzare il codice "999999999671".</p>
Codice Censito di tipo A	00212	13	Il codice censito di tipo A deve essere utilizzato nelle seguenti voci (ove la sottovoce lo richieda): 58795, 40733.
Codice censito di tipo B	01172	13	Il codice censito di tipo B deve essere utilizzato nelle seguenti voci (ove la sottovoce lo richieda): 58005, 58007, 58011, 58030, 58065, 58202, 58204, 58206, 58208, 58210, 58212, 58214, 58216, 58900, 58902, 58910, 58916, 58917, 58920, 58940.
Codice censito originator	01186	13	Il codice censito originator deve essere utilizzato nelle seguenti voci (ove la sottovoce lo richieda): 58212, 58216
Indicatore di quotazione	00552	3	<p>Codifiche valide per le voci dei servizi di investimento:</p> <ul style="list-style-type: none"> - valori mobiliari quotati in mercati regolamentati 028 - valori mobiliari non quotati in mercati regolamentati 029 - valori mobiliari in corso di quotazione in mercati regolamentati 027 - non applicabile 770 <p>Codifiche valide per le altre voci:</p> <ul style="list-style-type: none"> - quotati in mercati regolamentati attivi 021 - quotati in mercati regolamentati non attivi 022 - quotati in altri mercati attivi 023 - non quotati 005 - in corso di quotazione 004
Clientela MIFID	00800	3	<ul style="list-style-type: none"> - clientela Retail..... 500 - clientela Professionale 510 - controparti qualificate..... 520
Servizio consulenza	00806	1	<ul style="list-style-type: none"> - si 1 - no 2 - non applicabile 7
Gerarchia del fair value	01190	1	<ul style="list-style-type: none"> - livello 1 1 - livello 2 2 - livello 3 3

MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4' 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	LUNGH CAMP O	CODIFICHE
Tipologia valutazione	01191	3	- valutazione al costo 200 - valutazione al valore rivalutato 201
Tipo strumento finanziario	01192	4	- strum. strutturati..... 1511 - altri..... 1512
Tipo scaduto	01193	4	- soggetto debitore 1501 - singola transazione..... 1502
CLASSIFICA ZIONE DEI VALORI MOBILIARI			
Codice del titolo	00032	12	<p>La codifica dei titoli emessi da residenti e non residenti è gestita dalla Banca d'Italia – Servizio RST – Divisione “Codifica e informazioni valori mobiliari”, la quale provvede alla divulgazione dell’anagrafe. Ai fini delle segnalazioni deve essere utilizzato il “codice ISIN” comprensivo del valore di controllo.</p> <p>Fanno eccezione i certificati di deposito e i buoni fruttiferi <u>emessi da istituzioni creditizie residenti</u> i quali, non formando oggetto di codifica centralizzata, devono essere segnalati (laddove sia richiesta l’indicazione del codice titolo) con i seguenti codici convenzionali:</p> <ul style="list-style-type: none"> - buoni fruttiferi e certificati di deposito in euro 9 - buoni fruttiferi e certificati di deposito in altre valute 10 <p>In mancanza del codice del titolo ovvero del codice ISIN è consentito, in via temporanea e del tutto eccezionale, l’uso dei seguenti codici residuali:</p> <ul style="list-style-type: none"> - per i titoli in euro emessi da residenti 1 - per i titoli in altre valute emessi da residenti 2 - per i titoli in euro emessi da non residenti 3 - per i titoli in altre valute emessi da non residenti 4 <p>Per ogni tipologia di valore mobiliare per la quale non è prevista l’attribuzione della codifica ISIN (esempio, quote di srl) occorre utilizzare il codice convenzionale “995”.</p> <p>La segnalazione nominativa dei titoli in deposito che presentano data fine validità/scadenza anteriore alla data di riferimento della segnalazione e che, per cause particolari, risultano ancora depositati dalla clientela, deve essere effettuata utilizzando in luogo del codice ISIN, i codici convenzionali 998 (titoli emessi da residenti) e 997 (titoli emessi da non residenti).</p> <p>Ovviamente, anche nel caso di utilizzo di codici titolo residuali, dovranno essere correttamente fornite, ove richieste, le informazioni per “codici di raggruppamento”.</p>

MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4' 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	LUNGH CAMP O	CODIFICHE
1) Codice del raggruppamento dei titoli	00551	7	<p>L'informazione e' richiesta a diversi livelli di dettaglio:</p> <p>1) codice del raggruppamento dei titoli;</p> <p>2) codice del raggruppamento dei contratti derivati.</p> <p>a) Titoli di Stato italiani (sono esclusi i titoli garantiti dallo Stato Italiano)</p> <ul style="list-style-type: none"> - B.O.T..... 0100101 - C.C.T. a cedola variabile..... 0100102 - C.T.E..... 0100104 - C.T.O. (Certificati del Tesoro con opzione) 0100105 - C.T.Z..... 0100107 - Altri C.C.T. (C.T.R., C.T.S., Certificati Ordinari, Certificati per enti mutualistici)..... 0100108 - B.T.P..... 0100103 - Cartelle Cassa DD. PP..... 0100109 - BTP oggetto di operazioni di coupon stripping: <ul style="list-style-type: none"> - mantello..... 0100171 - cedola..... 0100172 - Altri titoli dello Stato italiano 0100198 <p>b) Titoli di debito (sono compresi i titoli di Stato esteri e di amministrazioni pubbliche italiane ed estere)</p> <ul style="list-style-type: none"> - bb.ff. e cc.dd. di durata originaria fino a 18 mesi compresi 0100201 - altri titoli di mercato monetario (con durata originaria fino a 18 mesi compresi): <ul style="list-style-type: none"> - cambiali finanziarie, certificati di investimento, accettazioni bancarie e valori assimilati e altri investimenti finanziari (valido solo per le segnalazioni statistiche sui servizi di investimento)..... 0100212 - altri..... 0100213 - bb.f.f. e cc.dd. di durata originaria oltre 18 mesi..... 0100211 - obbligazioni ordinarie 0100204 - obbligazioni convertibili 0100205 - obbligazioni con opzioni di rimborso anticipato..... 0100206 - obbligazioni emesse da organismi internazionali 0100214 - titoli emessi per operazioni di cartolarizzazione: <ul style="list-style-type: none"> - senior..... 0100217 - mezzanine 0100218 - junior..... 0100219 <p>c) Titoli di capitale</p> <ul style="list-style-type: none"> - azioni e quote <ul style="list-style-type: none"> - ordinarie0100302 - privilegiate.....0100303 - di risparmio0100304 - quote di risparmio0100305 - altre0100306 - altri titoli di capitale0100399 <p>d) Parti di organismi di investimento collettivo del risparmio (o.i.c.r.)</p> <ul style="list-style-type: none"> - Oicr di diritto italiano: <ul style="list-style-type: none"> - armonizzati aperti0100410 - non armonizzati aperti0100411 - chiusi0100412 - riservati0100413 - speculativi0100414 - exchange traded funds ...0100500 - Oicr di altri stati UE: <ul style="list-style-type: none"> - armonizzati0100415 - non armonizzati aperti0100416 - non armonizzati chiusi0100417 - exchange traded funds ...0100501 - Oicr di stati no UE: <ul style="list-style-type: none"> - aperti.....0100418 - chiusi0100419 - exchange traded funds ...0100502 <p>e) Altri titoli0100091</p> <p>f) Altri valori.....0000995</p>

MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4' 'W')

VARIABLE DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	LUNGH. CAMPO	CODIFICHE
<p style="text-align: center;">2) Codice del raggruppamento dei contratti derivati</p> <p style="text-align: center;">2.a Codifiche relative ai contratti derivati valide per le segnalazioni statistiche sui servizi d'investimento (sez. 2.2 della matrice dei conti)</p>	00551	7	<p>DERIVATI FINANZIARI</p> <p>a) Futures (i futures su titoli nozionali (es. MIF) sono da inserire nella categoria corrispondente al tipo di titolo nozionale)</p> <ul style="list-style-type: none"> - su titoli dello Stato italiano 0200101 - su titoli di debito 0200102 - su titoli di capitale 0200103 - su tassi di interesse 0200104 - su indici di borsa 0200105 - su valute 0200106 - su merci 0200107 - altri 0200198 <p>b) Swaps e fras</p> <ul style="list-style-type: none"> - interest rate swaps (IRS) tasso fisso/tasso variabile (con capitali di riferimento denominati nella medesima valuta) 0200201 - IRS tasso variabile/tasso variabile (Basis swaps) 0200202 - IRS cross-currency (Consistono nello scambio di un tasso di interesse in una valuta con un altro tasso di interesse in una valuta differente) 0200203 - currency swaps euro/valuta (Consistono nello scambio di un ammontare prefissato di euro contro un altro di valuta) 0200204 - currency swaps valuta/valuta (Consistono nello scambio di due ammontari prefissati di valute differenti) 0200205 - domestic currency swaps (Consistono nello scambio, ad una data prestabilita, di un importo determinato in base al differenziale tra il tasso di cambio contrattuale e quello corrente alla data di scadenza dell'operazione) 0200206 - forward rate agreements 0200207 - altri swaps 0200299 <p>c) Opzioni su titoli (Sono inclusi i warrant e i diritti. Le opzioni su un titolo nozionale sono da inserire nella categoria corrispondente al tipo del titolo nozionale)</p> <ul style="list-style-type: none"> - opzioni call su titoli dello Stato italiano 0200301 - opzioni put su titoli dello Stato italiano 0200302 - opzioni call su titoli di debito 0200303 - opzioni put su titoli di debito 0200304 <p>d) Opzioni su futures o su indici di borsa (Le opzioni su futures su un titolo nozionale sono da inserire nella categoria corrispondente al tipo del titolo nozionale)</p> <ul style="list-style-type: none"> - opzioni call su futures su titoli dello Stato italiano 0200401 - opzioni put su futures su titoli dello Stato italiano 0200402 - opzioni call su futures su titoli di debito o tassi 0200403 - opzioni put su futures su titoli di debito o tassi 0200404 - opzioni call su indici di borsa o su futures su indici di borsa 0200405 - opzioni put su indici di borsa o su futures su indici di borsa 0200406 - opzioni su altri futures 0200407 <p>e) Opzioni su valute</p> <ul style="list-style-type: none"> - opzioni call 0200501 - opzioni put 0200502 - altre opzioni su valute 0200503 <p>f) Opzioni su tassi di interesse</p> <ul style="list-style-type: none"> - cap 0200601 - floor 0200602 - opzioni su IRS (swaptions) 0200603 - altre opz. Su tassi di interesse 0200604 <p>g) Opzioni su merci</p> <ul style="list-style-type: none"> - opzioni call 0200231 - opzioni put 0200232 - altre opzioni 0200233 <p>h) Opzioni su altri valori o indicatori 0200070</p> <p>i) Forward</p> <ul style="list-style-type: none"> - titoli di debito 0200223 - titoli di capitale 0200224 - quote di OICR 0200225 - valute e oro 0200226 - merci 0200227 - altro 0200228 <p>i) Altri contratti derivati 0200230</p> <p>DERIVATI CREDITIZI 0200700</p>

MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4' 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	LUNGH CAMP O	CODIFICHE
2.b Codifiche relative ai contratti derivati valide per i dati informativi diversi da quelli delle segnalazioni statistiche sui servizi d'investi- mento	00551	7	Derivati finanziari diversi dalle opzioni: - Futures 200010 - Forwards 200208 - Fra's 200207 - EONIA swaps 200209 - Altri swaps 200210 - Altri derivati finanziari 200222 Opzioni: - Call europee plain vanilla 200211 - Call americane plain vanilla 200212 - Call esotiche 200213 - Put europee plain vanilla 200214 - Put americane plain vanilla 200215 - Put esotiche 200216 Derivati finanziari strutturati non oggetto di scomposizione 200850 Derivati creditizi: - Credit default swap 200803 - Credit default swap index 200217 - Credit default option 200218 - Total rate of return swap 200804 - Credit spread swap 200219 - Credit spread option 200220 - Altri derivati creditizi 200221
Canali distributivi	00944	3	Sportello 83 Automatic teller machines 84 Promotori finanziari 85 Canale telefonico 86 Internet 87 Altri collegamenti telematici 88 Società bancarie e finanziarie 89 Società di assicurazione 90 Esercizi commerciali 91 Altri canali distributivi 98
Mercato di negozia- zione	00554	3	Classificazione dei mercati in cui sono stati trattati i valori mobiliari oggetto di compravendita. E' rappresentata mediante codici di tre posizioni numeriche. I valori previsti sono: - mercati regolamentati 100 - sistemi multilaterali di negoziazione 018 - internalizzazione sistematica 226 - altro 227

MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4' 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	LUNGH CAMP O	CODIFICHE
Categoria emittente	00555	3	<p>Classificazione degli emittenti dei valori mobiliari.</p> <p>a) Categorie emittenti italiani</p> <ul style="list-style-type: none"> - Stato/Governo italiano – Banca Centrale (sottosettori 16 e 30)..... 812 - Amministrazioni locali italiane (sottosettore 17)..... 017 - Istituzioni finanziarie monetarie: <ul style="list-style-type: none"> - Banche (sottosettore 24)..... 024 - Fondi comuni di investimento monetario (sottosettore 21) 021 - Altri intermediari (sottosettore 35)..... 035 - Istituzioni finanziarie italiane: <ul style="list-style-type: none"> - SIM (sottogruppo 264) 264 - Fiduciarie (sottogruppi 265 e 273) 828 - Società di gestione del risparmio e SICAV italiane. (sottogruppi 266, 267 e 270)..... 817 - Holding finanziarie pubbliche (sottogruppo 255)..... 255 - Altre (sottogruppi da 249 a 250, da 256 a 263, 268, da 275 a 284, 329)..... 857 - Imprese di assicuraz. italiane (sottogruppo 294) 294 - Società non finanziarie italiane: <ul style="list-style-type: none"> - Holding pubbliche (sottogruppo 474) 474 - Imprese partecipate dallo Stato (sottogruppo 471)..... 471 - Altre (sottogruppi da 430 a 450, 470, 472, 473, da 480 a 492) 877 - Altri residenti (sottogruppi di residenti non ricompresi nelle precedenti categorie) 881 <p>b) Categorie emittenti esteri</p> <ul style="list-style-type: none"> - Stato/Governo estero - Banca centrale (sottogruppi da 704 a 707, da 724 a 726)..... 893 - Organismi internazionali (sottosettore 88) 883 - Banche estere (sottogruppi da 727 a 729) 884 - Istituzioni finanziarie estere dei paesi dell'Unione Europea (sottogruppi 717, 718, 733, 734, 739, 743, 746, 747)..... 868 - Imprese di assicurazione estere dei paesi dell'Unione Europea (sottogruppi 744 e 745)..... 869 - Altre finanziarie estere (sottogruppi 735 e 748)..... 876 - Società non finanziarie estere (sottosettore 85) 887 - Altri esteri (sottogruppi di non residenti non ricompresi nelle precedenti categorie) 888

MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4' 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	LUNGH CAMP O	CODIFICHE
Classifica- zione del deposito: classe di importo del cliente	00599	2	Codifiche valide per la voce 58341:
			- fino a 12.500 euro 66
			- oltre 12.500 fino a 50.000 euro 67
			- oltre 50.000 fino a 250.000 euro 92
			- oltre 250.000 fino a 500.000 euro 94
			- oltre 500.000 euro 95
			- non applicabile 17
			Codifiche valide per le voci 58306 e 41419.22:
			- fino a 50.000 euro 88
			- oltre 50.000 fino a 250.000 euro 92
			- oltre 250.000 fino a 500.000 euro 94
			- oltre 500.000 euro 95
			Codifiche valide per le voci 40035 e 40045:
			- fino a 250.000 euro 35
			- oltre 250.000 fino a 1.000.000 di euro 36
- oltre 1.000.000 di euro 47			
Codifiche valide per la sez. II sottosez. 3			
- fino a 12.500 euro 66			
- oltre 12.500 fino a 50.000 euro 67			
- oltre 50.000 euro 89			
Tipo carta	00902	2	- personale 01 - aziendale 02
Categoria esercizi convenzio- nati	00903	3	- Alberghi e ristoranti 068 - Autonoleggi 901 - Linee aeree 902 - Agenzie di viaggio 771 - Ipermercati, supermercati e grandi magazzini 903 - Distributori carburante 652 - Vendita per corrispondenza 904 - Abbigliamento 645 - Altri esercizi al dettaglio 905
Tipo gestione	00906	2	- Fondo comune aperto di diritto italiano 01 - Fondo comune chiuso di diritto italiano 02 - Patrimonio o compartimento Sicav di diritto italiano 03 - Fondo pensione ex art. 4 D. Lgs. 124/93 04 - Fondo pensione ex art. 9 D. Lgs. 124/93 05 - Gestione di patrimoni mobiliari su base individuale 06 - Altro 07
Rapporti con emittente	00937	2	- Società o ente controllante 01 - Altro soggetto appartenente al gruppo 05 - Soggetto non appartenente al gruppo 07 - Ente segnalante (in caso di liquidità) 08
Natura del contratto derivato	00940	3	- Non incorporato 036 - Incorporati in passività finanziarie 037 - Incorporati in attività finanziarie 038 - Incorporati in altri derivati 039

MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4' 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	LUNGH CAMP O	CODIFICHE
Tipo soggetto delegante/ delegato	00941	5	Banca italiana 00245 Banca estera 00884 SIM italiana 00264 Impresa di investimento estera 10021 OICR italiano 10033 SGR italiana 10019 Fondo pensioni 10029 Altro 10034
Periodo iniziale di determina- zione del tasso di interesse	00939	3	variabile o fino a 3 mesi 14 oltre 3 mesi e fino a 1 anno 120 variabile o fino a 1 anno (valido solo per le voci 40035-08, 40035-12, 40045-08, 40045-12) 5 oltre 1 anno e fino a 3 anni 121 oltre 3 anni e fino a 5 anni 122 oltre 5 anni e fino a 10 anni 36 oltre 10 anni 37
Depositario	01059	3	Montetitoli 082 Altro depositario residente 081 Depositario non residente 083 Deposito presso il segnalante 086 Titolo non disponibile 087
Tipo cessione/ Attività proprie/ Cedute non cancellate	01166	3	Proprie 095 Cedute non cancellate a fini prudenziali e di bilancio 097 Cedute non cancellate solo a fini di bilancio 096 Passività a fronte di attività cedute e non cancellate 118 Altre 119 Per le voci 58083, 58202, 58204 i codici da utilizzare sono: - Auto-cartolarizzazioni 098 - Auto-cartolarizzazioni con deroga (c.d. "grandfathered") 111 - Warehousing 106 - Altre cartolarizzazioni 109 Per la voce 58086 i codici da utilizzare sono: - riacquisto di crediti ceduti e non cancellati 114 - altri acquisti 115
Classe importo tipologia titolo	00594	3	fino a 50.000 euro 088 oltre 50.000 fino a 150.000 euro 090 oltre 150.000 euro 091

MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4' 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	LUNGH CAMP O	CODIFICHE
Tipo prodotto/ servizio	01167	3	Gestioni di portafogli proprie 150 Gestioni di portafogli di terzi 151 Prodotti assicurativi 152 Leasing di terzi 153 Factoring di terzi 154 Crediti personali di terzi 155 Altri finanziamenti di terzi 156 Altri servizi propri: - Operazioni pronti contro termine, depositi a risparmio e conti correnti 157 - Altri 158 Altri servizi di terzi 159 Parti di OICR italiani propri 160 Parti di OICR italiani di terzi 161 Parti di OICR esteri propri 162 Parti di OICR esteri di terzi 163 Titoli di Stato propri 164 Titoli di Stato di terzi 165 Obbligazioni emesse da banche – titoli propri 166 Obbligazioni emesse da banche – titoli di terzi 167 Altre obbligazioni – titoli propri 168 Altre obbligazioni – titoli di terzi 169 Azioni proprie 170 Azioni di terzi 171 Altri valori mobiliari propri emessi da banche 172 Altri valori mobiliari di terzi emessi da banche 173 Altri valori mobiliari propri 174 Altri valori mobiliari di terzi 175
Qualità del credito	00522	7	In bonis 550010 Deteriorate 550009 Codifiche da utilizzare per le "informazioni di vita residua" e per la voce 58892 (base inf. "A2"): - Sofferenza 551000 - Incagli 550002 - Ristrutturate 550014 - Scadute e/o sconfinanti deteriorate 550016 - Altre attività 550019 Codifiche da utilizzare per la voce 40707 "Finanziamenti ripartiti per forma tecnica" (base inf. "W"): - Sofferenza 551000 - Incagli 550002 - Ristrutturate 550014 - Scadute e/o sconfinanti deteriorate approccio per debitore 550022 - Scadute e/o sconfinanti deteriorate approccio per transazione 550023 - Altre attività 550019
Accordo compensa- zione	01169	1	Sì 1 No 2

MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4' 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	LUNGH CAMP O	CODIFICHE
Causale frode	01006	4	Furto/smarrimento 0871
			Contraffazione o duplicazione..... 0872
			Mancata ricezione carta..... 0873
			Frode "carta non presente" 0875
			Altro 0876
Tecnologia chip	01073	2	Dispositivi compatibili con la tecnologia a microcircuito (standard SEPA/EMV) 65
			Altro 66
Causale operazione	00020	4	Servizi postali e di corriere..... 2015
			Servizi di telecomunicazione..... 2030
			Costruzioni all'estero..... 2040
			Costruzioni in Italia 2050
			Premi per assicurazioni vita 2060
			Indennizzi per assicurazioni vita 2070
			Premi per garanzie standardizzate del credito..... 2075
			Indennizzi per garanzie standardizzate del credito 2076
			Premi per assicurazioni trasporto merci 2080
			Indennizzi per assicurazioni trasporto merci..... 2090
			Premi per altre assicurazioni dirette 2100
			Indennizzi per altre assicurazioni dirette..... 2110
			Premi per riassicurazioni 2120
			Indennizzi per riassicurazioni..... 2130
			Servizi assicurativi ausiliari 2140
			Servizi finanziari..... 2150
			Servizi informatici..... 2160
			Servizi di informazione di agenzie di stampa..... 2170
			Altri servizi di informazione 2180
			Compensi per l'uso della proprietà intellettuale 2195
			Compravendita di attività intangibili 2210
			Merchanting - acquisti e rivendite contestuali..... 2220
			Merchanting - acquisti di beni non rivenduti nello stesso periodo 2230
			Merchanting - rivendite di beni con acquisto in periodo precedente..... 2240
			Servizi legati al commercio 2250
			Riparazioni di beni mobili..... 2260
			Lavorazioni con vendita nel paese di lavorazione e/o in paesi terzi 2270
			Bunkeraggi e provviste di bordo 2280
			Leasing operativo 2290
			Servizi legali..... 2300
			Servizi contabili, di auditing e di consulenza fiscale e contabile..... 2310
			Consulenza manageriale ed imprenditoriale e servizi di pubbl. rel..... 2320
			Servizi pubblicitari, ricerche di mercato e sondaggi di opinione 2330
			Servizi di ricerca e sviluppo 2341
			Acquisto/Vendita di diritti di proprietà derivanti da ricerca e sviluppo..... 2342
Altri servizi di ricerca e sviluppo 2343			
Servizi di architettura 2351			
Servizi di ingegneria 2352			
Altri servizi scientifici e tecnici..... 2353			
Trattamento rifiuti e disinquinamento..... 2360			
Servizi agricoli..... 2370			
Servizi estrattivi e minerari..... 2380			
Altri servizi alle imprese non inclusi altrove 2390			
Servizi tra imprese collegate non inclusi altrove 2400			
Servizi audiovisivi ed altri servizi collegati 2410			
Servizi per l'istruzione 2420			
Servizi per la salute..... 2430			

MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4' 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	LUNGH CAMP O	CODIFICHE
			Servizi culturali e ricreativi 2441 Altri servizi personali 2442 Beni e servizi forniti ad ambasciate e consolati stranieri..... 2450 Beni e servizi forniti ad unità militari straniere 2460 Beni e servizi forniti ad altre entità governative straniere 2470 Imposte in conto capitale 2478 Contributi agli investimenti 2479 Altri trasferimenti unilaterali in conto capitale..... 2480 Cancellazione del debito 2481 Imposte sui prodotti 2483 Imposte sulla produzione 2484 Imposte sui redditi e sul patrimonio..... 2485 Contributi ai prodotti 2486 Contributi alla produzione 2487 Affitto di risorse naturali..... 2488 Altri trasferimenti unilaterali correnti..... 2490 Salari e stipendi..... 2500
Portafoglio contabile	01014	3	attività finanziarie di negoziazione..... 501 attività finanziarie valutate al fair value..... 502 attività finanziarie disponibili per la vendita 503 attività finanziarie detenute sino alla scadenza 504 crediti verso banche 505 crediti verso clientela..... 506 crediti..... 516 attività non correnti e gruppi di attività in via di dismissione..... 507 gruppi di attività in via di dismissione 517 passività finanziarie di negoziazione 508 passività finanziarie valutate al fair value 509 debiti verso banche 510 debiti verso clientela..... 511 titoli in circolazione..... 512 passività associate a singole attività e gruppi di attività in via di dismissione 513 derivati di copertura..... 515 partecipazioni sottoposte a influenza notevole 519 partecipazioni sottoposte a controllo congiunto 520 partecipazioni sottoposte a controllo esclusivo 521 Codifica valida per le voci da 58446 a 58450: - portafoglio di negoziazione di vigilanza 550 - portafoglio bancario 553
Servizio in contropartita	01175	4	esecuzione di ordini per conto del cliente 103 gestione di portafogli 104 non applicabile 770

MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4' 'W')

VARIABLE DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	LUNGH. CAMPO	CODIFICHE
Natura attività sottostante dei contratti derivati	01016	3	DERIVATI FINANZIARI - titolo di debito e tassi di interesse 207 - titoli di capitale e indici azionari 208 - valute e oro 209 - quote di OICR 205 - merci 211 - altri 212 DERIVATI CREDITIZI - derivati su crediti su un singolo soggetto ("single name") 201 - derivati su crediti su più soggetti: ("basket") 202
Tipologia esposizione	01017	6	- senior 550005 - mezzanine 550006 - junior 550007
Tipologia di attività finanziaria	00556	3	- titoli di debito 203 - titoli di capitale 204 - quote di oicr 205 - finanziamenti 206

MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4' 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	LUNGH CAMP O	CODIFICHE
Tipo garanzia	00352	3	<p>Codifica valida per le voci 58352, 58354, 58356:</p> <ul style="list-style-type: none"> - garanzie reali e finanziarie..... 82 - garanzie personali 59 - derivati creditizi 83 <p>Codifica valida per la voce 40728:</p> <p>Garanzie reali</p> <ul style="list-style-type: none"> - pegni su depositi di contante 70 - pegni su titoli 71 - pegni su altri valori 76 - ipoteche su immobili 12 - immobili oggetto di operazioni di leasing finanziario 73 - altre garanzie reali 77 <p>Garanzie personali: derivati di credito (diversi da CLN)</p> <ul style="list-style-type: none"> - governi e banche centrali 84 - altri enti pubblici 85 - banche 86 - società finanziarie 87 - società di assicurazione 88 - imprese non finanziarie 89 - altri soggetti 90 <p>Garanzie personali: derivati di credito (credit-link notes – CLN) 72</p> <p>Garanzie personali: crediti di firma</p> <ul style="list-style-type: none"> - governi e banche centrali 91 - altri enti pubblici 92 - banche 93 - società finanziarie 94 - società di assicurazione 95 - imprese non finanziarie 96 - altri soggetti 97 <p>Non garantito 98</p> <p>Codifica valida per le voci 40730, 40731, 40732, 40734:</p> <ul style="list-style-type: none"> - garanzia reale 51 - garanzia personale di Stati e di altri enti pubblici 52 - garanzia personale di banche 53 - garanzie di amministrazioni centrali italiane* 46 - garanzie di amministrazioni locali italiane* 47 - garanzie di enti di previdenza e assistenza italiani* 48 - garanzie di amministrazioni pubbliche estere* 11 - garanzia personale di imprese non bancarie 54 - garanzia personale di altri soggetti (famiglie consumatrici e istituzioni sociali private) 55 - senza garanzia 98 <p>(*) i valori entreranno in vigore a partire dal 01.01.2012</p>
Tipo servicer	01185	5	<p>Codifica valida per le voci 58202 e 58204:</p> <ul style="list-style-type: none"> - banca originator 20097 - altre banche residenti 20098 - intermediari finanziari ex art. 107 TUB 20099 - soggetti esteri 20102

MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4' 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	LUNGH CAMP O	CODIFICHE
Numero operazione	00914	5	E' rappresentato mediante codici assegnati dalla Banca d'Italia
Tipo contratto	04005	3	- non rilevante 170 - acquisto immobili – abitazioni famiglie consumatrici: non rinegoziato..... 171 - acquisto immobili – abitazioni famiglie consumatrici: rinegoziato..... 172 - acquisto immobili – abitazioni famiglie consumatrici: nuovi contratti 173 - acquisto immobili – abitazioni famiglie consumatrici: surroghe 174 - acquisto immobili – abitazioni famiglie consumatrici: sostituzioni 175
Fascia scaduto	01216	3	- da 1 giorno a 90 gg..... 398 - da oltre 90 gg. a 180 gg..... 399 - da oltre 180 gg. a 1 anno..... 400 - oltre 1 anno..... 403
Causale trattamento	01071	3	- Interruzione di collegamento..... 636 - Trattamento cartaceo..... 637 - Altro 638
Oggetto dei reclami	01217	5	- Finanziamenti 206 - Raccolta 213 - Strumenti e servizi di pagamento 214 - Segnalazioni in CAI o sistemi di informazioni creditizie 215 - Altro 216
Tipo crediti	04120	3	- Crediti temporaneamente inibiti 49 - Crediti non inibiti 50

MATRICE DEI CONTI (base informativa 'LD')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	CODIFICHE
Data inizio status	Data di ingresso in default della posizione o data del passaggio ad uno stadio successivo di default rispetto al quello iniziale.
Data fine status	Data di chiusura della posizione o data immediatamente precedente l'eventuale passaggio ad uno stadio successivo di default rispetto a quello iniziale.
Fascia temporale	Data di manifestazione dei flussi di cassa.
Forma tecnica	<p>POSIZIONI CHIUSE SUCCESSIVAMENTE AL 31 DICEMBRE 2013</p> <ul style="list-style-type: none"> - Mutui ipotecari 840 - Mutui diversi da ipotecari..... 841 - Carte di credito 815 - Prestiti personali e cessioni del quinto 842 - Credito al consumo :finanziamenti finalizzati 858 - Leasing finanziario immobiliare 843 - Leasing finanziario strumentale 844 - Leasing finanziario targato 845 - Leasing finanziario energy 846 - Leasing finanziario: altro 847 - Factoring pro-solvendo..... 34 - Factoring pro-soluto: acquisti di crediti deteriorati..... 834 - Factoring pro-soluto: altro 835 - Acquisto di crediti deteriorati 852 - Specialised lending 848 - Altri finanziamenti: garanzie concesse escusse..... 854 - Altri finanziamenti : derivati scaduti 853 - Altri finanziamenti a breve termine 849 - Altri finanziamenti a medio e lungo termine 850 - Titoli di debito 203 - Crediti di firma: connessi con operazioni di natura commerciale 856 - Crediti di firma :connessi con operazioni di natura finanziaria 857 - Impegni 859 <p>SOFFERENZE ANTECEDENTI AL 1° GENNAIO 2008</p> <ul style="list-style-type: none"> - Mutui ipotecari 840 - Leasing finanziario immobiliare 843 - Leasing finanziario strumentale 844 - Leasing finanziario targato 845 - Leasing finanziario energy 846 - Leasing finanziario: altro 847 - Factoring pro-solvendo..... 34 - Factoring pro-soluto: acquisti di crediti deteriorati..... 834 - Factoring pro-soluto: altro 835 - Acquisto di crediti deteriorati 852 - Credito al consumo 527 - Altro: garanzie concesse escusse..... 854 - Altro: altre esposizioni 855

MATRICE DEI CONTI (base informativa 'LD')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	CODIFICHE
	POSIZIONI CHIUSE ENTRO LA DATA DEL 31 DICEMBRE 2013 <ul style="list-style-type: none"> - Mutui ipotecari..... 840 - Leasing finanziario immobiliare..... 843 - Leasing finanziario strumentale 844 - Leasing finanziario targato..... 845 - Leasing finanziario energy..... 846 - Leasing finanziario: altro 847 - Factoring pro-solvendo 34 - Factoring pro-soluto: acquisti di crediti deteriorati 834 - Factoring pro-soluto: altro 835 - Acquisto di crediti deteriorati..... 852 - Credito al consumo 527 - Altro: garanzie concesse escusse 854 - Altro: altre esposizioni..... 855
Tipo garanzia	<ul style="list-style-type: none"> - Non garantito 98 - Pegno su deposito di contante..... 70 - Pegno su titoli 71 - Pegno su altri valori 76 - Ipoteca 12 - Altre garanzie reali 127 - Garanzie personali rilasciate da Stati o da altri enti pubblici..... 52 - Garanzie personali di banche 86 - Garanzie personali di intermediari finanziari: <ul style="list-style-type: none"> - confidi..... 128 - altri..... 129 - Garanzie personali di altri soggetti..... 130 - Derivati su crediti 83 - Multigarantito: garanzie reali + personali 131 - Multigarantito: più garanzie personali 132 - Multigarantito: più garanzie reali 118 - Altro..... 133 - Dati non ripartibili 777
Grado di copertura delle garanzie	<ul style="list-style-type: none"> - Inferiore a 1..... 260 - Uguale o superiore a 1 e inferiore a 1,5..... 261 - Uguale o superiore a 1,5 e inferiore a 2..... 262 - Uguale o superiore a 2..... 263 - Dati non ripartibili 777
Tipologia chiusura posizione	<ul style="list-style-type: none"> - Cessione pro-soluto: a società appartenenti al gruppo..... 1000 - Cessione pro-soluto: a soggetti terzi..... 1008 - Chiusura della posizione senza perdite 1009 - Accordo tra le parti..... 1002 - Procedure fallimentari 1003 - Procedure esecutive 1004 - Recupero da beni ex leasing 1005 - Passaggio a perdita 1006 - Ritorno in bonis 1007 - Escussione della garanzia 1010 - Utilizzo linea di credito 1012 - Incomplete workout..... 1011 - Dati non ripartibili 7777

MATRICE DEI CONTI (base informativa 'LD')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	CODIFICHE
Portafoglio regolamentare	<p>METODOLOGIA STANDARDIZZATA:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Amministrazioni centrali e banche centrali 51 - Intermediari vigilati 52 - Enti territoriali 53 - Enti senza scopo di lucro ed enti del settore pubblico 55 - Banche multilaterali di sviluppo 56 - Organizzazioni internazionali 57 - Imprese e altri soggetti 58 - Esposizioni al dettaglio 59 - Esposizioni a breve termine verso imprese 60 - Esposizioni verso organismi di investimento collettivo del risparmio (O.I.C.R.) 61 - Esposizioni garantite da immobili 62 - Esposizioni sotto forma di obbligazioni bancarie garantite 63 - Esposizioni scadute 64 - Esposizioni ad alto rischio 65 - Altre esposizioni 79 - Dati non ripartibili 77 <p>METODOLOGIA IRB:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Amministrazioni centrali e banche centrali 51 - Intermediari vigilati e altri soggetti: Intermediari vigilati 52 - Intermediari vigilati e altri soggetti: Enti pubblici 70 - Intermediari vigilati e altri soggetti: Altri 71 - Esposizioni verso o garantite da imprese: Finanziamenti Specializzati 72 - Esposizioni verso o garantite da imprese: PMI 66 - Esposizioni verso o garantite da imprese: Altre imprese 67 - Esposizioni al dettaglio: Esposizioni garantite da immobili residenziali: PMI 73 - Esposizioni al dettaglio: Esposizioni garantite da immobili residenziali: persone fisiche 74 - Esposizioni al dettaglio: Esposizioni rotative al dettaglio qualificate 75 - Esposizioni al dettaglio: Altre esposizioni al dettaglio: PMI 76 - Esposizioni al dettaglio: Altre esposizioni al dettaglio: persone fisiche 78 - Crediti commerciali acquistati: rischio di diluizione 80 - Finanziamenti specializzati: slotting criteria 81 - Trattamento alternativo delle ipoteche immobiliari 82 - Rischio di regolamento: esposizioni per transazioni non DVP con fattori di ponderazione regolamentari 83 - Altre attività 69 - Dati non ripartibili 77
Codice censito	Codice identificativo attribuito dall'Anagrafe dei soggetti della Banca d'Italia.
Progressivo transazione	Codice numerico progressivo per ciascuna controparte debitrice attribuito dall'intermediario a ciascuna transazione.
Provenienza precedente scaduto	<ul style="list-style-type: none"> - Si 1 - No 2

MATRICE DEI CONTI (base informativa 'LD')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	CODIFICHE
Status inizio	Sofferenza 551000 Incagli 550002 Ristrutturate 550014 Scadute e/o confinanti deteriorate 550016 Sofferenze già incomplete workout 550026
Status fine	Sofferenza 551000 Incagli 550002 Crediti in bonis 550010 Ristrutturate 550014 Scadute e/o confinanti deteriorate 550016 Incomplete workout 550027

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA CONSOLIDATA (base informativa 'M')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	Lungh. campo	CODIFICHE
Residenza	-	-	<p>Ai fini della classificazione va assunta la definizione vigente nell'ambito della disciplina valutaria italiana. L'informazione è richiesta nella parte fissa del record "movimento".</p> <ul style="list-style-type: none"> - rapporti con soggetti residenti in Italia 1 - rapporti con soggetti non residenti in Italia 2
Divisa	-	-	<p>L'informazione è richiesta nella parte fissa del record "movimento". I codici da utilizzare sono:</p> <ul style="list-style-type: none"> - euro 1 - altre valute 2
Durata	-	-	<p>L'informazione e' richiesta nella parte fissa nel record "movimento". Va utilizzato per convenzione il codice "00" (due volte zero).</p>
Sottosistema di rilevazione	02029	5	<p>Tale parametro di disaggregazione consente di individuare il sottosistema cui e' riferita l'informazione</p> <p>A) Dati consolidati</p> <ul style="list-style-type: none"> - Gruppo Bancario: banche e società strumentali residenti 1 - Gruppo Bancario: banche e società strumentali non residenti 2 - Gruppo Bancario: società finanziarie residenti 3 - Gruppo Bancario: società finanziarie non residenti 4 - Gruppo Bancario: intero (1+2+3+4) 5 - Altre società incluse nel consolidamento: società assicurative residenti 31 - Altre società incluse nel consolidamento: società assicurative non residenti 32 - Altre società incluse nel consolidamento: banche residenti 33 - Altre società incluse nel consolidamento: banche non residenti 34 - Altre società incluse nel consolidamento: società finanziarie residenti 35 - Altre società incluse nel consolidamento: società finanziarie non residenti 36 - Altre società incluse nel consolidamento: altre società residenti 37 - Altre società incluse nel consolidamento: altre società non residenti 38 - Altre società incluse nel consolidamento: totale (31+32+33+34+35+36+37+38) 100 - Totale Gruppo (5+100) 101 <p>B) Dati nominativi</p> <ul style="list-style-type: none"> - Gruppo bancario: banche residenti 15 - Gruppo bancario: banche non residenti 16 - Gruppo bancario: società finanziarie residenti 13 - Gruppo bancario: società finanziarie non residenti 14
Sottosistema di appartenenza della controparte	01013	5	<p>L'informazione è richiesta nelle voci riferite ai rapporti tra gruppo bancario e altre imprese incluse nel consolidamento (voci 36383, 36385, 36391 e 36393); i valori richiesti sono:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Altre società incluse nel consolidamento: società assicurative residenti 31 - Altre società incluse nel consolidamento: società assicurative non residenti 32 - Altre società incluse nel consolidamento: banche residenti 33 - Altre società incluse nel consolidamento: banche non residenti 34 - Altre società incluse nel consolidamento: società finanziarie residenti 35 - Altre società incluse nel consolidamento: società finanziarie non residenti 36 - Altre società incluse nel consolidamento: altre società residenti 37 - Altre società incluse nel consolidamento: altre società non residenti 38 - Altre società incluse nel consolidamento: totale (31+32+33+34+35+36+37+38) 100

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA CONSOLIDATA (base informativa 'M')

VARIABILI DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	Lungh. campo	CODIFICHE
Soggetto di riferimento	01165	13	<p>Per i dettagli sulle modalità di compilazione di tale variabile cfr. quanto detto per le informazioni nominative per la matrice dei conti.</p> <p>Tale attributo consente di individuare il soggetto a cui le informazioni si riferiscono. Nel caso in cui le informazioni si riferiscano a dati consolidati (Sottosistemi di rilevazione 1-5 e 31-101), andrà indicato il codice dell'ente segnalante; allorquando la segnalazione si riferisca alle singole società estere appartenenti al gruppo bancario (Sottosistemi di rilevazione 14 o 16), andrà indicato il codice di queste ultime.</p> <p>Per quanto concerne i rapporti tra le imprese del gruppo bancario (voce 36381), tale variabile individua la controparte "attiva" secondo le istruzioni fornite nella Circolare 115.</p>
INFORMAZIONI NOMINATIVE Codice Censito di tipo B	01172	13	<p>Per i dettagli sulle modalità di compilazione di tale variabile cfr. quanto detto per le informazioni nominative per la matrice dei conti.</p> <p>Tale attributo è richiesto esclusivamente per i rapporti tra le imprese del gruppo bancario (voce 36381) e consente di individuare la controparte "passiva" secondo le istruzioni fornite nella Circolare 115.</p>
Vita residua delle operazioni con riferimento alla data di revisione dei rendimenti (B)	00042	3	<p>Codifica valida per la sottosezione "3.5 Vita residua: Rischio di tasso di interesse":</p> <ul style="list-style-type: none"> - a vista e a revoca..... 010 - da oltre 1 giorno a 7 giorni 025 - da oltre 7 giorni a 1 mese 035 - da oltre 1 mese a 3 mesi 040 - da oltre 3 mesi a 6 mesi..... 050 - da oltre 6 mesi a 1 anno 060 - da oltre 1 anno a 18 mesi 070 - da oltre 18 mesi a 2 anni 080 - da oltre 2 anni a 3 anni 160 - da oltre 3 anni a 4 anni 170 - da oltre 4 anni a 5 anni 180 - da oltre 5 anni a 7 anni 310 - da oltre 7 anni a 10 anni 330 - da oltre 10 anni a 15 anni 430 - da oltre 15 anni a 20 anni 460 - oltre 20 anni 490 - irredimibile 903 - durata indeterminata 900
Vita residua delle operazioni (A)	00040	3	<p>Codifica valida per la sottosezione "3.5 Vita residua: Rischio di liquidità":</p> <ul style="list-style-type: none"> - A vista e a revoca:..... 010 - oltre 1 giorno a 7 giorni 025 - da oltre 7 giorni a 15 giorni 041 - da oltre 15 giorni a 1 mese 042 - da oltre 1 mese a 2 mesi 043 - da oltre 2 mesi a 3 mesi 044 - da oltre 3 mesi a 6 mesi 050 - da oltre 6 mesi a 12 mesi 060 - da oltre 12 mesi fino a 18 mesi 070 - da oltre 18 mesi fino a 24 mesi 080 - da oltre 2 anni a 3 anni 160 - da oltre 3 anni a 4 anni 170 - da oltre 4 anni a 5 anni 180 - oltre 5 anni 300 - irredimibile 903 - durata indeterminata 900

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA CONSOLIDATA (base informativa 'M')

VARIABLE DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	Lungh. campo	CODIFICHE
Indicatore di quotazione	00552	3	- quotati in mercati regolamentati attivi 021 - quotati in mercati regolamentati non attivi 022 - quotati in altri mercati attivi 023 - non quotati 005 - in corso di quotazione 004
Codice raggruppamento derivati	00551	7	Derivati finanziari: - contratti derivati su titoli di debito e tassi di interesse 200800 - contratti derivati su titoli di capitale e indici azionari 200810 - contratti derivati su valute e oro 200830 - contratti derivati su merci 200844 - altri sottostanti 200845 - non applicabile 777777
Natura del contratto derivato	00940	3	- Incorporato in altri strumenti finanziari 001 - Altri contratti derivati 002
Portafoglio contabile	01014	3	- attività finanziarie di negoziazione 501 - attività finanziarie valutate al fair value 502 - attività finanziarie disponibili per la vendita 503 - attività finanziarie detenute sino alla scadenza 504 - crediti verso banche 505 - crediti verso clientela 506 - crediti 516 - attività materiali 514 - attività non correnti e gruppi di attività in via di dismissione 507 - gruppi di attività in via di dismissione 517 - passività finanziarie di negoziazione 508 - passività finanziarie valutate al fair value 509 - debiti verso banche 510 - debiti verso clientela 511 - titoli in circolazione 512 - passività associate a singole attività e gruppi di attività in via di dismissione 513 - passività associate a gruppi di attività in via di dismissione 518 - derivati di copertura 515 Codifica valida per le voci 36262, 36264, 36266, 36268, 36270: - portafoglio di negoziazione di vigilanza 550 - portafoglio bancario - di copertura 551 - portafoglio bancario - altri derivati 552 Codifica valida per le voci da 36400 a 36404: - portafoglio di negoziazione di vigilanza 550 - portafoglio bancario 553
Tipo garanzia	00352	3	Codifica valida per la voce 36239: Garanzie reali - pegni su depositi di contante 70 - pegni su titoli 71 - pegni su altri valori 76 - ipoteche su immobili 12 - immobili oggetto di operazioni di leasing finanziario 73 - altre garanzie reali 77 Garanzie personali: derivati di credito (diversi da CLN) - governi e banche centrali 84 - altri enti pubblici 85

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA CONSOLIDATA (base informativa 'M')

VARIABLE DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	Lungh. campo	CODIFICHE
			- banche..... 86 - società finanziarie..... 87 - società di assicurazione 88 - imprese non finanziarie 89 - altri soggetti 90 Garanzie personali: derivati di credito (credit-link notes – CLN) 72 Garanzie personali: crediti di firma - governi e banche centrali 91 - altri enti pubblici..... 92 - banche..... 93 - società finanziarie..... 94 - società di assicurazione 95 - imprese non finanziarie 96 - altri soggetti 97 Non garantito..... 98
Codice valuta	00007	3	Unità di conto in cui sono espressi i fenomeni segnalati. I codici sono attribuiti dalla Banca d'Italia – Servizio RST.
Tipo tasso	00113	2	- tasso fisso 83 - tasso indicizzato 84
Tipologia esposizione	01017	6	- senior 550005 - mezzanine..... 550006 - junior 550007
Natura attività sottostante dei contratti derivati	01016	3	DERIVATI CREDITIZI - derivati su crediti su un singolo soggetto ("single name")..... 201 - derivati su crediti su più soggetti: ("basket") 202
Tipologia di attività finanziaria	00556	3	- titoli di debito 203 - titoli di capitale 204 - quote di oicr 205 - finanziamenti..... 206
Stato di residenza della controparte	00016	3	Viene utilizzata la codifica predisposta e gestita dalla Banca d'Italia - Servizio RST. Per ciò che concerne i rapporti con gli Organismi Internazionali, devono essere utilizzati gli specifici codici assegnati ai suddetti organismi.
Stato emittente	01215	5	- Italia..... 00086 - Paesi UEM diversi dall'Italia..... 00703 - Paesi UE non UEM 00704 - Paesi europei non UE 59001 - Asia 40220 - Africa 40230 - Oceania..... 40250 - America del Nord 40341 - America Centrale 40342 - America del Sud..... 40343 - Non classificabile 07777

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA CONSOLIDATA (base informativa 'M')

VARIABLE DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	Lungh. campo	CODIFICHE
Qualità del credito	00522	7	- In bonis..... 550010
			- Deteriorate 550009
In bonis/ deteriorate	00522	7	Codifiche da utilizzare per la voce 36333 "Finanziamenti ripartiti per forma tecnica" :
			- Sofferenza..... 551000
			- Incagli..... 550002
			- Ristrutturate..... 550014
			- Scadute e/o sconfinanti deteriorate approccio per debitore 550022
			- Scadute e/o sconfinanti deteriorate approccio per transazione 550023
			- Altre attività 550019
			Codifiche da utilizzare per le "informazioni di vita residua":
			- Sofferenza..... 551000
			- Incagli..... 550002
			- Ristrutturate..... 550014
			- Scadute e/o sconfinanti deteriorate..... 550016
			- Altre attività 550019
			Tipo cessione/ Attività proprie/ Cedute non cancellate
- Cedute non cancellate a fini prudenziali e di bilancio 097			
- Cedute non cancellate solo a fini di bilancio 096			
- Passività a fronte di attività cedute e non cancellate 118			
- Altre 119			
Accordo compensazione	01169	1	- Sì 1
			- No..... 2
Gerarchia del fair value	01190	1	- livello 1 1
			- livello 2 2
			- livello 3 3
Tipologia valutazione	01191	3	- valutazione al costo 200
			- valutazione al valore rivalutato 201
Tipo strumento finanziario	01192	4	- strum. strutturati 1511
			- altri 1512
Tipo scaduto	01193	4	- soggetto debitore 1501
			- singola transazione 1502

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',
'LY', '1' e 'L1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	Lungh. campo	CODIFICHE
Durata	-	-	L'informazione è richiesta nella parte fissa del record "movimento". - Imprecisabile o irrilevante..... 3
Residenza	-	-	L'informazione è richiesta nella parte fissa del record "movimento". Fatto salvo quanto di seguito specificato, va utilizzato per convenzione il codice "1". Per le voci 59102 e 34102 i codici da utilizzare sono: - rapporti con soggetti residenti in Italia 1 - rapporti con soggetti non residenti in Italia 2
Divisa	-	-	L'informazione è richiesta nella parte fissa del record "movimento". Va utilizzato per convenzione il codice "1".
Appartenenza patrimonio	01020	3	- Aggregato patrimoniale di riferimento società consolidata 112 - Aggregato patrimoniale di riferimento società consolidata - pertinenza terzi 113 - Strumenti di capitale e relativi sovrapprezzi di emissione, utili non distribuiti, altre componenti di CE complessivo accumulate e altre riserve della società consolidata..... 114 - Aggregato patrimoniale di riferimento società consolidante – pertinenza terzi 115
Approccio	01255	3	- Approccio semplificato..... 321 - Approccio delta-plus: rischio gamma..... 322 - Approccio delta-plus: rischio vega 323 - Approccio di scenario 324 - Non applicabile 777
Assimilate Amministrazioni Centrali	01225	1	- Sì 1 - No 2
Attività economica: ramo	01118	5	Deve essere utilizzata la classificazione delle attività economiche ATECO 2007 predisposta dall'ISTAT (il livello di classificazione richiesto è coincidente con quello della classificazione NACE Rev. 2).. Gli schemi prevedono la segnalazione di quelli corrispondenti alle Divisioni ("D" negli schemi) e delle Sezioni ("S" negli schemi). I valori previsti in tale classificazione sono illustrati nelle istruzioni relative alla classificazione della clientela divulgate dalla Banca d'Italia (Circolare n. 140 dell'11 febbraio 1991). Campo alfanumerico con allineamento a sinistra. La parte non utilizzata del campo deve contenere il carattere "blank". Il valore non applicabile corrisponde al valore '00000' (5 zeri).
Cartolarizzazione – posizioni fuori bilancio	01244	3	- Garanzie con carattere di sostituti del credito 643 - IRS/CRS..... 644 - Linee di liquidità idonee 645 - Altro..... 646 - Non applicabile 770
Categoria esposizione	01209	3	- Esposizioni che costituiscono grande rischio e non sono detenute verso controparte non bancaria, non finanziaria e non assicurativa 122 - Prime 20 esposizioni più rilevanti che non costituiscono grande rischio né sono detenute nei confronti di controparti non bancarie, non finanziarie e

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',
'LY', '1' e 'L1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	Lungh. campo	CODIFICHE
			non assicurative..... 123 - Esposizioni detenute verso controparte non bancaria, non finanziaria e non assicurativa che non costituiscono grande rischio né sono ricomprese tra le 20 esposizioni più rilevanti..... 124 - Esposizioni verso controparte non bancaria, non finanziaria e non assicurativa che costituiscono anche un grande rischio..... 125 - Esposizioni verso controparte non bancaria, non finanziaria e non assicurativa che rientrano anche tra le 20 esposizioni più rilevanti..... 126
Categoria intermediario	01226	2	- Attività bancaria al dettaglio, commerciale e di investimento (Banca universale) 36 - Attività bancaria al dettaglio e commerciale..... 37 - Attività bancaria di investimento 38 - Attività bancaria specializzata 39
CCP qualificata	01230	1	- Sì..... 1 - No 2 - Non applicabile 7
Classe di merito creditizio	01134	3	Numero ordinale che rappresenta la classe di merito creditizio. L'opzione "non applicabile" corrisponde al codice 0.
Classe di merito di credito	01251	3	<u>Cartolarizzazioni – metodologia standardizzata</u> - CQS1 128 - CQS2 129 - CQS3 130 - CQS4 131 - 1250% - con rating [altro CQS] 31 - 1250% - privo di rating 32 - <i>Look-through</i> – second loss in ABCP 33 - <i>Look-through</i> 34 - Approccio della valutazione interna (ABCP) 127 - Non applicabile 77 <u>Cartolarizzazioni – metodologia IRB</u> - CQS1 (CQS1 breve termine) 181 - CQS2 129 - CQS3 130 - CQS4 (CQS2 breve termine) 182 - CQS5 132 - CQS6 133 - CQS7 (CQS3 breve termine) 183 - CQS8 135 - CQS9 136 - CQS10 137 - CQS11 138 - 1250% - con rating [altro CQS] 31 - Metodo formula di vigilanza 149 - 1250% - privo di rating 32 - <i>Look-through</i> 34 - Approccio della valutazione interna (ABCP) 127 - Non applicabile 77 Rischio di liquidità:

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',
'LY', '1' e 'L1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	Lungh. campo	CODIFICHE
			- CQS1 128 - CQS2 129 - CQS3 130 - Non applicabile 77
Classe di merito di credito originaria	01235	3	<u>Cartolarizzazioni – metodologia standardizzata</u> - CQS1 128 - CQS2 129 - CQS3 130 - CQS4 131 - Altro e privo di rating 168 <u>Cartolarizzazioni – metodologia IRB</u> - CQS1 (CQS1 breve termine) 181 - CQS2 129 - CQS3 130 - CQS4 (CQS2 breve termine) 182 - CQS5 132 - CQS6 133 - CQS7 (CQS3 breve termine) 183 - CQS8 135 - CQS9 136 - CQS10 137 - CQS11 138 - Altro e privo di rating 168
Classe di ponderazione	01239	3	- Classe A 175 - Classe B 176 - Classe C 177 - Classe D 178 - Classe E 179
Codice valuta	00007	3	Unità di conto in cui sono espressi i fenomeni segnalati. I codici sono attribuiti dalla Banca d'Italia - Servizio RST. Voci 59150 e 34150: valute segnalabili (utilizzando il corrispondente codice numerico): EUR (242), ALL (47), BGN (262), CZK (223), DKK (7), EGP (70), GBP (2), HUF (153), ISK (62), JPY (71), LVL (219), LTL (221), MKD (236), NOK (8), PLN (237), RON (270), RUB (244), RSD (274), SEK (9), CHF (3), TRY (267), UAH (241), USD (1) L'opzione "Altro" corrisponde al codice 823 L'opzione "Totale" corrisponde al codice 820 Voci 59578 e 34578: valute segnalabili (utilizzando il corrispondente codice numerico): EUR (242), ALL (47), ARS (216), AUD (109), BRL (234), BGN (262), CAD (12), CZK (223), DKK (7), EGP (70), GBP (2), HUF (153), JPY (71), LVL (219), LTL (221), MKD (236), MXN (222), PLN (237), RON (270), RUB (244), RSD (274), SEK (9), CHF (3), TRY (267), UAH (241), USD (1), ISK (62), NOK (8), HKD (103), TWD (143), NZD (113), SGD (124), KRW (119), CNY (144) L'opzione "Altro" corrisponde al codice 824 L'opzione "Totale" corrisponde al codice 820
Clausola di rimborso	01237	1	- Sì 1 - No 2

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',
'LY', '1' e 'L1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	Lungh. campo	CODIFICHE
anticipato			- Non applicabile 7
Codice interno operazione di cartolarizzazione	01248	10	Campo alfanumerico con allineamento a sinistra. La parte non utilizzata del campo deve contenere il carattere "blank". Codice alfanumerico interno utilizzato dall'intermediario per identificare l'operazione di cartolarizzazione.
Condizioni di mercato	02027	1	- Si 1 - No 2
Conformità alla normativa	01242	1	- Si 1 - No 2 - Non applicabile 7
Contributo di garanzia verso CCP	01229	1	- Si 1 - No 2 - Non applicabile 7
Data di creazione	01258	8	Data contabile di riferimento della valutazione. Va indicata nel formato AAAAMMGG. Ove l'attributo non risulti applicabile, valorizzare il campo con il codice 77777777.
Data di scadenza finale legale	01260	8	Va indicata nel formato AAAAMMGG.
Deflussi/ Afflussi	04115	3	- Deflussi 634 - Afflussi 635
Delibera quadro	02023	1	- Si 1 - No 2
Deposito garantito	01246	1	- Si 1 - No 2
Detrazione	01236	1	- Si 1 - No 2 - Non applicabile 7
Esposizione diretta/ indiretta	01224	3	- Diretta 166 - Indiretta 167 - Non applicabile 77
Esposizione rotativa	01238	3	- Si 647 - No 648 - Altro 649
Eventi di perdita	01025	3	- Frode interna 111 - Frode esterna 112 - Rapporto di impiego e sicurezza sul lavoro 113 - Clientela, prodotti e prassi professionali 114 - Danni da eventi esterni 115 - Interruzioni dell'operatività e disfunzioni dei sistemi 116 - Esecuzione, consegna e gestione dei processi 117 - Totale eventi di perdita 118
Fattore di conversione	01133	3	- 0% - rischio basso 1 - 20% - rischio medio-basso 2 - 50% - medio 3 - 100% - pieno 10

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',
'LY', '1' e 'L1')**

VARIABILI DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	Lungh. campo	CODIFICHE
			- non applicabile 77
			<u>Cartolarizzazioni:</u>
			- 0% 1
			- maggiore di 0% e minore o uguale al 20% 186
			- maggiore del 20% e minore o uguale al 50% 143
			- maggiore del 50% e minore o uguale al 100% 187
			- non applicabile 77
Fattore di ponderazione	01136	3	<u>Rischio di credito e di controparte - metodologia standardizzata:</u>
			- 0% 1
			- 2% 36
			- 4% 139
			- 10% 5
			- 20% 2
			- 35% 6
			- 50% 3
			- 70% 20
			- 75% 9
			- 100% 10
			- 150% 18
			- 250% 19
			- 370% 86
			- 1250% 140
			- metodologia standardizzata: altre ponderazioni 188
			- non applicabile 77
			<u>Rischio di credito e di controparte - metodologia IRB:</u>
			- 0% 1
			- 10% 5
			- 20% 2
			- 35% 6
			- 50% 3
			- 70% - con vita residua uguale o superiore a 2,5 anni 7
			- 70% - totale 20
			- 75% 9
			- 90% 40
			- 100% 10
			- 115% 17
			- 150% 18
			- 200% 4
			- 250% 19
			- Metodologia IRB: altre ponderazioni 189
			- Non applicabile 77
			<u>Voci 59534 e 36534:</u>
			- 190% 84
			- 290% 85
			- 370% 86
			- Non applicabile 77
			<u>Rischi di mercato:</u>
			- 7 -10% 47

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',
'LY', '1' e 'L1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	Lungh. campo	CODIFICHE			
Fattore di ponderazione			- 12 -18%..... 42			
			- 20-35%..... 43			
			- 40-75%..... 48			
			- 100%..... 10			
			- 150%..... 18			
			- 200%..... 4			
			- 225%..... 21			
			- 250%..... 19			
			- 300%..... 23			
			- 350%..... 30			
			- 425%..... 45			
			- 500%..... 24			
			- 650%..... 46			
			- 750%..... 25			
			- 850%..... 26			
			- 1250% - con rating..... 31			
			- 1250% - privo di rating..... 32			
			- Look-through..... 34			
			- Metodo formula di vigilanza..... 149			
			- Approccio della valutazione interna (ABCP)..... 127			
			- Altro..... 169			
			- Non applicabile..... 77			
			<u>Leva finanziaria:</u>			
			- 0%..... 1			
			- maggiore di 0% e minore/uguale a 12%..... 141			
			- maggiore di 12% e minore/uguale a 20%..... 142			
			- maggiore di 20% e minore/uguale a 50%..... 143			
			- maggiore di 50% e minore/uguale a 75%..... 44			
			- maggiore di 75% e minore/uguale a 100%..... 144			
			- maggiore di 100% e minore/uguale a 425%..... 145			
			- maggiore di 425% e minore/uguale a 1250%..... 146			
			- esposizioni in stato di default..... 147			
			- esposizioni fuori bilancio a rischio basso (CCF 0%)..... 148			
			Forma giuridica societaria	01254	4	Campo alfanumerico con allineamento a sinistra. La parte non utilizzata del campo deve contenere il carattere "blank". - Società per azioni..... SPA - Mutua/cooperativa..... COPE - altro..... VV1
			Forma tecnica	01234	3	- Totale attività di rischio per cassa..... 101 - Garanzie rilasciate e impegni a erogare fondi..... 103 - Operazioni SFT..... 104 - Contratti derivati e operazioni con regolamento a lungo termine..... 105 - Compensazione tra prodotti diversi..... 106 - Non applicabile..... 777 <u>Cartolarizzazioni:</u> - Totale attività di rischio per cassa..... 101 - Attività di rischio fuori bilancio e derivati..... 102 - Non applicabile..... 777 <u>Rischi di mercato:</u> - Attività e passività in bilancio..... 107 - Attività e passività fuori bilancio..... 108 - Derivati..... 109 - Non applicabile..... 777

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',
'LY', '1' e 'L1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	Lungh. campo	CODIFICHE
Garanzie rilasciate e impegni a erogare fondi	01232	1	- Sì 1 - No 2 - Non applicabile 7
Grado di liquidità e qualità creditizia	01223	3	- Elevatissime 172 - Elevate 173 - Altro 174 - Non applicabile 77
Identificativo della cartolarizzazione	01240	45	Campo alfanumerico con allineamento a sinistra. La parte non utilizzata del campo deve contenere il carattere "blank".
Identificativo dell'originator	01261	45	Campo alfanumerico con allineamento a sinistra. La parte non utilizzata del campo deve contenere il carattere "blank".
INFORMAZIONI NOMINATIVE:			
Codice Censito di tipo A	00212	13	Codice censito (cfr. quanto riportato per le informazioni nominative della matrice dei conti) del cliente ovvero della capogruppo per gli affidamenti concessi a gruppi di clienti connessi. In ipotesi di raggruppamento i cui componenti siano legati soltanto da "connessione economica" va segnalato il codice di uno qualunque dei soggetti componenti il raggruppamento. Per le esposizioni nei confronti di schemi di investimento, nel caso di "unknown exposure", il codice censito deve assumere il valore convenzionale 999999999427.
Codice Censito di tipo B	01172	13	
Infra-gruppo	02024	1	- Sì 1 - No 2
Interesse economico netto	1256	3	- Metodo ex CRR, art. 405(1) lettera (a) 314 - Metodo ex CRR, art. 405(1) lettera (b) 315 - Metodo ex CRR, art. 405(1) lettera (c) 316 - Metodo ex CRR, art. 405(1) lettera (d) 317 - Metodo ex CRR, art. 405(1) lettera (e) 318 - Esenzione ex CRR, art. 405(3) 319 - Non applicabile 777 - Altro 320
Linee di business	04009	3	- Servizi finanziari per l'impresa (Corporate finance) 611 - Negoziazione e vendita (Trading and sales) 612 - Servizi bancari al dettaglio (Retail banking) 613 - Servizi bancari a carattere commerciale (Commercial banking) 614 - Servizi di pagamento e regolamento (Payment and settlement) 615 - Gestioni fiduciarie (Agency services) 616 - Gestioni patrimoniali (Asset management) 617 - Intermediazione al dettaglio (Retail brokerage) 618 - Elementi d'impresa (Corporate items) 619 - Totale linee di business 629
Metodo utilizzato	01206	3	- full look through 310 - partial look through 311 - schema granulare 312 - structured-based approach 313 - Sottostanti tutti sconosciuti 000

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',
'LY', '1' e 'L1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	Lungh. campo	CODIFICHE
Metodologia applicata	01125	3	<ul style="list-style-type: none"> - Metodologia IRB – di base 152 - Metodologia IRB – avanzata 153 <p>Voci 59067 e 34067:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Metodologia standard 151 - Metodologia IRB – di base 152 - Metodologia IRB – avanzata 153 - Metodologia IRB 155 - Metodologia mista (Standard e IRB) 327 - Non applicabile 777 <p>Voci 59078 e 34078:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Metodo avanzato 333 - Metodologia standard 332 - Metodo dell'esposizione originaria 328 - Non applicabile 777 <p><u>Rischi di mercato:</u></p> <ul style="list-style-type: none"> - Metodo basato sulle fasce di scadenza 329 - Metodo basato sulle fasce di scadenza ampliato 330 - Metodo semplificato 331 <p><u>Leva finanziaria:</u></p> <ul style="list-style-type: none"> - Metodologia Standard 151 - Metodologia IRB 155 - Non applicabile 777
Metodologia di consolidamento	01222	3	<ul style="list-style-type: none"> - Filiazione consolidata integralmente 334 - Filiazione consolidata parzialmente 335 - Filiazione cui fa riferimento un sub-consolidato 336
Modalità di calcolo segnaletico	01227	3	<ul style="list-style-type: none"> - Trimestrale basata sulla media aritmetica dei 3 dati di fine mese 158 - Trimestrale basata sul valore di fine trimestre (ex art.499(3) CRR) 159
Operatività ordinaria	02020	1	<ul style="list-style-type: none"> - Si 1 - No 2
Paese del mercato di quotazione	00934	5	<p>Viene utilizzata la codifica predisposta e gestita dalla Banca d'Italia – Servizio RST.</p> <p>Voci 59568 e 34568: Paesi segnalabili (utilizzando i corrispondenti codici numerici): Austria, Belgium, Bulgaria, Cyprus, Czech Republic, Denmark, Estonia, Egypt, Finland, France, Germany, Greece, Hungary, Iceland, Ireland, Italy, Latvia, Lithuania, Liechtenstein, Luxembourg, Malta, Netherlands, Norway, Poland, Portugal, Romania, Slovakia, Slovenia, Spain, Sweden, United Kingdom, Albania, Japan, Former Yugoslav Republic of Macedonia, Russian Federation, Serbia, Switzerland, Turkey, Ukraine, USA</p> <p>L'opzione "Altro" corrisponde al codice 61013 L'opzione "Totale" corrisponde al codice 62009</p>
Parere positivo	02022	1	<ul style="list-style-type: none"> - Si 1 - No 2 - Non applicabile 7

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',
'LY', '1' e 'L1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	Lungh. campo	CODIFICHE
Parte correlata	02017	13	Per la classificazione nominativa della controparte deve essere utilizzato il "codice censito" (codice "Centrale dei rischi"). Il codice può essere richiesto attenendosi alle modalità previste dalla Circ. 139 dell'11/02/91 ("Centrale dei rischi – Istruzioni per gli intermediari creditizi"), cap. III sez. 2.
PMI	01245	1	- Sì 1 - No 2
Portafoglio di negoziazione di correlazione	1243	1	- Sì 1 - No 2
Portafoglio SA e IRB	01130	3	<p><u>Rischio di credito e di controparte - metodologia standardizzata:</u></p> <ul style="list-style-type: none"> - Amministrazioni centrali e banche centrali 51 - Intermediari vigilati 52 - Amministrazioni regionali o autorità locali 53 - Organismi del settore pubblico 156 - Banche multilaterali di sviluppo 56 - Organizzazioni internazionali 57 - Imprese e altri soggetti 58 - Esposizioni al dettaglio 59 - Esposizioni a breve termine verso imprese e intermediari vigilati 157 - Esposizioni verso organismi di investimento collettivo del risparmio (O.I.C.R.) 61 - Esposizioni garantite da immobili 62 - Esposizioni sotto forma di obbligazioni bancarie garantite 63 - Esposizioni in stato di default 158 - Esposizioni ad alto rischio 65 - Esposizioni in strumenti di capitale 159 - Altre esposizioni 185 <p><u>Rischio di credito e di controparte - metodologia IRB:</u></p> <ul style="list-style-type: none"> - Amministrazioni centrali e banche centrali 51 - Intermediari vigilati, enti pubblici e territoriali e altri soggetti 160 - Esposizioni verso o garantite da imprese: Finanziamenti specializzati 72 - Esposizioni verso o garantite da imprese: PMI 66 - Esposizioni verso o garantite da imprese: PMI cui si applica il fattore di sostegno (0,7619) 161 - Esposizioni verso o garantite da imprese: Altre imprese 67 - Esposizioni al dettaglio: Esposizioni garantite da immobili: PMI 162 - Esposizioni al dettaglio: Esposizioni garantite da immobili: PMI cui si applica il fattore di sostegno (0,7619) 163 - Esposizioni al dettaglio: Esposizioni garantite da immobili: persone fisiche 164 - Esposizioni al dettaglio: Esposizioni rotative al dettaglio qualificate 75 - Esposizioni al dettaglio: Altre esposizioni al dettaglio: PMI 76 - Esposizioni al dettaglio: Altre esposizioni al dettaglio: PMI cui si applica il fattore di sostegno (0,7619) 165 - Esposizioni al dettaglio: Altre esposizioni al dettaglio: persone fisiche 78 - Crediti commerciali acquistati: rischio di diluizione 80 - Finanziamenti specializzati: slotting criteria 81 - Trattamento alternativo delle ipoteche immobiliari 82 - Esposizioni per transazioni con regolamento non contestuale ex art.379(2) CRR, Esposizioni in strumenti n-to default prive di rating, Esposizioni residue 180

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',
'LY', '1' e 'L1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	Lungh. campo	CODIFICHE
			- Totale 184
Posizione diretta	01228	1	- Sì 1 - No 2
Prima data di chiusura prevedibile	01259	8	Va indicata nel formato AAAAMMGG.
Rilevanza	02019	1	- Sì 1 - No 2
Ruolo nella cartolarizzazione	01127	3	- Originator 101 - Investitore 102 - Sponsor 103 - Cedente 104 - Non applicabile 890 Nota. Si precisa che il cedente corrisponde al prestatore originario.
Scadenza dell'operazione di cartolarizzazione	4367	8	Data contabile di riferimento della valutazione. Va indicata nel formato AAAAMMGG.
Soggetto connesso	02018	13	Per la classificazione nominativa della controparte deve essere utilizzato il "codice censito" (codice "Centrale dei rischi"). Il codice può essere richiesto attenendosi alle modalità previste dalla Circ. 139 dell'11/02/91 ("Centrale dei rischi – Istruzioni per gli intermediari creditizi"), cap. III sez. 2. Per la segnalazione delle attività di rischio nei confronti delle relative parti correlate la variabile "codice censito soggetto connesso" è segnalata con il valore: 999999999345 Soggetto non classificabile. Per la segnalazione delle attività di rischio nei confronti dei soggetti connessi occorre segnalare il codice nominativo di tali ultimi nonché quello delle relative parti correlate.
Sottosistema di rilevazione	02029	5	- Consolidamento a fini prudenziali (CRR/CRD) 104 - Sottogruppo di liquidità 105
Stato della controparte	00016	3	Viene utilizzata la codifica predisposta e gestita dalla Banca d'Italia - Servizio RST. Per ciò che concerne i rapporti con gli Organismi Internazionali, devono essere utilizzati gli specifici codici assegnati ai suddetti organismi. Voci: 59067 e 34067: l'opzione "altro" (per il mancato superamento della soglia del 20%) corrisponde al codice 707 Voci: 59076 e 34076: Paesi segnalabili (utilizzando i corrispondenti codici numerici): Italia (86), Germania (94), "n" paese UE L'opzione "Mercati nazionali extra UE" corrisponde al codice 705 L'opzione "Totale" corrisponde al codice 500
Tempo di inadempimento	00294	2	- fino al 4° giorno lavorativo 39 - dal 5° al 15° giorno lavorativo 21 - dal 16° al 30° giorno lavorativo 22 - dal 31° al 45° giorno lavorativo 23

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',
'LY', '1' e 'L1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	Lungh. campo	CODIFICHE
			- oltre il 45° giorno lavorativo 24
Tipo di cartolariz- zazione	01126	3	- Tradizionale 604 - Sintetica 605 - Qualsiasi 607 - Non applicabile 770
Tipo di rischio	00356	3	- Titoli di debito: totale 111 - Titoli di debito: rischio generico 112 - Titoli di debito: rischio specifico 113 - Titoli di capitale: totale 114 - Titoli di capitale: rischio generico 115 - Titoli di capitale: rischio specifico 116 - Rischio di cambio 117 - Rischio di posizione in merci 118 - Rischio generico: totale 119 - Rischio specifico: totale 120 - Totale posizioni 121
Tipo garanzia	00352	3	<u>Rischio di credito e di controparte - metodologia standardizzata:</u> - Garanzie personali 59 - Derivati su crediti 56 - Garanzie reali assimilate alle personali 57 - Garanzie reali - metodo semplificato 58 - Non applicabile 777 <u>Rischio di credito e di controparte - metodologia IRB:</u> - Garanzie personali 59 - Derivati su crediti 56 - Garanzie reali assimilate alle personali 57 - Garanzie reali finanziarie 134 - Altre garanzie reali idonee: garanzie immobiliari 135 - Altre garanzie reali idonee: cessioni di crediti 136 - Altre garanzie reali idonee: altro 137 - <i>Double default</i> : garanzie personali e derivati su credito 138 - Non applicabile 777
Tipo importo	00350	3	<u>Fondi propri:</u> - Variazioni del CET1 290 - Variazioni dell'AT1 291 - Variazioni del T2 292 - Variazioni degli RWA 293 - Ammontare di base per l'applicazione delle disposizioni transitorie 294 - Ammontare degli strumenti più le relative riserve di sovrapprezzo 295 - Base per calcolare i limiti 296 - Limiti 297 - Ammontare che eccede i limiti di grandfathering 298 - Ammontare totale oggetto di grandfathering 299 - Ammontare di base per l'applicazione delle disposizioni transitorie moltiplicato per la percentuale applicabile 300 - Percentuale applicabile 301 <u>Rischio di credito e di controparte:</u> - Valore ponderato dell'esposizione 3 - Valore nominale 24 - Durata residua media (numero giorni) 76 - Posizione netta 77

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',
'LY', '1' e 'L1')**

VARIABILI DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	Lungh. campo	CODIFICHE
Tipo importo			- Valore dell'esposizione [E] 80
			- Valore corretto dell'esposizione [E*] 82
			- Equivalente creditizio di garanzie e impegni [E* x FCC] 83
			- Valore della garanzia reale al netto degli scarti prudenziali [Cvam] 85
			- Valore della garanzia personale, derivati su crediti e altre garanzie assimilate (incluse le garanzie reali alle quali si applica il metodo semplificato) al netto degli scarti prudenziali [Ga]..... 86
			- LGD media ponderata per l'esposizione al netto effetti CRM 87
			- Rettifiche di valore complessive..... 95
			- Equivalente creditizio dei contratti derivati finanziari 97
			- Perdita attesa (Expected Loss, EL) 98
			- Valore ponderato dell'esposizione ante <i>cap</i> , incrementi per <i>Due Diligence</i> e disallineamento durata 205
			- Valore ponderato dell'esposizione ante <i>cap</i> 207
			- Valore ponderato dell'esposizione ante applicazione del fattore di sostegno (0,7619) 208
			- Valore ponderato dell'esposizione connessa ai deflussi..... 211
			- Esposizione originaria [E ₀] alla data di emissione della prima <i>tranche</i> 212
			- Valore nominale complessivo <i>tranches</i> emesse..... 213
			- Esposizione originaria [E ₀]..... 214
			- Esposizione originaria al netto delle rettifiche di valore complessive [E ₁]..... 215
			- CRM: deflussi dalla classe di esposizione 216
			- CRM: afflussi alla classe di esposizione 217
			- Equivalente creditizio di garanzie e impegni [E* x FCC]: di cui connesso con esposizioni in strumenti derivati, SFT, operazioni con regolamento a lungo termine 220
			- Valore della garanzia reale al netto degli scarti prudenziali, escluse le rettifiche per disallineamento di scadenza [Cva]..... 221
			- Valore della garanzia personale, derivati su crediti e altre garanzie assimilate (incluse le garanzie reali alle quali si applica il metodo semplificato) corretti per il solo rischio di cambio [G*] 223
			- Rettifica per la volatilità all'esposizione [E*He] 224
			- Numero dei debitori..... 225
			- Scarti prudenziali [Cvam - C] 226
			- LGD: impatto CRM..... 227
			- Prezzo di liquidazione convenuto..... 228
			- Differenza di prezzo [prezzo liquidazione – valore di mercato corrente]..... 229
			- Requisito patrimoniale 230
			- Esposizione nominale di protezione di credito trattenuta o riacquistata ... 231
			- Fattore di ponderazione medio ponderato 232
			- Attività ponderate per il rischio: incremento per violazione disposizioni in materia di <i>Due Diligence</i> 233
			- Attività ponderate per il rischio: incremento per disallineamento di durata 234
			- Percentuale impegni mantenuti dall'emittente 235
			- Percentuale detenuta portafoglio cartolarizzato..... 236
			- Numero posizioni portafoglio cartolarizzato 237
			- Fattore di conversione creditizia per cartolarizzazioni rotative con clausola di rimborso anticipato..... 238
			- Esposizione originaria [E ₀] connessa con esposizioni in stato di default 239
			- Esposizione originaria [E ₀] connessa con esposizioni in stato di default dall'ultima data di riferimento segnaletica 240
			- Rettifiche specifiche 241

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',
'LY', '1' e 'L1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	Lungh. campo	CODIFICHE
Tipo importo			- Rettifiche specifiche – di cui stralci parziali 242
			- Rettifiche generiche..... 243
			- Rettifiche di valore contabili registrate su esposizioni in stato di default dall'ultima data di riferimento segnaletica..... 244
			- PD classe di merito creditizio 245
			- LGD media ponderata per l'esposizione al netto effetti CRM connessa con esposizioni in stato i default 246
			- Valore ponderato dell'esposizione ante applicazione del fattore di sostegno (0,7619) – esposizioni in stato di default..... 247
			- Perdita su crediti ipotecari fino alla soglia di riferimento..... 248
			- Perdita su crediti ipotecari fino alla soglia di riferimento: di cui valore credito ipotecario 249
			- Perdita su crediti ipotecari 250
			- Perdita su crediti ipotecari: di cui valore credito ipotecario..... 251
			- Valore a rischio..... 252
			- Numero controparti..... 253
			<u>Grandi esposizioni:</u>
			- Esposizione originaria 206
			- Valore dell'esposizione..... 209
			- Valore dell'esposizione post CRM ed esenzioni ex art. 400 CRR 210
			- Limite dei grandi rischi – percentuale 254
			- Limite dei grandi rischi – in milioni di euro..... 255
			- Valore dell'esposizione espresso come percentuale del capitale ammissibile..... 256
			- Valore dell'esposizione post CRM ed esenzioni ex art. 400 CRR espresso come percentuale del capitale ammissibile 257
			- Esposizioni detratte dai fondi propri 258
			- Valore dell'esposizione esentato ex art. 400 CRR 259
			- Riduzione del valore dell'esposizione connesso all'applicazione di tecniche CRM 260
			- Rettifiche di valore complessive 95
			<u>Rischi di mercato:</u>
			- Posizione netta 77
			- Prezzo di liquidazione convenuto 228
			- Differenza di prezzo [prezzo liquidazione – valore di mercato corrente] 229
			- Requisito patrimoniale 230
			- Fattore di ponderazione medio ponderato..... 232
			- Posizione lorda 261
			- Posizioni soggette a requisiti patrimoniali..... 262
			- Posizioni detratte dai fondi propri 263
			- <i>Due Diligence</i> – Posizione aggiuntiva ex art. 407 CRR..... 264
			- Posizione netta ponderata ante cap 265
			- Posizione netta ponderata post cap 266
			- Misura di rischio..... 267
			<u>Posizione patrimoniale consolidata:</u>
			- Requisito patrimoniale 230
			- Esposizioni ponderate per il rischio totali 268
			- Importo Fondi Propri per tipologia di <i>Tier</i> 269
			- Quota di partecipazione nel capitale della filiazione..... 270
			<u>Rischio di liquidità:</u>
			- Valore nominale..... 24
			- Valore di mercato 271

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',
'LY', '1' e 'L1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	Lungh. campo	CODIFICHE			
Tipo importo			- Valore di mercato al netto degli scarti di garanzia 272			
			- Accordato non utilizzato 273			
			- Deflusso 274			
			- Afflusso 275			
			<u>Leva finanziaria:</u>			
			- Valore ponderato dell'esposizione 3			
			- Valore contabile 21			
			- Valore nominale 24			
			- Valore dell'esposizione (inclusi FCC) 276			
			- Ammontare dei Fondi Propri 277			
			- Rapporto capitale/esposizione 278			
			- Valore contabile escludendo compensazioni di bilancio, prudenziali e della CRM 279			
			- Valore contabile al netto delle compensazioni di bilancio, prudenziali e della CRM 280			
			- SFT/CCE 281			
			- Metodo del valore di mercato: <i>add-on</i> escludendo compensazioni di bilancio, prudenziali e della CRM 282			
			- Metodo del valore di mercato: <i>add-on</i> al netto solo dei contratti di novazione e altri accordi bilaterali di compensazione 283			
			- Valore nominale: protezione acquistata e venduta sullo stesso nome 284			
			- Valore nominale: protezione acquistata e venduta sullo stesso nome e con la stessa controparte (o CCP) 285			
			- Valore nominale: protezione acquistata da CCP e venduta sullo stesso nome 286			
			- Valore nominale: protezione acquistata e venduta sullo stesso nome con scadenza della protezione maggiore o uguale a quella della protezione venduta 287			
			- Ammontare capitale contabile 288			
			- Coefficiente di inclusione 289			
			<u>Soggetti Collegati:</u>			
			- Valore non ponderato 1			
			- Valore ponderato 3			
			Tipologia controparte	00353	3	Voci 34328 e 34330
						- Banca, SIM o società soggetta a disciplina equivalente 71
						- Altro 72
						Voci 59360, 59366, 59372, 34360, 34366 e 34372:
						- Finanziaria 69
- Non finanziaria 70						
Voci: 59364 e 34364						
- Banca centrale 78						
- Amministrazioni Centrali, Organismi del settore pubblico, BMS 79						
- Altro 80						
- Non applicabile 777						
Voci 59440 e 34440:						
- Soggetto del settore finanziario 73						
- SPV 74						
- Altro (soggetto commerciale) 75						
Voci 59102 e 34102:						
- Soggetto regolamentato del settore finanziario 76						

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',
'LY', '1' e 'L1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	Lungh. campo	CODIFICHE
			- Soggetto non regolamentato del settore finanziario 77 - Non applicabile 777
Tipologia esposizione	01017	6	- Senior 550005 - Mezzanine 550006 - Junior 550007 - Non applicabile 777
Tipologia impegno	01247	3	- Non impegnato 150 - Impegnato sino a 3 mesi 151 - Impegnato da 3 a 6 mesi 152 - Impegnato da 6 a 9 mesi 153 - Impegnato da 9 a 12 mesi 154 - Impegnato oltre 12 mesi 155 - Non applicabile 77
Tipologia parte correlata	02025	2	- Parte correlata – esponente aziendale 54 - Parte correlata – partecipante 55 - Parte correlata – altro soggetto con potere di nomina organi aziendali... 56 - Parte correlata – società o impresa sottoposta a controllo/influenza notevole 57
Tipologia posizione – Tipo X	01252	3	- Posizione individuale 10 - Gruppo di clienti connessi 116 - Gruppo di clienti connessi – controllo 117 - Gruppo di clienti connessi – connessione economica 118
Tipologia posizione – Tipo Y	01253	3	- SPV, Fondi comuni o altri schemi 119 - altro 120
Tipologia soggetto connesso	02026	2	- Soggetto connesso – società o impresa controllata 63 - Soggetto connesso – soggetto controllante o sottoposto a comune controllo 64 - Soggetto connesso – stretti familiari e società o impresa da questi controllata 65 - Soggetto connesso - altro 66 - Soggetto connesso - cointestazioni 67 - Non applicabile 77
Tipologia soggetto finanziario	01233	3	- Soggetto di grandi dimensioni o non regolamentato 76 - Altro 77 - Non applicabile 890
Tipologia sottostante	01212	3	<u>Cartolarizzazioni: metodologia standardizzata / IRB:</u> - Cartolarizzazioni 824 - Sottostante diverso dalle cartolarizzazioni 244 - Non applicabile 770 <u>Cartolarizzazioni: informazioni aggiuntive:</u> - Mutui ipotecari su immobili residenziali 822 - Mutui ipotecari su immobili commerciali 823 - Crediti concessi a carte di credito 815 - Leasing 22 - Prestiti verso imprese (incluse PMI) 813

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',
'LY', '1' e 'L1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	Lungh. campo	CODIFICHE
			- Crediti al consumo..... 527 - Crediti al commercio..... 816 - Altre attività..... 248 - Debiti (obbligazioni garantite)..... 245 - Altre passività..... 249 - Cartolarizzazioni..... 824 - Sottostante diverso dalle cartolarizzazioni 244 - Non applicabile..... 770 <u>Rischi di mercato:</u> - Mutui ipotecari su immobili residenziali 822 - Mutui ipotecari su immobili commerciali..... 823 - Crediti concessi a carte di credito 815 - Leasing..... 22 - Prestiti verso imprese (incluse PMI) 813 - Crediti al consumo..... 527 - Crediti al commercio..... 816 - Altre attività..... 248 - Obbligazioni bancarie garantite 247 - Altre passività 246
Trattamento contabile	01166	3	- Esposizioni interamente non cancellate 636 - Esposizioni parzialmente cancellate 637 - Esposizioni interamente cancellate..... 638 - Non applicabile per gli investitori 771 - Non applicabile 770
Trattamento dei derivati	1257	3	- Metodo dell'esposizione originaria 156 - Metodo del valore di mercato 157
Trattamento prudenziale	01241	3	- Posizioni verso la cartolarizzazione non soggette a requisiti patrimoniali..... 639 - Posizioni verso la cartolarizzazione incluse nel portafoglio bancario ("BB") 640 - Posizioni verso la cartolarizzazione incluse nel portafoglio di negoziazione di vigilanza ("TB")..... 641 - Posizioni verso la cartolarizzazione incluse sia nel BB che nel TB..... 642 - Non applicabile 770
Urgenza	02021	1	- Si..... 1 - No..... 2
Valutazione del merito di credito	01231	3	- ECAI..... 170 - Derivato dal merito di credito dell'Amministrazione Centrale..... 171 - Non applicabile 77
Vita residua di tipo A	00040	3	Voci 34098 e 34100: - Entro un mese..... 20 - Da oltre 1 mese e fino a 2 mesi 43 - Da oltre 2 mesi e fino a 3 mesi 44 - Da oltre 3 mesi e fino a 4 mesi 85 - Da oltre 4 mesi e fino a 5 mesi 86 - Da oltre 5 mesi e fino a 6 mesi 87 - Da oltre 6 mesi e fino a 7 mesi 88 - Da oltre 7 mesi e fino a 8 mesi 89

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',
'LY', '1' e 'L1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	Lungh. campo	CODIFICHE
			- Da oltre 8 mesi e fino a 9 mesi 134 - Da oltre 9 mesi e fino a 10 mesi 91 - Da oltre 10 mesi e fino a 11 mesi 135 - Da oltre 11 mesi e fino a 12 mesi 93 - Da oltre 12 mesi e fino a 15 mesi 94 - Da oltre 15 mesi e fino a 18 mesi 95 - Da oltre 18 mesi e fino a 21 mesi 96 - Da oltre 21 mesi e fino a 24 mesi 97 - Da oltre 24 mesi e fino a 27 mesi 98 - Da oltre 27 mesi e fino a 30 mesi 136 - Da oltre 30 mesi e fino a 33 mesi 137 - Da oltre 33 mesi e fino a 36 mesi 138 - Da oltre 3 anni e fino a 5 anni 139 - Da oltre 5 anni e fino a 10 anni 132 - Oltre i 10 anni 133 - Indefinito 900
Vita residua rischio di mercato	01249	3	Voci 59150.12/14, 34150.12/14: - Fino a 12 mesi (Zona1) 68 - Fino a un mese 30 - Oltre un mese fino a 3 mesi 40 - Oltre 3 mesi fino a 6 mesi 50 - Oltre 6 mesi fino a 1 anno 60 - Oltre 12 mesi e fino a 4 anni (3,6 se cedola inferiore al 3%) (Zona 2) 516 - Oltre 1 anno e fino a 2 anni (1,9 se cedola inferiore al 3%) 505 - Oltre 2 (1,9) anni e fino a 3 anni (2,8 se cedola inferiore al 3%) 517 - Oltre 3 (2,8) anni e fino a 4 anni (3,6 se cedola inferiore al 3%) 518 - Oltre 4 anni (3,6 se cedola inferiore al 3%) (Zona 3) 519 - Oltre 4 (3,6) anni e fino a 5 anni (4,3 se cedola inferiore al 3%) 508 - Oltre 5 (4,3) anni e fino a 7 anni (5,7 se cedola inferiore al 3%) 509 - Oltre 7 (5,7) anni e fino a 10 anni (7,3 se cedola inferiore al 3%) 510 - Oltre 10 (7,3) anni e fino a 15 anni (9,3 se cedola inferiore al 3%) 511 - Oltre 15 (9,3) anni e fino a 20 anni (10,6 se cedola inferiore al 3%) 512 - Oltre 20 anni (oltre 10,6 e fino a 12 anni se cedola inferiore al 3%) 513 - Oltre 12 anni fino a 20 anni (solo cedola inferiore al 3%) 514 - Oltre 20 anni (solo cedola inferiore al 3%) 515 Voci 59150.16/18, 34150.16/18: - Fino a 12 mesi (Zona1) 68 - Oltre 12 mesi e fino a 4 anni (3,6 se cedola inferiore al 3%) (Zona 2) 516 - Oltre 4 anni (3,6 se cedola inferiore al 3%) (Zona 3) 519 Voci 59150.27/28/30, 34150.27/28/30: - Fino a 6 mesi 45 - Oltre 6 mesi e fino a 24 mesi 69 - Oltre 24 mesi 162
Vita residua rischio di liquidità	01250	3	Voce 59370 e 34370: - Entro i 30 giorni 83 - Oltre i 30 giorni 84 Voci 59372, 59374, 59376, 59378, 34372, 34374, 34376 e 34378: - Entro i 3 mesi 38 - Da 3 a 6 mesi 50 - Da 6 a 9 mesi 51

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',
'LY', '1' e 'L1')**

VARIABILI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	Lungh. campo	CODIFICHE
			- Da 9 a 12 mesi..... 52
			- Oltre i 12 mesi..... 72

**SEGNALAZIONI SU BASE CONSOLIDATA RELATIVE ALLE INFORMAZIONI
PER PAESE DI CONTROPARTE (base informativa 'EP')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	Lungh. campo	CODIFICHE
Residenza	-	-	Ai fini della classificazione va assunta la definizione vigente nell'ambito della disciplina valutaria italiana. L'informazione è richiesta nella parte fissa del record "movimento". - rapporti con soggetti residenti in Italia 1 - rapporti con soggetti non residenti in Italia 2
Divisa	-	-	L'informazione è richiesta nella parte fissa del record "movimento". I codici da utilizzare sono: - euro 1 - altre valute 2
Durata	-	-	L'informazione è richiesta nella parte fissa nel record "movimento". Va utilizzato per convenzione il codice "00" (due volte zero).
Codice valuta	00007	3	Unità di conto in cui sono espressi i fenomeni segnalati. I codici sono attribuiti dalla Banca d'Italia - Servizio RST. Nelle voci in cui viene richiesta la singola valuta, le operazioni di impiego finanziate con provvista in valuta assistita dalla garanzia pubblica sul rischio di cambio vanno segnalate come segue: - importi in euro, codice valuta = 398, divisa = 2
Sottosistema di rilevazione	02029	5	- Gruppo Bancario: banche residenti 15 - Gruppo Bancario: banche non residenti- filiali estere 6 - Gruppo Bancario: banche non residenti- filiazioni estere 7 - Gruppo Bancario: società finanziarie residenti 3 - Gruppo Bancario: società finanziarie non residenti-filiali estere 8 - Gruppo Bancario: società finanziarie non residenti-filiazioni estere 9
Stato controparte	00016	3	Viene utilizzata la codifica predisposta e gestita dalla Banca d'Italia - Servizio RST. Per ciò che concerne i rapporti con gli Organismi Internazionali, devono essere utilizzati gli specifici codici assegnati ai suddetti organismi.
Settore controparte	00011	3	Codifica da utilizzare (indicata negli schemi con la lettera N): - Amministrazioni pubbliche e organismi internazionali (sg. 100, da 102 a 191, da 704 a 715, 770, 771, 794) 902 - Autorità bancarie centrali (sg. 300, da 724 a 726, 791) 903 - Banche (sg. 245, da 727 a 729) 904 - Altri intermediari finanziari (sg. 101, da 247 a 284, 329, 717, 718, da 733 a 735, 739, 743, 746, 747 e 748 (eccetto imprese di assicurazione e fondi pensione extra UE) 905 - Imprese di assicurazione e fondi pensione (sg. da 294 a 296, 744, 745 e 748 (limitatamente alle imprese di assicurazione e fondi pensione extra UE) 906 - Società non finanziarie (sg. da 430 a 492, da 757 a 759) 907 - Famiglie e istituzioni senza finalità di lucro (sg. 500, 501, da 600 a 615, da 768 a 785 esclusi i valori 770 e 771) 908 - Unità non classificabili (sg. 551, 552) 055
Stato di residenza del garante	00018	3	Viene utilizzata la codifica predisposta e gestita dalla Banca d'Italia - Servizio RST. Per ciò che concerne i rapporti con gli Organismi Internazionali, devono essere utilizzati gli specifici codici assegnati ai suddetti organismi. Qualora non si verifichi la traslazione del rischio deve essere utilizzato il codice 000.

**SEGNALAZIONI SU BASE CONSOLIDATA RELATIVE ALLE INFORMAZIONI
PER PAESE DI CONTROPARTE (base informativa 'EP')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	Lungh. campo	CODIFICHE
Attività economica: Settore del garante	00019	3	<p>Codifica da utilizzare (indicata negli schemi con la lettera N):</p> <ul style="list-style-type: none"> - Amministrazioni pubbliche e organismi internazionali (sg. 100, da 102 a 191, da 704 a 715, 770, 771, 794) 902 - Autorità bancarie centrali (sg. 300, da 724 a 726, 791) 903 - Banche (sg. 245, da 727 a 729)..... 904 - Altri intermediari finanziari (sg. 101, da 247 a 284, 329, 717, 718, da 733 a 735, 739, 743, 746, 747 e 748 (eccetto imprese di assicurazione e fondi pensione extra UE) 905 - Imprese di assicurazione e fondi pensione (sg. da 294 a 296, 744, 745 e 748 (limitatamente alle imprese di assicurazione e fondi pensione extra UE) 906 - Società non finanziarie (sg. da 430 a 492, da 757 a 759) 907 - Famiglie e istituzioni senza finalità di lucro (sg. 500, 501, da 600 a 615, da 768 a 785) 908 - Unità non classificabili (sg. 551, 552)..... 055 <p>Qualora non si verifichi la traslazione del rischio deve essere utilizzato il codice 000.</p>
Tipo garanzia	02064	2	<ul style="list-style-type: none"> - garanzie reali e finanziarie 82 - garanzie personali 59 - derivati creditizi 83 <p>Qualora non si verifichi la traslazione del rischio deve essere utilizzato il codice 00.</p>
Vita residua	00040	3	<ul style="list-style-type: none"> - a vista e fino a 1 anno 68 - da 1 anno a 2 anni 90 - oltre 2 anni 162 - non applicabile 777
Localizza- zione unità segnalante (Stato)	00063	3	Viene utilizzata la codifica predisposta e gestita dalla Banca d'Italia – Servizio RST.

Capitolo 2

Schemi di segnalazione matrice dei conti

MATRICE DEI CONTI

I N D I C E

Legenda dei simboli..... B.5

I Sezione : Dati statistici mensili

1.1	Situazione patrimoniale: attivo	B.1.1.1
1.2	Situazione patrimoniale: passivo.....	B.1.2.1
1.3	Situazione patrimoniale: altre informazioni.....	B.1.3.1
1.4	Tassi di interesse.....	B.1.4.1

II Sezione : Altri dati statistici

2.1	Dati patrimoniali	
	– parte prima: dati territoriali e settoriali	B.2.1.1.1
	– parte seconda: altri dati patrimoniali	B.2.1.2.1
	– parte terza: vita residua – rischio di liquidità	B.2.1.3.1
	– parte quarta: vita residua – rischio di tasso di interesse.....	B.2.1.4.1
	– parte quinta: derivati	B.2.1.5.1
	– parte sesta: partite viaggianti e sospese	B.2.1.6.1
2.2	Servizi di investimento	B.2.2.1
2.3	Servizi di pagamento	B.2.3.1
2.4	Altre informazioni	
	– parte prima: canali distributivi.....	B.2.4.1.1
	– parte seconda: altre informazioni	B.2.4.2.1
2.5	Andamento conto economico	
	– costi	B.2.5.1.1
	– ricavi	B.2.5.2.1
	– altre informazioni	B.2.5.3.1
2.6	Dati patrimoniali filiali estere	
	– parte prima: attivo	B.2.6.1.1
	– parte seconda: passivo	B.2.6.2.1
	– parte terza: altre informazioni	B.2.6.3.1

III Sezione : Dati di bilancio

3.1	Dati patrimoniali: attivo	B.3.1.1
3.2	Dati patrimoniali: passivo	B.3.2.1
3.3	Dati patrimoniali: dati integrativi	
	– parte prima: garanzie rilasciate e impegni	B.3.3.1.1
	– parte seconda: qualità del credito	B.3.3.2.1
	– parte terza: cartolarizzazioni	B.3.3.3.1
	– parte quarta: notizie complementari.....	B.3.3.4.1
	– parte quinta: unità operanti all'estero	B.3.3.5.1
3.4	Conto economico: costi	B.3.4.1
3.5	Conto economico: ricavi	B.3.5.1
3.6	Conto economico: dati integrativi.....	B.3.6.1
3.7	Perdite storicamente registrate sulle posizioni in default.....	B.3.7.1

IV Sezione : Segnalazioni prudenziali

4.1	Fondi propri su base individuale	B.4.1.1.1
4.2	Rischio di credito e di controparte su base individuale	B.4.2.1.1
4.3	Grandi esposizioni su base individuale	B.4.3.1
4.4	Rischio di mercato su base individuale.....	B.4.4.1
4.5	Rischio operativo su base individuale.....	B.4.5.1
4.6	Posizione patrimoniale su base individuale	B.4.6.1
4.7	Rischio di liquidità su base individuale.....	B.4.7.1.1
4.8	Leva finanziaria su base individuale	B.4.8.1.1
4.9	Soggetti collegati.....	B.4.9.1
4.10	SIM escluse dall'ambito di applicazione del pacchetto "CRR/CRDIV" - informazioni sui requisiti patrimoniali minimi.....	B.4.10.1

LEGENDA DEI SIMBOLI

DURATA	
SIMBOLI	CODICI UTILIZZABILI (CFR. SISTEMA DELLE CODIFICHE)
C	5/16/17
D	5/6/7
E	14/15
F	13
G	7/13
H	14/25/7
M	3/5/18
N	5/16/43/44/45/46/47
P	5/18
Q	16/17
R	6/7

RESIDENZA	
SIMBOLI	CODICI UTILIZZABILI (CFR. SISTEMA DELLE CODIFICHE)
1	1 (RESIDENTI IN ITALIA)
2	2 (NON RESIDENTI IN ITALIA)
X	1, 2

DIVISA	
SIMBOLI	CODICI UTILIZZABILI (CFR. SISTEMA DELLE CODIFICHE)
1	EURO
2	ALTRE VALUTE
X	1, 2

GRADO DI SETTORIZZAZIONE	
SIMBOLI	SIGNIFICATO
S	SETTORE
SS	SOTTOSETTORE
SG	SOTTOGRUPPO
S	SEZIONE
D	DIVISIONE
L	cfr. pag A.7
M	SOTTOSETTORE PER I RESIDENTI E SOTTOGRUPPO PER I NON RESIDENTI
N	cfr. pag. A.38, A.39

QUALIFICA DELLA CONTROPARTE	
SIMBOLI	SIGNIFICATO
Af	AFFIDATO
C	CEDENTE
Cl	CLIENTE
Cnp	CONTROPARTE
Co	CESSIONARIO
Cr	CREDITORE
D	DEBITORE
De	DEPOSITANTE
Do	DEPOSITARIO
E	EMITTENTE
Or	ORDINANTE
P	PARTECIPAZIONE
Po	POSSESSORE DI CARTA DI CREDITO
Tn	TRAENTE
V	VENDITORE

NOTE	
SIMBOLI	SIGNIFICATO
XD	OPERAZIONI DA ATTRIBUIRE CONVENZIONALMENTE PER L'AMMONTARE GLOBALE NELL'UNICA COMBINAZIONE 'RESIDENZA/DIVISA' PREVISTA. SE LA DIVISA E' UGUALE A 1 (EURO), L'EVENTUALE 'CODICE VALUTA' RICHIESTO DEVE ESSERE UGUALE A 242 (EURO); GLI EVENTUALI 'IMPORTI IN ALTRE MONETE VANNO CONVERTITI IN EURO . OVVERO: OPERAZIONE DA RIPARTIRE NELLE COMBINAZIONI 'RESIDENZA/DIVISA' PREVISTE TENENDO CONTO DELLA 'DIVISA'. I RAPPORTI IN EURO VANNO ATTRIBUITI AI 'RESIDENTI(1)/EURO(1)'; I RAPPORTI IN ALTRE MONETE AI 'NON RESIDENTI(2)/ALTRE VALUTE(2)'.
XR	OPERAZIONI DA RIPARTIRE NELLE COMBINAZIONI 'RESIDENZA/DIVISA' PREVISTE TENENDO CONTO DELLA 'RESIDENZA'. I RAPPORTI CON 'RESIDENTI' VANNO ATTRIBUITI AI 'RESIDENTI(1)/EURO(1)'; I RAPPORTI CON NON RESIDENTI AI 'NON RESIDENTI(2)/ALTRE VALUTE(2)'.
R	LA INDICAZIONE DELLA VARIABILE "RAMO DI ATTIVITA' ECONOMICA" RIGUARDA SOLTANTO LA CLIENTELA CLASSIFICATA NEL SETTORE 4 (SOCIETA' NON FINANZIARIE) E NEL SETTORE 6 - SOTTOSETTORE 61 (FAMIGLIE PRODUTTRICI)
F	LA INDICAZIONE DELLA VARIABILE "FINALITA' DEL CREDITO" RIGUARDA SOLTANTO LE "FAMIGLIE" E LE "ISTITUZIONI SENZA SCOPO DI LUCRO" (SOTTOSETTORI 51, 60, 61, 86 E 87)
VS	LA VITA RESIDUA RELATIVA AL TEMPO DI RIPREZZAMENTO RIGUARDA LE SOLE OPERAZIONI A TASSO INDICIZZATO
Z	IL VALORE "NON APPLICABILE " DEVE ESSERE UTILIZZATO NEI CAMPI 040 E 042 PER SEGNALARE I CREDITI IN SOFFERENZA .PER I CREDITI NON IN SOFFERENZA, IL VALORE "NON APPLICABILE " DEVE ESSERE UTILIZZATO NEL CAMPO 042 SOLO NEL CASO IN CUI IL CAMPO 040 E' UGUALE O INFERIORE A 1 ANNO E IL TASSO E' INDICIZZATO

PERIODICITA'	
SIMBOLI	SIGNIFICATO
M	MENSILE
T	TRIMESTRALE
S	SEMESTRALE
A	ANNUALE
<p>Per le periodicità fornite nell'ambito della sez.IV "Segnalazioni Prudenziali" (ad eccezione delle sottosez.4.9 "Soggetti Collegati" e 4.10 "SIM escluse dall'ambito di applicazione del pacchetto CRR/CRDIV") si rimanda al Regolamento della Commissione Europea sulle norme tecniche di attuazione (ITS) in materia di segnalazioni prudenziali armonizzate delle banche e delle imprese di investimento. Le informazioni riportate all'interno degli schemi sono puramente indicative.</p>	

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.1.1 FONDI PROPRI SU BASE INDIVIDUALE: ELEMENTI COSTITUTIVI DEI FONDI PROPRI	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
		sotvoci					
Y	CAPITALE PRIMARIO DI CLASSE 1 (COMMON EQUITY TIER 1 - CET1).....	59010					
	STRUMENTI DI CET1:						
	CAPITALE VERSATO.....	02	3	1	1	T	XD
	SOVRAPPREZZI DI EMISSIONE.....	04	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI CET1 PROPRI:.....	06	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI CET1 DETENUTI DIRETTAMENTE.....	08	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI CET1 DETENUTI INDIRETTAMENTE.....	10	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI CET1 DETENUTI SINTETICAMENTE.....	12	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI CET1 SUI QUALI L'ENTE HA OBBLIGO REALE O EVENTUALE DI ACQUISTO.....	14	3	1	1	T	XD
	RISERVE:						
	RISERVE DI UTILI:						
	UTILI O PERDITE PORTATI A NUOVO.....	16	3	1	1	T	XD
	UTILI O PERDITA DI PERIODO:.....	18	3	1	1	T	XD
	UTILE O PERDITA DI PERTINENZA DELLA CAPOGRUPPO.....	20	3	1	1	T	XD
	(-) QUOTA DELL'UTILE DEL PERIODO NON INCLUSA NEL CET1.....	22	3	1	1	T	XD
	ALTRE COMPONENTI DI CONTO ECONOMICO ACCUMULATE (OCI) (*).....	24	3	1	1	T	XD
	RISERVE - ALTRO.....	26	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI CET1 OGGETTO DI DISPOSIZIONI TRANSITORIE (GRANDFATHERING).....	28	3	1	1	T	XD
	FILTRI PRUDENZIALI:						
	(-) INCREMENTO DI CET1 CONNESSO CON LE ATTIVITÀ CARTOLARIZZATE.....	32	3	1	1	T	XD
	COPERTURA DEI FLUSSI DI CASSA (CASH FLOW HEDGE).....	34	3	1	1	T	XD
	UTILI O PERDITE SULLE PASSIVITÀ VALUTATE AL VALORE EQUO DOVUTI AL PROPRIO MERITO DI CREDITO.....	36	3	1	1	T	XD
	UTILI O PERDITE DI VALORE EQUO DERIVANTI DAL RISCHIO DI CREDITO PROPRIO DELL'ENTE CORRELATO A PASSIVITÀ DERIVATIVE.....	38	3	1	1	T	XD
	(-) RETTIFICHE DI VALORE DI VIGILANZA.....	40	3	1	1	T	XD
	DETRAZIONI:						
	AVVIAMENTO:						
	(-) AVVIAMENTO CONNESSO CON ATTIVITÀ IMMATERIALI.....	42	3	1	1	T	XD
	(-) AVVIAMENTO INCLUSO NELLA VALUTAZIONE DEGLI INVESTIMENTI SIGNIFICATIVI.....	44	3	1	1	T	XD
	PASSIVITÀ FISCALI DIFFERITE ASSOCIATE ALL'AVVIAMENTO..	46	3	1	1	T	XD
	ALTRE ATTIVITÀ IMMATERIALI:						
	(-) ALTRE ATTIVITÀ IMMATERIALI IMPORTO AL LORDO DELL'EFFETTO FISCALE.....	48	3	1	1	T	XD
	PASSIVITÀ FISCALI DIFFERITE CONNESSE CON LE ALTRE ATTIVITÀ IMMATERIALI.....	50	3	1	1	T	XD
	(-) ATTIVITÀ FISCALI DIFFERITE CHE SI BASANO SULLA REDDITIVITÀ FUTURA E NON DERIVANO DA DIFFERENZE TEMPORANEE AL NETTO DELLE RELATIVE PASSIVITÀ FISCALI DIFFERITE.....	52	3	1	1	T	XD
	(-) ENTI IRB - ECCEDENZA DELLE PERDITE ATTESE RISPETTO ALLE RETTIFICHE DI VALORE.....	54	3	1	1	T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.1.1 FONDI PROPRI SU BASE INDIVIDUALE: ELEMENTI COSTITUTIVI DEI FONDI PROPRI	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					
	FONDI PENSIONE A PRESTAZIONE DEFINITA:						
	(-) FONDI PENSIONE A PRESTAZIONE DEFINITA - IMPORTO AL LORDO DELL'EFFETTO FISCALE.....	56	3	1	1	T	XD
	PASSIVITÀ FISCALI DIFFERITE CONNESSE CON ATTIVITÀ DI FONDI PENSIONE A PRESTAZIONE DEFINITA.....	58	3	1	1	T	XD
	ATTIVITÀ DEI FONDI PENSIONE A PRESTAZIONE DEFINITA CHE L'ENTE PUÒ UTILIZZARE SENZA RESTRIZIONI.....	60	3	1	1	T	XD
	(-) PARTECIPAZIONI INCROCIATE IN STRUMENTI DI CET1....	62	3	1	1	T	XD
	(-) ECCEDENZA DEGLI ELEMENTI DA DETRARRE DAL CAPITALE AGGIUNTIVO DI CLASSE 1 RISPETTO AL CAPITALE AGGIUNTIVO DI CLASSE 1.....	64	3	1	1	T	XD
	ESPOSIZIONI DEDOTTE ANZICHÉ PONDERATE CON FATTORE DI PONDERAZIONE PARI A 1250%						
	(-) PARTECIPAZIONI QUALIFICATE AL DI FUORI DEL SETTORE FINANZIARIO.....	66	3	1	1	T	XD
	(-) CARTOLARIZZAZIONI.....	68	3	1	1	T	XD
	(-) TRANSAZIONI CON REGOLAMENTO NON CONTESTUALE.....	70	3	1	1	T	XD
	(-) ENTI IRB - POSIZIONI IN UN PANIERE PER LE QUALI L'ENTE NON È IN GRADO DI STABILIRE UN FATTORE DI PONDERAZIONE.....	72	3	1	1	T	XD
	(-) ENTI IRB - ESPOSIZIONI IN STRUMENTI DI CAPITALE OGGETTO DI MODELLI INTERNI.....	74	3	1	1	T	XD
	(-) INVESTIMENTI NON SIGNIFICATIVI IN STRUMENTI DI CET1 IN ALTRI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO.....	76	3	1	1	T	XD
	DETRAZIONI CON SOGLIA DEL 10%:						
	(-) ATTIVITÀ FISCALI DIFFERITE CHE SI BASANO SULLA REDDITIVITÀ FUTURA ED EMERGONO DA DIFFERENZE TEMPORANEE.....	78	3	1	1	T	XD
	(-) INVESTIMENTI SIGNIFICATIVI IN STRUMENTI DI CET1 DI ALTRI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO.....	80	3	1	1	T	XD
	(-) DETRAZIONE CON SOGLIA DEL 17,65%.....	82	3	1	1	T	XD
	(-) DETRAZIONI EX ARTICOLO 3 CRR.....	84	3	1	1	T	XD
	ELEMENTI POSITIVI O NEGATIVI - ALTRI.....	86	3	1	1	T	XD
	REGIME TRANSITORIO - IMPATTO SU CET1 (*).....	88	3	1	1	T	XD
	TOTALE CAPITALE PRIMARIO DI CLASSE 1.....	90	3	1	1	T	XD

(119) - (*) Segnalazioni che possono assumere valore negativo

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.1.1 FONDI PROPRI SU BASE INDIVIDUALE: ELEMENTI COSTITUTIVI DEI FONDI PROPRI	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					
Y	CAPITALE AGGIUNTIVO DI CLASSE 1 (ADDITIONAL TIER 1 - AT1)...	59012					
	STRUMENTI DI AT1:						
	CAPITALE VERSATO.....	02	3	1	1	T	XD
	SOVRAPPREZZI DI EMISSIONE.....	04	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI AT1 PROPRI:.....	06	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI AT1 DETENUTI DIRETTAMENTE.....	08	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI AT1 DETENUTI INDIRETTAMENTE.....	10	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI AT1 DETENUTI SINTETICAMENTE.....	12	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI AT1 SUI QUALI L'ENTE HA OBBLIGO REALE O EVENTUALE DI ACQUISTO.....	14	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI AT1 OGGETTO DI DISPOSIZIONI TRANSITORIE (GRANDFATHERING).....	16	3	1	1	T	XD
	DETRAZIONI:						
	(-) PARTECIPAZIONI INCROCIATE IN STRUMENTI DI AT1.....	20	3	1	1	T	XD
	(-) INVESTIMENTI NON SIGNIFICATIVI IN STRUMENTI DI AT1 IN ALTRI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO.....	22	3	1	1	T	XD
	(-) INVESTIMENTI SIGNIFICATIVI IN STRUMENTI DI AT1 IN ALTRI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO.....	24	3	1	1	T	XD
	(-) ECCEDENZIA DEGLI ELEMENTI DA DETRARRE DAL CAPITALE DI CLASSE 2 RISPETTO AL CAPITALE DI CLASSE 2.....	26	3	1	1	T	XD
	(-) DETRAZIONI EX ARTICOLO 3 CRR.....	28	3	1	1	T	XD
	REGIME TRANSITORIO - IMPATTO SU AT1 (*).....	30	3	1	1	T	XD
	ECCEDENZIA DEGLI ELEMENTI DA DETRARRE DAL CAPITALE AGGIUNTIVO DI CLASSE 1 RISPETTO AL CAPITALE AGGIUNTIVO DI CLASSE 1.....	32	3	1	1	T	XD
	ELEMENTI POSITIVI O NEGATIVI - ALTRI.....	34	3	1	1	T	XD
	TOTALE CAPITALE AGGIUNTIVO DI CLASSE 1.....	36	3	1	1	T	XD
	<i>(119) - (*) Segnalazioni che possono assumere valore negativo</i>						
Y	CAPITALE DI CLASSE 1.....	59014					
	TOTALE CAPITALE DI CLASSE 1.....	00	3	1	1	T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.1.1 FONDI PROPRI SU BASE INDIVIDUALE: ELEMENTI COSTITUTIVI DEI FONDI PROPRI	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					
Y	CAPITALE DI CLASSE 2 (TIER 2 - T2).....	59016					
	STRUMENTI DI T2						
	CAPITALE VERSATO.....	02	3	1	1	T	XD
	SOVRAPPREZZI DI EMISSIONE.....	04	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI T2 PROPRI:.....	06	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI T2 DETENUTI DIRETTAMENTE.....	08	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI T2 DETENUTI INDIRETTAMENTE.....	10	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI T2 DETENUTI SINTETICAMENTE.....	12	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI T2 SUI QUALI L'ENTE HA OBBLIGO REALE O EVENTUALE DI ACQUISTO.....	14	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI T2 OGGETTO DI DISPOSIZIONI TRANSITORIE (GRANDFATHERING).....	16	3	1	1	T	XD
	ENTI IRB - ECCEDENZA DELLE RETTIFICHE DI VALORE RISPETTO ALLE PERDITE ATTESE.....	20	3	1	1	T	XD
	DETRAZIONI:						
	(-) PARTECIPAZIONI INCROCIATE IN STRUMENTI DI T2.....	22	3	1	1	T	XD
	(-) INVESTIMENTI NON SIGNIFICATIVI IN STRUMENTI DI T2 IN ALTRI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO.....	24	3	1	1	T	XD
	(-) INVESTIMENTI SIGNIFICATIVI IN STRUMENTI DI T2 IN ALTRI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO.....	26	3	1	1	T	XD
	(-) DETRAZIONI EX ARTICOLO 3 CRR.....	28	3	1	1	T	XD
	REGIME TRANSITORIO - IMPATTO SU T2 (*).....	30	3	1	1	T	XD
	ECCEDENZA DEGLI ELEMENTI DA DETRARRE DAL CAPITALE DI CLASSE 2 RISPETTO AL CAPITALE DI CLASSE 2.....	32	3	1	1	T	XD
	ELEMENTI POSITIVI O NEGATIVI - ALTRI.....	34	3	1	1	T	XD
	TOTALE CAPITALE DI CLASSE 2.....	36	3	1	1	T	XD
	(119) - (*) Segnalazioni che possono assumere valore negativo						
Y	FONDI PROPRI.....	59018					
	TOTALE FONDI PROPRI.....	00	3	1	1	T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.1.2 FONDI PROPRI SU BASE INDIVIDUALE: ALTRE INFORMAZIONI	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					
Y	INFORMAZIONI SU STRUMENTI DI CAPITALE CON CARATTERISTICHE REVERSIBILI.....	59020					
	STRUMENTI DI CAPITALE LA CUI INCLUSIONE NEL CET1 DIPENDE DA CARATTERISTICHE REVERSIBILI.....	02	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI CAPITALE LA CUI INCLUSIONE NELL'AT1 DIPENDE DA CARATTERISTICHE REVERSIBILI.....	04	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI CAPITALE LA CUI INCLUSIONE NEL T2 DIPENDE DA CARATTERISTICHE REVERSIBILI.....	06	3	1	1	T	XD
Y	INFORMAZIONI SULLA FISCALITÀ:.....	59022					
	TOTALE ATTIVITÀ FISCALI DIFFERITE (DTA):						
	DTA CHE NON SI BASANO SULLA REDDITIVITÀ FUTURA.....	02	3	1	1	T	XD
	DTA CHE SI BASANO SULLA REDDITIVITÀ FUTURA E NON DERIVANO DA DIFFERENZE TEMPORANEE.....	04	3	1	1	T	XD
	DTA CHE SI BASANO SULLA REDDITIVITÀ FUTURA E DERIVANO DA DIFFERENZE TEMPORANEE.....	06	3	1	1	T	XD
	TOTALE PASSIVITÀ FISCALI DIFFERITE (DTL):						
	DTL NON DEDUCIBILI DALLE DTA E CHE SI BASANO SULLA REDDITIVITÀ FUTURA.....	08	3	1	1	T	XD
	DTL DEDUCIBILI DALLE DTA E CHE SI BASANO SULLA REDDITIVITÀ FUTURA:						
	- DI CUI NON DERIVANTI DA DIFFERENZE TEMPORANEE.....	10	3	1	1	T	XD
	- DI CUI DERIVANTI DA DIFFERENZE TEMPORANEE.....	12	3	1	1	T	XD
Y	INFORMAZIONI SUI MODELLI INTERNI ENTI IRB (SHORTFALL/EXCESS RESERVE).....	59024					
	ENTI IRB - ECCEDENZIA O CARENZA DELLE RETTIFICHE DI VALORE CONTABILI, PRUDENZIALI E DELLE ALTRE RIDUZIONI DEI FONDI PROPRI RISPETTO ALLE PERDITE ATTESE PER ESPOSIZIONI NON IN STATO DI DEFAULT:						
	TOTALE RETTIFICHE DI VALORE E DELLE ALTRE RIDUZIONI DEI FONDI PROPRI:						
	RETTIFICHE SPECIFICHE.....	02	3	1	1	T	XD
	RETTIFICHE DI VALORE PRUDENZIALI E ALTRE RIDUZIONI DEI FONDI PROPRI.....	04	3	1	1	T	XD
	TOTALE PERDITE ATTESE.....	06	3	1	1	T	XD
	ENTI IRB - ECCEDENZIA O CARENZA DELLE RETTIFICHE DI VALORE CONTABILI, PRUDENZIALI E DELLE ALTRE RIDUZIONI DEI FONDI PROPRI RISPETTO ALLE PERDITE ATTESE PER ESPOSIZIONI IN STATO DI DEFAULT:						
	RETTIFICHE SPECIFICHE E POSTE SIMILI.....	08	3	1	1	T	XD
	TOTALE PERDITE ATTESE.....	10	3	1	1	T	XD
	TOTALE ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO UTILIZZATE AI FINI DEL CALCOLO DEL LIMITE MASSIMO (CAP) PER L'INCLUSIONE DELL'ECCEDENZIA DELLE RETTIFICHE DI VALORE CONTABILI, PRUDENZIALI E DELLE ALTRE RIDUZIONI DEI FONDI PROPRI RISPETTO ALLE PERDITE ATTESE.....	12	3	1	1	T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.1.2 FONDI PROPRI SU BASE INDIVIDUALE: ALTRE INFORMAZIONI	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					
Y	INFORMAZIONI SU SOGLIE PER DETRAZIONI E CAPITALE AMMISSIBILE.....	59026					
	SOGLIA PER GLI INVESTIMENTI NON SIGNIFICATIVI IN STRUMENTI DI CET1 DI ALTRI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO (10%).....	02	3	1	1	T	XD
	SOGLIA 10% EX ARTICOLO 48 CRR.....	04	3	1	1	T	XD
	SOGLIA 17,65% EX ARTICOLO 48 CRR.....	06	3	1	1	T	XD
	CAPITALE AMMISSIBILE AI FINI DELLA DISCIPLINA DELLE PARTECIPAZIONI QUALIFICATE AL DI FUORI DEL SETTORE FINANZIARIO E DEI GRANDI RISCHI.....	08	3	1	1	T	XD
Y	INFORMAZIONI SU INVESTIMENTI NON SIGNIFICATIVI IN FONDI PROPRI DI ALTRI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO.....	59028					
	STRUMENTI DI CET1 AL NETTO DELLE POSIZIONI CORTE:						
	STRUMENTI DI CET1 DETENUTI DIRETTAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	02	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	04	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI CET1 DETENUTI INDIRETTAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	06	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	08	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI CET1 DETENUTI SINTETICAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	10	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	12	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI AT1 AL NETTO DELLE POSIZIONI CORTE:						
	STRUMENTI DI AT1 DETENUTI DIRETTAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	14	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	16	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI AT1 DETENUTI INDIRETTAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	18	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	20	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI AT1 DETENUTI SINTETICAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	22	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	24	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI T2 AL NETTO DELLE POSIZIONI CORTE:						
	STRUMENTI DI T2 DETENUTI DIRETTAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	26	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	28	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI T2 DETENUTI INDIRETTAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	30	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	32	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI T2 DETENUTI SINTETICAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	34	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	36	3	1	1	T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.1.2 FONDI PROPRI SU BASE INDIVIDUALE: ALTRE INFORMAZIONI	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
		sotvoco					
Y	INFORMAZIONI SU INVESTIMENTI SIGNIFICATIVI IN FONDI PROPRI DI ALTRI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO:.....	59030					
	STRUMENTI DI CET1 AL NETTO DELLE POSIZIONI CORTE:						
	STRUMENTI DI CET1 DETENUTI DIRETTAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	02	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	04	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI CET1 DETENUTI INDIRETTAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	06	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	08	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI CET1 DETENUTI SINTETICAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	10	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	12	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI AT1 AL NETTO DELLE POSIZIONI CORTE:						
	STRUMENTI DI AT1 DETENUTI DIRETTAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	14	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	16	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI AT1 DETENUTI INDIRETTAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	18	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	20	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI AT1 DETENUTI SINTETICAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	22	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	24	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI T2 AL NETTO DELLE POSIZIONI CORTE:						
	STRUMENTI DI T2 DETENUTI DIRETTAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	26	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	28	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI T2 DETENUTI INDIRETTAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	30	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	32	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI T2 DETENUTI SINTETICAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	34	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	36	3	1	1	T	XD
Y	ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO DI INVESTIMENTI NON DEDOTTI DAI CORRISPONDENTI TIER DEI FONDI PROPRI DI ALTRI SOGGETTI APPARTENENTI AL SETTORE FINANZIARIO:.....	59032					
	STRUMENTI DI CET1.....	02	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI AT1.....	04	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI T2.....	06	3	1	1	T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.1.2 FONDI PROPRI SU BASE INDIVIDUALE: ALTRE INFORMAZIONI	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					
Y	DEROGA TEMPORANEA ALLA DEDUZIONE DAI FONDI PROPRI EX ART.						
	79 CRR.....	59034					
	STRUMENTI DI CET1 CONNESSI CON INVESTIMENTI:						
	SIGNIFICATIVI IN ALTRI SOGGETTI APPARTENENTI AL						
	SETTORE FINANZIARIO.....	02	3	1	1	T	XD
	NON SIGNIFICATIVI IN ALTRI SOGGETTI APPARTENENTI AL						
	SETTORE FINANZIARIO.....	04	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI AT1 CONNESSI CON INVESTIMENTI:						
	SIGNIFICATIVI IN ALTRI SOGGETTI APPARTENENTI AL						
	SETTORE FINANZIARIO.....	06	3	1	1	T	XD
	NON SIGNIFICATIVI IN ALTRI SOGGETTI APPARTENENTI AL						
	SETTORE FINANZIARIO.....	08	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI T2 CONNESSI CON INVESTIMENTI:						
	SIGNIFICATIVI IN ALTRI SOGGETTI APPARTENENTI AL						
	SETTORE FINANZIARIO.....	10	3	1	1	T	XD
	NON SIGNIFICATIVI IN ALTRI SOGGETTI APPARTENENTI AL						
	SETTORE FINANZIARIO.....	12	3	1	1	T	XD
Y	ALTRI REQUISITI.....	59036					
	REQUISITO COMBINATO DI RISERVA DI CAPITALE						
	RISERVA DI CONSERVAZIONE DI CAPITALE.....	02	3	1	1	T	XD
	RISERVA DI CONSERVAZIONE DI CAPITALE CONNESSA AL						
	RISCHIO MACROPRUDENZIALE O SISTEMICO IDENTIFICATA A						
	LIVELLO DI SINGOLO PAESE MEMBRO.....	04	3	1	1	T	XD
	RISERVA DI CAPITALE ANTICICLICA SPECIFICA DELL'ENTE.....	06	3	1	1	T	XD
	RISERVA DI CAPITALE A FRONTE DEL RISCHIO SISTEMICO						
	CUMULABILE.....	08	3	1	1	T	XD
	RISERVA DI CAPITALE A FRONTE DEL RISCHIO SISTEMICO NON						
	CUMULABILE.....	10	3	1	1	T	XD
	RISERVA PER GLI O-SII.....	14	3	1	1	T	XD
Y	FLOOR.....	59037					
	VARIAZIONE AI FONDI PROPRI TOTALI.....	02	3	1	1	T	XD
	FONDI PROPRI INTERAMENTE AGGIUSTATI PER TENER CONTO DEL						
	FLOOR DI BASILEA 1.....	04	3	1	1	T	XD
	REQUISITI DI FONDI PROPRI PER IL FLOOR DI BASILEA 1.....	06	3	1	1	T	XD
	REQUISITI DI FONDI PROPRI PER IL FLOOR DI BASILEA 1 -						
	ALTERNATIVA PER IL METODO STANDARD.....	08	3	1	1	T	XD
Y	SOGLIA DI RILEVANZA PER LA SEGNALAZIONE DELLE ESPOSIZIONI						
	NON-DOMESTICHE.....	59042					
	ESPOSIZIONE ORIGINARIA NON DOMESTICA.....	02	3	1	1	T	XD
	TOTALE DELLE ESPOSIZIONI ORIGINARIE.....	04	3	1	1	T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.1.3 FONDI PROPRI SU BASE INDIVIDUALE: ALTRE INFORMAZIONI - SIM	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					
Y	CAPITALE INIZIALE.....	59038 00	3	1	1	T	XD
Y	FONDI PROPRI BASATI SULLE SPESE FISSE GENERALI.....	59040 00	3	1	1	T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.1.4 FONDI PROPRI SU BASE INDIVIDUALE: ELEMENTI OGGETTO DI DISPOSIZIONI TRANSITORIE Le voci di cui alla presente parte possono assumere valore positivo o negativo	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	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		SOTVOC						
Y	STRUMENTI OGGETTO DI GRANDFATHERING.....	59200 02	3	1	1	X	T	XD
	STRUMENTI CHE COSTITUISCONO AIUTI DI STATO:							
	- STRUMENTI CHE SI QUALIFICANO COME FONDI PROPRI AI SENSI DELLA DIRETTIVA 2006/48/CE.....	04	3	1	1	X	T	XD
	- STRUMENTI EMESSI DA ENTI INSEDIATI IN STATI MEMBRI SOGGETTI A PROGRAMMI DI AGGIUSTAMENTO ECONOMICO.....	06	3	1	1	X	T	XD
	STRUMENTI CHE NON COSTITUISCONO AIUTI DI STATO.....	08	3	1	1	X	T	XD
Y	ALTRE VARIAZIONI TRANSITORIE: PROFITTI E PERDITE NON REALIZZATI.....	59204 02	3	1	1	X	T	XD
	-PROFITTI NON REALIZZATI.....	04	3	1	1	X	T	XD
	-PERDITE NON REALIZZATE.....	06	3	1	1	X	T	XD
	-PROFITTI NON REALIZZATI RELATIVI ALLE ESPOSIZIONI VERSO LE AMMINISTRAZIONI CENTRALI CLASSIFICATE NELLA CATEGORIA "ATTIVITA' FINANZIARIE DISPONIBILI PER LA VENDITA" DELLO IAS 39 APPROVATO DALL'UE.....	08	3	1	1	X	T	XD
	-PERDITE NON REALIZZATE RELATIVE ALLE ESPOSIZIONI VERSO LE AMMINISTRAZIONI CENTRALI CLASSIFICATE NELLA CATEGORIA "ATTIVITA' FINANZIARIE DISPONIBILI PER LA VENDITA" DELLO IAS 39 APPROVATO DALL'UE.....	10	3	1	1	X	T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.1.4 FONDI PROPRI SU BASE INDIVIDUALE: ELEMENTI OGGETTO DI DISPOSIZIONI TRANSITORIE	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	P E R I O D I C I T A'	N O T E	
		SOTVOC							
Y	ALTRE VARIAZIONI TRANSITORIE: DEDUZIONI.....	59206	02	3	1	1	X	T	XD
	-PERDITE RELATIVE ALL'ESERCIZIO IN CORSO.....	04		3	1	1	X	T	XD
	-ATTIVITA' FISCALI DIFFERITE CHE DIPENDONO DALLA REDDITIVITA' FUTURA E NON DERIVANO DA DIFFERENZE TEMPORANEE.....	06		3	1	1	X	T	XD
	-IMPORTI NEGATIVI RISULTANTI DAL CALCOLO DELLE PERDITE ATTESE DI CUI AGLI ARTICOLI 158 E 159 CRR.....	08		3	1	1	X	T	XD
	-DEDUZIONE DELLE ATTIVITA' DEI FONDI PENSIONE A PRESTAZIONI DEFINITE RIPORTATE NELLO STATO PATRIMONIALE DELLA BANCA.....	10		3	1	1	X	T	XD
	-DI CUI: INTRODUZIONE DELLE MODIFICHE ALLO IAS 19 - ELEMENTI POSITIVI.....	12		3	1	1	X	T	XD
	-DI CUI: INTRODUZIONE DELLE MODIFICHE ALLO IAS 19 - ELEMENTI NEGATIVI.....	14		3	1	1	X	T	XD
	-STRUMENTI DI FONDI PROPRI DI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO IN CUI L'ENTE NON HA UN INVESTIMENTO SIGNIFICATIVO								
	-STRUMENTI DI CET1.....	16		3	1	1	X	T	XD
	-STRUMENTI DI AT1.....	18		3	1	1	X	T	XD
	-STRUMENTI DI T2 INDIRETTI O SINTETICI.....	20		3	1	1	X	T	XD
	-ATTIVITA' FISCALI DIFFERITE CHE DIPENDONO DALLA REDDITIVITA' FUTURA E DERIVANO DA DIFFERENZE TEMPORANEE E STRUMENTI DI CET1 DI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO IN CUI L'ENTE HA UN INVESTIMENTO SIGNIFICATIVO.....	22		3	1	1	X	T	XD
	-STRUMENTI DI FONDI PROPRI DI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO IN CUI L'ENTE HA UN INVESTIMENTO SIGNIFICATIVO								
	-STRUMENTI DI CET1.....	24		3	1	1	X	T	XD
	-STRUMENTI DI AT1.....	26		3	1	1	X	T	XD
	-STRUMENTI DI T2 INDIRETTI O SINTETICI.....	28		3	1	1	X	T	XD
	-ESENZIONE DALLA DEDUZIONE DI PARTECIPAZIONI ASSICURATIVE DAGLI ELEMENTI DEL CET1.....	30		3	1	1	X	T	XD
Y	ALTRE VARIAZIONI TRANSITORIE: ALTRI FILTRI E DEDUZIONI.....	59208	00	3	1	1	X	T	XD
Y	VARIAZIONI TOTALI.....	59210	00	3	1	1	X	T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.1.5 FONDI PROPRI SU BASE INDIVIDUALE: STRUMENTI OGGETTO DI GRANDFATHERING - STRUMENTI CHE NON COSTITUISCONO AIUTI DI STATO	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	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		SOTVOC						
Y	STRUMENTI COMPUTABILI NEL PATRIMONIO DI BASE AI SENSI DELLE DISPOSIZIONI DI RECEPIMENTO DELL'ART.57, LETT. A) DELLA DIRETTIVA 2006/48/CE(*).....	59220 00	3	1	1	X	T	XD
<i>(163) (*) Ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali</i>								
Y	STRUMENTI COMPUTABILI NEL PATRIMONIO DI BASE AI SENSI DELLE DISPOSIZIONI DI RECEPIMENTO DELL'ART.57, LETT. C-BIS) E DELL'ART.154, PARR.8 E 9, DELLA DIRETTIVA 2006/48/CE, SOGGETTI AI LIMITI DELL'ART.489(*).....(163	59222 02	3	1	1	X	T	XD
	-STRUMENTI SENZA OPZIONI CALL O INCENTIVI AL RIMBORSO -TOTALE DEGLI STRUMENTI SENZA OPZIONI CALL O INCENTIVI AL RIMBORSO.....	04	3	1	1	X	T	XD
	-STRUMENTI OGGETTO DI GRANDFATHERING CON OPZIONI CALL O INCENTIVI AL RIMBORSO							
	-STRUMENTI CON UN'OPZIONE CALL ESERCITABILE DOPO LA DATA DI SEGNALAZIONE E CHE SODDISFANO I REQUISITI DELL'ART. 52 DEL CRR DOPO LA DATA DI SCADENZA EFFETTIVA.....	06	3	1	1	X	T	XD
	-STRUMENTI CON UN'OPZIONE CALL ESERCITABILE DOPO LA DATA DI SEGNALAZIONE E CHE NON SODDISFANO I REQUISITI DELL'ART. 52 DEL CRR DOPO LA DATA DI SCADENZA EFFETTIVA.....	08	3	1	1	X	T	XD
	-STRUMENTI CON UN'OPZIONE CALL ESERCITABILE PRIMA DEL 31 DICEMBRE 2011 O IL GIORNO STESSO E CHE NON SODDISFANO I REQUISITI DELL'ART. 52 DEL CRR DOPO LA DATA DI SCADENZA EFFETTIVA.....	10	3	1	1	X	T	XD
	-ECCEDENZA RISPETTO AI LIMITI DEGLI STRUMENTI DI CET1 OGGETTO DI GRANDFATHERING.....	12	3	1	1	X	T	XD
<i>(163) (*) Ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali</i>								
Y	STRUMENTI COMPUTABILI NEL PATRIMONIO SUPPLEMENTARE AI SENSI DELLE DISPOSIZIONI DI RECEPIMENTO DELL'ART.57, LETT. E), F), G) O H) DELLA DIRETTIVA 2006/48/CE, SOGGETTI AI LIMITI DELL'ART.490(*).....(163	59224 02	3	1	1	X	T	XD
	-ELEMENTI SENZA INCENTIVI AL RIMBORSO -TOTALE DEGLI ELEMENTI SENZA INCENTIVI AL RIMBORSO.....	04	3	1	1	X	T	XD
	-ELEMENTI OGGETTO DI GRANDFATHERING CON INCENTIVI AL RIMBORSO							
	-ELEMENTI CON UN'OPZIONE CALL ESERCITABILE DOPO LA DATA DI SEGNALAZIONE E CHE SODDISFANO I REQUISITI DELL'ARTICOLO 63 DEL CRR DOPO LA DATA DI SCADENZA EFFETTIVA.....	06	3	1	1	X	T	XD
	-ELEMENTI CON UN'OPZIONE CALL ESERCITABILE DOPO LA DATA DI SEGNALAZIONE E CHE NON SODDISFANO I REQUISITI DELL'ARTICOLO 63 DEL CRR DOPO LA DATA DI SCADENZA EFFETTIVA.....	08	3	1	1	X	T	XD
	-ELEMENTI CON UN'OPZIONE CALL ESERCITABILE PRIMA DEL 31 DICEMBRE 2011 O IL GIORNO STESSO E CHE NON SODDISFANO I REQUISITI DELL'ARTICOLO 63 DEL CRR DOPO LA DATA DI SCADENZA EFFETTIVA.....	10	3	1	1	X	T	XD
	-ECCEDENZA RISPETTO AI LIMITI DEGLI STRUMENTI DI AT1 OGGETTO DI GRANDFATHERING.....	12	3	1	1	X	T	XD
<i>(163) (*) Ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali</i>								

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.2.1 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE SU BASE INDIVIDUALE: METODOLOGIA STANDARDIZZATA	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	C P P Q U A L I F I C A T A	V A L U T M E R I T O C R E	C O N T R I B G A R C C P	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	T I P O I M P O R T O	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoc													
Y	ATTIVITA' DI RISCHIO.....	59526													
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI E BANCHE CENTRALI.....	02	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA AMMINISTRAZIONI REGIONALI O AUTORITA' LOCALI.....	04	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA ORGANISMI DEL SETTORE PUBBLICO.....	07	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA BANCHE MULTILATERALI DI SVILUPPO.....	08	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA ORGANIZZAZIONI INTERNAZIONALI.....	10	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA INTERMEDIARI VIGILATI...	12	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA IMPRESE.....	11	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO.....	16	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI.....	18	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI IN STATO DI DEFAULT.....	20	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI AD ALTO RISCHIO.....	22	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI SOTTO FORMA DI OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE.....	24	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI A BREVE TERMINE VERSO IMPRESE O INTERMEDIARI VIGILATI.....	25	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO DEL RISPARMIO (OICR).....	28	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI IN STRUMENTI DI CAPITALE.....	27	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ALTRE ESPOSIZIONI.....	29	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-TOTALE ATTIVITA' DI RISCHIO														
	-ATTIVITA' DI RISCHIO PER CASSA.....	50	3	1	1			X			X		X	T	XD
	-GARANZIE RILASCIATE E IMPEGNI A EROGARE FONDI.....	52	3	1	1			X	X		X		X	T	XD
	-OPERAZIONI SFT.....	55	3	1	1	X					X		X	T	XD
	-CONTRATTI DERIVATI E OPERAZIONI CON REGOLAMENTO A LUNGO TERMINE.....	57	3	1	1	X					X		X	T	XD
	-COMPENSAZIONE TRA PRODOTTI DIVERSI.....	58	3	1	1						X		X	T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

BASE INF.	4.2.1 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE SU BASE INDIVIDUALE: METODOLOGIA STANDARDIZZATA	VOCE	DURATA	DIVISA	RESIDENZA	CP QUALIFICATA	VALUT MERITO CRE	CONTTRIB GAR CCP	FATTORE CONVERSA	FATTORE PONDERAZ	PORTAFOLIO	TIPO GARANZIA	TIPO IMPORTO	PERIODICITA'	NOTE
		SOTVOC													
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:														
	-ATTIVITÀ 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
	-OPERAZIONI SFT.....	05	3	1	1						X	X	X	T	XD
	-CONTRATTI DERIVATI E OPERAZIONI CON REGOLAMENTO A LUNGO TERMINE.....	07	3	1	1						X	X	X	T	XD
	-COMPENSAZIONE TRA PRODOTTI DIVERSI.....	09	3	1	1						X	X	X	T	XD
	-STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO REALE - METODO INTEGRALE														
	-ESPOSIZIONI GARANTITE:														
	-ATTIVITÀ 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	
	-OPERAZIONI SFT.....	15	3	1	1						X	X	T	XD	
	-CONTRATTI DERIVATI E OPERAZIONI CON REGOLAMENTO A LUNGO TERMINE.....	17	3	1	1						X	X	T	XD	
	-COMPENSAZIONE TRA PRODOTTI DIVERSI.....	19	3	1	1						X	X	T	XD	
Y	ATTIVITA' DI RISCHIO: ALTRE INFORMAZIONI.....	59050													
	-TOTALE ATTIVITÀ DI RISCHIO: DI CUI PMI.....	02	3	1	1				X	X	X	X	T	XD	
	-TOTALE ATTIVITÀ DI RISCHIO: DI CUI PMI CUI SI APPLICA IL FATTORE DI SOSTEGNO (0,7619).....	04	3	1	1				X	X	X	X	T	XD	
	-TOTALE ATTIVITÀ DI RISCHIO: DI CUI ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI RESIDENZIALI.....	06	3	1	1				X	X	X	X	T	XD	
	-TOTALE ATTIVITÀ DI RISCHIO: DI CUI ESPOSIZIONI SOGGETTE ALL'UTILIZZO PARZIALE PERMANENTE DELLA METODOLOGIA STANDARDIZZATA.....	08	3	1	1				X	X	X	X	T	XD	
	-TOTALE ATTIVITÀ DI RISCHIO: DI CUI ESPOSIZIONI SOGGETTE A ESTENSIONE PROGRESSIVA DEL METODO IRB.....	10	3	1	1				X	X	X	X	T	XD	
	-ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI COMMERCIALI.....	12	3	1	1				X	X	X	X	T	XD	
	-ESPOSIZIONI IN STATO DI DEFAULT PONDERATE AL 100%.....	14	3	1	1				X	X	X	X	T	XD	
	-ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI RESIDENZIALI.....	16	3	1	1				X	X	X	X	T	XD	
	-ESPOSIZIONI IN STATO DI DEFAULT PONDERATE AL 150%.....	18	3	1	1				X	X	X	X	T	XD	
Y	TECNICHE DI ATTENUAZIONE DEL RISCHIO DI CREDITO: ALTRE INFORMAZIONI.....	59052													
	-TOTALE ATTIVITÀ DI RISCHIO: DI CUI PMI.....	02	3	1	1						X	X	X	T	XD
	-TOTALE ATTIVITÀ DI RISCHIO: DI CUI PMI CUI SI APPLICA IL FATTORE DI SOSTEGNO (0,7619).....	04	3	1	1						X	X	X	T	XD
	-TOTALE ATTIVITÀ DI RISCHIO: DI CUI ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI RESIDENZIALI.....	06	3	1	1						X	X	X	T	XD
	-TOTALE ATTIVITÀ DI RISCHIO: DI CUI ESPOSIZIONI SOGGETTE ALL'UTILIZZO PARZIALE PERMANENTE DELLA METODOLOGIA STANDARDIZZATA.....	08	3	1	1						X	X	X	T	XD
	-TOTALE ATTIVITÀ DI RISCHIO: DI CUI ESPOSIZIONI SOGGETTE A ESTENSIONE PROGRESSIVA DEL METODO IRB.....	10	3	1	1						X	X	X	T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.2.2 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE SU BASE INDIVIDUALE: METODOLOGIA BASATA SUI RATING INTERNI	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	C L A S S E M E R I T O C R	F A T T O R E P O N D E R A Z	F O R M A T E C N I C A	G A R A N Z R I L E I M P	M E T O D O L A P P L I C	P O R T A F O G L I O	T I P O G A R A N Z I A	T I P O I M P O R T O	T I P O L O G S O G G F I N	P E R I O D I C I T A'	N O T E
Y	METODOLOGIA BASATA SUI RATING INTERNI: PROBABILITA' DI DEFAULT.....	59530														
	-RISCHIO DI CREDITO															
	-AMMINISTRAZIONI CENTRALI E BANCHE CENTRALI.....	02	3	1	1	X		X					X		T	XD
	-INTERMEDIARI VIGILATI, ENTI PUBBLICI E TERRITORIALI E ALTRI SOGGETTI.....	04	3	1	1	X		X					X		T	XD
	-IMPRESE E FINANZIAMENTI SPECIALIZZATI:															
	-FINANZIAMENTI SPECIALIZZATI.....	06	3	1	1	X		X					X		T	XD
	-PMI.....	20	3	1	1	X		X					X		T	XD
	-PMI: CUI SI APPLICA IL FATTORE DI SOSTEGNO (0,7619)..	22	3	1	1	X		X					X		T	XD
	-ALTRE IMPRESE.....	24	3	1	1	X		X					X		T	XD
	-ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO															
	-ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI: PMI.....	26	3	1	1	X		X					X		T	XD
	-ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI: PMI CUI SI APPLICA IL FATTORE DI SOSTEGNO (0,7619).....	28	3	1	1	X		X					X		T	XD
	-ALTRE ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO: PMI.....	30	3	1	1	X		X					X		T	XD
	-ALTRE ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO: PMI CUI SI APPLICA IL FATTORE DI SOSTEGNO (0,7619).....	32	3	1	1	X		X					X		T	XD
	-ESPOSIZIONI ROTATIVE AL DETTAGLIO QUALIFICATE.....	12	3	1	1	X		X					X		T	XD
	-ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI: PERSONE FISICHE...	34	3	1	1	X		X					X		T	XD
	-ALTRE ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO: PERSONE FISICHE.....	36	3	1	1	X		X					X		T	XD
	-TOTALE.....	38	3	1	1	X		X					X		T	XD
	-METODO PD/LGD.....	15	3	1	1	X							X		T	XD
	-RISCHIO DI DILUIZIONE.....	16	3	1	1						X				T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.2.2 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE SU BASE INDIVIDUALE: METODOLOGIA BASATA SUI RATING INTERNI	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	C L A S S E M E R I T O C R	F A T T O R E P O N D E R A Z	F O R M A T E C N I C A	G A R A N Z R I L E I M P	M E T O D O L A P P L I C	P O R T A F O G L I O	T I P O G A R A N Z I A	T I P O I M P O R T O	T I P O S O G G F I N	P E R I O D I C I T A'	N O T E
Y	METODOLOGIA BASATA SUI RATING INTERNI: ATTIVITA' DI RISCHIO.....	59532														
	-TOTALE (*).....	01	3	1	1	X			X	X			X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI E BANCHE CENTRALI (*).....	02	3	1	1	X			X	X			X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA INTERMEDIARI VIGILATI, ENTI PUBBLICI E TERRITORIALI E ALTRI SOGGETTI(*).....	03	3	1	1	X			X	X			X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA IMPRESE:															
	-FINANZIAMENTI SPECIALIZZATI(*).....	12	3	1	1	X			X	X			X	X	T	XD
	-PMI(*).....	13	3	1	1	X			X	X			X	X	T	XD
	-PMI CUI SI APPLICA IL FATTORE DI SOSTEGNO (0,7619) (*).....	15	3	1	1	X			X	X			X	X	T	XD
	-ALTRE IMPRESE (*).....	17	3	1	1	X			X	X			X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO:															
	-ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI: PMI (*).....	46	3	1	1	X			X				X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI: PMI CUI SI APPLICA IL FATTORE DI SOSTEGNO (0,7619)(*).....	48	3	1	1	X			X				X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI: PERSONE FISICHE(*)..	22	3	1	1	X			X				X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI ROTATIVE AL DETTAGLIO QUALIFICATE (*).....	24	3	1	1	X			X				X	X	T	XD
	-ALTRE ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO: PMI(*).....	50	3	1	1	X			X				X	X	T	XD
	-ALTRE ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO: PMI CUI SI APPLICA IL FATTORE DI SOSTEGNO (0,7619)(*).....	52	3	1	1	X			X				X	X	T	XD
	-ALTRE ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO: PERSONE FISICHE(*).....	28	3	1	1	X			X				X	X	T	XD
	-CREDITI COMMERCIALI ACQUISTATI - RISCHIO DI DILUIZIONE(*).....	32	3	1	1					X	X		X		T	XD
	-FINANZIAMENTI SPECIALIZZATI - SLOTTING CRITERIA.....	36	3	1	1		X		X	X	X		X		T	XD
	-TRATTAMENTO ALTERNATIVO DELLE IPOTECHE IMMOBILIARI.....	38	3	1	1				X	X	X		X		T	XD
	-ESPOSIZIONI PER TRANSAZIONI CON REGOLAMENTO NON CONTESTUALE EX ARTICOLO 379(2) CRR, ESPOSIZIONI IN STRUMENTI N-TO-DEFAULT PRIVE DI RATING ED ESPOSIZIONI RESIDUE.....	54	3	1	1				X	X	X		X		T	XD
	-TOTALE ATTIVITÀ DI RISCHIO															
	-ATTIVITÀ 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
	-OPERAZIONI SFT (*).....	63	3	1	1				X	X			X		T	XD
	-CONTRATTI DERIVATI E OPERAZIONI CON REGOLAMENTO A LUNGO TEMINE(*).....	65	3	1	1				X	X			X		T	XD
	-COMPENSAZIONE TRA PRODOTTI DIVERSI(*).....	68	3	1	1				X	X			X		T	XD

(163) (*) ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.2.2 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE SU BASE INDIVIDUALE: METODOLOGIA BASATA SUI RATING INTERNI	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	C L A S S E	F A T T O R E	F O R M A	G A R A N Z	M E T O D O L	P O R T A F O G L I O	T I P O	T I P O	T I P O	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoc														
Y	TECNICHE DI ATTENUAZIONE DEL RISCHIO DI CREDITO: AMMONTARE PROTETTO.....	59054														
	STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO PERSONALE E REALE (PRINCIPIO DI SOSTITUZIONE)															
	-ESPOSIZIONI GARANTITE:															
	-TOTALE.....	02	3	1	1	X				X	X	X	X		T	XD
	-CREDITI COMMERCIALI ACQUISTATI - RISCHIO DI DILUIZIONE.....	03	3	1	1	X				X	X	X	X		T	XD
	-ESPOSIZIONI PER TRANSAZIONI CON REGOLAMENTO NON CONTESTUALE EX ARTICOLO 379(2) CRR, ESPOSIZIONI IN STRUMENTI N-TO-DEFAULT PRIVE DI RATING ED ESPOSIZIONI RESIDUE.....	05	3	1	1	X				X	X	X	X		T	XD
	-ATTIVITÀ DI RISCHIO PER CASSA.....	04	3	1	1					X	X	X	X		T	XD
	-GARANZIE RILASCIATE E IMPEGNI A EROGARE FONDI.....	06	3	1	1					X	X	X	X		T	XD
	-OPERAZIONI SFT.....	08	3	1	1					X	X	X	X		T	XD
	-CONTRATTI DERIVATI E OPERAZIONI CON REGOLAMENTO A LUNGO TERMINE.....	10	3	1	1					X	X	X	X		T	XD
	-COMPENSAZIONE TRA PRODOTTI DIVERSI.....	12	3	1	1					X	X	X	X		T	XD
	STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO PERSONALE E REALE CONSIDERATI NELLA STIMA DELLA LGD															
	-ESPOSIZIONI GARANTITE:															
	-TOTALE.....	14	3	1	1	X				X	X	X	X		T	XD
	-CREDITI COMMERCIALI ACQUISTATI- RISCHIO DI DILUIZIONE.....	15	3	1	1	X				X	X	X	X		T	XD
	-ATTIVITÀ DI RISCHIO PER CASSA.....	16	3	1	1					X	X	X	X		T	XD
	-GARANZIE RILASCIATE E IMPEGNI A EROGARE FONDI.....	18	3	1	1					X	X	X	X		T	XD
	-OPERAZIONI SFT.....	20	3	1	1					X	X	X	X		T	XD
	-CONTRATTI DERIVATI E OPERAZIONI CON REGOLAMENTO A LUNGO TERMINE.....	22	3	1	1					X	X	X	X		T	XD
	-COMPENSAZIONE TRA PRODOTTI DIVERSI.....	24	3	1	1					X	X	X	X		T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.2.3 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE SU BASE INDIVIDUALE: METODOLOGIA BASATA SUI RATING INTERNI - ESPOSIZIONI IN STRUMENTI DI CAPITALE	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	C L A S S E	F A T T O R E	T I P O	T I P O	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoci									
Y	METODOLOGIA BASATA SUI RATING INTERNI: ESPOSIZIONI IN										
	STRUMENTI DI CAPITALE.....	59534									
	-METODO PD/LGD: ATTIVITÀ DI RISCHIO(*).....		02	3	1	1	X		X	T	XD
	-METODO DELLA PONDERAZIONE SEMPLICE: ATTIVITÀ DI RISCHIO..		04	3	1	1		X	X	T	XD
	-METODO DEI MODELLI INTERNI: ATTIVITÀ DI RISCHIO.....		06	3	1	1			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI IN STRUMENTI DI CAPITALE SOGGETTE A FATTORI DI PONDERAZIONE FISSI (250% E 370%).....		08	3	1	1			X	T	XD
	<i>(163) (*) ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali</i>										
Y	ESPOSIZIONI IN STRUMENTI DI CAPITALE: TECNICHE DI										
	ATTENUAZIONE DEL RISCHIO DI CREDITO - AMMONTARE PROTETTO....	59058									
	STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO PERSONALE E REALE (PRINCIPIO DI SOSTITUZIONE)										
	-ESPOSIZIONI GARANTITE:										
	-METODO PD/LGD.....		02	3	1	1		X	X	T	XD
	-METODO DELLA PONDERAZIONE SEMPLICE.....		04	3	1	1		X	X	T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.2.4 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE SU BASE INDIVIDUALE: RISCHIO DI REGOLAMENTO PER LE TRANSAZIONI CON REGOLAMENTO CONTESTUALE	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	T E M P O	T I P O	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		SOTVOC							
Y	RISCHIO DI REGOLAMENTO PER LE TRANSAZIONI CON REGOLAMENTO								
	CONTESTUALE: ESPOSIZIONE.....	59060 00	3	1	1	X	X	T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

BASE INF.	4.2.5 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE SU BASE INDIVIDUALE: CARTOLARIZZAZIONI	VOCE	DURATA	DIVISA	RESIDENZA	CLASSE PONDERRAZ	CLAUSURE ANTIC	DETRAZIONE	FATTORE CONVERS	CLASMER CREDITO	CLMER CREDITO ORIG	FORMATECNICA	RUOLO CARTOLARIZ	TIPO CARTOLARIZ	TIPO IMPORTO	TIPOLOG SOTTOST	PERIODICITA'	NOTE
Y	METODOLOGIA STANDARDIZZATA: POSIZIONI VERSO LA																	
	CARTOLARIZZAZIONE.....	59536																
	-ATTIVITÀ DI RISCHIO PER CASSA																	
	-POSIZIONI VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE(*).....	02	3	1	1			X	X				X	X	X		T	XD
	-POSIZIONI VERSO LA RI-CARTOLARIZZAZIONE(*).....	03	3	1	1			X	X				X	X	X		T	XD
	-ATTIVITÀ DI RISCHIO FUORI BILANCIO																	
	-POSIZIONI VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE (*).....	04	3	1	1			X	X	X			X	X	X		T	XD
	-POSIZIONI VERSO LA RI-CARTOLARIZZAZIONE(*).....	05	3	1	1			X	X	X			X	X	X		T	XD
	-CLAUSOLE DI RIMBORSO ANTICIPATO.....	06	3	1	1			X	X	X			X	X	X		T	XD
	-TOTALE ESPOSIZIONI.....	20	3	1	1			X	X	X			X	X	X		T	XD

(163) (*) ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali

Y	METODOLOGIA STANDARDIZZATA: POSIZIONI VERSO LA																	
	CARTOLARIZZAZIONE: AMMONTARE PROTETTO.....	59538																
	-ATTIVITÀ DI RISCHIO																	
	-STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO PERSONALE E ASSIMILATI, DERIVATI SU CREDITO - EFFETTO SOSTITUZIONE.....	01	3	1	1		X					X	X	X	X	X	T	XD
	-STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO REALE - METODO SEMPLIFICATO.....	02	3	1	1		X					X	X		X	X	T	XD
	-STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO REALE - METODO INTEGRALE.....	12	3	1	1		X					X	X	X	X	X	T	XD

Y METODOLOGIA BASATA SU RATING INTERNI: POSIZIONI VERSO LA

	CARTOLARIZZAZIONE.....	59062																
	-ATTIVITÀ DI RISCHIO PER CASSA																	
	-POSIZIONI VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE(*).....	02	3	1	1	X		X	X				X	X	X		T	XD
	-POSIZIONI VERSO LA RI-CARTOLARIZZAZIONE(*).....	04	3	1	1	X		X	X				X	X	X		T	XD
	-ATTIVITÀ DI RISCHIO FUORI BILANCIO																	
	-POSIZIONI VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE(*).....	06	3	1	1	X		X	X	X			X	X	X		T	XD
	-POSIZIONI VERSO LA RI-CARTOLARIZZAZIONE(*).....	08	3	1	1	X		X	X	X			X	X	X		T	XD
	-CLAUSOLE DI RIMBORSO ANTICIPATO(*).....	10	3	1	1			X	X	X			X	X	X		T	XD
	-TOTALE ESPOSIZIONI.....	12	3	1	1			X	X	X			X	X	X		T	XD

(163) (*) ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali

Y	METODOLOGIA BASATA SU RATING INTERNI: POSIZIONI VERSO LA																	
	CARTOLARIZZAZIONE: AMMONTARE PROTETTO.....	59064																
	-ATTIVITÀ DI RISCHIO																	
	-STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO PERSONALE E ASSIMILATI, DERIVATI SU CREDITO - EFFETTO SOSTITUZIONE.....	02	3	1	1		X					X	X	X	X	X	T	XD
	-STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO REALE - METODO SEMPLIFICATO.....	04	3	1	1		X					X	X		X	X	T	XD
	-STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO REALE - METODO INTEGRALE.....	06	3	1	1		X					X	X	X	X	X	T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.2.6 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE SU BASE INDIVIDUALE: CARTOLARIZZAZIONI - INFORMAZIONI AGGIUNTIVE	VOCE		D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	C A R T O L P O S F/ B I L	C O D I C E	M E T O D O L	C O N F O R M I T T A	T I P O	I N T E C O N O M I C O R R	P O R T O	R U O L O	S T A T O	T I P O	T I P O	T I P O	T R A T T A M	I D E N T	I D E N T	D A T A	P R D A T A	D A T A	P E R I O D I C I T A'	N O T E		
		sotvoc																										
Y	OPERAZIONI DI CARTOLARIZZAZIONE.....	59066																										
	- IDENTIFICATIVO OPERAZIONE (#).....	02	3	1	1			X												X						S	XD	
	- IDENTIFICATIVO ORIGINATOR (#).....	04	3	1	1			X														X				S	XD	
	- PERCENTUALE DEGLI IMPEGNI MANTENUTI DALL'EMITTENTE (*)..	06	3	1	1			X		X	X	X	X					X	X	X						S	XD	
(603) (*) Ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali; (#) La voce deve essere segnalata indicando convenzionalmente "1" nel campo importo.																												
Y	PORTAFOGLIO CARTOLARIZZATO.....	59067																										
	- CARATTERISTICHE GENERALI (#).....	02	3	1	1			X	X						X				X							S	XD	
	- ESPOSIZIONI (*).....	04	3	1	1			X								X										S	XD	
(603) (*) Ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali; (#) La voce deve essere segnalata indicando convenzionalmente "1" nel campo importo.																												
Y	STRUTTURA OPERAZIONE E POSIZIONE VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE.....	59069																										
	-STRUTTURA OPERAZIONE (#).....	02	3	1	1			X																X	X	S	XD	
	-ATTIVITA' DI RISCHIO PER CASSA.....	04	3	1	1			X								X	X									S	XD	
	-ATTIVITA' DI RISCHIO FUORI BILANCIO.....	06	3	1	1		X	X								X	X									S	XD	
	-POSIZIONE VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE NEL TB.....	12	3	1	1			X					X													S	XD	
	-POSIZIONE LUNGA.....	14	3	1	1			X								X										S	XD	
	-POSIZIONE CORTA.....	16	3	1	1			X								X										S	XD	
	-POSIZIONE DETRATTA DAI FONDI PROPRI (-).....	18	3	1	1			X								X										S	XD	
	-TOTALE POSIZIONI VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE (*).....	20	3	1	1			X								X										S	XD	
(603) (*) Ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali; (#) La voce deve essere segnalata indicando convenzionalmente "1" nel campo importo.																												

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.2.7 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE SU BASE INDIVIDUALE: RIPARTIZIONE GEOGRAFICA ATTIVITA' DI RISCHIO	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	P M I	S T A T O	T I P O I M P O R T O	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoc								
Y	RIPARTIZIONE GEOGRAFICA ATTIVITA' DI RISCHIO - METODOLOGIA									
	STANDARDIZZATA.....	59070								
	ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA AMMINISTRAZIONI									
	CENTRALI E BANCHE CENTRALI.....	02	3	1	1		X	X	T	XD
	ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA AMMINISTRAZIONI									
	REGIONALI O AUTORITA' LOCALI.....	04	3	1	1		X	X	T	XD
	ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA ORGANISMI DEL SETTORE									
	PUBBLICO.....	06	3	1	1		X	X	T	XD
	ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA BANCHE MULTILATERALI DI									
	SVILUPPO.....	08	3	1	1		X	X	T	XD
	ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA ORGANIZZAZIONI									
	INTERNAZIONALI.....	10	3	1	1		X	X	T	XD
	ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA INTERMEDIARI VIGILATI....	12	3	1	1		X	X	T	XD
	ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA IMPRESE.....	14	3	1	1		X	X	T	XD
	ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA IMPRESE: DI CUI PMI.....	16	3	1	1		X	X	T	XD
	ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO.....	18	3	1	1		X	X	T	XD
	ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO: DI CUI PMI.....	20	3	1	1		X	X	T	XD
	ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI.....	22	3	1	1		X	X	T	XD
	ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI: DI CUI PMI.....	24	3	1	1		X	X	T	XD
	ESPOSIZIONI IN STATO DI DEFAULT.....	26	3	1	1		X	X	T	XD
	ESPOSIZIONI AD ALTO RISCHIO.....	28	3	1	1		X	X	T	XD
	ESPOSIZIONI SOTTO FORMA DI OBBLIGAZIONI BANCARIE									
	GARANTITE.....	30	3	1	1		X	X	T	XD
	ESPOSIZIONI A BREVE TERMINE VERSO IMPRESE E INTERMEDIARI									
	VIGILATI.....	32	3	1	1		X	X	T	XD
	ESPOSIZIONI VERSO ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO									
	DEL RISPARMIO (OIC).....	34	3	1	1		X	X	T	XD
	ESPOSIZIONI IN STRUMENTI DI CAPITALE.....	36	3	1	1		X	X	T	XD
	ALTRE ESPOSIZIONI.....	38	3	1	1		X	X	T	XD

Y	RIPARTIZIONE GEOGRAFICA ATTIVITA' DI RISCHIO - METODOLOGIA									
	BASATA SUI RATING INTERNI.....	59072								
	TOTALE (*).....	02	3	1	1		X	X	T	XD
	ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA AMMINISTRAZIONI									
	CENTRALI E BANCHE CENTRALI(*).....	04	3	1	1		X	X	T	XD
	ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA INTERMEDIARI VIGILATI									
	(*).....	06	3	1	1		X	X	T	XD
	ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA IMPRESE (*).....	08	3	1	1		X	X	T	XD
	ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA IMPRESE: DI CUI									
	FINANZIAMENTI SPECIALIZZATI (*).....	10	3	1	1		X	X	T	XD
	ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA IMPRESE: DI CUI PMI (*)..	12	3	1	1		X	X	T	XD
	ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO (*).....	14	3	1	1		X	X	T	XD
	ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO: DI CUI GARANTITE DA IMMOBILI									
	(*).....	16	3	1	1	X	X	X	T	XD
	ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO: DI CUI ROTATIVE QUALIFICATE									
	(*).....	18	3	1	1		X	X	T	XD
	ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO: DI CUI ALTRO (*).....	20	3	1	1	X	X	X	T	XD
	ESPOSIZIONI IN STRUMENTI DI CAPITALE (*).....	22	3	1	1		X	X	T	XD

(163) (*) ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.2.7 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE SU BASE INDIVIDUALE: RIPARTIZIONE GEOGRAFICA ATTIVITA' DI RISCHIO	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	P M I	S T A T O	T I P O I M P O R T O	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoci								
Y	RIPARTIZIONE GEOGRAFICA DEI REQUISITI PATRIMONIALI TOTALI									
	A FRONTE DEL RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE.....	59074								
	REQUISITO PATRIMONIALE.....	02	3	1	1		X	X	T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.2.8 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE SU BASE INDIVIDUALE: ALTRO	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z I A	M E T O D O L O G I A	S T A T O	T I P O	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoc								
Y	PERDITE SU CREDITI IPOTECARI.....	59076								
	-ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI RESIDENZIALI.....	02	3	1	1		X	X	S	XD
	-ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI NON RESIDENZIALI.....	04	3	1	1		X	X	S	XD
Y	AGGIUSTAMENTO DELLA VALUTAZIONE DEL CREDITO (CVA).....	59078								
	- ESPOSIZIONI TOTALI.....	02	3	1	1	X		X	T	XD
	- DI CUI: DERIVATI OTC.....	04	3	1	1	X		X	T	XD
	- DI CUI: SFT.....	06	3	1	1	X		X	T	XD
	- VAR REGOLAMENTARE DECADELE									
	- MEDIA RELATIVA AGLI ULTIMI 60 GIORNI MOLTIPLICATA									
	PER IL FATTORE bc.....	10	3	1	1	X		X	T	XD
	- VAR T-1.....	12	3	1	1	X		X	T	XD
	- VAR REGOLAMENTARE DECADELE IN CONDIZIONI DI STRESS									
	- MEDIA RELATIVA AGLI ULTIMI 60 GIORNI MOLTIPLICATA									
	PER IL FATTORE bs.....	16	3	1	1	X		X	T	XD
	- VAR IN CONDIZIONI DI STRESS T-1.....	18	3	1	1	X		X	T	XD
	- NUMERO DI CONTROPARTI.....	20	3	1	1	X		X	T	XD
	- DI CUI: PROXY DIFFERENZIALE SUL CDS.....	22	3	1	1	X		X	T	XD
	- COPERTURE AMMISSIBILI									
	- CDS.....	26	3	1	1	X		X	T	XD
	- INDICI DI CDS.....	28	3	1	1	X		X	T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

BASE INF.	4.3.1 GRANDI ESPOSIZIONI SU BASE INDIVIDUALE	VOCE	DURATA	DIVISA	RESIDENZA	ATTIV. ECON. RAMO	CODICE CENSITO	CODICE CENSITO	POSIZ. DIRETTA	TIPOLOG. CONTRO	TIPOLOG. POSIZ.	TIPOLOG. POSIZ.	PERIODICITA'	NOTE
Y	ATTIVITÀ DI RISCHIO.....	59090												
	PORTAFOGLIO NON DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA.....	02	3	1	1			X	X				T	XD
	TOTALE DELLE ATTIVITÀ DI RISCHIO (*).....	04	3	1	1			X	X	X	X		T	XD
	- TOTALE DELLE ATTIVITÀ DI RISCHIO: DI CUI POSIZIONI IN STATO DI DEFAULT.....	06	3	1	1			X	X				T	XD
	TOTALE DELLE ATTIVITÀ DI RISCHIO: TIPOLOGIA ESPOSIZIONE													
	-DI CUI: STRUMENTI DI DEBITO.....	10	3	1	1			X	X	X			T	XD
	-DI CUI: STRUMENTI DI CAPITALE.....	12	3	1	1			X	X	X			T	XD
	-DI CUI: STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI.....	14	3	1	1			X	X	X			T	XD
	-DI CUI: IMPEGNI A EROGARE FONDI.....	16	3	1	1			X	X	X			T	XD
	-DI CUI: GARANZIE REALI FINANZIARIE.....	18	3	1	1			X	X	X			T	XD
	-DI CUI: ALTRE GARANZIE E IMPEGNI.....	20	3	1	1			X	X	X			T	XD
	-DI CUI: SCHEMI DI INVESTIMENTO.....	22	3	1	1			X	X				T	XD
	(163) (*) Ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali													
Y	TECNICHE DI ATTENUAZIONE DELLE ATTIVITÀ DI RISCHIO.....	59092												
	-EFFETTO DI SOSTITUZIONE: RIPARTIZIONE PER SOTTOSTANTE GARANTITO													
	-DI CUI: STRUMENTI DI DEBITO.....	02	3	1	1			X	X				T	XD
	-DI CUI: STRUMENTI DI CAPITALE.....	04	3	1	1			X	X				T	XD
	-DI CUI: STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI.....	06	3	1	1			X	X				T	XD
	-DI CUI: IMPEGNI A EROGARE FONDI.....	08	3	1	1			X	X				T	XD
	-DI CUI: GARANZIE REALI FINANZIARIE.....	10	3	1	1			X	X				T	XD
	-DI CUI: ALTRE GARANZIE E IMPEGNI.....	12	3	1	1			X	X				T	XD
	-METODOLOGIA INTEGRALE.....	14	3	1	1			X	X				T	XD
	-GARANZIE IMMOBILIARI.....	16	3	1	1			X	X				T	XD
Y	ATTIVITÀ DI RISCHIO: COMPOSIZIONE DEI GRUPPI DI CLIENTI CONNESSI.....	59094												
	-PORTAFOGLIO NON DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA.....	02	3	1	1			X	X	X			T	XD
	-TOTALE DELLE ATTIVITÀ DI RISCHIO (*).....	04	3	1	1			X	X	X	X	X	T	XD
	-TOTALE DELLE ATTIVITÀ DI RISCHIO: DI CUI POSIZIONI IN STATO DI DEFAULT.....	06	3	1	1			X	X	X			T	XD
	-TOTALE DELLE ATTIVITÀ DI RISCHIO: TIPOLOGIA ESPOSIZIONE													
	-DI CUI: STRUMENTI DI DEBITO.....	10	3	1	1			X	X	X	X		T	XD
	-DI CUI: STRUMENTI DI CAPITALE.....	12	3	1	1			X	X	X	X		T	XD
	-DI CUI: STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI.....	14	3	1	1			X	X	X	X		T	XD
	-DI CUI: IMPEGNI A EROGARE FONDI.....	16	3	1	1			X	X	X	X		T	XD
	-DI CUI: GARANZIE REALI FINANZIARIE.....	18	3	1	1			X	X	X	X		T	XD
	-DI CUI: ALTRE GARANZIE E IMPEGNI.....	20	3	1	1			X	X	X	X		T	XD
	-DI CUI: SCHEMI DI INVESTIMENTO.....	22	3	1	1			X	X	X			T	XD
	(163) (*) Ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali													

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

BASE INF.	4.3.1 GRANDI ESPOSIZIONI SU BASE INDIVIDUALE	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	A T T I V E C O N - R A M O	C O D I C E C E N S I T O B	C O D I C E C E N S I T O A	P O S I Z I M P O R T O	T I P O L O G C O N T R O P	T I P O L O G P O S I Z X	T I P O L O G P O S I Z Y	P E R I O D I C I T A'	N O T E	
		sotvoc													
Y	TECNICHE DI ATTENUAZIONE DELLE ATTIVITA' DI RISCHIO:														
	COMPOSIZIONE DEI GRUPPI DI CLIENTI CONNESSI.....	59096													
	EFFETTO DI SOSTITUZIONE: RIPARTIZIONE PER SOTTOSTANTE GARANTITO														
	-DI CUI: STRUMENTI DI DEBITO.....	02	3	1	1		X	X	X				T	XD	
	-DI CUI: STRUMENTI DI CAPITALE.....	04	3	1	1		X	X	X				T	XD	
	-DI CUI: STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI.....	06	3	1	1		X	X	X				T	XD	
	-DI CUI: IMPEGNI A EROGARE FONDI.....	08	3	1	1		X	X	X				T	XD	
	-DI CUI: GARANZIE REALI FINANZIARIE.....	10	3	1	1		X	X	X				T	XD	
	-DI CUI: ALTRE GARANZIE E IMPEGNI.....	12	3	1	1		X	X	X				T	XD	
	-METODOLOGIA INTEGRALE.....	14	3	1	1		X	X	X				T	XD	
	-GARANZIE IMMOBILIARI.....	16	3	1	1		X	X	X				T	XD	
Y	GRANDI ESPOSIZIONI: IDENTIFICAZIONE DELLA CONTROPARTE.....	59102													
	-CONTROPARTI ITALIANE (#).....	02	3	1	1			X		X			T		
	-CONTROPARTI ESTERE:														
	-SOCIETA' NON FINANZIARIE (#).....	04	3	1	2	S		X		X			T		
	-ALTRE SOCIETA' FINANZIARIE (#).....	06	3	1	2	D		X		X			T		
	-ALTRE (#).....	08	3	1	2			X		X			T		
	<small>(601) - (#) La voce deve essere segnalata indicando convenzionalmente " 1 nel campo importo.</small>														
Y	GRANDI ESPOSIZIONI: LIMITI APPLICATI.....	59104													
	-ENTI(*).....	02	3	1	1				X				T	XD	
	-CONTROPARTI DIVERSE DA ENTI.....	04	3	1	1				X				T	XD	
	<small>(163) (*) Ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali</small>														

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

BASE INF.	4.4 RISCHIO DI MERCATO SU BASE INDIVIDUALE	VOCE	DURATA	DIVISA	RESIDENZA	APPROCCIO	FATTORE DI POND	FORMA TECNICA	METODOLOG APPLIC	PAESE MERC QUOT	RUOLO CARTOLARIZ	TEMPO INADEMPIM	TIPO DI RISCHIO	TIPO IMPORTO	TIPO LOG SOTTOST	VALUTA	VRS RISC MERC	PERIODICITA'	NOTE
Y	PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA:																		
	METODOLOGIA STANDARDIZZATA - TITOLI DI DEBITO - RISCHIO																		
	GENERICO E SPECIFICO.....	59150																	
	RISCHIO GENERICO.....	02	3	1	1									X		X		T	XD
	RISCHIO GENERICO: DI CUI CONTRATTI DERIVATI																	T	
	-POSIZIONI LUNGHE.....	04	3	1	1									X		X		T	XD
	-POSIZIONI CORTE.....	06	3	1	1									X		X		T	XD
	RISCHIO GENERICO: DI CUI ALTRE ATTIVITA' E PASSIVITA'																		
	-POSIZIONI LUNGHE.....	08	3	1	1									X		X		T	XD
	-POSIZIONI CORTE.....	10	3	1	1									X		X		T	XD
	RISCHIO GENERICO: METODO BASATO SULLA SCADENZA.....	11	3	1	1									X		X		T	XD
	-POSIZIONI LUNGHE.....	12	3	1	1									X		X	X	T	XD
	-POSIZIONI CORTE.....	14	3	1	1									X		X	X	T	XD
	RISCHIO GENERICO: METODO BASATO SULLA DURATA																		
	FINANZIARIA.....	15	3	1	1									X		X		T	XD
	-POSIZIONI LUNGHE.....	16	3	1	1									X		X	X	T	XD
	-POSIZIONI CORTE.....	18	3	1	1									X		X	X	T	XD
	RISCHIO SPECIFICO.....	17	3	1	1									X		X		T	XD
	-POSIZIONI LUNGHE.....	20	3	1	1									X		X		T	XD
	-POSIZIONI CORTE.....	22	3	1	1									X		X		T	XD
	RISCHIO SPECIFICO: DI CUI TITOLI DI DEBITO DI																		
	CATEGORIA 1.....	23	3	1	1									X		X		T	XD
	-POSIZIONI LUNGHE.....	24	3	1	1									X		X		T	XD
	-POSIZIONI CORTE.....	26	3	1	1									X		X		T	XD
	RISCHIO SPECIFICO: DI CUI TITOLI DI DEBITO DI																		
	CATEGORIA 2.....	27	3	1	1									X		X	X	T	XD
	-POSIZIONI LUNGHE.....	28	3	1	1									X		X	X	T	XD
	-POSIZIONI CORTE.....	30	3	1	1									X		X	X	T	XD
	RISCHIO SPECIFICO: DI CUI TITOLI DI DEBITO DI																		
	CATEGORIA 3.....	31	3	1	1									X		X		T	XD
	-POSIZIONI LUNGHE.....	32	3	1	1									X		X		T	XD
	-POSIZIONI CORTE.....	34	3	1	1									X		X		T	XD
	RISCHIO SPECIFICO: DI CUI TITOLI DI DEBITO DI																		
	CATEGORIA 4.....	35	3	1	1									X		X		T	XD
	-POSIZIONI LUNGHE.....	36	3	1	1									X		X		T	XD
	-POSIZIONI CORTE.....	38	3	1	1									X		X		T	XD
	DERIVATI NTH-TO-DEFAULT.....	39	3	1	1									X		X		T	XD
	-POSIZIONI LUNGHE.....	40	3	1	1									X		X		T	XD
	-POSIZIONI CORTE.....	42	3	1	1									X		X		T	XD
	POSIZIONI VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE.....	44	3	1	1									X		X		T	XD
	PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE DI CORRELAZIONE.....	46	3	1	1									X		X		T	XD
	OIC.....	48	3	1	1									X		X		T	XD
	OPZIONI: RISCHI AGGIUNTIVI.....	50	3	1	1	X								X		X		T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

BASE INF.	4.4 RISCHIO DI MERCATO SU BASE INDIVIDUALE	VOCE	DURATA	DIVISA	RESIDENZA	APPROCCIO	FATTORE DI POND	FORMA TECNICA	METODOLOG APPLIC	PAESE MERC QUOT	RUOLO CARTOLARIZ	TEMPO INADEMPIM	TIPO DIRISCHIO	TIPO IMPORTO	TIPOLOG SOTTOST	VALUTA	VRES RISC MERC	PERIODICITA'	NOTE
Y	PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA:																		
	METODOLOGIA STANDARDIZZATA - POSIZIONI VERSO LA																		
	CARTOLARIZZAZIONE - RISCHIO SPECIFICO.....	59567																	
	TOTALE DELLE POSIZIONI VERSO CARTOLARIZZAZIONI.....	34	3	1	1								X	X				T	XD
	-POSIZIONI LUNGHE VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE(*).....	36	3	1	1		X			X			X					T	XD
	-POSIZIONI CORTE VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE(*).....	38	3	1	1		X			X			X					T	XD
	-POSIZIONI LUNGHE VERSO LA RI-CARTOLARIZZAZIONE(*).....	40	3	1	1		X			X			X					T	XD
	-POSIZIONI CORTE VERSO LA RI-CARTOLARIZZAZIONE(*).....	42	3	1	1		X			X			X					T	XD
	<i>(163) (*) ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali</i>																		
Y	PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA:																		
	METODOLOGIA STANDARDIZZATA - SOTTO PORTAFOGLIO DI																		
	NEGOZIAZIONE DI CORRELAZIONE - RISCHIO SPECIFICO.....	59569																	
	-POSIZIONI VERSO CARTOLARIZZAZIONI																		
	-POSIZIONI LUNGHE(*).....	46	3	1	1		X			X			X					T	XD
	-POSIZIONI CORTE(*).....	48	3	1	1		X			X			X					T	XD
	-POSIZIONI IN DERIVATI CREDITIZI N-TO-DEFAULT																		
	-POSIZIONI LUNGHE.....	34	3	1	1		X						X					T	XD
	-POSIZIONI CORTE.....	36	3	1	1		X						X					T	XD
	-ALTRE POSIZIONI DEL PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE DI																		
	CORRELAZIONE:																		
	-CONNESSE CON POSIZIONI VERSO CARTOLARIZZAZIONI																		
	-POSIZIONI LUNGHE.....	50	3	1	1		X			X			X					T	XD
	-POSIZIONI CORTE.....	52	3	1	1		X			X			X					T	XD
	-CONNESSE CON POSIZIONI IN DERIVATI CREDITIZI																		
	N-TO-DEFAULT																		
	-POSIZIONI LUNGHE.....	54	3	1	1		X						X					T	XD
	-POSIZIONI CORTE.....	56	3	1	1		X						X					T	XD
	<i>(163) (*) ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali</i>																		

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

BASE INF.	4.4 RISCHIO DI MERCATO SU BASE INDIVIDUALE	VOCE	DURATA	DIVISA	RESIDENZA	APPROCCIO	FATTORE DI POND	FORMA TECNICA	METODOLOG APPLIC	PAESE MERC QUOT	RUOLO CARTO LA RIZ	TEMPO INADEMPI M	TIPO DI RISCHIO	TIPO IMPORTO	TIPOLOG SOTTOST	VALUTA	VRES RISC MERC	PERIODICITA'	NOTE
Y	PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA:																		
		METODOLOGIA STANDARDIZZATA - TITOLI DI CAPITALE.....	59568																
		-RISCHIO GENERICO.....	11	3	1	1				X			X					T	XD
		-POSIZIONI LUNGHE.....	20	3	1	1				X			X					T	XD
		-POSIZIONI CORTE.....	22	3	1	1				X			X					T	XD
		-RISCHIO GENERICO - DI CUI:																	
		-DERIVATI																	
		-POSIZIONI LUNGHE.....	24	3	1	1				X			X					T	XD
		-POSIZIONI CORTE.....	26	3	1	1				X			X					T	XD
		-ALTRE ATTIVITA' E PASSIVITA'																	
		-POSIZIONI LUNGHE.....	28	3	1	1				X			X					T	XD
		-POSIZIONI CORTE.....	30	3	1	1				X			X					T	XD
		-INDICI AZIONARI NEGOZIATI DIVERSIFICATI																	
		-POSIZIONI LUNGHE.....	32	3	1	1				X			X					T	XD
		-POSIZIONI CORTE.....	34	3	1	1				X			X					T	XD
		-ALTRI TITOLI DI CAPITALE																	
		-POSIZIONI LUNGHE.....	36	3	1	1				X			X					T	XD
		-POSIZIONI CORTE.....	38	3	1	1				X			X					T	XD
		-RISCHIO SPECIFICO.....	71	3	1	1				X			X					T	XD
		-POSIZIONI LUNGHE.....	72	3	1	1				X			X					T	XD
		-POSIZIONI CORTE.....	74	3	1	1				X			X					T	XD
		-OIC.....	75	3	1	1				X			X					T	XD
		-POSIZIONI LUNGHE.....	76	3	1	1				X			X					T	XD
		-POSIZIONI CORTE.....	78	3	1	1				X			X					T	XD
		-OPZIONI: RISCHI AGGIUNTIVI.....	79	3	1	1	X			X			X					T	XD
		-POSIZIONI LUNGHE.....	80	3	1	1				X			X					T	XD
		-POSIZIONI CORTE.....	82	3	1	1				X			X					T	XD
Y		RISCHIO DI REGOLAMENTO PER LE TRANSAZIONI CON REGOLAMENTO																	
		CONTESTUALE - ESPOSIZIONE.....	59575	00	3	1	1						X	X				T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

BASE INF.	4.4 RISCHIO DI MERCATO SU BASE INDIVIDUALE	VOCE	DURATA	DIVISA	RESIDENZA	APPROCCIO	FATTORE DI POND	FORMA TECNICA	METODOLOGIA APPLIC	PAESE MERC QUOT	RUOLO CARTOGLARIZ	TEMPO INADEMPIM	TIPO DI RISCHIO	TIPO IMPORTO	TIPOLOG SOTTOST	VALUTA	VRES RISSC MERC	PERIODICITA'	NOTE
Y	RISCHIO DI CAMBIO: METODOLOGIA STANDARDIZZATA - POSIZIONE																		
	NETTA APERTA IN CAMBI.....	59578																	
	-POSIZIONE COMPLESSIVA IN VALUTE ESTERE																		
	-POSIZIONI LUNGHE.....	42	3	1	1								X					T	XD
	-POSIZIONI CORTE.....	44	3	1	1								X					T	XD
	-POSIZIONE COMPENSATA.....	46	3	1	1								X					T	XD
	-POSIZIONE COMPLESSIVA IN VALUTE ESTERE: DI CUI VALUTE STRETTAMENTE CORRELATE.....	47	3	1	1								X					T	XD
	-POSIZIONE LUNGA.....	48	3	1	1								X					T	XD
	-POSIZIONE CORTA.....	50	3	1	1								X					T	XD
	-POSIZIONE COMPENSATA.....	52	3	1	1								X					T	XD
	-POSIZIONE COMPLESSIVA IN VALUTE ESTERE: DI CUI ALTRE VALUTE.....	53	3	1	1								X					T	XD
	-POSIZIONE LUNGA.....	54	3	1	1								X					T	XD
	-POSIZIONE CORTA.....	56	3	1	1								X					T	XD
	-POSIZIONE COMPLESSIVA IN VALUTE ESTERE: DI CUI ORO.....	57	3	1	1								X					T	XD
	-POSIZIONE LUNGA.....	58	3	1	1								X					T	XD
	-POSIZIONE CORTA.....	62	3	1	1								X					T	XD
	-POSIZIONE COMPLESSIVA IN VALUTE ESTERE:DI CUI OPZIONI-RISCHI AGGIUNTIVI.....	64	3	1	1	X							X					T	XD
	-POSIZIONE COMPLESSIVA																		
	-POSIZIONE LUNGA.....	66	3	1	1			X					X		X			T	XD
	-POSIZIONE CORTA.....	68	3	1	1			X					X		X			T	XD
Y	RISCHIO SULLE POSIZIONI IN MERCI: METODOLOGIA STANDARDIZZATA.....	59590																	
	-METALLI PREZIOSI (ECCETTO L'ORO).....	12	3	1	1								X					T	XD
	POSIZIONI LUNGHE.....	14	3	1	1								X					T	XD
	POSIZIONI CORTE.....	16	3	1	1								X					T	XD
	-METALLI COMUNI.....	18	3	1	1								X					T	XD
	POSIZIONI LUNGHE.....	20	3	1	1								X					T	XD
	POSIZIONI CORTE.....	22	3	1	1								X					T	XD
	-PRODOTTI AGRICOLI.....	24	3	1	1								X					T	XD
	POSIZIONI LUNGHE.....	26	3	1	1								X					T	XD
	POSIZIONI CORTE.....	28	3	1	1								X					T	XD
	-ALTRO.....	30	3	1	1								X					T	XD
	POSIZIONI LUNGHE.....	32	3	1	1								X					T	XD
	POSIZIONI CORTE.....	34	3	1	1								X					T	XD
	-ALTRO: DI CUI PRODOTTI ENERGETICI.....	36	3	1	1								X					T	XD
	POSIZIONI LUNGHE.....	38	3	1	1								X					T	XD
	POSIZIONI CORTE.....	40	3	1	1								X					T	XD
	-TOTALE POSIZIONI IN MERCI.....	42	3	1	1			X					X					T	XD
	POSIZIONI LUNGHE.....	44	3	1	1			X					X					T	XD
	POSIZIONI CORTE.....	46	3	1	1			X					X					T	XD
	-OPZIONI - RISCHI AGGIUNTIVI.....	48	3	1	1	X							X					T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.4 RISCHIO DI MERCATO SU BASE INDIVIDUALE	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 R O C C I O	F A T T O R E D I P O N D	F O R M A T E C N I C A	M E T O D O L O G A P P L I C A	P A E S E M E R C Q U O T	R U O L O C A R T O L A R I Z	T E M P O I N A D E M P I M	T I P O D I R I S C H I O	T I P O I M P O R T O	T I P O L O G S O T T O S T	V A L U T A	V R E S R I S C M E R C	P E R I O D I C I T A'	N O T E	
		sotvoci																		
Y	MODELLI INTERNI SUI RISCHI DI MERCATO: INFORMAZIONI SUL																			
	VAR.....	59580																		
	-VAR REGOLAMENTARE DECADELE																			
	-MEDIA RELATIVA AGLI ULTIMI 60 GIORNI MOLTIPLICATA PER IL FATTORE mc.....	02	3	1	1								X	X					T	XD
	-VAR T-1.....	04	3	1	1								X	X					T	XD
	-VAR REGOLAMENTARE DECADELE IN CONDIZIONI DI STRESS:																			
	-MEDIA RELATIVA AGLI ULTIMI 60 GIORNI MOLTIPLICATA PER IL FATTORE ms.....	05	3	1	1								X	X					T	XD
	-VAR IN CONDIZIONI DI STRESS T-1.....	07	3	1	1								X	X					T	XD
	-REQUISITO PER IL RISCHIO DI MIGRAZIONE E DEFAULT (IRC):																			
	-MEDIA RELATIVA ALLE 12 SETTIMANE PRECEDENTI.....	09	3	1	1								X						T	XD
	-IRC T-1.....	11	3	1	1								X						T	XD
	-APR:																			
	-MEDIA RELATIVA ALLE 12 SETTIMANE PRECEDENTI.....	13	3	1	1								X						T	XD
	-APR T-1.....	15	3	1	1								X						T	XD
	-APR FLOOR.....	17	3	1	1								X						T	XD
	-NUMERO DI SCOSTAMENTI DEL VAR REGOLAMENTARE.....	22	3	1	1														T	XD
	-FATTORE MOLTIPLICATIVO mc (*).....	24	3	1	1														T	XD
	-FATTORE MOLTIPLICATIVO ms (*).....	26	3	1	1														T	XD
	-APR: REQUISITO APPLICATO ALLE SOLE POSIZIONI LUNGHE NETTE DEL PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE DI CORRELAZIONE....	28	3	1	1								X						T	XD
	-APR: REQUISITO APPLICATO ALLE SOLE POSIZIONI CORTE NETTE DEL PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE DI CORRELAZIONE....	30	3	1	1								X						T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

BASE INF.	4.6 POSIZIONE PATRIMONIALE INDIVIDUALE	VOCE	DURATA	DIVISA	RESIDENZA	PERIODICITA'	NOTE
		sotvoci					
Y	ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO TOTALI: RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE.....	59300					
	METODOLOGIA STANDARDIZZATA						
	- AMMINISTRAZIONI CENTRALI E BANCHE CENTRALI.....	02	3	1	1	T	XD
	- AMMINISTRAZIONI REGIONALI O AUTORITA' LOCALI.....	04	3	1	1	T	XD
	- ORGANISMI DEL SETTORE PUBBLICO.....	06	3	1	1	T	XD
	- BANCHE MULTILATERALI DI SVILUPPO.....	08	3	1	1	T	XD
	- ORGANIZZAZIONI INTERNAZIONALI.....	10	3	1	1	T	XD
	- INTERMEDIARI VIGILATI.....	12	3	1	1	T	XD
	- IMPRESE.....	14	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO.....	16	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI.....	18	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI SCADUTE.....	20	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI AD ALTO RISCHIO.....	22	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI SOTTO FORMA DI OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE.....	24	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI A BREVE TERMINE VERSO IMPRESE O INTERMEDIARI VIGILATI.....	26	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI VERSO ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO DEL RISPARMIO (OIC).....	28	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI IN STRUMENTI DI CAPITALE.....	30	3	1	1	T	XD
	- ALTRE ESPOSIZIONI.....	32	3	1	1	T	XD
	- CARTOLARIZZAZIONI						
	- POSIZIONI VERSO CARTOLARIZZAZIONI: TOTALE.....	34	3	1	1	T	XD
	- POSIZIONI VERSO CARTOLARIZZAZIONI: DETTAGLIO						
	POSIZIONI VERSO RI-CARTOLARIZZAZIONI.....	36	3	1	1	T	XD
	METODOLOGIA BASATA SUI RATING INTERNI:						
	-TUTTE LE METODOLOGIE						
	- STRUMENTI DI CAPITALE.....	38	3	1	1	T	XD
	- POSIZIONI VERSO LE CARTOLARIZZAZIONI: TOTALE.....	40	3	1	1	T	XD
	- POSIZIONI VERSO LE CARTOLARIZZAZIONI: DETTAGLIO						
	POSIZIONI VERSO LE RI-CARTOLARIZZAZIONI.....	42	3	1	1	T	XD
	- ALTRE ATTIVITA'.....	44	3	1	1	T	XD
	-METODOLOGIA DI BASE						
	- AMMINISTRAZIONI CENTRALI E BANCHE CENTRALI.....	46	3	1	1	T	XD
	- INTERMEDIARI VIGILATI.....	48	3	1	1	T	XD
	- IMPRESE - PMI.....	50	3	1	1	T	XD
	- IMPRESE - PMI CUI SI APPLICA IL FATTORE DI SOSTEGNO (0,7619).....	52	3	1	1	T	XD
	- IMPRESE - FINANZIAMENTI SPECIALIZZATI.....	54	3	1	1	T	XD
	- IMPRESE - ALTRO.....	56	3	1	1	T	XD
	-METODOLOGIA AVANZATA						
	- AMMINISTRAZIONI CENTRALI E BANCHE CENTRALI.....	58	3	1	1	T	XD
	- INTERMEDIARI VIGILATI.....	60	3	1	1	T	XD
	- IMPRESE - PMI.....	62	3	1	1	T	XD
	- IMPRESE - PMI CUI SI APPLICA IL FATTORE DI SOSTEGNO (0,7619).....	64	3	1	1	T	XD
	- IMPRESE - FINANZIAMENTI SPECIALIZZATI.....	66	3	1	1	T	XD
	- IMPRESE - ALTRO.....	68	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO VERSO PMI - GARANTITE DA						

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.6 POSIZIONE PATRIMONIALE INDIVIDUALE	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						
	IMMOBILI.....	70	3	1	1	T	XD	
	- ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO GARANTITE DA IMMOBILI VERSO PMI CUI SI APPLICA IL FATTORE DI SOSTEGNO (0,7619).....	72	3	1	1	T	XD	
	- ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO VERSO NON PMI - GARANTITE DA IMMOBILI.....	74	3	1	1	T	XD	
	- ESPOSIZIONI ROTATIVE AL DETTAGLIO QUALIFICATE.....	76	3	1	1	T	XD	
	- ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO VERSO PMI - ALTRO.....	78	3	1	1	T	XD	
	- ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO - ALTRO: VERSO PMI CUI SI APPLICA IL FATTORE DI SOSTEGNO (0,7619).....	80	3	1	1	T	XD	
	- ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO VERSO NON PMI - ALTRO.....	82	3	1	1	T	XD	
	- ESPOSIZIONI VERSO CONTROPARTI CENTRALI NELLA FORMA DI CONTRIBUTI PREFINANZIATI AL FONDO DI GARANZIA.....	84	3	1	1	T	XD	
<input checked="" type="checkbox"/>	ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO TOTALI: RISCHIO DI AGGIUSTAMENTO DELLA VALUTAZIONE DEL CREDITO.....	59302						
	- METODO DELL'ESPOSIZIONE ORIGINARIA.....	02	3	1	1	T	XD	
	- METODO STANDARD.....	04	3	1	1	T	XD	
	- METODO AVANZATO.....	06	3	1	1	T	XD	
<input checked="" type="checkbox"/>	ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO TOTALI: RISCHIO DI REGOLAMENTO.....	59304						
	- POSIZIONI INCLUSE NEL PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE DI VIGILANZA.....	02	3	1	1	T	XD	
	- POSIZIONI INCLUSE NEL PORTAFOGLIO BANCARIO.....	04	3	1	1	T	XD	
<input checked="" type="checkbox"/>	ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO TOTALI: RISCHI DI MERCATO (POSIZIONE, CAMBIO E MERCI).....	59306						
	METODOLOGIA STANDARDIZZATA							
	- RISCHIO DI POSIZIONE SU STRUMENTI DI DEBITO.....	02	3	1	1	T	XD	
	- RISCHIO DI POSIZIONE SU STRUMENTI DI CAPITALE.....	04	3	1	1	T	XD	
	- RISCHIO DI CAMBIO.....	06	3	1	1	T	XD	
	- RISCHIO DI POSIZIONE SU MERCI.....	08	3	1	1	T	XD	
	MODELLI INTERNI							
	- MODELLI INTERNI: TOTALE.....	10	3	1	1	T	XD	
<input checked="" type="checkbox"/>	ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO TOTALI: RISCHIO DI CONCENTRAZIONE.....	59308	00	3	1	1	T	XD
<input checked="" type="checkbox"/>	ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO TOTALI: RISCHIO OPERATIVO.....	59310						
	- METODO BASE.....	02	3	1	1	T	XD	
	- METODO STANDARDIZZATO.....	04	3	1	1	T	XD	
	- METODI AVANZATI.....	06	3	1	1	T	XD	
<input checked="" type="checkbox"/>	ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO TOTALI - SIM: SPESE FISSE GENERALI.....	59312	00	3	1	1	T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.6 POSIZIONE PATRIMONIALE INDIVIDUALE	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					
Y	ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO TOTALI: ALTRO.....	59314					
	- ART 458 CRR						
	- CONCENTRAZIONE DEI RISCHI.....	04	3	1	1	T	XD
	- SETTORE IMMOBILIARE.....	06	3	1	1	T	XD
	- SETTORE FINANZIARIO.....	08	3	1	1	T	XD
	- ART 459 CRR.....	10	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO SPECIFICHE.....	12	3	1	1	T	XD
	- ART 3 CRR.....	14	3	1	1	T	XD
Y	POSIZIONE PATRIMONIALE COMPLESSIVA.....	59324					
	- ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO TOTALI.....	02	3	1	1	T	XD
	- COEFFICIENTE DI CET1.....	08	3	1	1	T	XD
	- COEFFICIENTE DI CET1 INCLUSI REQUISITI DI FONDI PROPRI SPECIFICI.....	10	3	1	1	T	XD
	- ECCEDEZZA/DEFICIENZA DI CET1 RISPETTO SOGLIA DEL 4,5%...	12	3	1	1	T	XD
	- COEFFICIENTE DI T1.....	14	3	1	1	T	XD
	- COEFFICIENTE DI T1 INCLUSI I REQUISITI DI FONDI PROPRI SPECIFICI.....	16	3	1	1	T	XD
	- ECCEDEZZA/DEFICIENZA DI T1 RISPETTO SOGLIA DEL 6%.....	18	3	1	1	T	XD
	- COEFFICIENTE DEI FONDI PROPRI.....	20	3	1	1	T	XD
	- COEFFICIENTE DEI FONDI PROPRI INCLUSI I REQUISITI DI FONDI PROPRI SPECIFICI.....	22	3	1	1	T	XD
	- ECCEDEZZA/DEFICIENZA DI FONDI PROPRI RISPETTO RISPETTO SOGLIA DELL' 8%.....	24	3	1	1	T	XD
Y	INFORMAZIONI AGGIUNTIVE.....	59326					
	- LIVELLO DI CET1 SPECIFICO (TARGET).....	02	3	1	1	T	XD
	- LIVELLO DI T1 SPECIFICO (TARGET).....	04	3	1	1	T	XD
	- LIVELLO DI FONDI PROPRI SPECIFICO (TARGET).....	06	3	1	1	T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.7.1 RISCHIO DI LIQUIDITA' SU BASE INDIVIDUALE - COPERTURA DELLA LIQUIDITA' (LCR)- MONITORAGGIO ATTIVITA' LIQUIDE	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	E S P O S I T I O N I	C L A S S E	G R A D O	T I P O	V A L U T A	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoci										
LY	ATTIVITA' LIQUIDE DI BASE.....	59350										
	- CASSA.....	02	3	1	1				X	X	M	XD
	- ESPOSIZIONI VERSO BANCA CENTRALE MOBILIZZABILI IN CONDIZIONI DI STRESS.....	04	3	1	1				X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI O REGIONALI.....	06	3	1	1	X			X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BANCHE CENTRALI O DA ORGANISMI DEL SETTORE PUBBLICO.....	08	3	1	1	X			X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BRI, FMI, CE E BMS.....	10	3	1	1	X			X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA EFSF, ESM.....	12	3	1	1	X			X	X	M	XD
	- AZIONI O QUOTE DI OIC											
	- DI CUI: SCARTO PRUDENZIALE 0% (CRR, ART. 416(1) LETTERA A).....	14	3	1	1				X	X	M	XD
	- DI CUI: SCARTO PRUDENZIALE 5% (CRR, ART. 416(1) LETTERA B E C).....	16	3	1	1				X	X	M	XD
	- DI CUI: SCARTO PRUDENZIALE 20% (CRR, ART. 416(1) LETTERA D).....	18	3	1	1				X	X	M	XD
	- LINEE DI CREDITO STAND BY GARANTITE ACCORDATE DALLA BANCA CENTRALE.....	20	3	1	1				X	X	M	XD
	- SISTEMI DI TUTELA ISTITUZIONALE O ENTI AFFILIATI PERMANENTEMENTE AD UN ORGANISMO CENTRALE											
	- DI CUI: DEPOSITI.....	22	3	1	1				X	X	M	XD
	- DI CUI: ALTRI FONDI CONTRATTUALMENTE DISPONIBILI.....	24	3	1	1				X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI DA BANCHE COSTITUITE DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI O REGIONALI.....	26	3	1	1			X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI DA IMPRESE NON FINANZIARIE.....	28	3	1	1	X	X	X	X	X	M	XD
	- OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE CON PONDERAZIONE RIDOTTA.....	30	3	1	1	X	X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI GARANTITI DA CREDITI IPOTECARI COMMERCIALI (CMBS).....	32	3	1	1	X	X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI GARANTITI DA CREDITI IPOTECARI RESIDENZIALI (RMBS).....	34	3	1	1	X	X	X	X	X	M	XD
	- OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE AMMISSIBILI EX ART. 52(4) DIRETTIVA 2009/65.....	36	3	1	1	X	X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI DI LIQUIDITA' E QUALITA' CREDITIZIA ESTREMAMENTE ELEVATE: ALTRE.....	38	3	1	1	X			X	X	M	XD
	- TITOLI DI LIQUIDITA' E QUALITA' CREDITIZIA ELEVATE: ALTRE.....	40	3	1	1	X			X	X	M	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.7.1 RISCHIO DI LIQUIDITA' SU BASE INDIVIDUALE - COPERTURA DELLA LIQUIDITA' (LCR)- MONITORAGGIO ATTIVITA' LIQUIDE	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	E S P O S I T I V I T A	C L A S S I F I C A Z I O N E	G R A D O	T I P O	V A L U T A	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoc										
LY	ATTIVITA' LIQUIDE SUPPLEMENTARI.....	59352										
	- CASSA.....	02	3	1	1				X	X	M	XD
	- ESPOSIZIONE VERSO BANCA CENTRALE MOBILIZZABILI IN CONDIZIONI DI STRESS.....	04	3	1	1				X	X	M	XD
	- TITOLI SOGGETTI A PONDERAZIONE PARI A 0%											
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI.....	06	3	1	1	X		X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BANCHE CENTRALI.....	08	3	1	1			X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA ORGANISMI DEL SETTORE PUBBLICO, REGIONI ED AUTORITA' LOCALI.....	10	3	1	1			X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BRI, FMI, UE, BMS, EFSF, ESM.....	12	3	1	1			X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI O BANCHE CENTRALI: ALTRE.....	14	3	1	1			X	X	X	M	XD
	- TITOLI SOGGETTI A PONDERAZIONE PARI A 20%											
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI.....	16	3	1	1	X		X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BANCHE CENTRALI.....	18	3	1	1			X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA ORGANISMI DEL SETTORE PUBBLICO, REGIONI CON AUTONOMIA FISCALE ED AUTORITA' LOCALI.....	20	3	1	1			X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BMS.....	22	3	1	1			X	X	X	M	XD
	- OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE: ALTRE.....	24	3	1	1			X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI DA IMPRESE NON FINANZIARIE CON PONDERAZIONE MINORE O UGUALE AL 50%.....	26	3	1	1			X	X	X	M	XD
	- TITOLI GARANTITI DA CREDITI IPOTECARI RESIDENZIALI (RMBS): SOTTOSTANTE CON PONDERAZIONE AL 35%.....	28	3	1	1			X	X	X	M	XD
	- LINEE DI CREDITO STAND BY GARANTITE ACCORDATE DALLA BANCA CENTRALE.....	30	3	1	1			X	X	X	M	XD
	- SISTEMI DI TUTELA ISTITUZIONALE O ENTI AFFILIATI PERMANENTEMENTE AD UN ORGANISMO CENTRALE.....	32	3	1	1			X	X	X	M	XD
	- STRUMENTI DI CAPITALE.....	34	3	1	1			X	X	X	M	XD
	- ORO.....	36	3	1	1			X	X	X	M	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.7.1 RISCHIO DI LIQUIDITA' SU BASE INDIVIDUALE - COPERTURA DELLA LIQUIDITA' (LCR)- MONITORAGGIO ATTIVITA' LIQUIDE	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	E S P O S I T I O N I	C L A S S E M E R C R E D I T O	G R A D O L I Q / Q U A C R	T I P O I M P O R T O	V A L U T A	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoc										
LY	ATTIVITA' LIQUIDE AGGIUNTIVE.....	59354										
	- TITOLI EMESSI DA IMPRESE FINANZIARIE.....	02	3	1	1		X		X	X	M	XD
	- EMISSIONI PROPRIE.....	04	3	1	1		X		X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI DA BANCHE NON GARANTITI.....	06	3	1	1		X		X	X	M	XD
	- TITOLI GARANTITI DA CREDITI IPOTECARI COMMERCIALI (CMBS): ALTRI.....	08	3	1	1		X		X	X	M	XD
	- TITOLI GARANTITI DA CREDITI IPOTECARI RESIDENZIALI (RMBS): ALTRI.....	10	3	1	1		X		X	X	M	XD
	- STRUMENTI DI CAPITALE.....	12	3	1	1				X	X	M	XD
	- ORO.....	14	3	1	1				X	X	M	XD
	- TITOLI DI DEBITO GARANTITI: ALTRI.....	16	3	1	1				X	X	M	XD
	- OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE NON AMMISSIBILI.....	18	3	1	1				X	X	M	XD
	- TITOLI DI DEBITO EMESSI DA IMPRESE NON FINANZIARIE: ALTRI.....	20	3	1	1				X	X	M	XD
	- AZIONI O QUOTE IN OIC.....	22	3	1	1				X	X	M	XD
	- ALTRE ATTIVITA' AMMISSIBILI PRESSO BANCA CENTRALE											
	- DI CUI: TITOLI EMESSI DA AMMINISTRAZIONI LOCALI.....	24	3	1	1				X	X	M	XD
	- DI CUI: COMMERCIAL PAPER.....	26	3	1	1				X	X	M	XD
	- DI CUI: CREDITI.....	28	3	1	1				X	X	M	XD
	- GIURISDIZIONI CON SCARSE ATTIVITA' LIQUIDE											
	- DEROGA DI TIPO A (DISALLINEAMENTO DI VALUTA).....	30	3	1	1				X	X	M	XD
	- DEROGA DI TIPO B (LINEA DI CREDITO DALLA BANCA CENTRALE).....	32	3	1	1				X	X	M	XD
	- FINANZA ISLAMICA: TITOLI AMMESSI.....	34	3	1	1		X		X	X	M	XD
LY	ATTIVITA' LIQUIDE: ALTRE INFORMAZIONI.....	59356										
	ATTIVITA' LIQUIDE											
	- ESPOSIZIONE VERSO BANCA CENTRALE.....	02	3	1	1				X	X	M	XD
	ATTIVITA' LIQUIDE NON AMMISSIBILI											
	- ATTIVITA' NON INCLUSE NELLA FUNZIONE DI GESTIONE DELLA LIQUIDITA'.....	04	3	1	1			X	X	X	M	XD
	- ATTIVITA' NON DISPONIBILI NEI 30 GIORNI SUCCESSIVI....	06	3	1	1			X	X	X	M	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F	4.7.2 RISCHIO DI LIQUIDITA' SU BASE INDIVIDUALE - COPERTURA DELLA LIQUIDITA' (LCR)- DEFLUSSI E AFFLUSSI	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	D E F L U S S I / A F F L U S S	D E P O S I T O G A R A N T	E S P O S I T O I N D I R	C L A S S I F I C A T O R I E	G R A D O L I Q / Q U A C R	T I P O I M P O R T O	T I P O L O G C O N T R O P	V A L U T A	P E R I O D I C I T A'	N O T E
LY	DEFLUSSI RELATIVI A OPERAZIONI DIVERSE DA SFT.....	59360													
	DEPOSITI AL DETTAGLIO														
	- DEPOSITI GARANTITI: RELAZIONI CONSOLIDATE.....	02	3	1	1						X	X	M	XD	
	- DEPOSITI GARANTITI: CONTO TRANSATTIVO.....	04	3	1	1						X	X	M	XD	
	- DEPOSITI GARANTITI: ALTRO.....	06	3	1	1						X	X	M	XD	
	- DEPOSITI NON GARANTITI.....	08	3	1	1						X	X	M	XD	
	- DEPOSITI SOGGETTI A PERCENTUALI DI DEFLUSSO SPECIFICHE														
	- CATEGORIA 1.....	10	3	1	1						X	X	M	XD	
	- CATEGORIA 2.....	12	3	1	1						X	X	M	XD	
	- CATEGORIA 3.....	14	3	1	1						X	X	M	XD	
	- DEPOSITI IN PAESI TERZI SOGGETTI A PONDERAZIONI DI DEFLUSSO MAGGIORI.....	16	3	1	1						X	X	M	XD	
	- DEPOSITI ESENTATI.....	18	3	1	1						X	X	M	XD	
	DEPOSITI NON AL DETTAGLIO - OPERATIVI														
	- DEPOSITI: SERVIZI DI COMPENSAZIONE, CUSTODIA, GESTIONE DELLA LIQUIDITA' CONFORMI ARTICOLO 422 (4) DELLA CRR.....	20	3	1	1		X				X	X	X	M	XD
	- DEPOSITI: SERVIZI DI COMPENSAZIONE, CUSTODIA, GESTIONE DELLA LIQUIDITA' NON CONFORMI ARTICOLO 422 (4) DELLA CRR.....	22	3	1	1		X				X	X	X	M	XD
	- DEPOSITI: SISTEMI DI TUTELA ISTITUZIONALE.....	24	3	1	1						X	X	X	M	XD
	- DEPOSITI: RELAZIONE OPERATIVA CONSOLIDATA.....	26	3	1	1						X	X	X	M	XD
	- DEPOSITI: RETE COOPERATIVA.....	28	3	1	1						X	X	X	M	XD
	- ISTITUTI DI CREDITO CENTRALI: DEPOSITI.....	30	3	1	1						X	X	X	M	XD
	- ISTITUTI DI CREDITO CENTRALI: ALTRI FONDI.....	32	3	1	1						X	X	X	M	XD
	DEPOSITI NON OPERATIVI E ALTRE PASSIVITA'														
	- DEPOSITI: CLIENTELA NON FINANZIARIA.....	34	3	1	1		X				X	X	M	XD	
	- STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI.....	36	3	1	1						X	X	M	XD	
	- PASSIVITA' INFRAGRUPPO: SOGGETTI ITALIANI.....	38	3	1	1						X	X	M	XD	
	- PASSIVITA' INFRAGRUPPO: SOGGETTI UE.....	40	3	1	1						X	X	M	XD	
	- LINEE DI CREDITO O LIQUIDITA' VERSO CLIENTI AL DETTAGLIO.....	42	3	1	1						X	X	M	XD	
	- LINEE DI CREDITO VERSO CLIENTELA NON FINANZIARIA.....	44	3	1	1						X	X	M	XD	
	- LINEE DI LIQUIDITA' VERSO CLIENTELA NON FINANZIARIA.....	46	3	1	1						X	X	M	XD	
	- LINEE DI LIQUIDITA' VERSO VEICOLI AI SENSI DELL'ART.424, PAR.4, CRR.....	48	3	1	1						X	X	M	XD	
	- LINEE DI LIQUIDITA' VERSO VEICOLI PER ACQUISTO O SCAMBIO ATTIVI CARTOLARIZZATI.....	50	3	1	1						X	X	M	XD	
	- LINEE DI LIQUIDITA' VERSO VEICOLI: ALTRO.....	52	3	1	1						X	X	M	XD	
	- LINEE DI CREDITO VERSO BANCHE.....	54	3	1	1						X	X	M	XD	
	- LINEE DI LIQUIDITA' VERSO BANCHE.....	56	3	1	1						X	X	M	XD	
	- LINEE DI CREDITO VERSO SIM ED ENTI FINANZIARI.....	58	3	1	1						X	X	M	XD	
	- LINEE DI LIQUIDITA' VERSO SIM ED ENTI FINANZIARI.....	60	3	1	1						X	X	M	XD	
	- LINEE DI CREDITO O LIQUIDITA' VERSO SOGGETTI INFRAGRUPPO.....	62	3	1	1						X	X	M	XD	
	- LINEE DI CREDITO O LIQUIDITA' PER PRESTITI AGEVOLATI.....	64	3	1	1						X	X	M	XD	
	- LINEE DI CREDITO O LIQUIDITA' VERSO ALTRI SOGGETTI.....	66	3	1	1						X	X	M	XD	
	- ALTRE PASSIVITA' POTENZIALI.....	68	3	1	1						X	X	M	XD	
	- TRADE FINANCE.....	70	3	1	1						X	X	M	XD	

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.7.2 RISCHIO DI LIQUIDITA' SU BASE INDIVIDUALE - COPERTURA DELLA LIQUIDITA' (LCR)- DEFLUSSI E AFFLUSSI	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	D E F L U S S I / A F F L U S S	D E P O S I T O / G A R A N T	E S P O S I T O / I N D I R	C L A S S E / C R E D I T O	G R A D O / L I Q / Q U A C R	T I P O / I M P O R T O	T I P O / C O N T R O P	V A L U T A	P E R I O D I C I T A'	N O T E
	- ALTRE PASSIVITA': FUORI BILANCIO.....	72	3	1	1						X		X	M	XD
	- ALTRE PASSIVITA': ALTRE.....	74	3	1	1						X		X	M	XD
	DEFLUSSI: ALTRI														
	- OPERAZIONI IN STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI														
	- GARANZIE REALI FORNITE.....	76	3	1	1						X		X	M	XD
	- FABBISOGNO GARANZIE REALI AGGIUNTIVE: MERITO DI CREDITO.....	78	3	1	1						X		X	M	XD
	- FABBISOGNO GARANZIE REALI AGGIUNTIVE: SCENARI DI MERCATO AVVERSI.....	80	3	1	1						X		X	M	XD
	- VENDITE ALLO SCOPERTO.....	82	3	1	1						X		X	M	XD
	- GARANZIE DOVUTE NON ANCORA RICHIESTE.....	84	3	1	1						X		X	M	XD
	- GARANZIE REALI RICEVUTE ECCEDENTI GLI OBBLIGHI CONTRATTUALI.....	86	3	1	1						X		X	M	XD
	- GARANZIE REALI RICEVUTE SOSTITUIBILI UNILATERALMENTE DALLA CONTROPARTE.....	88	3	1	1						X		X	M	XD
	- GARANZIE REALI RICEVUTE: DEPOSITI.....	90	3	1	1						X		X	M	XD
	- PROPRIE SPESE DI FUNZIONAMENTO.....	92	3	1	1						X		X	M	XD
LY	AFFLUSSI RELATIVI A OPERAZIONI DIVERSE DA SFT.....	59362													
	CLIENTELA NON FINANZIARIA														
	- CLIENTI AL DETTAGLIO.....	02	3	1	1						X		X	M	XD
	- IMPRESE NON FINANZIARIE.....	04	3	1	1						X		X	M	XD
	- BANCHE CENTRALI.....	06	3	1	1						X		X	M	XD
	- ALTRI.....	08	3	1	1						X		X	M	XD
	CLIENTELA FINANZIARIA														
	- DEPOSITI OPERATIVI.....	10	3	1	1						X		X	M	XD
	- ATTIVITA' INFRAGRUPPO: SOGGETTI ITALIANI.....	12	3	1	1						X		X	M	XD
	AFFLUSSI: ALTRI														
	- TRADE FINANCE.....	14	3	1	1						X		X	M	XD
	- CREDITI REVOCABILI A SCADENZA INDETERMINATA.....	16	3	1	1						X		X	M	XD
	- STRUMENTI DI CAPITALE.....	18	3	1	1						X		X	M	XD
	ALTRE ATTIVITA'														
	- LINEE DI CREDITO O LIQUIDITA' INFRAGRUPPO: SOGGETTI ITALIANI.....	20	3	1	1						X		X	M	XD
	- LINEE DI CREDITO O LIQUIDITA' INFRAGRUPPO: SOGGETTI UE.....	22	3	1	1						X		X	M	XD
	- STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI: INFRAGRUPPO.....	24	3	1	1						X		X	M	XD
	- AFFLUSSI NON INCLUSI NEL VALORE DI MERCATO DELLE ATTIVITA' LIQUIDE DI BASE.....	26	3	1	1						X		X	M	XD
	- AFFLUSSI: ALTRI.....	28	3	1	1						X		X	M	XD
	- (-) AFFLUSSI NON AMMISSIBILI (CAP).....	30	3	1	1						X		X	M	XD
	AFFLUSSI ESENTI DAL CAP														
	- AFFLUSSI CONNESSI A CREDITI IPOTECARI A GARANZIA DI OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE.....	32	3	1	1						X		X	M	XD
	- PRESTITI AGEVOLATI.....	34	3	1	1						X		X	M	XD
	- AFFLUSSI INFRAGRUPPO EX CRR, ART. 113 (6) E SISTEMI DI TUTELA ISTITUZIONALE.....	36	3	1	1						X		X	M	XD
	- AFFLUSSI INFRAGRUPPO ESENTATI DALL'AUTORITA' DI VIGILANZA.....	38	3	1	1						X		X	M	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.7.2 RISCHIO DI LIQUIDITA' SU BASE INDIVIDUALE - COPERTURA DELLA LIQUIDITA' (LCR)- DEFLUSSI E AFFLUSSI	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z I A	D E F L U S S I / A F F L U S S	D E P O S I T O G A R A N T	E S P O S I T O I N D I R	C L A S S E M E R C R E D I T O	G R A D O L I Q / Q U A C R	T I P O I M P O R T O	T I P O L O G C O N T R O P	V A L U T A	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoc													
LY	DEFLUSSI/AFFLUSSI RELATIVI A OPERAZIONI SFT.....	59364													
	SOTTOSTANTE ATTIVITA' LIQUIDE DI BASE														
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI O REGIONALI.....	02	3	1	1	X		X		X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BANCHE CENTRALI O DA ORGANISMI DEL SETTORE PUBBLICO.....	04	3	1	1	X		X		X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BRI, FMI, CE E BMS.....	06	3	1	1	X		X		X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA EFSF, ESM.....	08	3	1	1	X		X		X	X	X	X	M	XD
	- AZIONI O QUOTE DI OIC														
	- DI CUI: SCARTO PRUDENZIALE 0% (CRR, ART. 416(1) LETTERA A).....	10	3	1	1	X				X	X	X	X	M	XD
	- DI CUI: SCARTO PRUDENZIALE 5% (CRR, ART. 416(1) LETTERA B E C).....	12	3	1	1	X				X	X	X	X	M	XD
	- DI CUI: SCARTO PRUDENZIALE 20% (CRR, ART. 416(1) LETTERA D).....	14	3	1	1	X				X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI DA BANCHE COSTITUITE DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI O REGIONALI.....	16	3	1	1	X				X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI DA IMPRESE NON FINANZIARIE.....	18	3	1	1	X			X	X	X	X	X	M	XD
	- OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE CON PONDERAZIONE RIDOTTA.....	20	3	1	1	X			X	X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI GARANTITI DA CREDITI IPOTECARI COMMERCIALI (CMBS).....	22	3	1	1	X			X	X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI GARANTITI DA CREDITI IPOTECARI RESIDENZIALI (RMBS).....	24	3	1	1	X			X	X	X	X	X	M	XD
	- OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE AMMISSIBILI EX ART. 52(4) DIRETTIVA 2009/65.....	26	3	1	1	X			X	X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI DI LIQUIDITA' E QUALITA'CREDITIZIA ESTREMAMENTE ELEVATE: ALTRE.....	28	3	1	1	X			X	X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI DI LIQUIDITA' E QUALITA'CREDITIZIA ELEVATE: ALTRE.....	30	3	1	1	X			X	X	X	X	X	M	XD
	SOTTOSTANTE ATTIVITA' LIQUIDE NON AMMISSIBILI														
	- ATTIVITA' NON INCLUSE NELLA FUNZIONE DI GESTIONE DELLA LIQUIDITA'.....	32	3	1	1	X				X	X	X	X	M	XD
	- ATTIVITA' NON DISPONIBILI NEI 30 GIORNI SUCCESSIVI.....	34	3	1	1	X				X	X	X	X	M	XD
	SOTTOSTANTE ATTIVITA' LIQUIDE SUPPLEMENTARI														
	- CASSA.....	36	3	1	1	X				X	X	X	X	M	XD
	- ESPOSIZIONI VERSO BANCA CENTRALE MOBILIZZABILI IN CONDIZIONI DI STRESS.....	38	3	1	1	X				X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI SOGGETTI A PONDERAZIONE PARI A 0%														
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI.....	40	3	1	1	X		X		X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BANCHE CENTRALI.....	42	3	1	1	X			X	X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA ORGANISMI DEL SETTORE PUBBLICO, REGIONI ED AUTORITA' LOCALI.....	44	3	1	1	X			X	X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BRI, FMI, UE, BMS, EFSF, ESM.....	46	3	1	1	X			X	X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI O BANCHE CENTRALI: ALTRE.....	48	3	1	1	X			X	X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI SOGGETTI A PONDERAZIONE PARI A 20%														
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA AMMINISTRAZIONI														

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

BASE INF.	4.7.2 RISCHIO DI LIQUIDITA' SU BASE INDIVIDUALE - COPERTURA DELLA LIQUIDITA' (LCR)- DEFLUSSI E AFFLUSSI	VOCE	DURATA	DIVISA	RESIDENZA	DEFLESSI/AFFLUSSI	DEPOSITO GARANTITO	ESPOSIZIONE/INDIRIZIONE	CLASSIFICAZIONE CREDITITIA	GRADO LIQ/QUANTITA'	TIPO IMPORTO	TIPO LOGICITA'	VALUTA	PERIODICITA'	NOTE
	CENTRALI.....	50	3	1	1	X		X	X	X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BANCHE CENTRALI.....	52	3	1	1	X			X	X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA ORGANISMI DEL SETTORE PUBBLICO, REGIONI ED AUTORITA' LOCALI.....	54	3	1	1	X			X	X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BMS.....	56	3	1	1	X			X	X	X	X	X	M	XD
	- OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE: ALTRE.....	58	3	1	1	X				X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI DA IMPRESE NON FINANZIARIE CON PONDERAZIONE MINORE O UGUALE AL 50%.....	60	3	1	1	X				X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI GARANTITI DA CREDITI IPOTECARI RESIDENZIALI (RMBS): SOTTOSTANTE CON PONDERAZIONE AL 35%.....	62	3	1	1	X				X	X	X	X	M	XD
	- LINEE DI CREDITO STAND BY GARANTITE ACCORDATE DALLA BANCA CENTRALE.....	64	3	1	1	X				X	X	X	X	M	XD
	- SISTEMI DI TUTELA ISTITUZIONALE O ENTI AFFILIATI PERMANENTEMENTE AD UN ORGANISMO CENTRALE.....	66	3	1	1	X				X	X	X	X	M	XD
	- STRUMENTI DI CAPITALE.....	68	3	1	1	X				X	X	X	X	M	XD
	- ORO.....	70	3	1	1	X				X	X	X	X	M	XD
	SOTTOSTANTE ATTIVITA' LIQUIDE AGGIUNTIVE														
	- TITOLI EMESSI DA IMPRESE FINANZIARIE.....	72	3	1	1	X			X	X	X	X	X	M	XD
	- EMISSIONI PROPRIE.....	74	3	1	1	X			X	X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI DA BANCHE NON GARANTITI.....	76	3	1	1	X			X	X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI GARANTITI DA CREDITI IPOTECARI COMMERCIALI (CMBS): ALTRI.....	77	3	1	1	X			X	X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI GARANTITI DA CREDITI IPOTECARI RESIDENZIALI (RMBS): ALTRI.....	78	3	1	1	X			X	X	X	X	X	M	XD
	- STRUMENTI DI CAPITALE.....	80	3	1	1	X				X	X	X	X	M	XD
	- ORO.....	82	3	1	1	X				X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI DI DEBITO GARANTITI: ALTRI.....	84	3	1	1	X				X	X	X	X	M	XD
	- OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE NON AMMISSIBILI.....	86	3	1	1	X				X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI DI DEBITO EMESSI DA IMPRESE NON FINANZIARIE: ALTRI.....	88	3	1	1	X				X	X	X	X	M	XD
	- AZIONI O QUOTE IN OIC.....	90	3	1	1	X				X	X	X	X	M	XD
	- ALTRE ATTIVITA' AMMISSIBILI PRESSO BANCA CENTRALE														
	- DI CUI: TITOLI EMESSI DA AMMINISTRAZIONI LOCALI.....	92	3	1	1	X				X	X	X	X	M	XD
	- DI CUI: COMMERCIAL PAPER.....	94	3	1	1	X				X	X	X	X	M	XD
	- DI CUI: CREDITI.....	96	3	1	1	X				X	X	X	X	M	XD
	- FINANZA ISLAMICA: TITOLI AMMESSI.....	98	3	1	1	X			X	X	X	X	X	M	XD
	LY DEFLUSSI/AFFLUSSI RELATIVI A OPERAZIONI DIVERSE DA SFT:														
	ALTRE INFORMAZIONI.....	59366													
	DEPOSITI NON AL DETTAGLIO - OPERATIVI														
	- DEPOSITI RICEVUTI: RELAZIONE OPERATIVA CONSOLIDATA - BANCA CORRISPONDENTE O PRIME BROKERAGE.....	02	3	1	1						X	X	X	M	XD
	- DEPOSITI OPERATIVI EFFETTUATI PRESSO CLIENTI NON FINANZIARI.....	04	3	1	1						X		X	M	XD
	- DEPOSITI OPERATIVI EFFETTUATI PRESSO BANCHE CENTRALI..	06	3	1	1						X		X	M	XD
	DEPOSITI NON OPERATIVI E ALTRE PASSIVITA'														
	- ALTRE PASSIVITA' POTENZIALI: DI CUI VERSO SOGGETTI INFRAGRUPPO.....	08	3	1	1						X		X	M	XD
	DEFLUSSI AI SENSI DELL'ART.105 CRD.....	10	3	1	1						X		X	M	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.7.3 RISCHIO DI LIQUIDITA' SU BASE INDIVIDUALE - COPERTURA DELLA LIQUIDITA' (LCR)- COLLATERAL SWAP	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	V A L U T A	V R E S R I S C L I Q	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoco								
	La presente parte deve essere segnalata esclusivamente dalle banche e dalle SIM non appartenenti a gruppi									
LY	COLLATERAL SWAP.....	59370								
	- CASSA ED ESPOSIZIONI VERSO BANCA CENTRALE MOBILIZZABILI IN CONDIZIONI DI STRESS.....	02	3	1	1	X	X	X	M	XD
	- TITOLI DI LIQUIDITA' E QUALITA' CREDITIZIA ESTREMAMENTE ELEVATE: ALTRE.....	04	3	1	1	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI O REGIONALI.....	06	3	1	1	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BANCHE CENTRALI O DA ORGANISMI DEL SETTORE PUBBLICO.....	08	3	1	1	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BRI, FMI, CE E BMS.....	10	3	1	1	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA EFSF, ESM.....	12	3	1	1	X	X	X	M	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.7.4 RISCHIO DI LIQUIDITA' SU BASE INDIVIDUALE - FINANZIAMENTO STABILE (NSFR)- MONITORAGGIO ELEMENTI CHE FORNISCONO FINANZIAMENTO STABILE	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	G R A D O	T I P O	T I P O L O G	V A L U T A	V R E S R I S C L I Q	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoci										
Y	ELEMENTI CHE FORNISCONO FINANZIAMENTO STABILE.....	59372										
	FONDI PROPRI											
	- STRUMENTI DI CAPITALE DI CLASSE 1 (TIER 1).....	02	3	1	1		X		X	X	T	XD
	- STRUMENTI DI CAPITALE DI CLASSE 2 (TIER 2).....	04	3	1	1		X		X	X	T	XD
	PASSIVITA': ALTRE											
	- DEPOSITI AL DETTAGLIO CON PERCENTUALE DI DEFLUSSO DEL 5%.....	06	3	1	1		X		X	X	T	XD
	- DEPOSITI AL DETTAGLIO CON PERCENTUALE DI DEFLUSSO DEL 10%.....	08	3	1	1		X		X	X	T	XD
	- DEPOSITI AL DETTAGLIO CON PERCENTUALE DI DEFLUSSO: ALTRO.....	10	3	1	1		X		X	X	T	XD
	- DEPOSITI NON AL DETTAGLIO OPERATIVI GARANTITI.....	12	3	1	1		X	X	X	X	T	XD
	- DEPOSITI: SISTEMI DI TUTELA ISTITUZIONALE.....	14	3	1	1		X	X	X	X	T	XD
	- DEPOSITI: RETE COOPERATIVA.....	16	3	1	1		X	X	X	X	T	XD
	- PASSIVITA' CONNESSE AD OPERAZIONI DI SFT.....	18	3	1	1	X	X	X	X	X	T	XD
	- PASSIVITA' CONNESSE AD OPERAZIONI NON GARANTITE.....	20	3	1	1		X	X	X	X	T	XD
	- OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE CON PONDERAZIONE RIDOTTA.....	22	3	1	1		X		X	X	T	XD
	- OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE AMMISSIBILI EX ART. 52(4) DIRETTIVA 2009/65.....	24	3	1	1		X		X	X	T	XD
	- PASSIVITA' DA ALTRI TITOLI EMESSI.....	26	3	1	1		X		X	X	T	XD
	- DERIVATI.....	28	3	1	1		X		X	X	T	XD
	- ALTRO.....	30	3	1	1		X		X	X	T	XD
Y	ELEMENTI CHE FORNISCONO FINANZIAMENTO STABILE: ALTRE INFORMAZIONI.....	59374										
	FONDI PROPRI											
	STRUMENTI DI CAPITALE E SUBORDINATI NON INCLUSI NEI FONDI PROPRI.....	02	3	1	1		X		X	X	T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.7.5 RISCHIO DI LIQUIDITA' SU BASE INDIVIDUALE - FINANZIAMENTO STABILE (NSFR)- MONITORAGGIO ELEMENTI CHE RICHIEDONO FINANZIAMENTO STABILE	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	E S P O S I T I V I T A	G R A D O	T I P O	T I P O L O G I C O	V A L U T A	V R E S R I S C L I Q	P E R I O D I C I T A'	N O T E
Y	ELEMENTI CHE RICHIEDONO FINANZIAMENTO STABILE.....	59376											
	ATTIVITA' LIQUIDE DI BASE												
	- CASSA.....	02	3	1	1		X	X		X	X	T	XD
	- ESPOSIZIONI VERSO BANCA CENTRALE MOBILIZZABILI IN CONDIZIONI DI STRESS.....	04	3	1	1		X	X		X	X	T	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI O REGIONALI.....	06	3	1	1	X	X	X		X	X	T	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BANCHE CENTRALI O DA ORGANISMI DEL SETTORE PUBBLICO.....	08	3	1	1	X	X	X		X	X	T	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BRI, FMI, CE E BMS.....	10	3	1	1	X	X	X	X	X	X	T	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA EFSF, ESM.....	12	3	1	1	X	X	X		X	X	T	XD
	- AZIONI O QUOTE DI OIC												
	- DI CUI: SCARTO PRUDENZIALE 0% (CRR, ART. 416(1) LETTERA A).....	14	3	1	1		X	X		X	X	T	XD
	- DI CUI: SCARTO PRUDENZIALE 5% (CRR, ART. 416(1) LETTERA B E C).....	16	3	1	1		X	X		X	X	T	XD
	- DI CUI: SCARTO PRUDENZIALE 20% (CRR, ART. 416(1) LETTERA D).....	18	3	1	1		X	X		X	X	T	XD
	- SISTEMI DI TUTELA ISTITUZIONALE O ENTI AFFILIATI PERMANENTEMENTE AD UN ORGANISMO CENTRALE												
	- DI CUI: DEPOSITI.....	20	3	1	1		X	X		X	X	T	XD
	- DI CUI: ALTRI FONDI CONTRATTUALMENTE DISPONIBILI....	22	3	1	1		X	X		X	X	T	XD
	- TITOLI EMESSI DA BANCHE COSTITUITE DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI O REGIONALI.....	24	3	1	1		X	X		X	X	T	XD
	- TITOLI EMESSI DA IMPRESE NON FINANZIARIE.....	26	3	1	1		X	X	X	X	X	T	XD
	- TITOLI GARANTITI DA CREDITI IPOTECARI COMMERCIALI (CMBS).....	28	3	1	1		X	X	X	X	X	T	XD
	- TITOLI GARANTITI DA CREDITI IPOTECARI RESIDENZIALI (RMBS).....	30	3	1	1		X	X	X	X	X	T	XD
	- OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE CON PONDERAZIONE RIDOTTA.....	32	3	1	1		X	X	X	X	X	T	XD
	- OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE AMMISSIBILI EX ART. 52 (4) DIRETTIVA 2009/65.....	34	3	1	1		X	X	X	X	X	T	XD
	- ALTRE ATTIVITA' LIQUIDE DI BASE.....	36	3	1	1		X	X	X	X	X	T	XD
	ATTIVITA' LIQUIDE: ALTRE												
	- TITOLI DI DEBITO E STRUMENTI DEL MERCATO MONETARIO EMESSI DA IMPRESE NON FINANZIARIE: CLASSE 1.....	38	3	1	1		X	X	X	X	X	T	XD
	- TITOLI DI DEBITO E STRUMENTI DEL MERCATO MONETARIO EMESSI DA IMPRESE NON FINANZIARIE: CLASSE 2.....	40	3	1	1		X	X	X	X	X	T	XD
	- TITOLI DI DEBITO E STRUMENTI DEL MERCATO MONETARIO EMESSI DA IMPRESE NON FINANZIARIE: ALTRO.....	42	3	1	1		X	X	X	X	X	T	XD
	- STRUMENTI DI CAPITALE QUOTATI EMESSI DA IMPRESE NON FINANZIARIE.....	44	3	1	1		X	X	X	X	X	T	XD
	- STRUMENTI DI CAPITALE EMESSI DA IMPRESE NON FINANZIARIE: ALTRI.....	46	3	1	1		X	X	X	X	X	T	XD
	- ORO.....	48	3	1	1		X	X	X	X	X	T	XD
	- ALTRI METALLI PREZIOSI.....	50	3	1	1		X	X	X	X	X	T	XD
	FINANZIAMENTI E CREDITI COMMERCIALI NON RINNOVABILI												
	- PERSONE FISICHE.....	52	3	1	1		X	X	X	X	X	T	XD
	- PMI.....	54	3	1	1		X	X	X	X	X	T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.7.5 RISCHIO DI LIQUIDITA' SU BASE INDIVIDUALE - FINANZIAMENTO STABILE (NSFR)- MONITORAGGIO ELEMENTI CHE RICHIEDONO FINANZIAMENTO STABILE	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	E S P O S I O N I /	G R A D O L I Q /	T I P O I M P O R T O	T I P O L O G I M P E G N O	V A L U T A	V R E S R I S C L I Q	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoc											
	- AMMINISTRAZIONI CENTRALI, BANCHE CENTRALI E ORGANISMI DEL SETTORE PUBBLICO.....	56	3	1	1			X	X	X	X	T	XD
	- SOGGETTI NON FINANZIARI: ALTRI.....	58	3	1	1			X	X	X	X	T	XD
	- BANCHE.....	60	3	1	1			X	X	X	X	T	XD
	- SOGGETTI FINANZIARI: ALTRI.....	62	3	1	1			X	X	X	X	T	XD
	ATTIVITA': ALTRE												
	- DERIVATI.....	64	3	1	1			X		X	X	T	XD
	- LINEE DI CREDITO NON REVOCABILI.....	66	3	1	1			X		X	X	T	XD
	- ALTRO.....	68	3	1	1			X		X	X	T	XD
	ELEMENTI CHE RICHIEDONO FINANZIAMENTO STABILE:												
	INFORMAZIONI AGGIUNTIVE.....	59378											
	ATTIVITA' LIQUIDE DI BASE												
	- ESPOSIZIONI VERSO BANCA CENTRALE.....	02	3	1	1		X	X		X	X	T	XD
	- AZIONI O QUOTE DI OIC.....	04	3	1	1		X	X	X	X	X	T	XD
	FINANZIAMENTI E CREDITI COMMERCIALI NON RINNOVABILI												
	- GARANTITI DA IMMOBILI NON RESIDENZIALI.....	06	3	1	1			X		X	X	T	XD
	- GARANTITI DA IMMOBILI RESIDENZIALI.....	08	3	1	1			X		X	X	T	XD
	- OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE: ATTIVI A GARANZIA....	10	3	1	1			X		X	X	T	XD
	ATTIVITA': ALTRE												
	- ATTIVITA' DEDOTTE DAI FONDI PROPRI.....	12	3	1	1			X		X	X	T	XD

MATRICE DEI CONTI

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.10 SIM ESCLUSE DALL'AMBITO DI APPLICAZIONE DEL PACCHETTO "CRR/CRDIV" - INFORMAZIONI SUI REQUISITI PATRIMONIALI MINIMI	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					
Y	CAPITALE INIZIALE.....	59230 00	3	1	1	T	XD
Y	TOTALE FONDI PROPRI.....	59232 00	3	1	1	T	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.1.1 FONDI PROPRI SU BASE CONSOLIDATA: ELEMENTI COSTITUTIVI DEI FONDI PROPRI	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	CAPITALE PRIMARIO DI CLASSE 1 (COMMON EQUITY TIER 1 - CET1).....	34010					
	STRUMENTI DI CET1:						
	CAPITALE VERSATO.....	02	3	1	1	T	XD
	SOVRAPPREZZI DI EMISSIONE.....	04	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI CET1 PROPRI:.....	06	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI CET1 DETENUTI DIRETTAMENTE.....	08	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI CET1 DETENUTI INDIRETTAMENTE.....	10	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI CET1 DETENUTI SINTETICAMENTE.....	12	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI CET1 SUI QUALI L'ENTE HA OBBLIGO REALE O EVENTUALE DI ACQUISTO.....	14	3	1	1	T	XD
	RISERVE:						
	RISERVE DI UTILI:						
	UTILI O PERDITE PORTATI A NUOVO.....	16	3	1	1	T	XD
	UTILI O PERDITA DI PERIODO:.....	18	3	1	1	T	XD
	UTILE O PERDITA DI PERTINENZA DELLA CAPOGRUPPO.....	20	3	1	1	T	XD
	(-) QUOTA DELL'UTILE DEL PERIODO NON INCLUSA NEL CET1.....	22	3	1	1	T	XD
	ALTRE COMPONENTI DI CONTO ECONOMICO ACCUMULATE (OCI) (*).....	24	3	1	1	T	XD
	RISERVE - ALTRO.....	26	3	1	1	T	XD
	FONDI PER RISCHI BANCARI GENERALI.....	27	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI CET1 OGGETTO DI DISPOSIZIONI TRANSITORIE (GRANDFATHERING).....	28	3	1	1	T	XD
	INTERESSI DI MINORANZA INCLUSI NEL CET1.....	30	3	1	1	T	XD
	INTERESSI DI MINORANZA AGGIUNTIVI OGGETTO DI DISPOSIZIONI TRANSITORIE.....	31	3	1	1	T	XD
	FILTRI PRUDENZIALI:						
	(-) INCREMENTO DI CET1 CONNESSO CON ATTIVITÀ CARTOLARIZZATE.....	32	3	1	1	T	XD
	COPERTURA DEI FLUSSI DI CASSA (CASH FLOW HEDGE).....	34	3	1	1	T	XD
	UTILI O PERDITE SULLE PASSIVITÀ VALUTATE AL VALORE EQUO DOVUTI AL PROPRIO MERITO DI CREDITO.....	36	3	1	1	T	XD
	UTILI O PERDITE DI VALORE EQUO DERIVANTI DAL RISCHIO DI CREDITO PROPRIO DELL'ENTE CORRELATO A PASSIVITÀ DERIVATIVE.....	38	3	1	1	T	XD
	RETTIFICHE DI VALORE DI VIGILANZA.....	40	3	1	1	T	XD
	DETRAZIONI:						
	AVVIAMENTO:						
	(-) AVVIAMENTO CONNESSO CON ATTIVITÀ IMMATERIALI.....	42	3	1	1	T	XD
	(-) AVVIAMENTO INCLUSO NELLA VALUTAZIONE DEGLI INVESTIMENTI SIGNIFICATIVI.....	44	3	1	1	T	XD
	PASSIVITÀ FISCALI DIFFERITE ASSOCIATE ALL'AVVIAMENTO..	46	3	1	1	T	XD
	ALTRE ATTIVITÀ IMMATERIALI:						
	(-) ALTRE ATTIVITÀ IMMATERIALI IMPORTO AL LORDO DELL'EFFETTO FISCALE.....	48	3	1	1	T	XD
	PASSIVITÀ FISCALI DIFFERITE CONNESSE CON LE ALTRE ATTIVITÀ IMMATERIALI.....	50	3	1	1	T	XD
	(-) ATTIVITÀ FISCALI DIFFERITE CHE SI BASANO SULLA REDDITIVITÀ FUTURA E NON DERIVANO DA DIFFERENZE						

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.1.1 FONDI PROPRI SU BASE CONSOLIDATA: ELEMENTI COSTITUTIVI DEI FONDI PROPRI	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
			sotvoci					
	TEMPORANEE AL NETTO DELLE RELATIVE PASSIVITÀ FISCALI DIFFERITE.....	52		3	1	1	T	XD
	(-) ENTI IRB - ECCEDENZA DELLE PERDITE ATTESE RISPETTO ALLE RETTIFICHE DI VALORE.....	54		3	1	1	T	XD
	FONDI PENSIONE A PRESTAZIONE DEFINITA: (-) FONDI PENSIONE A PRESTAZIONE DEFINITA - IMPORTO AL LORDO DELL'EFFETTO FISCALE.....	56		3	1	1	T	XD
	PASSIVITÀ FISCALI DIFFERITE CONNESSE AD ATTIVITÀ DI FONDI PENSIONE A PRESTAZIONE DEFINITA.....	58		3	1	1	T	XD
	ATTIVITÀ DEI FONDI PENSIONE A PRESTAZIONE DEFINITA CHE L'ENTE PUÒ UTILIZZARE SENZA RESTRIZIONI.....	60		3	1	1	T	XD
	(-) PARTECIPAZIONI INCROCIATE IN STRUMENTI DI CET1.....	62		3	1	1	T	XD
	(-) ECCEDENZA DEGLI ELEMENTI DA DETRARRE DAL CAPITALE AGGIUNTIVO DI CLASSE 1 RISPETTO AL CAPITALE AGGIUNTIVO DI CLASSE 1.....	64		3	1	1	T	XD
	ESPOSIZIONI DEDOTTE ANZICHÉ PONDERATE CON FATTORE DI PONDERAZIONE PARI A 1250% (-) PARTECIPAZIONI QUALIFICATE AL DI FUORI DEL SETTORE FINANZIARIO.....	66		3	1	1	T	XD
	(-) CARTOLARIZZAZIONI.....	68		3	1	1	T	XD
	(-) TRANSAZIONI CON REGOLAMENTO NON CONTESTUALE.....	70		3	1	1	T	XD
	(-) ENTI IRB - POSIZIONI IN UN PANIERE PER LE QUALI L'ENTE NON È IN GRADO DI STABILIRE UN FATTORE DI PONDERAZIONE.....	72		3	1	1	T	XD
	(-) ENTI IRB - ESPOSIZIONI IN STRUMENTI DI CAPITALE OGGETTO DI MODELLI INTERNI.....	74		3	1	1	T	XD
	(-) INVESTIMENTI NON SIGNIFICATIVI IN STRUMENTI DI CET1 IN ALTRI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO.....	76		3	1	1	T	XD
	DETRAZIONI CON SOGLIA DEL 10%: (-) ATTIVITÀ FISCALI DIFFERITE CHE SI BASANO SULLA REDDITIVITÀ FUTURA ED EMERGONO DA DIFFERENZE TEMPORANEE.....	78		3	1	1	T	XD
	(-) INVESTIMENTI SIGNIFICATIVI IN STRUMENTI DI CET1 DI ALTRI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO.....	80		3	1	1	T	XD
	(-) DETRAZIONE CON SOGLIA DEL 17,65%.....	82		3	1	1	T	XD
	(-) DETRAZIONI EX ARTICOLO 3 CRR.....	84		3	1	1	T	XD
	ELEMENTI POSITIVI O NEGATIVI - ALTRI.....	86		3	1	1	T	XD
	REGIME TRANSITORIO - IMPATTO SU CET1 (*)......	88		3	1	1	T	XD
	TOTALE CAPITALE PRIMARIO DI CLASSE 1.....	90		3	1	1	T	XD

(119) - (*) Segnalazioni che possono assumere valore negativo

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.1.1 FONDI PROPRI SU BASE CONSOLIDATA: ELEMENTI COSTITUTIVI DEI FONDI PROPRI	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	CAPITALE AGGIUNTIVO DI CLASSE 1 (ADDITIONAL TIER 1 - AT1)...	34012					
	STRUMENTI DI AT1:						
	CAPITALE VERSATO.....	02	3	1	1	T	XD
	SOVRAPPREZZI DI EMISSIONE.....	04	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI AT1 PROPRI:.....	06	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI AT1 DETENUTI DIRETTAMENTE.....	08	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI AT1 DETENUTI INDIRETTAMENTE.....	10	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI AT1 DETENUTI SINTETICAMENTE.....	12	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI AT1 SUI QUALI L'ENTE HA OBBLIGO REALE O EVENTUALE DI ACQUISTO.....	14	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI AT1 OGGETTO DI DISPOSIZIONI TRANSITORIE (GRANDFATHERING).....	16	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI EMESSI DA FILIAZIONI INCLUSI NELL'AT1.....	18	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI EMESSI DA FILIAZIONI INCLUSI NELL'AT1 PER EFFETTO DI DISPOSIZIONI TRANSITORIE.....	19	3	1	1	T	XD
	DETRAZIONI:						
	(-) PARTECIPAZIONI INCROCIATE IN STRUMENTI DI AT1.....	20	3	1	1	T	XD
	(-) INVESTIMENTI NON SIGNIFICATIVI IN STRUMENTI DI AT1 IN ALTRI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO.....	22	3	1	1	T	XD
	(-) INVESTIMENTI SIGNIFICATIVI IN STRUMENTI DI AT1 IN ALTRI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO.....	24	3	1	1	T	XD
	(-) ECCEDEXENZA DEGLI ELEMENTI DA DETRARRE DAL CAPITALE DI CLASSE 2 RISPETTO AL CAPITALE DI CLASSE 2.....	26	3	1	1	T	XD
	(-) DETRAZIONI EX ARTICOLO 3 CRR.....	28	3	1	1	T	XD
	REGIME TRANSITORIO - IMPATTO SU AT1 (*).....	30	3	1	1	T	XD
	ECCEDEXENZA DEGLI ELEMENTI DA DETRARRE DAL CAPITALE AGGIUNTIVO DI CLASSE 1 RISPETTO AL CAPITALE AGGIUNTIVO DI CLASSE 1.....	32	3	1	1	T	XD
	ELEMENTI POSITIVI O NEGATIVI - ALTRI.....	34	3	1	1	T	XD
	TOTALE CAPITALE AGGIUNTIVO DI CLASSE 1.....	36	3	1	1	T	XD
	(119) - (*) segnalazioni che possono assumere valore negativo						
1	CAPITALE DI CLASSE 1.....	34014					
	TOTALE CAPITALE DI CLASSE 1.....	00	3	1	1	T	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.1.1 FONDI PROPRI SU BASE CONSOLIDATA: ELEMENTI COSTITUTIVI DEI FONDI PROPRI	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
		sotvoci					
1	CAPITALE DI CLASSE 2 (TIER 2 - T2).....	34016					
	STRUMENTI DI T2						
	CAPITALE VERSATO.....	02	3	1	1	T	XD
	SOVRAPPREZZI DI EMISSIONE.....	04	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI T2 PROPRI:.....	06	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI T2 DETENUTI DIRETTAMENTE.....	08	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI T2 DETENUTI INDIRETTAMENTE.....	10	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI T2 DETENUTI SINTETICAMENTE.....	12	3	1	1	T	XD
	(-) STRUMENTI DI T2 SUI QUALI L'ENTE HA OBBLIGO REALE O EVENTUALE DI ACQUISTO.....	14	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI T2 OGGETTO DI DISPOSIZIONI TRANSITORIE (GRANDFATHERING).....	16	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI EMESSI DA FILIAZIONI INCLUSI NEL T2.....	18	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI EMESSI DA FILIAZIONI INCLUSI NEL T2 PER EFFETTO DI DISPOSIZIONI TRANSITORIE.....	19	3	1	1	T	XD
	ENTI IRB - ECCEDENZA DELLE RETTIFICHE DI VALORE RISPETTO ALLE PERDITE ATTESE.....	20	3	1	1	T	XD
	RETTIFICHE GENERICHE INCLUSE NEL T2.....	21	3	1	1	T	XD
	DETRAZIONI:						
	(-) PARTECIPAZIONI INCROCIATE IN STRUMENTI DI T2.....	22	3	1	1	T	XD
	(-) INVESTIMENTI NON SIGNIFICATIVI IN STRUMENTI DI T2 IN ALTRI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO.....	24	3	1	1	T	XD
	(-) INVESTIMENTI SIGNIFICATIVI IN STRUMENTI DI T2 IN ALTRI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO.....	26	3	1	1	T	XD
	(-) DETRAZIONI EX ARTICOLO 3 CRR.....	28	3	1	1	T	XD
	REGIME TRANSITORIO - IMPATTO SU T2 (*).....	30	3	1	1	T	XD
	ECCEDENZA DEGLI ELEMENTI DA DETRARRE DAL CAPITALE DI CLASSE 2 RISPETTO AL CAPITALE DI CLASSE 2.....	32	3	1	1	T	XD
	ELEMENTI POSITIVI O NEGATIVI - ALTRI.....	34	3	1	1	T	XD
	TOTALE CAPITALE DI CLASSE 2.....	36	3	1	1	T	XD
	(119) - (*) segnalazioni che possono assumere valore negativo						
1	FONDI PROPRI.....	34018					
	TOTALE FONDI PROPRI.....	00	3	1	1	T	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.1.2 FONDI PROPRI SU BASE CONSOLIDATA: ALTRE INFORMAZIONI	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
		sotvoci					
1	INFORMAZIONI SU STRUMENTI DI CAPITALE CON CARATTERISTICHE REVERSIBILI.....	34020					
	STRUMENTI DI CAPITALE LA CUI INCLUSIONE NEL CET1 DIPENDE DA CARATTERISTICHE REVERSIBILI.....	02	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI CAPITALE LA CUI INCLUSIONE NELL'AT1 DIPENDE DA CARATTERISTICHE REVERSIBILI.....	04	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI CAPITALE LA CUI INCLUSIONE NEL T2 DIPENDE DA CARATTERISTICHE REVERSIBILI.....	06	3	1	1	T	XD
1	INFORMAZIONI SULLA FISCALITÀ.....	34022					
	TOTALE ATTIVITÀ FISCALI DIFFERITE (DTA):						
	DTA CHE NON SI BASANO SULLA REDDITIVITÀ FUTURA.....	02	3	1	1	T	XD
	DTA CHE SI BASANO SULLA REDDITIVITÀ FUTURA E NON DERIVANO DA DIFFERENZE TEMPORANEE.....	04	3	1	1	T	XD
	DTA CHE SI BASANO SULLA REDDITIVITÀ FUTURA E DERIVANO DA DIFFERENZE TEMPORANEE.....	06	3	1	1	T	XD
	TOTALE PASSIVITÀ FISCALI DIFFERITE (DTL):						
	DTL NON DEDUCIBILI DALLE DTA E CHE SI BASANO SULLA REDDITIVITÀ FUTURA.....	08	3	1	1	T	XD
	DTL DEDUCIBILI DALLE DTA E CHE SI BASANO SULLA REDDITIVITÀ FUTURA:						
	DI CUI NON DERIVANTI DA DIFFERENZE TEMPORANEE.....	10	3	1	1	T	XD
	DI CUI DERIVANTI DA DIFFERENZE TEMPORANEE.....	12	3	1	1	T	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.1.2 FONDI PROPRI SU BASE CONSOLIDATA: ALTRE INFORMAZIONI	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	INFORMAZIONI SUI MODELLI INTERNI ENTI IRB (SHORTFALL/EXCESS RESERVE).....	34024					
	ENTI IRB - ECCEDEZZA O CARENZA DELLE RETTIFICHE DI VALORE CONTABILI, PRUDENZIALI E DELLE ALTRE RIDUZIONI DEI FONDI PROPRI RISPETTO ALLE PERDITE ATTESE PER ESPOSIZIONI NON IN STATO DI DEFAULT: TOTALE RETTIFICHE DI VALORE E DELLE ALTRE RIDUZIONI DEI FONDI PROPRI:						
	RETTIFICHE GENERICHE.....	01	3	1	1	T	XD
	RETTIFICHE SPECIFICHE.....	02	3	1	1	T	XD
	RETTIFICHE DI VALORE PRUDENZIALI E ALTRE RIDUZIONI DEI FONDI PROPRI.....	04	3	1	1	T	XD
	TOTALE PERDITE ATTESE.....	06	3	1	1	T	XD
	ENTI IRB - ECCEDEZZA O CARENZA DELLE RETTIFICHE DI VALORE CONTABILI, PRUDENZIALI E DELLE ALTRE RIDUZIONI DEI FONDI PROPRI RISPETTO ALLE PERDITE ATTESE PER ESPOSIZIONI IN STATO DI DEFAULT: RETTIFICHE DI VALORE SPECIFICHE E POSTE SIMILI.....	08	3	1	1	T	XD
	TOTALE PERDITE ATTESE.....	10	3	1	1	T	XD
	TOTALE ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO UTILIZZATE AI FINI DEL CALCOLO DEL LIMITE MASSIMO (CAP) PER L'INCLUSIONE DELL'ECCEDEZZA DELLE RETTIFICHE DI VALORE CONTABILI, PRUDENZIALI E DELLE ALTRE RIDUZIONI DEI FONDI PROPRI RISPETTO ALLE PERDITE ATTESE.....	12	3	1	1	T	XD
	RETTIFICHE GENERICHE AMMISSIBILI NEL T2.....	14	3	1	1	T	XD
	TOTALE ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO UTILIZZATE AI FINI DEL CALCOLO DEL LIMITE MASSIMO (CAP) PER L'INCLUSIONE DELLE RETTIFICHE GENERICHE A T2.....	16	3	1	1	T	XD
1	INFORMAZIONI SU SOGLIE PER DETRAZIONI E CAPITALE AMMISSIBILE.....	34026					
	SOGLIA PER GLI INVESTIMENTI NON SIGNIFICATIVI IN STRUMENTI DI CET1 DI ALTRI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO (10%).....	02	3	1	1	T	XD
	SOGLIA 10% EX ARTICOLO 48 CRR.....	04	3	1	1	T	XD
	SOGLIA 17,65% EX ARTICOLO 48 CRR.....	06	3	1	1	T	XD
	CAPITALE AMMISSIBILE AI FINI DELLA DISCIPLINA DELLE PARTECIPAZIONI QUALIFICATE AL DI FUORI DEL SETTORE FINANZIARIO E DEI GRANDI RISCHI.....	08	3	1	1	T	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.1.2 FONDI PROPRI SU BASE CONSOLIDATA: ALTRE INFORMAZIONI	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	INFORMAZIONI SU INVESTIMENTI NON SIGNIFICATIVI IN FONDI						
	PROPRI DI ALTRI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO.....	34028					
	STRUMENTI DI CET1 AL NETTO DELLE POSIZIONI CORTE:						
	STRUMENTI DI CET1 DETENUTI DIRETTAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	02	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	04	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI CET1 DETENUTI INDIRETTAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	06	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	08	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI CET1 DETENUTI SINTETICAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	10	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	12	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI AT1 AL NETTO DELLE POSIZIONI CORTE:						
	STRUMENTI DI AT1 DETENUTI DIRETTAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	14	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	16	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI AT1 DETENUTI INDIRETTAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	18	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	20	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI AT1 DETENUTI SINTETICAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	22	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	24	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI T2 AL NETTO DELLE POSIZIONI CORTE:						
	STRUMENTI DI T2 DETENUTI DIRETTAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	26	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	28	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI T2 DETENUTI INDIRETTAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	30	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	32	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI T2 DETENUTI SINTETICAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	34	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	36	3	1	1	T	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.1.2 FONDI PROPRI SU BASE CONSOLIDATA: ALTRE INFORMAZIONI	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
		sotvoci					
1	INFORMAZIONI SU INVESTIMENTI SIGNIFICATIVI IN FONDI PROPRI DI ALTRI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO.....	34030					
	STRUMENTI DI CET1 AL NETTO DELLE POSIZIONI CORTE:						
	STRUMENTI DI CET1 DETENUTI DIRETTAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	02	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	04	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI CET1 DETENUTI INDIRETTAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	06	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	08	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI CET1 DETENUTI SINTETICAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	10	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	12	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI AT1 AL NETTO DELLE POSIZIONI CORTE:						
	STRUMENTI DI AT1 DETENUTI DIRETTAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	14	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	16	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI AT1 DETENUTI INDIRETTAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	18	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	20	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI AT1 DETENUTI SINTETICAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	22	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	24	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI T2 AL NETTO DELLE POSIZIONI CORTE:						
	STRUMENTI DI T2 DETENUTI DIRETTAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	26	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	28	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI T2 DETENUTI INDIRETTAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	30	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	32	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI T2 DETENUTI SINTETICAMENTE:						
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	34	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE..	36	3	1	1	T	XD
1	ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO DI INVESTIMENTI NON DEDOTTI DAI CORRISPONDENTI TIER DEI FONDI PROPRI DI ALTRI SOGGETTI APPARTENENTI AL SETTORE FINANZIARIO.....	34032					
	STRUMENTI DI CET1.....	02	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI AT1.....	04	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI T2.....	06	3	1	1	T	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.1.2 FONDI PROPRI SU BASE CONSOLIDATA: ALTRE INFORMAZIONI	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	DEROGA TEMPORANEA ALLA DEDUZIONE DAI FONDI PROPRI EX ART. 79 CRR.....	34034					
	STRUMENTI DI CET1 CONNESSI CON INVESTIMENTI:						
	SIGNIFICATIVI IN ALTRI SOGGETTI APPARTENENTI AL SETTORE FINANZIARIO.....	02	3	1	1	T	XD
	NON SIGNIFICATIVI IN ALTRI SOGGETTI APPARTENENTI AL SETTORE FINANZIARIO.....	04	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI AT1 CONNESSI CON INVESTIMENTI:						
	SIGNIFICATIVI IN ALTRI SOGGETTI APPARTENENTI AL SETTORE FINANZIARIO.....	06	3	1	1	T	XD
	NON SIGNIFICATIVI IN ALTRI SOGGETTI APPARTENENTI AL SETTORE FINANZIARIO.....	08	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI T2 CONNESSI CON INVESTIMENTI:						
	SIGNIFICATIVI IN ALTRI SOGGETTI APPARTENENTI AL SETTORE FINANZIARIO.....	10	3	1	1	T	XD
	NON SIGNIFICATIVI IN ALTRI SOGGETTI APPARTENENTI AL SETTORE FINANZIARIO.....	12	3	1	1	T	XD
1	ALTRI REQUISITI.....	34036					
	REQUISITO COMBINATO DI RISERVA DI CAPITALE						
	RISERVA DI CONSERVAZIONE DI CAPITALE.....	02	3	1	1	T	XD
	RISERVA DI CONSERVAZIONE DI CAPITALE CONNESSA AL RISCHIO MACROPRUDENZIALE O SISTEMICO IDENTIFICATA A LIVELLO DI SINGOLO PAESE MEMBRO.....	04	3	1	1	T	XD
	RISERVA DI CAPITALE ANTICICLICA SPECIFICA DELL'ENTE.....	06	3	1	1	T	XD
	RISERVA DI CAPITALE A FRONTE DEL RISCHIO SISTEMICO CUMULABILE.....	08	3	1	1	T	XD
	RISERVA DI CAPITALE A FRONTE DEL RISCHIO SISTEMICO NON CUMULABILE.....	10	3	1	1	T	XD
	RISERVA PER I G-SII.....	12	3	1	1	T	XD
	RISERVA PER GLI O-SII.....	14	3	1	1	T	XD
1	FLOOR.....	34037					
	VARIAZIONE AI FONDI PROPRI TOTALI.....	02	3	1	1	T	XD
	FONDI PROPRI INTERAMENTE AGGIUSTATI PER TENER CONTO DEL FLOOR DI BASILEA 1.....	04	3	1	1	T	XD
	REQUISITI DI FONDI PROPRI PER IL FLOOR DI BASILEA 1.....	06	3	1	1	T	XD
	REQUISITI DI FONDI PROPRI PER IL FLOOR DI BASILEA 1 - ALTERNATIVA PER IL METODO STANDARD.....	08	3	1	1	T	XD
1	SOGLIA DI RILEVANZA PER LA SEGNALAZIONE DELLE ESPOSIZIONI NON-DOMESTICHE.....	34042					
	ESPOSIZIONE ORIGINARIA NON DOMESTICA.....	02	3	1	1	T	XD
	TOTALE DELLE ESPOSIZIONI ORIGINARIE.....	04	3	1	1	T	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.1.3 FONDI PROPRI SU BASE CONSOLIDATA: ALTRE INFORMAZIONI - SIM	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	CAPITALE INIZIALE.....	34038 00	3	1	1	T	XD
1	FONDI PROPRI BASATI SULLE SPESE FISSE GENERALI.....	34040 00	3	1	1	T	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.1.4 FONDI PROPRI SU BASE CONSOLIDATA: ELEMENTI OGGETTO DI DISPOSIZIONI TRANSITORIE	VOCE	D	D	R	T	P	N	
		sotvoc	U R A T A	I V I S A	E S I D E N Z A	I M P O R T O	E R I O D I C I T A'	O T T E	
1	STRUMENTI OGGETTO DI GRANDFATHERING.....	34200	02	3	1	1	X	T	XD
	STRUMENTI CHE COSTITUISCONO AIUTI DI STATO:								
	- STRUMENTI CHE SI QUALIFICANO COME FONDI PROPRI AI SENSI DELLA DIRETTIVA 2006/48/CE.....	04		3	1	1	X	T	XD
	- STRUMENTI EMESSI DA ENTI INSEDIATI IN STATI MEMBRI SOGGETTI A PROGRAMMI DI AGGIUSTAMENTO ECONOMICO.....	06		3	1	1	X	T	XD
	STRUMENTI CHE NON COSTITUISCONO AIUTI DI STATO.....	08		3	1	1	X	T	XD
1	INTERESSI DI MINORANZA ED EQUIVALENTI.....	34202							
	- STRUMENTI ED ELEMENTI DI CAPITALE CHE NON SONO AMMISSIBILI COME INTERESSI DI MINORANZA.....	02		3	1	1	X	T	XD
	- RICONOSCIMENTO TRANSITORIO NEI FONDI PROPRI CONSOLIDATI DEGLI INTERESSI DI MINORANZA.....	04		3	1	1	X	T	XD
	- RICONOSCIMENTO TRANSITORIO NEI FONDI PROPRI CONSOLIDATI DEL CAPITALE AGGIUNTIVO DI CLASSE 1 QUALIFICATO.....	06		3	1	1	X	T	XD
	- RICONOSCIMENTO TRANSITORIO NEI FONDI PROPRI CONSOLIDATI DEL CAPITALE AGGIUNTIVO DI CLASSE 2 QUALIFICATO.....	08		3	1	1	X	T	XD
1	ALTRE VARIAZIONI TRANSITORIE: PROFITTI E PERDITE NON REALIZZATI.....	34204	02	3	1	1	X	T	XD
	-PROFITTI NON REALIZZATI.....	04		3	1	1	X	T	XD
	-PERDITE NON REALIZZATE.....	06		3	1	1	X	T	XD
	-PROFITTI NON REALIZZATI RELATIVI ALLE ESPOSIZIONI VERSO LE AMMINISTRAZIONI CENTRALI CLASSIFICATE NELLA CATEGORIA "ATTIVITA' FINANZIARIE DISPONIBILI PER LA VENDITA" DELLO IAS 39 APPROVATO DALL'UE.....	08		3	1	1	X	T	XD
	-PERDITE NON REALIZZATE RELATIVE ALLE ESPOSIZIONI VERSO LE AMMINISTRAZIONI CENTRALI CLASSIFICATE NELLA CATEGORIA "ATTIVITA' FINANZIARIE DISPONIBILI PER LA VENDITA" DELLO IAS 39 APPROVATO DALL'UE.....	10		3	1	1	X	T	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.1.4 FONDI PROPRI SU BASE CONSOLIDATA: ELEMENTI OGGETTO DI DISPOSIZIONI TRANSITORIE	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	P E R I O D I C I T A'	N O T E	
		sotvoc							
1	ALTRE VARIAZIONI TRANSITORIE: DEDUZIONI.....	34206	02	3	1	1	X	T	XD
	-PERDITE RELATIVE ALL'ESERCIZIO IN CORSO.....	04		3	1	1	X	T	XD
	-ATTIVITA' FISCALI DIFFERITE CHE DIPENDONO DALLA REDDITIVITA' FUTURA E NON DERIVANO DA DIFFERENZE TEMPORANEE.....	06		3	1	1	X	T	XD
	-IMPORTI NEGATIVI RISULTANTI DAL CALCOLO DELLE PERDITE ATTESE DI CUI AGLI ARTICOLI 158 E 159 CRR.....	08		3	1	1	X	T	XD
	-DEDUZIONE DELLE ATTIVITA' DEI FONDI PENSIONE A PRESTAZIONI DEFINITE RIPORTATE NELLO STATO PATRIMONIALE DELLA BANCA.....	10		3	1	1	X	T	XD
	-DI CUI: INTRODUZIONE DELLE MODIFICHE ALLO IAS 19 - ELEMENTI POSITIVI.....	12		3	1	1	X	T	XD
	-DI CUI: INTRODUZIONE DELLE MODIFICHE ALLO IAS 19 - ELEMENTI NEGATIVI.....	14		3	1	1	X	T	XD
	-STRUMENTI DI FONDI PROPRI DI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO IN CUI L'ENTE NON HA UN INVESTIMENTO SIGNIFICATIVO								
	-STRUMENTI DI CET1.....	16		3	1	1	X	T	XD
	-STRUMENTI DI AT1.....	18		3	1	1	X	T	XD
	-STRUMENTI DI T2 INDIRETTI O SINTETICI.....	20		3	1	1	X	T	XD
	-ATTIVITA' FISCALI DIFFERITE CHE DIPENDONO DALLA REDDITIVITA' FUTURA E DERIVANO DA DIFFERENZE TEMPORANEE E STRUMENTI DI CET1 DI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO IN CUI L'ENTE HA UN INVESTIMENTO SIGNIFICATIVO.....	22		3	1	1	X	T	XD
	-STRUMENTI DI FONDI PROPRI DI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO IN CUI L'ENTE HA UN INVESTIMENTO SIGNIFICATIVO								
	-STRUMENTI DI CET1.....	24		3	1	1	X	T	XD
	-STRUMENTI DI AT1.....	26		3	1	1	X	T	XD
	-STRUMENTI DI T2 INDIRETTI O SINTETICI.....	28		3	1	1	X	T	XD
	-ESENZIONE DALLA DEDUZIONE DI PARTECIPAZIONI ASSICURATIVE DAGLI ELEMENTI DEL CET1.....	30		3	1	1	X	T	XD
1	ALTRE VARIAZIONI TRANSITORIE: ALTRI FILTRI E DEDUZIONI.....	34208	00	3	1	1	X	T	XD
1	VARIAZIONI TOTALI.....	34210	00	3	1	1	X	T	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.1.5 FONDI PROPRI SU BASE CONSOLIDATA: STRUMENTI OGGETTO DI GRANDFATHERING - STRUMENTI CHE NON COSTITUISCONO AIUTI DI STATO	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	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoci						
1	STRUMENTI COMPUTABILI NEL PATRIMONIO DI BASE AI SENSI DELLE DISPOSIZIONI DI RECEPIMENTO DELL'ART.57, LETT. A) DELLA DIRETTIVA 2006/48/CE(*).....	34220 00	3	1	1	X	T	XD
	(163) (*) Ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali							
1	STRUMENTI COMPUTABILI NEL PATRIMONIO DI BASE AI SENSI DELLE DISPOSIZIONI DI RECEPIMENTO DELL'ART.57, LETT. C-BIS) E DELL'ART.154, PARR.8 E 9, DELLA DIRETTIVA 2006/48/CE, SOGGETTI AI LIMITI DELL'ART.489(*).....(163	34222 02	3	1	1	X	T	XD
	-STRUMENTI SENZA OPZIONI CALL O INCENTIVI AL RIMBORSO -TOTALE DEGLI STRUMENTI SENZA OPZIONI CALL O INCENTIVI AL RIMBORSO.....	04	3	1	1	X	T	XD
	-STRUMENTI OGGETTO DI GRANDFATHERING CON OPZIONI CALL O INCENTIVI AL RIMBORSO							
	-STRUMENTI CON UN'OPZIONE CALL ESERCITABILE DOPO LA DATA DI SEGNALAZIONE E CHE SODDISFANO I REQUISITI DELL'ART. 52 DEL CRR DOPO LA DATA DI SCADENZA EFFETTIVA.....	06	3	1	1	X	T	XD
	-STRUMENTI CON UN'OPZIONE CALL ESERCITABILE DOPO LA DATA DI SEGNALAZIONE E CHE NON SODDISFANO I REQUISITI DELL'ART. 52 DEL CRR DOPO LA DATA DI SCADENZA EFFETTIVA.....	08	3	1	1	X	T	XD
	-STRUMENTI CON UN'OPZIONE CALL ESERCITABILE PRIMA DEL 31 DICEMBRE 2011 O IL GIORNO STESSO E CHE NON SODDISFANO I REQUISITI DELL'ART. 52 DEL CRR DOPO LA DATA DI SCADENZA EFFETTIVA.....	10	3	1	1	X	T	XD
	-ECCEDENZA RISPETTO AI LIMITI DEGLI STRUMENTI DI CET1 OGGETTO DI GRANDFATHERING.....	12	3	1	1	X	T	XD
	(163) (*) Ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali							
1	STRUMENTI COMPUTABILI NEL PATRIMONIO SUPPLEMENTARE AI SENSI DELLE DISPOSIZIONI DI RECEPIMENTO DELL'ART.57, LETT. E), F), G) O H) DELLA DIRETTIVA 2006/48/CE, SOGGETTI AI LIMITI DELL'ART.490(*).....(163	34224 02	3	1	1	X	T	XD
	-ELEMENTI SENZA INCENTIVI AL RIMBORSO -TOTALE DEGLI ELEMENTI SENZA INCENTIVI AL RIMBORSO.....	04	3	1	1	X	T	XD
	-ELEMENTI OGGETTO DI GRANDFATHERING CON INCENTIVI AL RIMBORSO							
	-ELEMENTI CON UN'OPZIONE CALL ESERCITABILE DOPO LA DATA DI SEGNALAZIONE E CHE SODDISFANO I REQUISITI DELL'ARTICOLO 63 DEL CRR DOPO LA DATA DI SCADENZA EFFETTIVA.....	06	3	1	1	X	T	XD
	-ELEMENTI CON UN'OPZIONE CALL ESERCITABILE DOPO LA DATA DI SEGNALAZIONE E CHE NON SODDISFANO I REQUISITI DELL'ARTICOLO 63 DEL CRR DOPO LA DATA DI SCADENZA EFFETTIVA.....	08	3	1	1	X	T	XD
	-ELEMENTI CON UN'OPZIONE CALL ESERCITABILE PRIMA DEL 31 DICEMBRE 2011 O IL GIORNO STESSO E CHE NON SODDISFANO I REQUISITI DELL'ARTICOLO 63 DEL CRR DOPO LA DATA DI SCADENZA EFFETTIVA.....	10	3	1	1	X	T	XD
	-ECCEDENZA RISPETTO AI LIMITI DEGLI STRUMENTI DI AT1 OGGETTO DI GRANDFATHERING.....	12	3	1	1	X	T	XD
	(163) (*) Ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali							

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.2.1 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE SU BASE CONSOLIDATA: METODOLOGIA STANDARDIZZATA	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	C C P Q U A L I F I C A T A	V A L U T M E R I T O C R E	C O N T R I B G A R C C P	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	T I P O I M P O R T O	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoc													
1	METODOLOGIA STANDARDIZZATA: ATTIVITA' DI RISCHIO.....	36526													
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI E BANCHE CENTRALI.....	02	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA AMMINISTRAZIONE REGIONALI O AUTORITA' LOCALI.....	04	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA ORGANISMI DEL SETTORE PUBBLICO.....	06	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA BANCHE MULTILATERALI DI SVILUPPO.....	07	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA ORGANIZZAZIONI INTERNAZIONALI.....	10	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA INTERMEDIARI VIGILATI.....	12	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA IMPRESE.....	11	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO.....	16	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI.....	18	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI IN STATO DI DEFAULT.....	20	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI AD ALTO RISCHIO.....	22	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI SOTTO FORMA DI OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE.....	24	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI A BREVE TERMINE VERSO IMPRESE E INTERMEDIARI VIGILATI.....	25	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO DEL RISPARMIO (OICR).....	28	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ESPOSIZIONI IN STRUMENTI DI CAPITALE.....	27	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-ALTRE ESPOSIZIONI.....	29	3	1	1		X		X	X			X	T	XD
	-TOTALE ATTIVITA' DI RISCHIO														
	-ATTIVITA' DI RISCHIO PER CASSA.....	50	3	1	1			X			X		X	T	XD
	-GARANZIE RILASCIATE E IMPEGNI A EROGARE FONDI.....	52	3	1	1			X	X		X		X	T	XD
	-OPERAZIONI SFT.....	55	3	1	1	X					X		X	T	XD
	-CONTRATTI DERIVATI E OPERAZIONI CON REGOLAMENTO A LUNGO TERMINE.....	57	3	1	1	X					X		X	T	XD
	-COMPENSAZIONE TRA PRODOTTI DIVERSI.....	58	3	1	1						X		X	T	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

BASE INF.	4.2.1 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE SU BASE CONSOLIDATA: METODOLOGIA STANDARDIZZATA	VOCE	DURATA	DIVISA	RESIDENZA	CCP	QUALIFICATA	VALUT	MERITO	CCP	FATTORIB	CONVER	FATTORIB	PONDERAZ	PORTAFOLIO	TIPO	TIPO	PERIODICITA'	NOTE
		sotvoc																	
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:																		
	-ATTIVITÀ 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
	-OPERAZIONI SFT.....	05	3	1	1										X	X	X	T	XD
	-CONTRATTI DERIVATI E OPERAZIONI CON REGOLAMENTO A LUNGO TERMINE.....	07	3	1	1										X	X	X	T	XD
	-COMPENSAZIONE TRA PRODOTTI DIVERSI.....	09	3	1	1										X	X	X	T	XD
	-STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO REALE - METODO INTEGRALE																		
	-ESPOSIZIONI GARANTITE:																		
	-ATTIVITÀ DI RISCHIO PER CASSA.....	12	3	1	1										X	X	X	T	XD
	-GARANZIE RILASCIATE E IMPEGNI A EROGARE FONDI.....	14	3	1	1										X	X	X	T	XD
	-OPERAZIONI SFT.....	15	3	1	1										X	X	X	T	XD
	-CONTRATTI DERIVATI E OPERAZIONI CON REGOLAMENTO A LUNGO TERMINE.....	17	3	1	1										X	X	X	T	XD
	-COMPENSAZIONE TRA PRODOTTI DIVERSI.....	19	3	1	1										X	X	X	T	XD
1	ATTIVITA' DI RISCHIO: ALTRE INFORMAZIONI.....	34050																	
	-TOTALE ATTIVITÀ DI RISCHIO: DI CUI PMI.....	02	3	1	1										X	X	X	T	XD
	-TOTALE ATTIVITÀ DI RISCHIO: DI CUI PMI CUI SI APPLICA IL FATTORE DI SOSTEGNO (0,7619).....	04	3	1	1										X	X	X	T	XD
	-TOTALE ATTIVITÀ DI RISCHIO: DI CUI ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI RESIDENZIALI.....	06	3	1	1										X	X	X	T	XD
	-TOTALE ATTIVITÀ DI RISCHIO: DI CUI ESPOSIZIONI SOGGETTE ALL'UTILIZZO PARZIALE PERMANENTE DELLA METODOLOGIA STANDARDIZZATA.....	08	3	1	1										X	X	X	T	XD
	-TOTALE ATTIVITÀ DI RISCHIO: DI CUI ESPOSIZIONI SOGGETTE A ESTENSIONE PROGRESSIVA DEL METODO IRB.....	10	3	1	1										X	X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI COMMERCIALI.....	12	3	1	1										X	X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI IN STATO DI DEFAULT PONDERATE AL 100%.....	14	3	1	1										X	X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI RESIDENZIALI.....	16	3	1	1										X	X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI IN STATO DI DEFAULT PONDERATE AL 150%.....	18	3	1	1										X	X	X	T	XD
1	TECNICHE DI ATTENUAZIONE DEL RISCHIO DI CREDITO: ALTRE INFORMAZIONI.....	34052																	
	-TOTALE ATTIVITÀ DI RISCHIO: DI CUI PMI.....	02	3	1	1										X	X	X	T	XD
	-TOTALE ATTIVITÀ DI RISCHIO: DI CUI PMI CUI SI APPLICA IL FATTORE DI SOSTEGNO (0,7619).....	04	3	1	1										X	X	X	T	XD
	-TOTALE ATTIVITÀ DI RISCHIO: DI CUI ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI RESIDENZIALI.....	06	3	1	1										X	X	X	T	XD
	-TOTALE ATTIVITÀ DI RISCHIO: DI CUI ESPOSIZIONI SOGGETTE ALL'UTILIZZO PARZIALE PERMANENTE DELLA METODOLOGIA STANDARDIZZATA.....	08	3	1	1										X	X	X	T	XD
	-TOTALE ATTIVITÀ DI RISCHIO: DI CUI ESPOSIZIONI SOGGETTE A ESTENSIONE PROGRESSIVA DEL METODO IRB.....	10	3	1	1										X	X	X	T	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.2.2 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE SU BASE CONSOLIDATA: METODOLOGIA BASATA SUI RATING INTERNI	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	C L A S S E	F A T T O R E	F O R M A	G A R A N Z	M E T O D O L	P O R T A F O G L I O	T I P O	T I P O	T I P O	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoc														
1	METODOLOGIA BASATA SUI RATING INTERNI: PROBABILITA' DI DEFAULT.....	36530														
	- RISCHIO DI CREDITO															
	-AMMINISTRAZIONI CENTRALI E BANCHE CENTRALI.....	02	3	1	1	X		X					X		T	XD
	-INTERMEDIARI VIGILATI, ENTI PUBBLICI E TERRITORIALI E ALTRI SOGGETTI.....	04	3	1	1	X		X					X		T	XD
	-IMPRESE E FINANZIAMENTI SPECIALIZZATI:															
	-FINANZIAMENTI SPECIALIZZATI.....	06	3	1	1	X		X					X		T	XD
	-PMI.....	20	3	1	1	X		X					X		T	XD
	-PMI: CUI SI APPLICA IL FATTORE DI SOSTEGNO (0,7619)..	22	3	1	1	X		X					X		T	XD
	-ALTRE IMPRESE.....	24	3	1	1	X		X					X		T	XD
	-ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO															
	-ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI: PMI.....	26	3	1	1	X		X					X		T	XD
	-ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI: PMI CUI SI APPLICA IL FATTORE DI SOSTEGNO (0,7619).....	28	3	1	1	X		X					X		T	XD
	-ALTRE ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO: PMI.....	30	3	1	1	X		X					X		T	XD
	-ALTRE ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO: PMI CUI SI APPLICA IL FATTORE DI SOSTEGNO (0,7619).....	32	3	1	1	X		X					X		T	XD
	-ESPOSIZIONI ROTATIVE AL DETTAGLIO QUALIFICATE.....	12	3	1	1	X		X					X		T	XD
	-ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI: PERSONE FISICHE...	34	3	1	1	X		X					X		T	XD
	-ALTRE ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO: PERSONE FISICHE.....	36	3	1	1	X		X					X		T	XD
	-TOTALE.....	38	3	1	1	X		X					X		T	XD
	-METODO PD/LGD.....	15	3	1	1	X							X		T	XD
	- RISCHIO DI DILUIZIONE.....	16	3	1	1						X				T	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.2.2 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE SU BASE CONSOLIDATA: METODOLOGIA BASATA SUI RATING INTERNI	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	C L A S S E M E R I T O C R	F A T T O R E P O N D E R A Z	F O R M A T E C N I C A	G A R A N Z R I L E I M P	M E T O D O L A P P L I C	P O R T A F O G L I O	T I P O G A R A N Z I A	T I P O I M P O R T O	T I P O S O G G F I N	P E R I O D I C I T A'	N O T E
1	METODOLOGIA BASATA SUI RATING INTERNI: ATTIVITA' DI RISCHIO.....	36532														
	-TOTALE (*).....	01	3	1	1	X			X	X			X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI E BANCHE CENTRALI (*).....	02	3	1	1	X			X	X			X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA INTERMEDIARI VIGILATI, ENTI PUBBLICI E TERRITORIALI E ALTRI SOGGETTI (*).....	03	3	1	1	X			X	X			X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA IMPRESE:															
	-FINANZIAMENTI SPECIALIZZATI (*).....	12	3	1	1	X			X	X			X	X	T	XD
	-PMI (*).....	13	3	1	1	X			X	X			X	X	T	XD
	-PMI CUI SI APPLICA IL FATTORE DI SOSTEGNO (0,7619) (*).....	15	3	1	1	X			X	X			X	X	T	XD
	-ALTRE IMPRESE (*).....	17	3	1	1	X			X	X			X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO:															
	-ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI: PMI (*).....	46	3	1	1	X			X				X	X		XD
	-ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI: PMI CUI SI APPLICA IL FATTORE DI SOSTEGNO (0,7619) (*).....	48	3	1	1	X			X				X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI: PERSONE FISICHE(*)..	22	3	1	1	X			X				X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI ROTATIVE AL DETTAGLIO QUALIFICATE (*).....	24	3	1	1	X			X				X	X	T	XD
	-ALTRE ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO: PMI (*).....	50	3	1	1	X			X				X	X	T	XD
	-ALTRE ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO: PMI CUI SI APPLICA IL FATTORE DI SOSTEGNO (0,7619) (*).....	52	3	1	1	X			X				X	X	T	XD
	-ALTRE ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO: PERSONE FISICHE (*)....	28	3	1	1	X			X				X	X	T	XD
	-CREDITI COMMERCIALI ACQUISTATI - RISCHIO DI DILUIZIONE (*).....	32	3	1	1					X	X		X		T	XD
	-FINANZIAMENTI SPECIALIZZATI - SLOTTING CRITERIA.....	36	3	1	1		X		X	X	X		X		T	XD
	-TRATTAMENTO ALTERNATIVO DELLE IPOTECHE IMMOBILIARI.....	38	3	1	1				X	X	X		X		T	XD
	-ESPOSIZIONI PER TRANSAZIONI CON REGOLAMENTO NON CONTESTUALE EX ARTICOLO 379(2) CRR, ESPOSIZIONI IN STRUMENTI N-TO-DEFAULT PRIVE DI RATING ED ESPOSIZIONI RESIDUE.....	54	3	1	1				X	X	X		X		T	XD
	-TOTALE ATTIVITÀ DI RISCHIO															
	-ATTIVITÀ 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
	-OPERAZIONI SFT (*).....	63	3	1	1				X	X			X		T	XD
	-CONTRATTI DERIVATI E OPERAZIONI CON REGOLAMENTO A LUNGO TEMINE (*).....	65	3	1	1				X	X			X		T	XD
	-COMPENSAZIONE TRA PRODOTTI DIVERSI (*).....	68	3	1	1				X	X			X		T	XD

(163) (*) ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.2.2 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE SU BASE CONSOLIDATA: METODOLOGIA BASATA SUI RATING INTERNI	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	C L A S S E	F A T T O R E	F O R M A	G A R A N Z I E	M E T O D O L O G I A	P O S T R I M O	T I P O	T I P O	T I P O	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoc														
1	TECNICHE DI ATTENUAZIONE DEL RISCHIO DI CREDITO: AMMONTARE PROTETTO.....	34054														
	STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO PERSONALE E REALE (PRINCIPIO DI SOSTITUZIONE)															
	-ESPOSIZIONI GARANTITE:															
	-TOTALE.....	02	3	1	1	X			X	X	X	X			T	XD
	-CREDITI COMMERCIALI ACQUISTATI - RISCHIO DI DILUIZIONE.....	03	3	1	1	X			X	X	X	X			T	XD
	-ESPOSIZIONI PER TRANSAZIONI CON REGOLAMENTO NON CONTESTUALE EX ARTICOLO 379(2) CRR, ESPOSIZIONI IN STRUMENTI N-TO-DEFAULT PRIVE DI RATING ED ESPOSIZIONI RESIDUE.....	05	3	1	1	X			X	X	X	X			T	XD
	-ATTIVITÀ DI RISCHIO PER CASSA.....	04	3	1	1				X	X	X	X			T	XD
	-GARANZIE RILASCIATE E IMPEGNI A EROGARE FONDI.....	06	3	1	1				X	X	X	X			T	XD
	-OPERAZIONI SFT.....	08	3	1	1				X	X	X	X			T	XD
	-CONTRATTI DERIVATI E OPERAZIONI CON REGOLAMENTO A LUNGO TERMINE.....	10	3	1	1				X	X	X	X			T	XD
	-COMPENSAZIONE TRA PRODOTTI DIVERSI.....	12	3	1	1				X	X	X	X			T	XD
	STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO PERSONALE E REALE CONSIDERATI NELLA STIMA DELLA LGD															
	-ESPOSIZIONI GARANTITE:															
	-TOTALE.....	14	3	1	1	X			X	X	X	X			T	XD
	-CREDITI COMMERCIALI ACQUISTATI - RISCHIO DI DILUIZIONE.....	15	3	1	1	X			X	X	X	X			T	XD
	-ATTIVITÀ DI RISCHIO PER CASSA.....	16	3	1	1				X	X	X	X			T	XD
	-GARANZIE RILASCIATE E IMPEGNI A EROGARE FONDI.....	18	3	1	1				X	X	X	X			T	XD
	-OPERAZIONI SFT.....	20	3	1	1				X	X	X	X			T	XD
	-CONTRATTI DERIVATI E OPERAZIONI CON REGOLAMENTO A LUNGO TERMINE.....	22	3	1	1				X	X	X	X			T	XD
	-COMPENSAZIONE TRA PRODOTTI DIVERSI.....	24	3	1	1				X	X	X	X			T	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.2.3 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE SU BASE CONSOLIDATA: METODOLOGIA BASATA SUI RATING INTERNI - ESPOSIZIONI IN STRUMENTI DI CAPITALE	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	C L A S S E	F A T T O R E	T I P O	T I P O	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoci									
1	RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE - METODOLOGIA BASATA										
	SUI RATING INTERNI: ESPOSIZIONI IN STRUMENTI DI CAPITALE....	36534									
	-METODO PD/LGD: ATTIVITÀ DI RISCHIO(*).....	02	3	1	1	X			X	T	XD
	-METODO DELLA PONDERAZIONE SEMPLICE: ATTIVITÀ DI RISCHIO..	04	3	1	1		X		X	T	XD
	-METODO DEI MODELLI INTERNI: ATTIVITÀ DI RISCHIO.....	06	3	1	1				X	T	XD
	-ESPOSIZIONI IN STRUMENTI DI CAPITALE SOGGETTE A FATTORI DI PONDERAZIONE FISSI (250% E 370%).....	08	3	1	1				X	T	XD
	<i>(163) (*) ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali</i>										
1	ESPOSIZIONI IN STRUMENTI DI CAPITALE: TECNICHE DI										
	ATTENUAZIONE DEL RISCHIO DI CREDITO - AMMONTARE PROTETTO....	34058									
	STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO PERSONALE E REALE (PRINCIPIO DI SOSTITUZIONE)										
	-ESPOSIZIONI GARANTITE:										
	-METODO PD/LGD.....	02	3	1	1			X	X	T	XD
	-METODO DELLA PONDERAZIONE SEMPLICE.....	04	3	1	1			X	X	T	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.2.4 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE SU BASE CONSOLIDATA: RISCHIO DI REGOLAMENTO PER LE TRANSAZIONI CON REGOLAMENTO CONTESTUALE	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	T E M P O	T I P O	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoci							
1	RISCHIO DI REGOLAMENTO PER LE TRANSAZIONI CON REGOLAMENTO								
	CONTESTUALE: ESPOSIZIONE.....	34060 00	3	1	1	X	X	T	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

BASE INF.	4.2.5 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE SU BASE CONSOLIDATA: CARTOLARIZZAZIONI	VOCE	DURATA	DIVISA	RESIDENZA	CLASSE PONDERRAZ	CLAUSURE ANTIC	DETRAZIONE	FATTORE CONVERS	CLASMER CREDITO	CLMER CREDITO ORIG	FORMATECNICA	RUOLO CARTOLARIZ	TIPO CARTOLARIZ	TIPO IMPORTO	TIPOLOG SOTTOST	PERIODICITA'	NOTE	
																			sotvoc
1	METODOLOGIA STANDARDIZZATA: POSIZIONI VERSO LA																		
	CARTOLARIZZAZIONE.....	36536																	
	-ATTIVITÀ DI RISCHIO PER CASSA																		
	-POSIZIONI VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE (*).....	02	3	1	1			X	X			X	X	X			T	XD	
	-POSIZIONI VERSO LA RI-CARTOLARIZZAZIONE(*).....	03	3	1	1			X	X			X	X	X			T	XD	
	-ATTIVITÀ DI RISCHIO FUORI BILANCIO																		
	-POSIZIONI VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE (*).....	04	3	1	1			X	X	X		X	X	X			T	XD	
	-POSIZIONI VERSO LA RI-CARTOLARIZZAZIONE (*).....	05	3	1	1			X	X	X		X	X	X			T	XD	
	-CLAUSOLE DI RIMBORSO ANTICIPATO.....	06	3	1	1			X	X	X		X	X	X			T	XD	
	-TOTALE ESPOSIZIONI.....	20	3	1	1			X	X	X		X	X	X			T	XD	
	<i>(163) (*) ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali</i>																		
1	METODOLOGIA STANDARDIZZATA: POSIZIONI VERSO LA																		
	CARTOLARIZZAZIONE: AMMONTARE PROTETTO.....	36538																	
	-ATTIVITÀ DI RISCHIO																		
	-STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO PERSONALE E ASSIMILATI, DERIVATI SU CREDITO - EFFETTO SOSTITUZIONE.....	01	3	1	1		X					X	X	X	X	X	T	XD	
	-STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO REALE - METODO SEMPLIFICATO.....	02	3	1	1		X					X	X		X	X	T	XD	
	-STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO REALE - METODO INTEGRALE.....	12	3	1	1		X					X	X	X	X	X	T	XD	
1	METODOLOGIA BASATA SU RATING INTERNI: POSIZIONI VERSO LA																		
	CARTOLARIZZAZIONE.....	34062																	
	-ATTIVITÀ DI RISCHIO PER CASSA																		
	-POSIZIONI VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE(*).....	02	3	1	1	X		X	X			X	X	X			T	XD	
	-POSIZIONI VERSO LA RI-CARTOLARIZZAZIONE(*).....	04	3	1	1	X		X	X			X	X	X			T	XD	
	-ATTIVITÀ DI RISCHIO FUORI BILANCIO																		
	-POSIZIONI VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE(*).....	06	3	1	1	X		X	X	X		X	X	X			T	XD	
	-POSIZIONI VERSO LA RI-CARTOLARIZZAZIONE(*).....	08	3	1	1	X		X	X	X		X	X	X			T	XD	
	-CLAUSOLE DI RIMBORSO ANTICIPATO(*).....	10	3	1	1			X	X	X		X	X	X			T	XD	
	-TOTALE ESPOSIZIONI.....	12	3	1	1			X	X	X		X	X	X			T	XD	
	<i>(163) (*) ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali</i>																		
1	METODOLOGIA BASATA SU RATING INTERNI: POSIZIONI VERSO LA																		
	CARTOLARIZZAZIONE: AMMONTARE PROTETTO.....	34064																	
	-ATTIVITÀ DI RISCHIO																		
	-STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO PERSONALE E ASSIMILATI, DERIVATI SU CREDITO - EFFETTO SOSTITUZIONE.....	02	3	1	1		X					X	X	X	X	X	T	XD	
	-STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO REALE - METODO SEMPLIFICATO.....	04	3	1	1		X					X	X		X	X	T	XD	
	-STRUMENTI DI PROTEZIONE DEL CREDITO DI TIPO REALE - METODO INTEGRALE.....	06	3	1	1		X					X	X	X	X	X	T	XD	

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.2.6 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE SU BASE CONSOLIDATA: CARTOLARIZZAZIONI - INFORMAZIONI AGGIUNTIVE	VOCE		D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	C A R T O L P O S F / B I L	C O D I C E I N T E R N O	M E T O D O L A P P L I C A	C O N F O R M I T T A N O R M	T I P O C A R T O L A R I Z Z	I N T E C O N O M I C O R R	P O R T O C O R R	R U O L O C A R T O L A R I Z	S T A T O	T I P O I M P O R T O	T I P O L O G E S P O S I Z	T I P O L O G S O T T O S T	T R A T T A M C O N T A B	T R A T T A M P R U D E N Z	I D E N T C A R T O L A R I Z	I D E N T O R I G I N A T O R	D A T A C R E A Z I O N E	P R E V I S I O N I	D A T A S C A F I N L E G	P E R I O D I C I T A'	N O T E				
		sotvoc																													
Y	OPERAZIONI DI CARTOLARIZZAZIONE.....	34066																													
	- IDENTIFICATIVO OPERAZIONE(#).....	02	3	1	1			X													X						S	XD			
	- IDENTIFICATIVO ORIGINATOR(#).....	04	3	1	1			X															X				S	XD			
	- PERCENTUALE DEGLI IMPEGNI MANTENUTI DALL'EMITTENTE(*)...	06	3	1	1			X		X	X	X		X				X	X	X							S	XD			
<small>(603) (*) Ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali; (#) La voce deve essere segnalata indicando convenzionalmente "1" nel campo importo.</small>																															
Y	PORTAFOGLIO CARTOLARIZZATO.....	34067																													
	- CARATTERISTICHE GENERALI(#).....	02	3	1	1			X	X						X										X			S	XD		
	- ESPOSIZIONI(*).....	04	3	1	1			X								X												S	XD		
<small>(603) (*) Ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali; (#) La voce deve essere segnalata indicando convenzionalmente "1" nel campo importo.</small>																															
Y	STRUTTURA OPERAZIONE E POSIZIONE VERSO LA																														
	CARTOLARIZZAZIONE.....	34069																													
	-STRUTTURA OPERAZIONE(#).....	02	3	1	1			X																		X	X	S	XD		
	-ATTIVITA' DI RISCHIO PER CASSA.....	04	3	1	1			X								X	X											S	XD		
	-ATTIVITA' DI RISCHIO FUORI BILANCIO.....	06	3	1	1		X	X								X	X											S	XD		
	-POSIZIONE VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE NEL TB.....	12	3	1	1			X					X															S	XD		
	-POSIZIONE LUNGA.....	14	3	1	1			X								X												S	XD		
	-POSIZIONE CORTA.....	16	3	1	1			X								X												S	XD		
	-POSIZIONE DETRATTA DAI FONDI PROPRI (-).....	18	3	1	1			X								X												S	XD		
	-TOTALE POSIZIONI VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE(*).....	20	3	1	1			X								X												S	XD		
<small>(603) (*) Ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali; (#) La voce deve essere segnalata indicando convenzionalmente "1" nel campo importo.</small>																															

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.2.7 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE SU BASE CONSOLIDATA: RIPARTIZIONE GEOGRAFICA ATTIVITA' DI RISCHIO	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	P M I	S T A T O	T I P O I M P O R T O	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoc								
1	RIPARTIZIONE GEOGRAFICA ATTIVITA' DI RISCHIO - METODOLOGIA STANDARDIZZATA.....	34070								
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI E BANCHE CENTRALI.....	02	3	1	1		X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA AMMINISTRAZIONI REGIONALI O AUTORITÀ LOCALI.....	04	3	1	1		X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA ORGANISMI DEL SETTORE PUBBLICO.....	06	3	1	1		X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA BANCHE MULTILATERALI DI SVILUPPO.....	08	3	1	1		X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA ORGANIZZAZIONI INTERNAZIONALI.....	10	3	1	1		X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA INTERMEDIARI VIGILATI...	12	3	1	1		X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA IMPRESE.....	14	3	1	1		X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA IMPRESE: DI CUI PMI.....	16	3	1	1		X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO.....	18	3	1	1		X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO: DI CUI PMI.....	20	3	1	1		X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI.....	22	3	1	1		X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI: DI CUI PMI.....	24	3	1	1		X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI IN STATO DI DEFAULT.....	26	3	1	1		X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI AD ALTO RISCHIO.....	28	3	1	1		X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI SOTTO FORMA DI OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE.....	30	3	1	1		X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI A BREVE TERMINE VERSO IMPRESE E INTERMEDIARI VIGILATI.....	32	3	1	1		X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO DEL RISPARMIO (OIC).....	34	3	1	1		X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI IN STRUMENTI DI CAPITALE.....	36	3	1	1		X	X	T	XD
	-ALTRE ESPOSIZIONI.....	38	3	1	1		X	X	T	XD

1	RIPARTIZIONE GEOGRAFICA ATTIVITA' DI RISCHIO - METODOLOGIA BASATA SUI RATING INTERNI.....	34072								
	-TOTALE (*).....	02	3	1	1		X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI E BANCHE CENTRALI(*).....	04	3	1	1		X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA INTERMEDIARI VIGILATI (*).....	06	3	1	1		X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA IMPRESE (*).....	08	3	1	1		X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA IMPRESE: DI CUI FINANZIAMENTI SPECIALIZZATI (*).....	10	3	1	1		X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI VERSO O GARANTITE DA IMPRESE: DI CUI PMI (*).....	12	3	1	1		X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO (*).....	14	3	1	1		X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO: DI CUI GARANTITE DA IMMOBILI (*).....	16	3	1	1	X	X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO: DI CUI ROTATIVE QUALIFICATE (*).....	18	3	1	1		X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO: DI CUI ALTRO (*).....	20	3	1	1	X	X	X	T	XD
	-ESPOSIZIONI IN STRUMENTI DI CAPITALE (*).....	22	3	1	1		X	X	T	XD

(163) (*) ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.2.7 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE SU BASE CONSOLIDATA: RIPARTIZIONE GEOGRAFICA ATTIVITA' DI RISCHIO	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	P M I	S T A T O	T I P O I M P O R T O	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoci								
1	RIPARTIZIONE GEOGRAFICA DEI REQUISITI PATRIMONIALI TOTALI									
	A FRONTE DEL RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE.....	34074								
	-REQUISITO PATRIMONIALE.....	02	3	1	1		X	X	T	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.2.8 RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE SU BASE CONSOLIDATA: ALTRO	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z I A	M E T O D O L O G A P P L I C A	S T A T O	T I P O I M P O R T O	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoc								
1	PERDITE SU CREDITI IPOTECARI.....	34076								
	-ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI RESIDENZIALI.....	02	3	1	1		X	X	S	XD
	-ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI NON RESIDENZIALI.....	04	3	1	1		X	X	S	XD
1	AGGIUSTAMENTO DELLA VALUTAZIONE DEL CREDITO (CVA).....	34078								
	- ESPOSIZIONI TOTALI.....	02	3	1	1	X		X	T	XD
	- DI CUI: DERIVATI OTC.....	04	3	1	1	X		X	T	XD
	- DI CUI: SFT.....	06	3	1	1	X		X	T	XD
	- VAR REGOLAMENTARE DECADELE									
	- MEDIA RELATIVA AGLI ULTIMI 60 GIORNI MOLTIPLICATA									
	PER IL FATTORE bc.....	10	3	1	1	X		X	T	XD
	- VAR T-1.....	12	3	1	1	X		X	T	XD
	- VAR REGOLAMENTARE DECADELE IN CONDIZIONI DI STRESS									
	- MEDIA RELATIVA AGLI ULTIMI 60 GIORNI MOLTIPLICATA									
	PER IL FATTORE bs.....	16	3	1	1	X		X	T	XD
	- VAR IN CONDIZIONI DI STRESS T-1.....	18	3	1	1	X		X	T	XD
	- NUMERO DI CONTROPARTI.....	20	3	1	1	X		X	T	XD
	- DI CUI: PROXY DIFFERENZIALE SUL CDS.....	22	3	1	1	X		X	T	XD
	- COPERTURE AMMISSIBILI									
	- CDS.....	26	3	1	1	X		X	T	XD
	- INDICI DI CDS.....	28	3	1	1	X		X	T	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.3.1 GRANDI ESPOSIZIONI 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	A T T E C O N O M - R A M O	C O D I C E C E N S I T O A	C O D I C E C E N S I T O B	P O S I Z I O D I R E T T A	T I P O I M P O R T O	T I P O L O G C O N T R O P	T I P O L O G P O S I Z X	T I P O L O G P O S I Z Y	V I T A R E S I D U A A	P E R I O D I C I T A'	N O T E
1	ATTIVITÀ DI RISCHIO.....	34090														
	PORTAFOGLIO NON DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA.....	02	3	1	1		X			X					T	XD
	TOTALE DELLE ATTIVITÀ DI RISCHIO (*).....	04	3	1	1		X			X		X	X		T	XD
	- TOTALE DELLE ATTIVITÀ DI RISCHIO: DI CUI POSIZIONI IN STATO DI DEFAULT.....	06	3	1	1		X			X					T	XD
	TOTALE DELLE ATTIVITÀ DI RISCHIO: TIPOLOGIA ESPOSIZIONE															
	-DI CUI: STRUMENTI DI DEBITO.....	10	3	1	1		X		X	X					T	XD
	-DI CUI: STRUMENTI DI CAPITALE.....	12	3	1	1		X		X	X					T	XD
	-DI CUI: STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI.....	14	3	1	1		X		X	X					T	XD
	-DI CUI: IMPEGNI A EROGARE FONDI.....	16	3	1	1		X		X	X					T	XD
	-DI CUI: GARANZIE REALI FINANZIARIE.....	18	3	1	1		X		X	X					T	XD
	-DI CUI: ALTRE GARANZIE E IMPEGNI.....	20	3	1	1		X		X	X					T	XD
	-DI CUI: SCHEMI DI INVESTIMENTO.....	22	3	1	1		X			X					T	XD
	(163) (*) Ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali															
1	TECNICHE DI ATTENUAZIONE DELLE ATTIVITÀ DI RISCHIO.....	34092														
	-EFFETTO DI SOSTITUZIONE: RIPARTIZIONE PER SOTTOSTANTE GARANTITO															
	-DI CUI: STRUMENTI DI DEBITO.....	02	3	1	1		X			X					T	XD
	-DI CUI: STRUMENTI DI CAPITALE.....	04	3	1	1		X			X					T	XD
	-DI CUI: STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI.....	06	3	1	1		X			X					T	XD
	-DI CUI: IMPEGNI A EROGARE FONDI.....	08	3	1	1		X			X					T	XD
	-DI CUI: GARANZIE REALI FINANZIARIE.....	10	3	1	1		X			X					T	XD
	-DI CUI: ALTRE GARANZIE E IMPEGNI.....	12	3	1	1		X			X					T	XD
	-METODOLOGIA INTEGRALE.....	14	3	1	1		X			X					T	XD
	-GARANZIE IMMOBILIARI.....	16	3	1	1		X			X					T	XD
1	ATTIVITÀ DI RISCHIO: COMPOSIZIONE DEI GRUPPI DI CLIENTI CONNESSI.....	34094														
	-PORTAFOGLIO NON DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA.....	02	3	1	1		X	X		X					T	XD
	-TOTALE DELLE ATTIVITÀ DI RISCHIO (*).....	04	3	1	1		X	X		X		X	X		T	XD
	-TOTALE DELLE ATTIVITÀ DI RISCHIO: DI CUI POSIZIONI IN STATO DI DEFAULT.....	06	3	1	1		X	X		X					T	XD
	-TOTALE DELLE ATTIVITÀ DI RISCHIO: TIPOLOGIA ESPOSIZIONE															
	-DI CUI: STRUMENTI DI DEBITO.....	10	3	1	1		X	X	X	X					T	XD
	-DI CUI: STRUMENTI DI CAPITALE.....	12	3	1	1		X	X	X	X					T	XD
	-DI CUI: STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI.....	14	3	1	1		X	X	X	X					T	XD
	-DI CUI: IMPEGNI A EROGARE FONDI.....	16	3	1	1		X	X	X	X					T	XD
	-DI CUI: GARANZIE REALI FINANZIARIE.....	18	3	1	1		X	X	X	X					T	XD
	-DI CUI: ALTRE GARANZIE E IMPEGNI.....	20	3	1	1		X	X	X	X					T	XD
	-DI CUI: SCHEMI DI INVESTIMENTO.....	22	3	1	1		X	X		X					T	XD
	(163) (*) Ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali															

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.3.1 GRANDI ESPOSIZIONI 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	A T T E C C I O N O M - R A M O	C O D I C E C E N S I T O A	C O D I C E C E N S I T O B	P O S I Z I O N E D I R E T T A	T I P O I M P O R T O	T I P O L O G C O N T R O P	T I P O L O G P O S I Z Y	T I P O L O G P O S I Z Y	V I T A R E S I D U A A	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoc														
1	TECNICHE DI ATTENUAZIONE DELLE ATTIVITA' DI RISCHIO: COMPOSIZIONE DEI GRUPPI DI CLIENTI CONNESSI.....	34096														
	EFFETTO DI SOSTITUZIONE: RIPARTIZIONE PER SOTTOSTANTE GARANTITO															
	-DI CUI: STRUMENTI DI DEBITO.....	02	3	1	1		X	X		X					T	XD
	-DI CUI: STRUMENTI DI CAPITALE.....	04	3	1	1		X	X		X					T	XD
	-DI CUI: STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI.....	06	3	1	1		X	X		X					T	XD
	-DI CUI: IMPEGNI A EROGARE FONDI.....	08	3	1	1		X	X		X					T	XD
	-DI CUI: GARANZIE REALI FINANZIARIE.....	10	3	1	1		X	X		X					T	XD
	-DI CUI: ALTRE GARANZIE E IMPEGNI.....	12	3	1	1		X	X		X					T	XD
	-METODOLOGIA INTEGRALE.....	14	3	1	1		X	X		X					T	XD
	-GARANZIE IMMOBILIARI.....	16	3	1	1		X	X		X					T	XD
1	ATTIVITA' DI RISCHIO: ESPOSIZIONI PIU' RILEVANTI.....	34098														
	-ESPOSIZIONI.....	02	3	1	1		X			X				X	T	XD
1	ATTIVITA' DI RISCHIO: ESPOSIZIONI PIU' RILEVANTI - COMPOSIZIONE DEI GRUPPI DI CLIENTI CONNESSI.....	34100														
	-ESPOSIZIONI.....	02	3	1	1		X	X		X				X	T	XD
1	GRANDI ESPOSIZIONI: IDENTIFICAZIONE DELLA CONTROPARTE.....	34102														
	-CONTROPARTI ITALIANE (#).....	02	3	1	1		X				X				T	
	-CONTROPARTI ESTERE:															
	-SOCIETA' NON FINANZIARIE (#).....	04	3	1	2	S	X				X				T	
	-ALTRE SOCIETA' FINANZIARIE (#).....	06	3	1	2	D	X				X				T	
	-ALTRE (#).....	08	3	1	2		X				X				T	
	(601) - (#) La voce deve essere segnalata indicando convenzionalmente "1" nel campo importo.															
1	GRANDI ESPOSIZIONI: LIMITI APPLICATI.....	34104														
	-ENTI(*).....	02	3	1	1					X					T	XD
	-CONTROPARTI DIVERSE DA ENTI.....	04	3	1	1					X					T	XD

(163) (*) ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.4 RISCHIO DI MERCATO 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	A P P R O C C I O	F A T T O R E D I P O N D	F O R M A T E C N I C A	M E T O D O L O G A P P L I C	P A E S E M E R C Q U O T	R U O L O C A R T O L A R I Z	T E M P O I N A D E M P I M	T I P O D I R I S C H I O	T I P O I M P O R T O	T I P O L O G S O T T O S T	V A L U T A	V R E S R I S C M E R C	P E R I O D I C I T A'	N O T E	
																				SOTVOC
1	PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA:																			
	METODOLOGIA STANDARDIZZATA - TITOLI DI DEBITO - RISCHIO																			
	GENERICO E SPECIFICO.....	34150																		
	RISCHIO GENERICO.....	02	3	1	1									X		X		T	XD	
	RISCHIO GENERICO: DI CUI CONTRATTI DERIVATI																			
	-POSIZIONI LUNGHE.....	04	3	1	1									X		X		T	XD	
	-POSIZIONI CORTE.....	06	3	1	1									X		X		T	XD	
	RISCHIO GENERICO: DI CUI ALTRE ATTIVITA' E PASSIVITA'																			
	-POSIZIONI LUNGHE.....	08	3	1	1									X		X		T	XD	
	-POSIZIONI CORTE.....	10	3	1	1									X		X		T	XD	
	RISCHIO GENERICO: METODO BASATO SULLA SCADENZA.....	11	3	1	1									X		X		T	XD	
	-POSIZIONI LUNGHE.....	12	3	1	1									X		X	X	T	XD	
	-POSIZIONI CORTE.....	14	3	1	1									X		X	X	T	XD	
	RISCHIO GENERICO: METODO BASATO SULLA DURATA																			
	FINANZIARIA.....	15	3	1	1									X		X		T	XD	
	-POSIZIONI LUNGHE.....	16	3	1	1									X		X	X	T	XD	
	-POSIZIONI CORTE.....	18	3	1	1									X		X	X	T	XD	
	RISCHIO SPECIFICO.....	17	3	1	1									X		X		T	XD	
	-POSIZIONI LUNGHE.....	20	3	1	1									X		X		T	XD	
	-POSIZIONI CORTE.....	22	3	1	1									X		X		T	XD	
	RISCHIO SPECIFICO: DI CUI TITOLI DI DEBITO DI																			
	CATEGORIA 1.....	23	3	1	1									X		X		T	XD	
	-POSIZIONI LUNGHE.....	24	3	1	1									X		X		T	XD	
	-POSIZIONI CORTE.....	26	3	1	1									X		X		T	XD	
	RISCHIO SPECIFICO: DI CUI TITOLI DI DEBITO DI																			
	CATEGORIA 2.....	27	3	1	1									X		X	X	T	XD	
	-POSIZIONI LUNGHE.....	28	3	1	1									X		X	X	T	XD	
	-POSIZIONI CORTE.....	30	3	1	1									X		X	X	T	XD	
	RISCHIO SPECIFICO: DI CUI TITOLI DI DEBITO DI																			
	CATEGORIA 3.....	31	3	1	1									X		X		T	XD	
	-POSIZIONI LUNGHE.....	32	3	1	1									X		X		T	XD	
	-POSIZIONI CORTE.....	34	3	1	1									X		X		T	XD	
	RISCHIO SPECIFICO: DI CUI TITOLI DI DEBITO DI																			
	CATEGORIA 4.....	35	3	1	1									X		X		T	XD	
	-POSIZIONI LUNGHE.....	36	3	1	1									X		X		T	XD	
	-POSIZIONI CORTE.....	38	3	1	1									X		X		T	XD	
	DERIVATI NTH-TO-DEFAULT.....	39	3	1	1									X		X		T	XD	
	-POSIZIONI LUNGHE.....	40	3	1	1									X		X		T	XD	
	-POSIZIONI CORTE.....	42	3	1	1									X		X		T	XD	
	POSIZIONI VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE.....	44	3	1	1									X		X		T	XD	
	PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE DI CORRELAZIONE.....	46	3	1	1									X		X		T	XD	
	OIC.....	48	3	1	1									X		X		T	XD	
	OPZIONI: RISCHI AGGIUNTIVI.....	50	3	1	1	X								X		X		T	XD	

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

BASE INF.	4.4 RISCHIO DI MERCATO 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	A P P R O C C I O	F A T T O R E D I P O N D	F O R M A T E C N I C A	M E T O D O L O G A P P L I C	P A E S E M E R C Q U O T	R U O L O C A R T O L A R I Z	T E M P O I N A D E M P I M	T I P O D I R I S C H I O	T I P O I M P O R T O	T I P O L O G S O T T O S T	V A L U T A	V R E S R I S C M E R C	P E R I O D I C I T A'	N O T E		
																				SOTVOC	
1	PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA:																				
	METODOLOGIA STANDARDIZZATA - POSIZIONI VERSO LA																				
	CARTOLARIZZAZIONE - RISCHIO SPECIFICO.....	34567																			
	TOTALE DELLE POSIZIONI VERSO CARTOLARIZZAZIONI.....	34	3	1	1									X	X				T	XD	
	-POSIZIONI LUNGHE VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE(*).....	36	3	1	1		X				X			X					T	XD	
	-POSIZIONI CORTE VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE(*).....	38	3	1	1		X				X			X					T	XD	
	-POSIZIONI LUNGHE VERSO LA RI-CARTOLARIZZAZIONE(*).....	40	3	1	1		X				X			X					T	XD	
	-POSIZIONI CORTE VERSO LA RI-CARTOLARIZZAZIONE(*).....	42	3	1	1		X				X			X					T	XD	
	<i>(163) (*) ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali</i>																				
1	PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA:																				
	METODOLOGIA STANDARDIZZATA - SOTTO PORTAFOGLIO DI																				
	NEGOZIAZIONE DI CORRELAZIONE - RISCHIO SPECIFICO.....	34569																			
	-POSIZIONI VERSO CARTOLARIZZAZIONI																				
	-POSIZIONI LUNGHE(*).....	46	3	1	1		X				X			X					T	XD	
	-POSIZIONI CORTE(*).....	48	3	1	1		X				X			X					T	XD	
	-POSIZIONI IN DERIVATI CREDITIZI N-TO-DEFAULT																				
	-POSIZIONI LUNGHE.....	34	3	1	1		X							X					T	XD	
	-POSIZIONI CORTE.....	36	3	1	1		X							X					T	XD	
	-ALTRE POSIZIONI DEL PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE DI																				
	CORRELAZIONE																				
	-CONNESSE CON POSIZIONI VERSO CARTOLARIZZAZIONI																				
	-POSIZIONI LUNGHE.....	50	3	1	1		X				X			X					T	XD	
	-POSIZIONI CORTE.....	52	3	1	1		X				X			X					T	XD	
	-CONNESSE CON POSIZIONI IN DERIVATI CREDITIZI																				
	N-TO-DEFAULT																				
	-POSIZIONI LUNGHE.....	54	3	1	1		X							X					T	XD	
	-POSIZIONI CORTE.....	56	3	1	1		X							X					T	XD	
	<i>(163) (*) ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali</i>																				

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

BASE INF.	4.4 RISCHIO DI MERCATO 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	A P P R O C C I O	F A T T O R E D I P O N D	F O R M A T E C N I C A	M E T O D O L O G A P P L I C	P A E S E M E R C Q U O T	R U O L O C A R T O L A R I Z	T E M P O I N A D E M P I M	T I P O D I R I S C H I O	T I P O I M P O R T O	T I P O L O G S O T T O S T	V A L U T A	V R E S R I S C M E R C	P E R I O D I C I T A'	N O T E	
																				sotvoc
1	PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA:																			
	METODOLOGIA STANDARDIZZATA - TITOLI DI CAPITALE.....		34568																	
		-RISCHIO GENERICO.....	11	3	1	1				X				X					T	XD
		-POSIZIONI LUNGHE.....	20	3	1	1				X				X					T	XD
		-POSIZIONI CORTE.....	22	3	1	1				X				X					T	XD
		-RISCHIO GENERICO - DI CUI:																		
		-DERIVATI																		
		-POSIZIONI LUNGHE.....	24	3	1	1				X				X					T	XD
		-POSIZIONI CORTE.....	26	3	1	1				X				X					T	XD
		-ALTRE ATTIVITA' E PASSIVITA'																		
		-POSIZIONI LUNGHE.....	28	3	1	1				X				X					T	XD
		-POSIZIONI CORTE.....	30	3	1	1				X				X					T	XD
		-INDICI AZIONARI NEGOZIATI DIVERSIFICATI																		
		-POSIZIONI LUNGHE.....	32	3	1	1				X				X					T	XD
		-POSIZIONI CORTE.....	34	3	1	1				X				X					T	XD
		-ALTRI TITOLI DI CAPITALE																		
		-POSIZIONI LUNGHE.....	36	3	1	1				X				X					T	XD
		-POSIZIONI CORTE.....	38	3	1	1				X				X					T	XD
		-RISCHIO SPECIFICO.....	71	3	1	1				X				X					T	XD
		-POSIZIONI LUNGHE.....	72	3	1	1				X				X					T	XD
		-POSIZIONI CORTE.....	74	3	1	1				X				X					T	XD
		-OIC.....	75	3	1	1				X				X					T	XD
		-POSIZIONI LUNGHE.....	76	3	1	1				X				X					T	XD
		-POSIZIONI CORTE.....	78	3	1	1				X				X					T	XD
		-OPZIONI: RISCHI AGGIUNTIVI.....	79	3	1	1	X			X				X					T	XD
		-POSIZIONI LUNGHE.....	80	3	1	1				X				X					T	XD
		-POSIZIONI CORTE.....	82	3	1	1				X				X					T	XD
1	RISCHIO DI REGOLAMENTO PER LE TRANSAZIONI CON REGOLAMENTO																			
	CONTESTUALE - ESPOSIZIONE.....		34575	00	3	1	1							X	X				T	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

BASE INF.	4.4 RISCHIO DI MERCATO SU BASE CONSOLIDATA	VOCE	DURATA	DIVISA	RESIDENZA	APPROCCIO	FATTORE DI POND	FORMA TECNICA	METODOLOGIA APPLIC	PAESE MERC QUOT	RUOLO CARTO LA RIZ	TEMPO INADEMPIM	TIPO DI RISCHIO	TIPO IMPORTO	TIPOLOG SOTTOST	VALUTA	VRES RISSC MERC	PERIODICITA'	NOTE
	1	RISCHIO DI CAMBIO: METODOLOGIA STANDARDIZZATA - POSIZIONE																	
		NETTA APERTA IN CAMBI.....	34578																
		-POSIZIONE COMPLESSIVA IN VALUTE ESTERE																	
		-POSIZIONI LUNGHE.....	42	3	1	1								X				T	XD
		-POSIZIONI CORTE.....	44	3	1	1								X				T	XD
		-POSIZIONE COMPENSATA.....	46	3	1	1								X				T	XD
		-POSIZIONE COMPLESSIVA IN VALUTE ESTERE: DI CUI VALUTE STRETTAMENTE CORRELATE.....	47	3	1	1								X				T	XD
		-POSIZIONE LUNGA.....	48	3	1	1								X				T	XD
		-POSIZIONE CORTA.....	50	3	1	1								X				T	XD
		-POSIZIONE COMPENSATA.....	52	3	1	1								X				T	XD
		-POSIZIONE COMPLESSIVA IN VALUTE ESTERE: DI CUI ALTRE VALUTE.....	53	3	1	1								X				T	XD
		-POSIZIONE LUNGA.....	54	3	1	1								X				T	XD
		-POSIZIONE CORTA.....	56	3	1	1								X				T	XD
		-POSIZIONE COMPLESSIVA IN VALUTE ESTERE: DI CUI ORO.....	57	3	1	1								X				T	XD
		-POSIZIONE LUNGA.....	58	3	1	1								X				T	XD
		-POSIZIONE CORTA.....	62	3	1	1								X				T	XD
		-POSIZIONE COMPLESSIVA IN VALUTE ESTERE:DI CUI OPZIONI-RISCHI AGGIUNTIVI.....	64	3	1	1	X							X				T	XD
		-POSIZIONE COMPLESSIVA																	
		-POSIZIONE LUNGA.....	66	3	1	1		X						X		X		T	XD
		-POSIZIONE CORTA.....	68	3	1	1		X						X		X		T	XD
	1	RISCHIO SULLE POSIZIONI IN MERCI: METODOLOGIA STANDARDIZZATA.....	34590																
		-METALLI PREZIOSI (ECCETTO L'ORO).....	12	3	1	1								X				T	XD
		POSIZIONI LUNGHE.....	14	3	1	1								X				T	XD
		POSIZIONI CORTE.....	16	3	1	1								X				T	XD
		-METALLI COMUNI.....	18	3	1	1								X				T	XD
		POSIZIONI LUNGHE.....	20	3	1	1								X				T	XD
		POSIZIONI CORTE.....	22	3	1	1								X				T	XD
		-PRODOTTI AGRICOLI.....	24	3	1	1								X				T	XD
		POSIZIONI LUNGHE.....	26	3	1	1								X				T	XD
		POSIZIONI CORTE.....	28	3	1	1								X				T	XD
		-ALTRO.....	30	3	1	1								X				T	XD
		POSIZIONI LUNGHE.....	32	3	1	1								X				T	XD
		POSIZIONI CORTE.....	34	3	1	1								X				T	XD
		-ALTRO: DI CUI PRODOTTI ENERGETICI.....	36	3	1	1								X				T	XD
		POSIZIONI LUNGHE.....	38	3	1	1								X				T	XD
		POSIZIONI CORTE.....	40	3	1	1								X				T	XD
		-TOTALE POSIZIONI IN MERCI.....	42	3	1	1			X					X				T	XD
		POSIZIONI LUNGHE.....	44	3	1	1			X					X				T	XD
		POSIZIONI CORTE.....	46	3	1	1			X					X				T	XD
		-OPZIONI - RISCHI AGGIUNTIVI.....	48	3	1	1	X							X				T	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.4 RISCHIO DI MERCATO 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	A P P R O C C I O	F A T T O R E D I P O N D	F O R M A T E C N I C A	M E T O D O L O G A P P L I C A	P A E S E M E R C Q U O T	R U O L O C A R T O L A R I Z	T E M P O I N A D E M P I M	T I P O D I R I S C H I O	T I P O I M P O R T O	T I P O L O G S O T T O S T	V A L U T A	V R E S R I S C M E R C	P E R I O D I C I T A'	N O T E	
		sotvoci																		
1	MODELLI INTERNI SUI RISCHI DI MERCATO: INFORMAZIONI SUL																			
	VAR.....	34580																		
	-VAR REGOLAMENTARE DECADALE																			
	-MEDIA RELATIVA AGLI ULTIMI 60 GIORNI MOLTIPLICATA PER IL FATTORE mc.....	02	3	1	1								X	X					T	XD
	-VAR T-1.....	04	3	1	1								X	X					T	XD
	-VAR REGOLAMENTARE DECADALE IN CONDIZIONI DI STRESS:																			
	-MEDIA RELATIVA AGLI ULTIMI 60 GIORNI MOLTIPLICATA PER IL FATTORE ms.....	05	3	1	1								X	X					T	XD
	-VAR IN CONDIZIONI DI STRESS T-1.....	07	3	1	1								X	X					T	XD
	-REQUISITO PER IL RISCHIO DI MIGRAZIONE E DEFAULT (IRC):																			
	-MEDIA RELATIVA ALLE 12 SETTIMANE PRECEDENTI.....	09	3	1	1								X						T	XD
	-IRC T-1.....	11	3	1	1								X						T	XD
	-APR:																			
	-MEDIA RELATIVA ALLE 12 SETTIMANE PRECEDENTI.....	13	3	1	1								X						T	XD
	-APR T-1.....	15	3	1	1								X						T	XD
	-APR FLOOR.....	17	3	1	1								X						T	XD
	-NUMERO DI SCOSTAMENTI DEL VAR REGOLAMENTARE.....	22	3	1	1														T	XD
	-FATTORE MOLTIPLICATIVO mc (*).....	24	3	1	1														T	XD
	-FATTORE MOLTIPLICATIVO ms (*).....	26	3	1	1														T	XD
	-APR: REQUISITO APPLICATO ALLE SOLE POSIZIONI LUNGHE NETTE DEL PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE DI CORRELAZIONE....	28	3	1	1								X						T	XD
	-APR: REQUISITO APPLICATO ALLE SOLE POSIZIONI CORTE NETTE DEL PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE DI CORRELAZIONE....	30	3	1	1								X						T	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.6.1 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	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoco					
1	ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO TOTALI: RISCHIO DI CREDITO E DI CONTROPARTE.....	34300					
	METODOLOGIA STANDARDIZZATA						
	- AMMINISTRAZIONI CENTRALI E BANCHE CENTRALI.....	02	3	1	1	T	XD
	- AMMINISTRAZIONI REGIONALI O AUTORITA' LOCALI.....	04	3	1	1	T	XD
	- ORGANISMI DEL SETTORE PUBBLICO.....	06	3	1	1	T	XD
	- BANCHE MULTILATERALI DI SVILUPPO.....	08	3	1	1	T	XD
	- ORGANIZZAZIONI INTERNAZIONALI.....	10	3	1	1	T	XD
	- INTERMEDIARI VIGILATI.....	12	3	1	1	T	XD
	- IMPRESE.....	14	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO.....	16	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI GARANTITE DA IMMOBILI.....	18	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI SCADUTE.....	20	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI AD ALTO RISCHIO.....	22	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI SOTTO FORMA DI OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE.....	24	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI A BREVE TERMINE VERSO IMPRESE O INTERMEDIARI VIGILATI.....	26	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI VERSO ORGANISMI DI INVESTIMENTO COLLETTIVO DEL RISPARMIO (OIC).....	28	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI IN STRUMENTI DI CAPITALE.....	30	3	1	1	T	XD
	- ALTRE ESPOSIZIONI.....	32	3	1	1	T	XD
	- CARTOLARIZZAZIONI						
	- POSIZIONI VERSO CARTOLARIZZAZIONI: TOTALE.....	34	3	1	1	T	XD
	- POSIZIONI VERSO CARTOLARIZZAZIONI: DETTAGLIO						
	POSIZIONI VERSO RI-CARTOLARIZZAZIONI.....	36	3	1	1	T	XD
	METODOLOGIA BASATA SUI RATING INTERNI:						
	-TUTTE LE METODOLOGIE						
	- STRUMENTI DI CAPITALE.....	38	3	1	1	T	XD
	- POSIZIONI VERSO LE CARTOLARIZZAZIONI: TOTALE.....	40	3	1	1	T	XD
	- POSIZIONI VERSO LE CARTOLARIZZAZIONI: DETTAGLIO						
	POSIZIONI VERSO LE RI-CARTOLARIZZAZIONI.....	42	3	1	1	T	XD
	- ALTRE ATTIVITA'.....	44	3	1	1	T	XD
	-METODOLOGIA DI BASE						
	- AMMINISTRAZIONI CENTRALI E BANCHE CENTRALI.....	46	3	1	1	T	XD
	- INTERMEDIARI VIGILATI.....	48	3	1	1	T	XD
	- IMPRESE - PMI.....	50	3	1	1	T	XD
	- IMPRESE - PMI CUI SI APPLICA IL FATTORE DI SOSTEGNO (0,7619).....	52	3	1	1	T	XD
	- IMPRESE - FINANZIAMENTI SPECIALIZZATI.....	54	3	1	1	T	XD
	- IMPRESE - ALTRO.....	56	3	1	1	T	XD
	-METODOLOGIA AVANZATA						
	- AMMINISTRAZIONI CENTRALI E BANCHE CENTRALI.....	58	3	1	1	T	XD
	- INTERMEDIARI VIGILATI.....	60	3	1	1	T	XD
	- IMPRESE - PMI.....	62	3	1	1	T	XD
	- IMPRESE - PMI CUI SI APPLICA IL FATTORE DI SOSTEGNO (0,7619).....	64	3	1	1	T	XD
	- IMPRESE - FINANZIAMENTI SPECIALIZZATI.....	66	3	1	1	T	XD
	- IMPRESE - ALTRO.....	68	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO VERSO PMI - GARANTITE DA						

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.6.1 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	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoc					
	IMMOBILI.....	70	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO GARANTITE DA IMMOBILI VERSO PMI CUI SI APPLICA IL FATTORE DI SOSTEGNO (0,7619).....	72	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO VERSO NON PMI - GARANTITE DA IMMOBILI.....	74	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI ROTATIVE AL DETTAGLIO QUALIFICATE.....	76	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO VERSO PMI - ALTRO.....	78	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO - ALTRO: VERSO PMI CUI SI APPLICA IL FATTORE DI SOSTEGNO (0,7619).....	80	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO VERSO NON PMI - ALTRO.....	82	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI VERSO CONTROPARTI CENTRALI NELLA FORMA DI CONTRIBUTI PREFINANZIATI AL FONDO DI GARANZIA.....	84	3	1	1	T	XD
1	ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO TOTALI: RISCHIO DI AGGIUSTAMENTO DELLA VALUTAZIONE DEL CREDITO.....	34302					
	- METODO DELL'ESPOSIZIONE ORIGINARIA.....	02	3	1	1	T	XD
	- METODO STANDARD.....	04	3	1	1	T	XD
	- METODO AVANZATO.....	06	3	1	1	T	XD
1	ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO TOTALI: RISCHIO DI REGOLAMENTO.....	34304					
	- POSIZIONI INCLUSE NEL PORTAFOGLIO DI NEGOZIAZIONE DI VIGILANZA.....	02	3	1	1	T	XD
	- POSIZIONI INCLUSE NEL PORTAFOGLIO BANCARIO.....	04	3	1	1	T	XD
1	ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO TOTALI: RISCHI DI MERCATO (POSIZIONE, CAMBIO E MERCI).....	34306					
	METODOLOGIA STANDARDIZZATA						
	- RISCHIO DI POSIZIONE SU STRUMENTI DI DEBITO.....	02	3	1	1	T	XD
	- RISCHIO DI POSIZIONE SU STRUMENTI DI CAPITALE.....	04	3	1	1	T	XD
	- RISCHIO DI CAMBIO.....	06	3	1	1	T	XD
	- RISCHIO DI POSIZIONE SU MERCI.....	08	3	1	1	T	XD
	MODELLI INTERNI						
	- MODELLI INTERNI: TOTALE.....	10	3	1	1	T	XD
1	ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO TOTALI: RISCHIO DI CONCENTRAZIONE.....	34308 00	3	1	1	T	XD
1	ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO TOTALI: RISCHIO OPERATIVO.....	34310					
	- METODO BASE.....	02	3	1	1	T	XD
	- METODO STANDARDIZZATO.....	04	3	1	1	T	XD
	- METODI AVANZATI.....	06	3	1	1	T	XD
1	ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO TOTALI - SIM: SPESE FISSE GENERALI.....	34312 00	3	1	1	T	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.6.1 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	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoc					
1	ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO TOTALI: ALTRI.....	34314					
	- ART 458 CRR						
	- CONCENTRAZIONE DEI RISCHI.....	04	3	1	1	T	XD
	- SETTORE IMMOBILIARE.....	06	3	1	1	T	XD
	- SETTORE FINANZIARIO.....	08	3	1	1	T	XD
	- ART 459 CRR.....	10	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO SPECIFICHE.....	12	3	1	1	T	XD
	- ART 3 CRR.....	14	3	1	1	T	XD
1	POSIZIONE PATRIMONIALE COMPLESSIVA.....	34324					
	- ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO TOTALI.....	02	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO: DETTAGLIO SIM EX ARTICOLO 95(2) CRR.....	04	3	1	1	T	XD
	- ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO: DETTAGLIO SIM EX ARTICOLO 96(1) E (2).....	06	3	1	1	T	XD
	- COEFFICIENTE DI CET1.....	08	3	1	1	T	XD
	- COEFFICIENTE DI CET1 INCLUSI REQUISITI DI FONDI PROPRI SPECIFICI.....	10	3	1	1	T	XD
	- ECCEDEENZA/DEFICIENZA DI CET1 RISPETTO SOGLIA DEL 4,5%...	12	3	1	1	T	XD
	- COEFFICIENTE DI T1.....	14	3	1	1	T	XD
	- COEFFICIENTE DI T1 INCLUSI I REQUISITI DI FONDI PROPRI SPECIFICI.....	16	3	1	1	T	XD
	- ECCEDEENZA/DEFICIENZA DI T1 RISPETTO SOGLIA DEL 6%.....	18	3	1	1	T	XD
	- COEFFICIENTE DEI FONDI PROPRI.....	20	3	1	1	T	XD
	- COEFFICIENTE DEI FONDI PROPRI INCLUSI I REQUISITI DI FONDI PROPRI SPECIFICI.....	22	3	1	1	T	XD
	- ECCEDEENZA/DEFICIENZA DI FONDI PROPRI RISPETTO SOGLIA DELL'8%.....	24	3	1	1	T	XD
1	INFORMAZIONI AGGIUNTIVE.....	34326					
	- LIVELLO DI CET1 SPECIFICO (TARGET).....	02	3	1	1	T	XD
	- LIVELLO DI T1 SPECIFICO (TARGET).....	04	3	1	1	T	XD
	- LIVELLO DI FONDI PROPRI SPECIFICO (TARGET).....	06	3	1	1	T	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.6.2 POSIZIONE PATRIMONIALE CONSOLIDATA: DATI NOMINATIVI	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 P A T R I M	C O D I C E C E N S I T O A	M E T O D O L C O N S O L I D	T I P O I M P O R T O	T I P O L O G C O N T R O P	P E R I O D I C I T A'	N O T E	
		sotvoc											
1	ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO TOTALI:.....	34328	00	3	1	1		X	X	X	X	S	XD
	BASE INDIVIDUALE:												
	- RISCHIO DI CREDITO, DI CONTROPARTE E DI REGOLAMENTO...	02	3	1	1		X	X	X	X	S	XD	
	- RISCHIO DI MERCATO.....	04	3	1	1		X	X	X	X	S	XD	
	- RISCHIO OPERATIVO.....	06	3	1	1		X	X	X	X	S	XD	
	- ALTRI RISCHI.....	08	3	1	1		X	X	X	X	S	XD	
	CONTRIBUTO ALLE ESPOSIZIONI TOTALI CONSOLIDATE:												
	- RISCHIO DI CREDITO, DI CONTROPARTE E DI REGOLAMENTO...	14	3	1	1		X	X	X	X	S	XD	
	- RISCHI DI MERCATO.....	16	3	1	1		X	X	X	X	S	XD	
	- RISCHIO OPERATIVO.....	18	3	1	1		X	X	X	X	S	XD	
	- ALTRI RISCHI.....	20	3	1	1		X	X	X	X	S	XD	
1	FONDI PROPRI.....	34330											
	BASE INDIVIDUALE:.....	00	3	1	1	X	X		X		S	XD	
	- CET1.....	02	3	1	1	X	X		X		S	XD	
	- AT1.....	04	3	1	1	X	X		X		S	XD	
	- T1.....	06	3	1	1	X	X		X		S	XD	
	- T2.....	08	3	1	1	X	X		X		S	XD	
	CONTRIBUTO AI FONDI PROPRI CONSOLIDATI DI PERTINENZA												
	TERZI:.....	10	3	1	1	X	X		X		S	XD	
	- CET1.....	12	3	1	1	X	X		X		S	XD	
	- AT1.....	14	3	1	1	X	X		X		S	XD	
	- T1.....	16	3	1	1	X	X		X		S	XD	
	- T2.....	18	3	1	1	X	X		X		S	XD	
	- AVVIAMENTO (POSITIVO/NEGATIVO).....	20	3	1	1	X	X		X		S	XD	
	FONDI PROPRI INCLUSI NEI FONDI PROPRI CONSOLIDATI.....	22	3	1	1		X		X		S	XD	
	- CET1 INCLUSO NEL CET1 CONSOLIDATO.....	24	3	1	1		X		X		S	XD	
	- AT1 INCLUSO NELL'AT1 CONSOLIDATO.....	26	3	1	1		X		X		S	XD	
	- CONTRIBUTO AL RISULTATO CONSOLIDATO.....	28	3	1	1		X		X		S	XD	
	- AVVIAMENTO (POSITIVO/NEGATIVO).....	30	3	1	1		X		X		S	XD	
1	RISERVE DI CAPITALE DI PERTINENZA DELLA FILIAZIONE.....	34340											
	- REQUISITO COMBINATO DI RISERVA DI CAPITALE.....	02	3	1	1		X		X		S	XD	
	- RISERVA DI CONSERVAZIONE DEL CAPITALE.....	04	3	1	1		X		X		S	XD	
	- RISERVA DI CAPITALE SPECIFICA DELL'ENTE.....	06	3	1	1		X		X		S	XD	
	- RISERVA DI CONSERVAZIONE DEL CAPITALE CONNESSA AL RISCHIO SISTEMICO O MACRO-PRUDENZIALE IDENTIFICATA A LIVELLO DI PAESE MEMBRO.....	08	3	1	1		X		X		S	XD	
	- RISERVA DI CAPITALE A FRONTE DEL RISCHIO SISTEMICO.....	10	3	1	1		X		X		S	XD	
	- RISERVA PER ENTI DI IMPORTANZA SISTEMICA.....	12	3	1	1		X		X		S	XD	
	- RISERVA PER I G-SII.....	14	3	1	1		X		X		S	XD	
	- RISERVA PER GLI O-SII.....	16	3	1	1		X		X		S	XD	

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.7.1 RISCHIO DI LIQUIDITA' SU BASE CONSOLIDATA - COPERTURA DELLA LIQUIDITA' (LCR)- MONITORAGGIO ATTIVITA' LIQUIDE	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	S O T T O S I T R I L E V A Z	E S P O S I T I R / I N D I R	C L A S M E R C R E D I T O	G R L I Q / Q U A L C R E D	T I P O I M P O R T O	V A L U T A	P E R I O D I C I T A'	N O T E
L1	ATTIVITA' LIQUIDE DI BASE.....	34350											
	- CASSA.....	02	3	1	1	X				X	X	M	XD
	- ESPOSIZIONI VERSO BANCA CENTRALE MOBILIZZABILI IN CONDIZIONI DI STRESS.....	04	3	1	1	X				X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI O REGIONALI.....	06	3	1	1	X	X			X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BANCHE CENTRALI O DA ORGANISMI DEL SETTORE PUBBLICO.....	08	3	1	1	X	X			X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BRI, FMI, CE E BMS.....	10	3	1	1	X	X			X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA EFSF, ESM.....	12	3	1	1	X	X			X	X	M	XD
	- AZIONI O QUOTE DI OIC												
	- DI CUI: SCARTO PRUDENZIALE 0% (CRR, ART. 416(1) LETTERA A).....	14	3	1	1	X				X	X	M	XD
	- DI CUI: SCARTO PRUDENZIALE 5% (CRR, ART. 416(1) LETTERA B E C).....	16	3	1	1	X				X	X	M	XD
	- DI CUI: SCARTO PRUDENZIALE 20% (CRR, ART. 416(1) LETTERA D).....	18	3	1	1	X				X	X	M	XD
	- LINEE DI CREDITO STAND BY GARANTITE ACCORDATE DALLA BANCA CENTRALE.....	20	3	1	1	X				X	X	M	XD
	- SISTEMI DI TUTELA ISTITUZIONALE O ENTI AFFILIATI PERMANENTEMENTE AD UN ORGANISMO CENTRALE												
	- DI CUI: DEPOSITI.....	22	3	1	1	X				X	X	M	XD
	- DI CUI: ALTRI FONDI CONTRATTUALMENTE DISPONIBILI.....	24	3	1	1	X				X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI DA BANCHE COSTITUITE DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI O REGIONALI.....	26	3	1	1	X			X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI DA IMPRESE NON FINANZIARIE.....	28	3	1	1	X		X	X	X	X	M	XD
	- OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE CON PONDERAZIONE RIDOTTA.....	30	3	1	1	X		X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI GARANTITI DA CREDITI IPOTECARI COMMERCIALI (CMBS).....	32	3	1	1	X		X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI GARANTITI DA CREDITI IPOTECARI RESIDENZIALI (RMBS).....	34	3	1	1	X		X	X	X	X	M	XD
	- OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE AMMISSIBILI EX ART. 52(4) DIRETTIVA 2009/65.....	36	3	1	1	X		X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI DI LIQUIDITA' E QUALITA' CREDITIZIA ESTREMAMENTE ELEVATE: ALTRE.....	38	3	1	1	X		X		X	X	M	XD
	- TITOLI DI LIQUIDITA' E QUALITA' CREDITIZIA ELEVATE: ALTRE.....	40	3	1	1	X		X		X	X	M	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.7.1 RISCHIO DI LIQUIDITA' SU BASE CONSOLIDATA - COPERTURA DELLA LIQUIDITA' (LCR)- MONITORAGGIO ATTIVITA' LIQUIDE	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	S O T T O S I T R I L E V A Z	E S P O S I T I R / I N D I R	C L A S M E R C R E D I T O	G R L I Q / Q U A L C R E D	T I P O I M P O R T O	V A L U T A	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoc											
L1	ATTIVITA' LIQUIDE SUPPLEMENTARI.....	34352											
	- CASSA.....	02	3	1	1	X				X	X	M	XD
	- ESPOSIZIONI VERSO BANCA CENTRALE MOBILIZZABILI IN CONDIZIONI DI STRESS.....	04	3	1	1	X				X	X	M	XD
	- TITOLI SOGGETTI A PONDERAZIONE PARI A 0%												
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI.....	06	3	1	1	X	X		X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BANCHE CENTRALI.....	08	3	1	1	X			X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA ORGANISMI DEL SETTORE PUBBLICO, REGIONI ED AUTORITA' LOCALI.....	10	3	1	1	X			X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BRI, FMI, UE, BMS, EFSF, ESM.....	12	3	1	1	X			X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI O BANCHE CENTRALI: ALTRE.....	14	3	1	1	X			X	X	X	M	XD
	- TITOLI SOGGETTI A PONDERAZIONE PARI A 20%												
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI.....	16	3	1	1	X	X		X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BANCHE CENTRALI.....	18	3	1	1	X			X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA ORGANISMI DEL SETTORE PUBBLICO, REGIONI CON AUTONOMIA FISCALE ED AUTORITA' LOCALI.....	20	3	1	1	X			X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BMS.....	22	3	1	1	X			X	X	X	M	XD
	- OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE: ALTRE.....	24	3	1	1	X			X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI DA IMPRESE NON FINANZIARIE CON PONDERAZIONE MINORE O UGUALE AL 50%.....	26	3	1	1	X			X	X	X	M	XD
	- TITOLI GARANTITI DA CREDITI IPOTECARI RESIDENZIALI (RMBS): SOTTOSTANTE CON PONDERAZIONE AL 35%.....	28	3	1	1	X			X	X	X	M	XD
	- LINEE DI CREDITO STAND BY GARANTITE ACCORDATE DALLA BANCA CENTRALE.....	30	3	1	1	X			X	X	X	M	XD
	- SISTEMI DI TUTELA ISTITUZIONALE O ENTI AFFILIATI PERMANENTEMENTE AD UN ORGANISMO CENTRALE.....	32	3	1	1	X			X	X	X	M	XD
	- STRUMENTI DI CAPITALE.....	34	3	1	1	X			X	X	X	M	XD
	- ORO.....	36	3	1	1	X			X	X	X	M	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.7.1 RISCHIO DI LIQUIDITA' SU BASE CONSOLIDATA - COPERTURA DELLA LIQUIDITA' (LCR)- MONITORAGGIO ATTIVITA' LIQUIDE	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z I A	S O T T O S I T R I L E V A Z	E S P O S I T I R / I N D I R	C L A S M E R C R E D I T O	G R L I Q / Q U A L C R E D	T I P O I M P O R T O	V A L U T A	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoc											
L1	ATTIVITA' LIQUIDE AGGIUNTIVE.....	34354											
	- TITOLI EMESSI DA IMPRESE FINANZIARIE.....	02	3	1	1	X		X		X	X	M	XD
	- EMISSIONI PROPRIE.....	04	3	1	1	X		X		X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI DA BANCHE NON GARANTITI.....	06	3	1	1	X		X		X	X	M	XD
	- TITOLI GARANTITI DA CREDITI IPOTECARI COMMERCIALI (CMBS): ALTRI.....	08	3	1	1	X		X		X	X	M	XD
	- TITOLI GARANTITI DA CREDITI IPOTECARI RESIDENZIALI (RMBS): ALTRI.....	10	3	1	1	X		X		X	X	M	XD
	- STRUMENTI DI CAPITALE.....	12	3	1	1	X				X	X	M	XD
	- ORO.....	14	3	1	1	X				X	X	M	XD
	- TITOLI DI DEBITO GARANTITI: ALTRI.....	16	3	1	1	X				X	X	M	XD
	- OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE NON AMMISSIBILI.....	18	3	1	1	X				X	X	M	XD
	- TITOLI DI DEBITO EMESSI DA IMPRESE NON FINANZIARIE: ALTRI.....	20	3	1	1	X				X	X	M	XD
	- AZIONI O QUOTE IN OIC.....	22	3	1	1	X				X	X	M	XD
	- ALTRE ATTIVITA' AMMISSIBILI PRESSO BANCA CENTRALE												
	- DI CUI: TITOLI EMESSI DA AMMINISTRAZIONI LOCALI.....	24	3	1	1	X				X	X	M	XD
	- DI CUI: COMMERCIAL PAPER.....	26	3	1	1	X				X	X	M	XD
	- DI CUI: CREDITI.....	28	3	1	1	X				X	X	M	XD
	- GIURISDIZIONI CON SCARSE ATTIVITA' LIQUIDE												
	- DEROGA DI TIPO A (DISALLINEAMENTO DI VALUTA).....	30	3	1	1	X				X	X	M	XD
	- DEROGA DI TIPO B (LINEA DI CREDITO DALLA BANCA CENTRALE).....	32	3	1	1	X				X	X	M	XD
	- FINANZA ISLAMICA: TITOLI AMMESSI.....	34	3	1	1	X		X		X	X	M	XD
L1	ATTIVITA' LIQUIDE: ALTRE INFORMAZIONI.....	34356											
	ATTIVITA' LIQUIDE												
	- ESPOSIZIONE VERSO BANCA CENTRALE.....	02	3	1	1	X				X	X	M	XD
	ATTIVITA' LIQUIDE NON AMMISSIBILI												
	- ATTIVITA' NON INCLUSE NELLA FUNZIONE DI GESTIONE DELLA LIQUIDITA'.....	04	3	1	1	X				X	X	M	XD
	- ATTIVITA' NON DISPONIBILI NEI 30 GIORNI SUCCESSIVI.....	06	3	1	1	X				X	X	M	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F	4.7.2 RISCHIO DI LIQUIDITA' SU BASE CONSOLIDATA - COPERTURA DELLA LIQUIDITA' (LCR)- DEFLUSSI E AFFLUSSI	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	S O T T O S I S R I L E V A Z	D E F L U S S I / A F F L U S S	D E P O S I T O G A R A N T I	E S P O S I T O D I R / I N D I R	C L A S S E M E R C R E D I T O	G R A D O L I Q / Q U A C R	T I P O I M P O R T O	T I P O L O G C O N T R O P	V A L U T A	P E R I O D I C I T A'	N O T E	
																	sotvoc
L1	DEFLUSSI RELATIVI A OPERAZIONI DIVERSE DA SFT.....	34360															
	DEPOSITI AL DETTAGLIO																
	- DEPOSITI GARANTITI: RELAZIONI CONSOLIDATE.....	02	3	1	1	X						X	X	M	XD		
	- DEPOSITI GARANTITI: CONTO TRANSATTIVO.....	04	3	1	1	X						X	X	M	XD		
	- DEPOSITI GARANTITI: ALTRO.....	06	3	1	1	X						X	X	M	XD		
	- DEPOSITI NON GARANTITI.....	08	3	1	1	X						X	X	M	XD		
	- DEPOSITI SOGGETTI A PERCENTUALI DI DEFLUSSO SPECIFICHE																
	- CATEGORIA 1.....	10	3	1	1	X						X	X	M	XD		
	- CATEGORIA 2.....	12	3	1	1	X						X	X	M	XD		
	- CATEGORIA 3.....	14	3	1	1	X						X	X	M	XD		
	- DEPOSITI IN PAESI TERZI SOGGETTI A PONDERAZIONI DI DEFLUSSO MAGGIORI.....	16	3	1	1	X						X	X	M	XD		
	- DEPOSITI ESENTATI.....	18	3	1	1	X						X	X	M	XD		
	DEPOSITI NON AL DETTAGLIO - OPERATIVI																
	- DEPOSITI: SERVIZI DI COMPENSAZIONE, CUSTODIA, GESTIONE DELLA LIQUIDITA' CONFORMI ARTICOLO 422 (4) DELLA CRR.....	20	3	1	1	X		X				X	X	X	M	XD	
	- DEPOSITI: SERVIZI DI COMPENSAZIONE, CUSTODIA, GESTIONE DELLA LIQUIDITA' NON CONFORMI ARTICOLO 422 (4) DELLA CRR.....	22	3	1	1	X		X				X	X	X	M	XD	
	- DEPOSITI: SISTEMI DI TUTELA ISTITUZIONALE.....	24	3	1	1	X						X	X	X	M	XD	
	- DEPOSITI: RELAZIONE OPERATIVA CONSOLIDATA.....	26	3	1	1	X						X	X	X	M	XD	
	- DEPOSITI: RETE COOPERATIVA.....	28	3	1	1	X						X	X	X	M	XD	
	- ISTITUTI DI CREDITO CENTRALI: DEPOSITI.....	30	3	1	1	X						X	X	X	M	XD	
	- ISTITUTI DI CREDITO CENTRALI: ALTRI FONDI.....	32	3	1	1	X						X	X	M	XD		
	DEPOSITI NON OPERATIVI E ALTRE PASSIVITA'																
	- DEPOSITI: CLIENTELA NON FINANZIARIA.....	34	3	1	1	X		X				X	X	M	XD		
	- STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI.....	36	3	1	1	X						X	X	M	XD		
	- PASSIVITA' INFRAGRUPPO: SOGGETTI ITALIANI.....	38	3	1	1	X						X	X	M	XD		
	- PASSIVITA' INFRAGRUPPO: SOGGETTI UE.....	40	3	1	1	X						X	X	M	XD		
	- LINEE DI CREDITO O LIQUIDITA' VERSO CLIENTI AL DETTAGLIO.....	42	3	1	1	X						X	X	M	XD		
	- LINEE DI CREDITO VERSO CLIENTELA NON FINANZIARIA.....	44	3	1	1	X						X	X	M	XD		
	- LINEE DI LIQUIDITA' VERSO CLIENTELA NON FINANZIARIA.....	46	3	1	1	X						X	X	M	XD		
	- LINEE DI LIQUIDITA' VERSO VEICOLI AI SENSI DELL'ART.424, PAR.4, CRR.....	48	3	1	1	X						X	X	M	XD		
	- LINEE DI LIQUIDITA' VERSO VEICOLI PER ACQUISTO O SCAMBIO ATTIVI CARTOLARIZZATI.....	50	3	1	1	X						X	X	M	XD		
	- LINEE DI LIQUIDITA' VERSO VEICOLI: ALTRO.....	52	3	1	1	X						X	X	M	XD		
	- LINEE DI CREDITO VERSO BANCHE.....	54	3	1	1	X						X	X	M	XD		
	- LINEE DI LIQUIDITA' VERSO BANCHE.....	56	3	1	1	X						X	X	M	XD		
	- LINEE DI CREDITO VERSO SIM ED ENTI FINANZIARI.....	58	3	1	1	X						X	X	M	XD		
	- LINEE DI LIQUIDITA' VERSO SIM ED ENTI FINANZIARI.....	60	3	1	1	X						X	X	M	XD		
	- LINEE DI CREDITO O LIQUIDITA' VERSO SOGGETTI INFRAGRUPPO.....	62	3	1	1	X						X	X	M	XD		
	- LINEE DI CREDITO O LIQUIDITA' PER PRESTITI AGEVOLATI.....	64	3	1	1	X						X	X	M	XD		
	- LINEE DI CREDITO O LIQUIDITA' VERSO ALTRI SOGGETTI.....	66	3	1	1	X						X	X	M	XD		
	- ALTRE PASSIVITA' POTENZIALI.....	68	3	1	1	X						X	X	M	XD		
	- TRADE FINANCE.....	70	3	1	1	X						X	X	M	XD		

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.7.2 RISCHIO DI LIQUIDITA' SU BASE CONSOLIDATA - COPERTURA DELLA LIQUIDITA' (LCR)- DEFLUSSI E AFFLUSSI	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	S O T T O S I S R I L E V A Z	D E F L U S S I / A F F L U S	D E P O S I T O G A R A N T	E S P O S I T O D I R / I N D I R	C L A S M E R C R E D I T O	G R A D O L I Q / Q U A C R	T I P O I M P O R T O	T I P O L O G C O N T R O P	V A L U T A	P E R I O D I C I T A'	N O T E
	- ALTRE PASSIVITA': FUORI BILANCIO.....	72	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	- ALTRE PASSIVITA': ALTRE.....	74	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	DEFLUSSI: ALTRI															
	- OPERAZIONI IN STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI															
	- GARANZIE REALI FORNITE.....	76	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	- FABBISOGNO GARANZIE REALI AGGIUNTIVE: MERITO DI CREDITO.....	78	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	- FABBISOGNO GARANZIE REALI AGGIUNTIVE: SCENARI DI MERCATO AVVERSI.....	80	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	- VENDITE ALLO SCOPERTO.....	82	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	- GARANZIE DOVUTE NON ANCORA RICHIESTE.....	84	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	- GARANZIE REALI RICEVUTE ECCEDENTI GLI OBBLIGHI CONTRATTUALI.....	86	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	- GARANZIE REALI RICEVUTE SOSTITUIBILI UNILATERALMENTE DALLA CONTROPARTE.....	88	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	- GARANZIE REALI RICEVUTE: DEPOSITI.....	90	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	- PROPRIE SPESE DI FUNZIONAMENTO.....	92	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	L1 AFFLUSSI RELATIVI A OPERAZIONI DIVERSE DA SFT.....	34362														
	CLIENTELA NON FINANZIARIA															
	- CLIENTI AL DETTAGLIO.....	02	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	- IMPRESE NON FINANZIARIE.....	04	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	- BANCHE CENTRALI.....	06	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	- ALTRI.....	08	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	CLIENTELA FINANZIARIA															
	- DEPOSITI OPERATIVI.....	10	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	- ATTIVITA' INFRAGRUPPO: SOGGETTI ITALIANI.....	12	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	AFFLUSSI: ALTRI															
	- TRADE FINANCE.....	14	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	- CREDITI REVOCABILI A SCADENZA INDETERMINATA.....	16	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	- STRUMENTI DI CAPITALE.....	18	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	ALTRE ATTIVITA'															
	- LINEE DI CREDITO O LIQUIDITA' INFRAGRUPPO: SOGGETTI ITALIANI.....	20	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	- LINEE DI CREDITO O LIQUIDITA' INFRAGRUPPO: SOGGETTI UE.....	22	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	- STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI: INFRAGRUPPO.....	24	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	- AFFLUSSI NON INCLUSI NEL VALORE DI MERCATO DELLE ATTIVITA' LIQUIDE DI BASE.....	26	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	- AFFLUSSI: ALTRI.....	28	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	- (-) AFFLUSSI NON AMMISSIBILI (CAP).....	30	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	AFFLUSSI ESENTI DAL CAP															
	- AFFLUSSI CONNESSI A CREDITI IPOTECARI A GARANZIA DI OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE.....	32	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	- PRESTITI AGEVOLATI.....	34	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	- AFFLUSSI INFRAGRUPPO EX CRR, ART. 113 (6) E SISTEMI DI TUTELA ISTITUZIONALE.....	36	3	1	1	X						X	X	M	XD	
	- AFFLUSSI INFRAGRUPPO ESENTATI DALL'AUTORITA' DI VIGILANZA.....	38	3	1	1	X						X	X	M	XD	

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.7.2 RISCHIO DI LIQUIDITA' SU BASE CONSOLIDATA - COPERTURA DELLA LIQUIDITA' (LCR)- DEFLUSSI E AFFLUSSI	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z I A	S O T T O S I S R I L E V A Z	D E F L U S S I / A F F L U S S	D E P O S I T O G A R A N T	E S P O S I T O D I R / I N D I R	C L A S M E R C R E D I T O	G R A D O L I Q / Q U A C R	T I P O I M P O R T O	T I P O L O G C O N T R O P	V A L U T A	P E R I O D I C I T A'	N O T E
L1	DEFLUSSI/AFFLUSSI RELATIVI A OPERAZIONI SFT.....	34364														
	SOTTOSTANTE ATTIVITA' LIQUIDE DI BASE															
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI O REGIONALI.....	02	3	1	1	X	X		X		X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BANCHE CENTRALI O DA ORGANISMI DEL SETTORE PUBBLICO.....	04	3	1	1	X	X		X		X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BRI, FMI, CE E BMS.....	06	3	1	1	X	X		X		X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA EFSF, ESM.....	08	3	1	1	X	X		X		X	X	X	X	M	XD
	- AZIONI O QUOTE DI OIC															
	- DI CUI: SCARTO PRUDENZIALE 0% (CRR, ART. 416(1) LETTERA A).....	10	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- DI CUI: SCARTO PRUDENZIALE 5% (CRR, ART. 416(1) LETTERA B E C).....	12	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- DI CUI: SCARTO PRUDENZIALE 20% (CRR, ART. 416(1) LETTERA D).....	14	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI DA BANCHE COSTITUITE DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI O REGIONALI.....	16	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI DA IMPRESE NON FINANZIARIE.....	18	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE CON PONDERAZIONE RIDOTTA.....	20	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI GARANTITI DA CREDITI IPOTECARI COMMERCIALI (CMBS).....	22	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI GARANTITI DA CREDITI IPOTECARI RESIDENZIALI (RMBS).....	24	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE AMMISSIBILI EX ART. 52(4) DIRETTIVA 2009/65.....	26	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI DI LIQUIDITA' E QUALITA'CREDITIZIA ESTREMAMENTE ELEVATE: ALTRE.....	28	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI DI LIQUIDITA' E QUALITA'CREDITIZIA ELEVATE: ALTRE.....	30	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	SOTTOSTANTE ATTIVITA' LIQUIDE NON AMMISSIBILI															
	- ATTIVITA' NON INCLUSE NELLA FUNZIONE DI GESTIONE DELLA LIQUIDITA'.....	32	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- ATTIVITA' NON DISPONIBILI NEI 30 GIORNI SUCCESSIVI.....	34	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	SOTTOSTANTE ATTIVITA' LIQUIDE SUPPLEMENTARI															
	- CASSA.....	36	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- ESPOSIZIONI VERSO BANCA CENTRALE MOBILIZZABILI IN CONDIZIONI DI STRESS.....	38	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI SOGGETTI A PONDERAZIONE PARI A 0%															
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI.....	40	3	1	1	X	X		X		X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BANCHE CENTRALI.....	42	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA ORGANISMI DEL SETTORE PUBBLICO, REGIONI ED AUTORITA' LOCALI.....	44	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BRI, FMI, UE, BMS, EFSF, ESM.....	46	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI O BANCHE CENTRALI: ALTRE.....	48	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI SOGGETTI A PONDERAZIONE PARI A 20%															
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA AMMINISTRAZIONI															

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.7.2 RISCHIO DI LIQUIDITA' SU BASE CONSOLIDATA - COPERTURA DELLA LIQUIDITA' (LCR)- DEFLUSSI E AFFLUSSI	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z I A	S O T T O S T A N T E R I L E V A Z	D E F L U S S I / A F F L U S S	D E P O S I T O G A R A N T I	E S P O S I T O D I R / I N D I R	C L A S M E R C R E D I T O	G R A D O L I Q / Q U A C R	T I P O I M P O R T O	T I P O L O G C O N T R O P	V A L U T A	P E R I O D I C I T A'	N O T E
	CENTRALI.....	50	3	1	1	X	X		X	X	X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BANCHE CENTRALI.....	52	3	1	1	X	X			X	X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA ORGANISMI DEL SETTORE PUBBLICO, REGIONI ED AUTORITA' LOCALI.....	54	3	1	1	X	X			X	X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BMS.....	56	3	1	1	X	X			X	X	X	X	X	M	XD
	- OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE: ALTRE.....	58	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI DA IMPRESE NON FINANZIARIE CON PONDERAZIONE MINORE O UGUALE AL 50%.....	60	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI GARANTITI DA CREDITI IPOTECARI RESIDENZIALI (RMBS): SOTTOSTANTE CON PONDERAZIONE AL 35%.....	62	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- LINEE DI CREDITO STAND BY GARANTITE ACCORDATE DALLA BANCA CENTRALE.....	64	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- SISTEMI DI TUTELA ISTITUZIONALE O ENTI AFFILIATI PERMANENTEMENTE AD UN ORGANISMO CENTRALE.....	66	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- STRUMENTI DI CAPITALE.....	68	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- ORO.....	70	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	SOTTOSTANTE ATTIVITA' LIQUIDE AGGIUNTIVE															
	- TITOLI EMESSI DA IMPRESE FINANZIARIE.....	72	3	1	1	X	X			X	X	X	X	X	M	XD
	- EMISSIONI PROPRIE.....	74	3	1	1	X	X			X	X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI DA BANCHE NON GARANTITI.....	76	3	1	1	X	X			X	X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI GARANTITI DA CREDITI IPOTECARI COMMERCIALI (CMBS): ALTRI.....	77	3	1	1	X	X			X	X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI GARANTITI DA CREDITI IPOTECARI RESIDENZIALI (RMBS): ALTRI.....	78	3	1	1	X	X			X	X	X	X	X	M	XD
	- STRUMENTI DI CAPITALE.....	80	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- ORO.....	82	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI DI DEBITO GARANTITI: ALTRI.....	84	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE NON AMMISSIBILI.....	86	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI DI DEBITO EMESSI DA IMPRESE NON FINANZIARIE: ALTRI.....	88	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- AZIONI O QUOTE IN OIC.....	90	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- ALTRE ATTIVITA' AMMISSIBILI PRESSO BANCA CENTRALE															
	- DI CUI: TITOLI EMESSI DA AMMINISTRAZIONI LOCALI.....	92	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- DI CUI: COMMERCIAL PAPER.....	94	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- DI CUI: CREDITI.....	96	3	1	1	X	X				X	X	X	X	M	XD
	- FINANZA ISLAMICA: TITOLI AMMESSI.....	98	3	1	1	X	X			X	X	X	X	X	M	XD
	L1 DEFLUSSI/AFFLUSSI RELATIVI A OPERAZIONI DIVERSE DA SFT:															
	ALTRE INFORMAZIONI.....	34366														
	DEPOSITI NON AL DETTAGLIO - OPERATIVI															
	- DEPOSITI RICEVUTI: RELAZIONE OPERATIVA CONSOLIDATA - BANCA CORRISPONDENTE O PRIME BROKERAGE.....	02	3	1	1	X						X	X	X	M	XD
	- DEPOSITI OPERATIVI EFFETTUATI PRESSO CLIENTI NON FINANZIARI.....	04	3	1	1	X						X		X	M	XD
	- DEPOSITI OPERATIVI EFFETTUATI PRESSO BANCHE CENTRALI..	06	3	1	1	X						X		X	M	XD
	DEPOSITI NON OPERATIVI E ALTRE PASSIVITA'															
	- ALTRE PASSIVITA' POTENZIALI: DI CUI VERSO SOGGETTI INFRAGRUPPO.....	08	3	1	1	X						X		X	M	XD
	DEFLUSSI AI SENSI DELL'ART.105 CRD.....	10	3	1	1	X						X		X	M	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.7.3 RISCHIO DI LIQUIDITA' SU BASE CONSOLIDATA - COPERTURA DELLA LIQUIDITA' (LCR)- COLLATERAL SWAP	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	S O T T O S I S R I L E V A Z	T I P O I M P O R T O	V A L U T A	V R E S R I S C L I Q	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoci									
L1	COLLATERAL SWAP.....	34370									
	- CASSA ED ESPOSIZIONI VERSO BANCA CENTRALE MOBILIZZABILI IN CONDIZIONI DI STRESS.....	02	3	1	1	X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI DI LIQUIDITA' E QUALITA' CREDITIZIA ESTREMAMENTE ELEVATE: ALTRE.....	04	3	1	1	X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI O REGIONALI.....	06	3	1	1	X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BANCHE CENTRALI O DA ORGANISMI DEL SETTORE PUBBLICO.....	08	3	1	1	X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BRI, FMI, CE E BMS.....	10	3	1	1	X	X	X	X	M	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA EFSF, ESM.....	12	3	1	1	X	X	X	X	M	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.7.4 RISCHIO DI LIQUIDITA' SU BASE CONSOLIDATA - FINANZIAMENTO STABILE (NSFR)- MONITORAGGIO ELEMENTI CHE FORNISCONO FINANZIAMENTO STABILE	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	S O T T O S I S T I L E V A Z	G R A D O L I Q / Q U A C R	T I P O I M P O R T O	T I P O L O G C O N T R O P	V A L U T A	V R E S R I S C L I Q	P E R I O D I C I T A'	N O T E
		sotvoci											
1	ELEMENTI CHE FORNISCONO FINANZIAMENTO STABILE.....	34372											
	FONDI PROPRI												
	- STRUMENTI DI CAPITALE DI CLASSE 1 (TIER 1).....	02	3	1	1	X		X		X	X	T	XD
	- STRUMENTI DI CAPITALE DI CLASSE 2 (TIER 2).....	04	3	1	1	X		X		X	X	T	XD
	PASSIVITA': ALTRE												
	- DEPOSITI AL DETTAGLIO CON PERCENTUALE DI DEFLUSSO DEL 5%.....	06	3	1	1	X		X		X	X	T	XD
	- DEPOSITI AL DETTAGLIO CON PERCENTUALE DI DEFLUSSO DEL 10%.....	08	3	1	1	X		X		X	X	T	XD
	- DEPOSITI AL DETTAGLIO CON PERCENTUALE DI DEFLUSSO: ALTRO.....	10	3	1	1	X		X		X	X	T	XD
	- DEPOSITI NON AL DETTAGLIO OPERATIVI GARANTITI.....	12	3	1	1	X		X	X	X	X	T	XD
	- DEPOSITI: SISTEMI DI TUTELA ISTITUZIONALE.....	14	3	1	1	X		X	X	X	X	T	XD
	- DEPOSITI: RETE COOPERATIVA.....	16	3	1	1	X		X	X	X	X	T	XD
	- PASSIVITA' CONNESSE AD OPERAZIONI DI SFT.....	18	3	1	1	X	X	X	X	X	X	T	XD
	- PASSIVITA' CONNESSE AD OPERAZIONI NON GARANTITE.....	20	3	1	1	X		X	X	X	X	T	XD
	- OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE CON PONDERAZIONE RIDOTTA.....	22	3	1	1	X		X		X	X	T	XD
	- OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE AMMISSIBILI EX ART. 52(4) DIRETTIVA 2009/65.....	24	3	1	1	X		X		X	X	T	XD
	- PASSIVITA' DA ALTRI TITOLI EMESSI.....	26	3	1	1	X		X		X	X	T	XD
	- DERIVATI.....	28	3	1	1	X		X		X	X	T	XD
	- ALTRO.....	30	3	1	1	X		X		X	X	T	XD
1	ELEMENTI CHE FORNISCONO FINANZIAMENTO STABILE: ALTRE INFORMAZIONI.....	34374											
	FONDI PROPRI												
	STRUMENTI DI CAPITALE E SUBORDINATI NON INCLUSI NEI FONDI PROPRI.....	02	3	1	1	X		X		X	X	T	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F	4.7.5 RISCHIO DI LIQUIDITA' SU BASE CONSOLIDATA - FINANZIAMENTO STABILE (NSFR)- MONITORAGGIO ELEMENTI CHE RICHIEDONO FINANZIAMENTO STABILE	VOCE	D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	S O T T O S I S R I L E V A Z	E S P O S I O N I D I R / I N D I R	G R A D O L I Q / Q U A C R	T I P O I M P O R T O	T I P O L O G I M P E G N O	V A L U T A	V R E S R I S C L I Q	P E R I O D I C I T A'	N O T E
1	ELEMENTI CHE RICHIEDONO FINANZIAMENTO STABILE.....	34376												
	ATTIVITA' LIQUIDE DI BASE													
	- CASSA.....	02	3	1	1	X		X	X		X	X	T	XD
	- ESPOSIZIONI VERSO BANCA CENTRALE MOBILIZZABILI IN CONDIZIONI DI STRESS.....	04	3	1	1	X		X	X		X	X	T	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI O REGIONALI.....	06	3	1	1	X	X	X	X		X	X	T	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BANCHE CENTRALI O DA ORGANISMI DEL SETTORE PUBBLICO.....	08	3	1	1	X	X	X	X		X	X	T	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA BRI, FMI, CE E BMS.....	10	3	1	1	X	X	X	X	X	X	X	T	XD
	- TITOLI EMESSI O GARANTITI DA EFSF, ESM.....	12	3	1	1	X	X	X	X		X	X	T	XD
	- AZIONI O QUOTE DI OIC													
	- DI CUI: SCARTO PRUDENZIALE 0% (CRR, ART. 416(1) LETTERA A).....	14	3	1	1	X		X	X		X	X	T	XD
	- DI CUI: SCARTO PRUDENZIALE 5% (CRR, ART. 416(1) LETTERA B E C).....	16	3	1	1	X		X	X		X	X	T	XD
	- DI CUI: SCARTO PRUDENZIALE 20% (CRR, ART. 416(1) LETTERA D).....	18	3	1	1	X		X	X		X	X	T	XD
	- SISTEMI DI TUTELA ISTITUZIONALE O ENTI AFFILIATI PERMANENTEMENTE AD UN ORGANISMO CENTRALE													
	- DI CUI: DEPOSITI.....	20	3	1	1	X		X	X		X	X	T	XD
	- DI CUI: ALTRI FONDI CONTRATTUALMENTE DISPONIBILI....	22	3	1	1	X		X	X		X	X	T	XD
	- TITOLI EMESSI DA BANCHE COSTITUITE DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI O REGIONALI.....	24	3	1	1	X		X	X		X	X	T	XD
	- TITOLI EMESSI DA IMPRESE NON FINANZIARIE.....	26	3	1	1	X		X	X	X	X	X	T	XD
	- TITOLI GARANTITI DA CREDITI IPOTECARI COMMERCIALI (CMBS).....	28	3	1	1	X		X	X	X	X	X	T	XD
	- TITOLI GARANTITI DA CREDITI IPOTECARI RESIDENZIALI (RMBS).....	30	3	1	1	X		X	X	X	X	X	T	XD
	- OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE CON PONDERAZIONE RIDOTTA.....	32	3	1	1	X		X	X	X	X	X	T	XD
	- OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE AMMISSIBILI EX ART. 52 (4) DIRETTIVA 2009/65.....	34	3	1	1	X		X	X	X	X	X	T	XD
	- ALTRE ATTIVITA' LIQUIDE DI BASE.....	36	3	1	1	X		X	X	X	X	X	T	XD
	ATTIVITA' LIQUIDE: ALTRE													
	- TITOLI DI DEBITO E STRUMENTI DEL MERCATO MONETARIO EMESSI DA IMPRESE NON FINANZIARIE: CLASSE 1.....	38	3	1	1	X		X	X	X	X	X	T	XD
	- TITOLI DI DEBITO E STRUMENTI DEL MERCATO MONETARIO EMESSI DA IMPRESE NON FINANZIARIE: CLASSE 2.....	40	3	1	1	X		X	X	X	X	X	T	XD
	- TITOLI DI DEBITO E STRUMENTI DEL MERCATO MONETARIO EMESSI DA IMPRESE NON FINANZIARIE: ALTRO.....	42	3	1	1	X		X	X	X	X	X	T	XD
	- STRUMENTI DI CAPITALE QUOTATI EMESSI DA IMPRESE NON FINANZIARIE.....	44	3	1	1	X		X	X	X	X	X	T	XD
	- STRUMENTI DI CAPITALE QUOTATI EMESSI DA IMPRESE NON FINANZIARIE: ALTRI.....	46	3	1	1	X		X	X	X	X	X	T	XD
	- ORO.....	48	3	1	1	X		X	X	X	X	X	T	XD
	- ALTRI METALLI PREZIOSI.....	50	3	1	1	X		X	X	X	X	X	T	XD
	FINANZIAMENTI E CREDITI COMMERCIALI NON RINNOVABILI													
	- PERSONE FISICHE.....	52	3	1	1	X		X	X	X	X	X	T	XD
	- PMI.....	54	3	1	1	X		X	X	X	X	X	T	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E I N F .	4.7.5 RISCHIO DI LIQUIDITA' SU BASE CONSOLIDATA - FINANZIAMENTO STABILE (NSFR)- MONITORAGGIO ELEMENTI CHE RICHIEDONO FINANZIAMENTO STABILE	VOCE		D U R A T A	D I V I S A	R E S I D E N Z A	S O T T O S I S R I L E V A Z	E S P O S I R / I N D I R	G R A D O L I Q / Q U A C R	T I P O I M P O R T O	T I P O L O G I M P E G N O	V A L U T A	V R E S R I S C L I Q	P E R I O D I C I T A'	N O T E
			sotvoc												
	- AMMINISTRAZIONI CENTRALI, BANCHE CENTRALI E ORGANISMI DEL SETTORE PUBBLICO.....	56		3	1	1	X			X	X	X	X	T	XD
	- SOGGETTI NON FINANZIARI: ALTRI.....	58		3	1	1	X			X	X	X	X	T	XD
	- BANCHE.....	60		3	1	1	X			X	X	X	X	T	XD
	- SOGGETTI FINANZIARI: ALTRI.....	62		3	1	1	X			X	X	X	X	T	XD
	ATTIVITA': ALTRE														
	- DERIVATI.....	64		3	1	1	X			X		X	X	T	XD
	- LINEE DI CREDITO NON REVOCABILI.....	66		3	1	1	X			X		X	X	T	XD
	- ALTRO.....	68		3	1	1	X			X		X	X	T	XD
1	ELEMENTI CHE RICHIEDONO FINANZIAMENTO STABILE:														
	INFORMAZIONI AGGIUNTIVE.....	34378													
	ATTIVITA' LIQUIDE DI BASE														
	- ESPOSIZIONI VERSO BANCA CENTRALE.....	02		3	1	1	X		X	X		X	X	T	XD
	- AZIONI O QUOTE DI OIC.....	04		3	1	1	X		X	X	X	X	X	T	XD
	FINANZIAMENTI E CREDITI COMMERCIALI NON RINNOVABILI														
	- GARANTITI DA IMMOBILI NON RESIDENZIALI.....	06		3	1	1	X			X		X	X	T	XD
	- GARANTITI DA IMMOBILI RESIDENZIALI.....	08		3	1	1	X			X		X	X	T	XD
	- OBBLIGAZIONI BANCARIE GARANTITE: ATTIVI A GARANZIA....	10		3	1	1	X			X		X	X	T	XD
	ATTIVITA': ALTRE														
	- ATTIVITA' DEDOTTE DAI FONDI PROPRI.....	12		3	1	1	X			X		X	X	T	XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA
DEGLI ENTI FINANZIARI

ISTRUZIONI PER LA PRODUZIONE E L'INOLTRO
DELLE SEGNALAZIONI

TOMO III

SCHEMI DI RILEVAZIONE E SISTEMA DELLE
CODIFICHE

(Circolare n. 154 del 22 novembre 1991)

TOMO III

I N D I C E

Capitolo 1 Sistema delle codifiche (enti finanziari, istituti di pagamento, istituti di moneta elettronica e gruppi di SIM)	
- Premessa.....	A.2
- Elenco generale dei codici di identificazione dei campi	A.3
- Segnalazioni concernenti le attività di intermediazione mobiliare	A.8
- Segnalazioni degli intermediari finanziari ex art. 107 d.lgs. 385/93, degli istituti di pagamento e degli istituti di moneta elettronica	A.24
- Segnalazioni statistiche e di vigilanza degli organismi di investimento collettivo del risparmio (OICR)	A.61
- Segnalazioni degli intermediari finanziari ex art. 106 d.lgs. 385/93	A.79
Capitolo 2 Schemi di segnalazione Attività degli operatori del mercato mobiliare.....	B.1
Capitolo 3 Schemi di segnalazione Attività degli intermediari finanziari ex art 107 d.lgs. 385/93, degli istituti di pagamento e degli istituti di moneta elettronica.....	C.1
Capitolo 4 Schemi di segnalazione Organismi di investimento collettivo del risparmio (O.I.C.R.)	D.1
Capitolo 5 Schemi di segnalazione Attività degli intermediari finanziari ex art. 106 d.lgs 385/93	H.1

Capitolo 1

Sistema delle codifiche (enti finanziari, istituti di pagamento, istituti di moneta elettronica e gruppi di SIM)

Premessa

Il presente capitolo evidenzia per ciascun parametro di disaggregazione presente all'interno delle segnalazioni (Paesi, titoli, ecc.) il sistema di codifica da utilizzare e l'ente preposto alla gestione delle codifiche stesse; ove necessario, vengono richiamate le pubblicazioni e la documentazione amministrativa dalle quali attingere tutte le necessarie informazioni nonché le istruzioni che regolano aspetti particolari della materia.

1 Elenco generale dei codici di identificazione dei campi

Codice campo	Descrizione del campo	lunghezza del campo	segnalazioni attività di intermediaz. mobiliare (basi S, T, U, V2)	segnalazioni attività di intermediaz. mobiliare (basi Y, LY, 1, L1)	segnalazioni intermediari finanziari ex art. 107, istituti di pagamento e istituti di moneta elettronica (basi 3, 4)	segnalazioni intermediari finanziari ex art. 107, istituti di pagamento e istituti di moneta elettronica (base 5)	segnalazioni o.i.c.r. (basi T1, T2, T3, T4, TA, TB, T5, T6, T7, T8, T9, TS)	segnalazioni intermediari ex art. 106 (base 3A)
007	Codice Valuta	3	X	X	X	X	X	
011	Settore istituzionale	3			X		X	X
013	Provincia/Regione - distribuzione territoriale intermediario/Provincia di sportello	5			X			X
015	Provincia residenza controparte - Regione	5	X		X		X	X
016	Area geografica - Residenza del percettore, del sottoscrittore, della controparte, del soggetto delegante, del soggetto delegato, del cedente – Stato estero	3		X	X		X	
022	Destinazione	3			X		X	
032	Titoli: codice titolo	12	X		X		X	X
034	Modalità di cessione	3					X	
040	Scaglioni di vita residua (con riferimento alla data di scadenza del capitale) - Durata finanziaria modificata – Vita residua	3	X	X	X		X	
042	Scaglioni di vita residua (con riferimento alla data di revisione dei rendimenti)	3			X			
075	Stato emittente	3	X					
113	Tipo tasso	2			X			
139	Tipo investimento	2					X	
212	Codice Censito di tipo A	13		X	X	X		
294	Tempo di inadempimento	2		X				
350	Tipo importo	3		X	X	X		
352	Tipo garanzia	3		X	X	X		
353	Controparte o garante	3		X	X			
356	Tipo rischio	3		X	X			
357	Tipo tasso (interesse o cambio)	2	X					
358	Depositario SIM	3	X					
363	Tipologia posizione	3				X		
500	Natura del deposito	4					X	
506	Modalità di collocamento	2					X	
513	Tipo gestione SGR	4					X	
519	Modalità di utilizzo	3					X	
522	Qualità del credito	7			X	X	X	
541	Depositaria	2					X	

Codice campo	Descrizione del campo	lunghezza del campo	segnalazioni attività di intermediaz. mobiliare (basi S, T, U, V2)	segnalazioni attività di intermediaz. mobiliare (basi Y, LY, 1, L1)	segnalazioni intermediari finanziari ex art. 107, istituti di pagamento e istituti di moneta elettronica (basi 3, 4)	segnalazioni intermediari finanziari ex art. 107, istituti di pagamento e istituti di moneta elettronica (base 5)	segnalazioni o.i.c.r. (basi T1, T2, T3, T4, TA, TB, T5, T6, T7, T8, T9, TS)	segnalazioni intermediari ex art. 106 (base 3A)
551	Categoria valori mobiliari/Raggruppamento titoli	7	X		X		X	
552	Indicatore quotazione	3	X		X		X	
554	Mercato di negoziazione	3	X					
555	Categoria emittente	3	X				X	
556	Tipo attività	3			X			
558	Tipologia operazioni	2	X				X	
559	Categoria controparte	3	X				X	
591	Causale operazione	4			X			
598	Provincia di effettuazione dell'operazione	5			X			
599	Classe di importo del cliente	2			X			
800	Clientela MIFID	3	X					
806	Servizio di consulenza	1	X					
810	Codice Censito di tipo C	13					X	
901	Tipo locazione finanziaria	3			X			
902	Tipo carta	2			X			
903	Categoria esercizi convenzionati	3			X			
904	Codice numerico	7	X					
905	Fondo/comparto	7					X	
906	Tipo gestione	2	X					
907	Percettore	5					X	
909	Rapporto con emittente/cedente	2					X	
910	Finalità	2					X	
911	Soggetto collocatore	5					X	
912	Data di riferimento	8			X		X	
913	Scaglione	2					X	
914	Numero operazione	5			X			
934	Paese del mercato di quotazione	5		X				
937	Appartenenza al gruppo	2					X	
938	Codice classe	12					X	
941	Tipo soggetto delegante/delegatario	5	X				X	
944	Canali distributivi	3	X		X			
987	Paese	3					X	
988	Periodicità di calcolo delle provvigioni	2					X	
990	Periodicità di prelievo delle provvigioni	2					X	
991	Arco temporale di confronto	2					X	
992	Residenza del collocatore	3					X	
993	Tipo indicatore	2					X	
994	Tipologia credito	6					X	
995	Tipologia partecipazione	2					X	
996	Base di calcolo	2					X	

Codice campo	Descrizione del campo	lunghezza del campo	segnalazioni attività di intermediaz. mobiliare (basi S, T, U, V2)	segnalazioni attività di intermediaz. mobiliare (basi Y, LY, 1, L1)	segnalazioni intermediari finanziari ex art. 107, istituti di pagamento e istituti di moneta elettronica (basi 3, 4)	segnalazioni intermediari finanziari ex art. 107, istituti di pagamento e istituti di moneta elettronica (base 5)	segnalazioni o.i.c.r. (basi T1, T2, T3, T4, TA, TB, T5, T6, T7, T8, T9, TS)	segnalazioni intermediari ex art. 106 (base 3A)
997	Stato ubicazione immobile	3					X	
1006	Tipo frode	4			X	X		
1014	Portafoglio contabile	3		X	X			
1017	Esposizioni derivanti da cartolarizzazione – Tipologia esposizione	6		X	X		X	
1020	Appartenenza patrimonio	3		X				
1025	Eventi di perdita	3		X			X	
1059	Depositario	3			X			
1070	Stato contratto	3			X			
1071	Causale trattamento	3			X			
1072	Tipo impegno	2			X	X		
1073	Tipo tecnologia	2			X			
1074	Natura garanzia	2			X			
1118	Ramo di attività economica	5		X	X			
1125	Metodologia applicata	3		X		X		
1126	Tipo di cartolarizzazione	3		X		X		
1127	Ruolo nella cartolarizzazione	3		X		X		
1130	Portafoglio	3		X		X		
1133	Fattore di conversione	3		X		X		
1134	Classe di merito creditizio	3		X		X		
1136	Fattore di ponderazione	3	X	X		X		
1166	Trattamento contabile/ Attività proprie/ Cedute non cancellate	3		X	X			
1172	Codice Censito di tipo B/ Banca depositaria	13		X	X			
1182	Settore istituzionale del debitore	5						X
1184	Stato di residenza della società veicolo	3			X			
1186	Codice Censito originator	13			X			
1193	Tipo scaduto	4			X			
1206	Approccio/ Interesse economico netto/ Metodologia utilizzata/ Trattamento dei derivati	3		X				
1207	Zone VP	3				X		
1208	Patrimonio destinato/azienda	3			X			
1209	Categoria esposizione	3		X				
1212	Tipologia sottostante	3		X				
1215	Stato emittente titolo	5			X			
1216	Fascia scaduto	3			X			
1217	Oggetto dei reclami	5			X			

Codice campo	Descrizione del campo	lunghezza del campo	segnalazioni attività di intermediaz. mobiliare (basi S, T, U, V2)	segnalazioni attività di intermediaz. mobiliare (basi Y, LY, 1, L1)	segnalazioni intermediari finanziari ex art. 107, istituti di pagamento e istituti di moneta elettronica (basi 3, 4)	segnalazioni intermediari finanziari ex art. 107, istituti di pagamento e istituti di moneta elettronica (base 5)	segnalazioni o.i.c.r. (basi T1, T2, T3, T4, TA, TB, T5, T6, T7, T8, T9, TS)	segnalazioni intermediari ex art. 106 (base 3A)
1222	Metodologia di consolidamento	3		X				
1223	Grado di liquidità e qualità creditizia	3		X				
1224	Esposizione diretta/indiretta	3		X				
1225	Assimilate Amministrazioni Centrali	1		X				
1226	Categoria Intermediario	2		X				
1227	Modalità di calcolo segnaletico	3		X				
1228	Posizione diretta	1		X				
1229	Contributo di garanzia verso CCP	1		X				
1230	CCP qualificata	1		X				
1231	Valutazione del merito di credito	3		X				
1232	Garanzie rilasciate e impegni a erogare fondi	1		X				
1233	Tipologia soggetto finanziario	3		X				
1234	Forma tecnica	3		X				
1235	Classe di merito di credito originaria	3		X				
1236	Detrazione	1		X				
1237	Clausola di rimborso anticipato	1		X				
1238	Esposizione rotativa	3		X				
1239	Classe di ponderazione	3		X				
1240	Identificativo della cartolarizzazione	45		X				
1241	Trattamento prudenziale	3		X				
1242	Conformità alla normativa	1		X				
1243	Portafoglio di negoziazione di correlazione	1		X				
1244	Cartolarizzazione – posizioni fuori bilancio	3		X				
1245	PMI	1		X				
1246	Deposito garantito	1		X				
1247	Tipologia impegno	3		X				
1248	Codice interno operazione di cartolarizzazione	10		X				
1249	Vita residua rischio di mercato	3		X				
1250	Vita residua rischio di liquidità	3		X				
1251	Classe di merito di credito	3		X				
1252	Tipologia posizione-Tipo X	3		X				
1253	Tipologia posizione-Tipo Y	3		X				

Codice campo	Descrizione del campo	lunghezza del campo	segnalazioni attività di intermediaz. mobiliare (basi S, T, U, V2)	segnalazioni attività di intermediaz. mobiliare (basi Y, LY, 1, L1)	segnalazioni intermediari finanziari ex art. 107, istituti di pagamento e istituti di moneta elettronica (basi 3, 4)	segnalazioni intermediari finanziari ex art. 107, istituti di pagamento e istituti di moneta elettronica (base 5)	segnalazioni o.i.c.r. (basi T1, T2, T3, T4, TA, TB, T5, T6, T7, T8, T9, TS)	segnalazioni intermediari ex art. 106 (base 3A)
1254	Forma giuridica societaria	4		X				
1255	Approccio	3						
1256	Interesse economico netto	3						
1257	Trattamento dei derivati	3						
1258	Data di creazione	8						
1259	Prima data di chiusura prevedibile	8						
1260	Data di scadenza finale legale	8						
1261	Identificativo dell'originator	45						
2029	Sottosistema di rilevazione	5		X				
4009	Oggetto delle rettifiche – Linee di business	3		X	X	X		
4115	Deflussi/ Afflussi	3		X				
4120	Tipo crediti	3			X			
4517	Tipo controllo	2			X	X		

2 Segnalazioni concernenti le attività di intermediazione mobiliare.

Istruzioni di carattere generale.

I dati vanno segnalati come segue:

- le informazioni di quantità (numero dei conti, numero dei movimenti, numero dei dipendenti, ecc.): in unità;
- le segnalazioni di importi: in unità di euro

2.1 SIM – Segnalazioni statistiche individuali

Variabili di classificazione.

A) CANALI DISTRIBUTIVI (codice campo 944): sono rappresentati mediante codici di tre posizioni. I valori previsti sono:

- In sede	063
- Fuori sede	064
- Canale telefonico	086
- Internet.....	087
- Altri collegamenti telematici	088
- Banche.....	078
- Altre SIM.....	079
- Altri canali distributivi	100

B) CATEGORIA CONTROPARTE (codice campo 559): Classificazione delle controparti. E' rappresentata mediante codici di tre posizioni numeriche. L'indicazione della Categoria Controparte può avvenire a due diversi livelli di dettaglio (vedi capitolo 2 per la corrispondenza fra ciascuna voce e livello di dettaglio richiesto). Di seguito sono riportati i valori previsti ed il livello cui si riferiscono:

	LIVELLO	CODICE
- categoria controparti "A"	2	810
- Stato / Governo italiano - Banca d'Italia	1	812
- Stati / Governi / Banche centrali di altri paesi "zona A" e Istituzioni dell'UE	1	816
- categoria controparti "B"	2	830

- banche italiane	1	245
- banche di altri paesi zona "A"	1	825
- S.I.M.	1	264
- imprese di investimento di altri paesi UE e G-10 nonché altri paesi della "zona A" dove sussistono regole di vigilanza prudenziale giudicate dalla Banca d'Italia equivalenti a quelle vigenti nell'U.E... 1	1	836
- borse valori, mercati regolamentati e organismi di compensazione nazionali ed esteri riconosciuti dalla Consob.....	1	840
- enti del settore pubblico di paesi della "zona A"	1	841
- altre controparti qualificate	1	849
- categoria controparti "C"	2	870
- Stati/Governi/Banche Centrali di paesi della "zona B"	1	871
- banche di paesi della "zona B"	1	872
- altre imprese di investimento.....	1	873
- altre borse valori, mercati regolamentati e organismi di compensazione nazionali ed esteri	1	874
- enti del settore pubblico di paesi della "zona B"	1	875
- società di gestione del risparmio e SICAV italiane ...	1	817
- altre istituzioni finanziarie	1	864
- società di assicurazione	1	865
- società e quasi società non finanziarie.....	1	866
- agenti di cambio	1	276
- famiglie (consumatrici e produttrici).....	1	867
- altri	1	889
- non applicabile	2	890
- struttura di negoziazione	1	891
- struttura di gestione di portafogli	1	892
- altro	1	899
- non applicabile	1	897

C) CATEGORIA EMITTENTE (codice campo 555): Classificazione degli emittenti dei valori mobiliari. E' rappresentata mediante codici di tre posizioni numeriche. L'indicazione della Categoria Emittenti può avvenire a due diversi livelli di dettaglio (vedi capitolo 2 per la corrispondenza fra ciascuna voce e livello di dettaglio richiesto). Di seguito sono riportati i valori previsti ed il livello cui si riferiscono:

	LIVELLO	CODICE
- categoria emittenti "A"	2	800
- Stato / Governo italiano, Banca d'Italia	1	812
- Stati / Governi / Banche centrali di altri paesi "zona A" e Istituzioni dell'U.E.	1	816
- categoria emittenti "B"	2	820
- banche italiane	1	245
- banche di altri paesi "zona A"	1	825
- S.I.M.	1	264
- imprese di investimento di altri paesi UE e G10 nonché altri paesi della "zona A" dove sussistono regole di vigilanza prudenziale giudicate dalla Banca d'Italia equivalenti a quelle vigenti nell'U.E. ...	1	836
- borse valori, mercati regolamentati e organismi di compensazione nazionali ed esteri riconosciuti dalla Consob	1	840
- enti del settore pubblico di paesi della "zona A"	1	841
- altri emittenti qualificati	1	859
- categoria emittenti "C"	2	860
- Stati/Governi/Banche Centrali di paesi della "zona B"	1	871
- banche di paesi della "zona B"	1	872
- altre imprese di investimento	1	873
- altre borse valori, mercati regolamentati e organismi di compensazione nazionali ed esteri	1	874
- enti del settore pubblico di paesi della "zona B"	1	875
- società di gestione del risparmio e SICAV italiane ...	1	817
- altre istituzioni finanziarie italiane	1	861
- altre istituzioni finanziarie estere	1	862
- imprese di assicurazione e fondi pensione italiani ..	1	029
- imprese di assicurazione e fondi pensione esteri ...	1	863
- società non finanziarie italiane	1	004
- società non finanziarie estere	1	085
- holding finanziarie pubbliche	1	255
- holding pubbliche	1	474
- imprese partecipate dallo Stato	1	471
- altri	1	879
- non applicabile	2	890
- non applicabile	1	890

D) CATEGORIA VALORI MOBILIARI (codice campo 551): Classificazione dei valori mobiliari oggetto di segnalazione. E' rappresentata mediante codici di sette posizioni numeriche. L'indicazione della Categoria Valori Mobiliari può avvenire a due diversi livelli di dettaglio (vedi capitolo 2 per la corrispondenza fra ciascuna voce e livello di dettaglio richiesto). Di seguito sono riportati i valori previsti ed il livello cui si riferiscono:

TITOLI	LIVELLO	CODICE
- titoli di Stato italiano	2	0100010
- bot	1	0100101
- cct (a cedola variabile)	1	0100102
- btp	1	0100103
- cte	1	0100104
- cto	1	0100105
- bte	1	0100106
- cartelle della Cassa DD.PP.	1	0100109
- btp oggetto di operazioni di coupon stripping		
- mantello	1	0100171
- cedola	1	0100172
- altri titoli di Stato italiano	1	0100199
- titoli di debito	2	0100020
- certificati di deposito di durata originaria fino a 18 mesi compresi	1	0100201
- altri titoli di mercato monetario	1	0100202
- certificati di deposito di durata originaria oltre 18 mesi	1	0100211
- obbligazioni ordinarie	1	0100204
- obbligazioni convertibili	1	0100205
- obbligazioni con opzioni	1	0100206
- reverse convertible	1	0100209
- titoli emessi per operazioni di cartolarizzazione		
- senior	1	0100217
- mezzanine	1	0100218
- junior	1	0100219
- titoli di debito oggetto di operazioni di coupon stripping		
- mantello	1	0100271
- cedola	1	0100250
- titoli strutturati (senza scomposizione)	1	0100225
- titoli strutturati (componente obbligazionaria)	1	0100227
- altri titoli di debito	1	0100229

-	titoli di capitale	2	0100030
-	- azioni e quote	1	0100301
-	- altri titoli di capitale	1	0100399
-	parti di organismi di investimento collettivo del risparmio (O.I.C.R.)	2	0100040
-	O.I.C.R. di diritto italiano		
-	- armonizzati aperti	1	0100410
-	- non armonizzati aperti	1	0100411
-	- chiusi	1	0100412
-	- riservati.....	1	0100413
-	- speculativi.....	1	0100414
-	O.I.C.R. di altri stati UE		
-	- armonizzati	1	0100415
-	- non armonizzati aperti	1	0100416
-	- non armonizzati chiusi.....	1	0100417
-	O.I.C.R. di stati no UE		
-	- aperti	1	0100418
-	- chiusi	1	0100419
-	altri titoli	2	0100090
-	- altri titoli	1	0100090
	CONTRATTI DERIVATI	LIVELLO	CODICE
-	futures	2	0200010
-	- su titoli dello Stato italiano	1	0200101
-	- su titoli di debito.....	1	0200102
-	- su titoli di capitale	1	0200103
-	- su tassi di interesse	1	0200104
-	- su indici di borsa	1	0200105
-	- su valute	1	0200106
-	- su merci.....	1	0200107
-	- altri.....	1	0200199
-	swaps e fras	2	0200020
-	- interest rate swaps (IRS) tasso fisso/tasso variabile.....	1	0200201
-	- IRS tasso variabile/tasso variabile.....	1	0200202
-	- IRS cross-currency	1	0200203
-	- currency swaps euro/valuta	1	0200204
-	- currency swaps valuta/valuta.....	1	0200205
-	- domestic currency swaps (DCS)	1	0200206
-	- altri swaps.....	1	0200299
-	- forward rate agreements (fras).....	1	0200207

-	opzioni su titoli	2	0200030
-	opzioni call su titoli dello Stato italiano	1	0200301
-	opzioni put su titoli dello Stato italiano	1	0200302
-	opzioni call su titoli di debito	1	0200303
-	opzioni put su titoli di debito	1	0200304
-	opzioni call su titoli di capitale	1	0200305
-	opzioni put su titoli di capitale.....	1	0200306
-	altre opzioni su titoli di capitale.....	1	0200307
-	opzioni su altri titoli	1	0200399
-	opzioni su futures	2	0200040
-	opzioni call su futures su titoli dello Stato italiano ...	1	0200401
-	opzioni put su futures su titoli dello Stato italiano....	1	0200402
-	opzioni call su futures su titoli di debito o tassi.....	1	0200403
-	opzioni put su futures su titoli di debito o tassi	1	0200404
-	opzioni call su futures su indici di borsa	1	0200405
-	opzioni put su futures su indici di borsa	1	0200406
-	opzioni su altri futures	1	0200407
-	opzioni su valute.....	2	0200050
-	opzioni call.....	1	0200501
-	opzioni put.....	1	0200502
-	altre opzioni su valute.....	1	0200503
-	opzioni su tassi di interesse.....	2	0200060
-	cap	1	0200601
-	floor	1	0200602
-	opzioni su IRS (swaptions).....	1	0200603
-	altre opzioni su tassi di interesse	1	0200604
-	opzioni su altri valori o indici	2	0200070
-	opzioni call su indici di borsa	1	0200701
-	opzioni put su indici di borsa	1	0200702
-	opzioni su merci	1	0200703
-	opzioni su altri valori o indici.....	1	0200704
-	covered warrant.....	2	0201310
-	covered warrant.....	1	0201310
-	certificates.....	2	0104012
-	certificates	1	0104012
-	derivati di credito.....	2	0200700
-	credit default swaps.....	1	0200803
-	credit linked notes	1	0104011
-	total rate of return swaps.....	1	0200804

- altri derivati di credito.....	1	0200807
- titoli strutturati	2	0200809
- titoli strutturati (componente derivativa).....	1	0200809
- altri contratti derivati	2	0200813
- altri contratti derivati	1	0200813
- non applicabile	2	0777770
- indicatore metodo della doppia entrata	1	0777771
- non applicabile	1	0777777

E) CLIENTELA MIFID (codice campo 800): E' rappresentato da codici di 3 posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- clientela retail.....	500
- clientela professionale	510
- controparti qualificate.....	520
- non applicabile	890

F) CODICE TITOLO (codice campo 032): La codifica dei titoli emessi da residenti e da non residenti è gestita dalla Banca d'Italia – Servizio RST - Divisione "Informazioni anagrafiche soggetti e strumenti finanziari", la quale provvede alla divulgazione dell'anagrafe. Andrà utilizzato il "codice Isin" comprensivo del valore di controllo.

G) DEPOSITARIO (codice campo 358): Indica la categoria alla quale appartiene il soggetto depositario. E' rappresentato mediante codici di 3 posizioni numeriche. I valori previsti sono:

Depositari nazionali:

- SIM	264
- banche	245
- altri agenti di cambio	276
- casse di compensazione e garanzia	842
- organismi di deposito centralizzato	843
- altri	844

Depositari esteri:

- Imprese di investimenti di altri paesi UE e G-10 nonché di altri paesi della "zona A" dove sussistono regole di vigilanza prudenziale giudicate dalla Banca d'Italia equivalenti a quelle vigenti nell'UE	836
- banche di altri paesi "zona A"	825
- casse di compensazione e garanzia di paesi UE.....	846
- organismi di deposito centralizzato di paesi UE.....	847
- altri soggetti appartenenti a paesi UE	851

- altre imprese di investimento873
- banche di paesi della "zona B"872
- casse di compensazione e garanzia di paesi extra UE848
- organismi di deposito centralizzato di paesi extra UE850
- altri soggetti appartenenti a paesi extra UE852

H) DIVISA: L'informazione è richiesta nella parte fissa del record "movimento". I codici da utilizzare sono:

- euro.....1
- altre valute2

N.B.: Ove l'informazione non è richiesta indicare convenzionalmente 1 nel campo corrispondente, previsto nei tracciati dei supporti per la trasmissione dati.

I) DURATA

N.B. Questa informazione non è richiesta ai fini delle segnalazioni. Indicare convenzionalmente **00** (due volte zero) nel campo corrispondente, previsto nel tracciato dei supporti per la trasmissione dei dati.

J) INDICATORE QUOTAZIONE (codice campo 552): Classificazione dei valori mobiliari oggetto di segnalazione. E' rappresentata mediante codice numerico di tre posizioni. Di seguito sono riportati i valori previsti per le diverse sezioni e sottosezioni cui si riferiscono.

Con riferimento agli strumenti finanziari in portafoglio della Sez. III, Sottosez. I – Strumenti finanziari in portafoglio. Deve essere utilizzata la seguente codifica:

- Valori mobiliari quotati su mercati ufficiali attivi021
- Valori mobiliari quotati su mercati ufficiali non attivi022
- Valori mobiliari quotati su altri mercati attivi.....023
- Valori mobiliari non quotati005
- Non applicabile770

Con riferimento alla Sez. VI – Segnalazioni statistiche, deve essere utilizzata la seguente codifica:

- Valori mobiliari quotati in mercati regolamentati028
- Valori mobiliari non quotati in mercati regolamentati029
- Valori mobiliari in corso di quotazione in mercati regolamentati027
- Non applicabile770

K) MERCATO DI NEGOZIAZIONE (codice campo 554): Classificazione dei mercati in cui sono stati trattati i valori mobiliari oggetto di compravendita. E' rappresentata mediante codici di tre posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- mercati regolamentati	100
- sistemi multilaterali di negoziazione.....	018
- internalizzazione sistematica	226
- altro.....	227

L) CODICE di provincia (codice campo 015): viene utilizzato il codice C.A.B. dei comuni capoluogo di provincia utilizzandone le prime 3 posizioni cui vanno anteposti due zeri: ad esempio il codice di Roma (identificato dal codice 03200) viene rappresentato con il valore 00032. Con riferimento ai non residenti in Italia, andrà convenzionalmente utilizzato il codice 00998. I valori previsti sono:

CODICE	PROVINCIA
00166.....	AGRIGENTO
00104.....	ALESSANDRIA
00026.....	ANCONA
00012.....	AOSTA
00141.....	AREZZO
00135.....	ASCOLI PICENO
00103.....	ASTI
00151.....	AVELLINO
00040.....	BARI
00206.....	BARLETTA-ANDRIA-TRANI
00119.....	BELLUNO
00150.....	BENEVENTO
00111.....	BERGAMO
00223.....	BIELLA
00024.....	BOLOGNA
00116.....	BOLZANO
00112.....	BRESCIA
00159.....	BRINDISI
00048.....	CAGLIARI
00167.....	CALTANISSETTA
00038.....	CAMPOBASSO
00175.....	CARBONIA-IGLESIAS
00149.....	CASERTA
00169.....	CATANIA
00044.....	CATANZARO
00155.....	CHIETI
00109.....	COMO
00162.....	COSENZA
00114.....	CREMONA
00222.....	CROTONE
00102.....	CUNEO
00168.....	ENNA
00205.....	FERMO
00130.....	FERRARA
00028.....	FIRENZE

00157 FOGGIA
00132 FORLI'
00148 FROSINONE
00014 GENOVA
00124 GORIZIA
00143 GROSSETO
00105 IMPERIA
00156 ISERNIA
00036 L'AQUILA
00107 LA SPEZIA
00147 LATINA
00160 LECCE
00229 LECCO
00139 LIVORNO
00203 LODI
00137 LUCCA
00134 MACERATA
00115 MANTOVA
00136 MASSA CARRARA
00161 MATERA
00178 MEDIO-CAMPIDANO
00165 MESSINA
00016 MILANO
00129 MODENA
00204 MONZA-BRIANZA
00034 NAPOLI
00101 NOVARA
00173 NUORO
00176 OGLIASTRA
00177 OLBIA-TEMPIO
00174 ORISTANO
00121 PADOVA
00046 PALERMO
00127 PARMA
00113 PAVIA
00030 PERUGIA
00133 PESARO E URBINO
00154 PESCARA
00126 PIACENZA
00140 PISA
00138 PISTOIA
00125 PORDENONE
00042 POTENZA
00215 PRATO
00170 RAGUSA
00131 RAVENNA
00163 REGGIO DI CALABRIA
00128 REGGIO NELL'EMILIA
00146 RIETI
00242 RIMINI
00032 ROMA
00122 ROVIGO
00152 SALERNO
00172 SASSARI
00106 SAVONA
00142 SIENA
00171 SIRACUSA

00110.....	SONDRIO
00158.....	TARANTO
00153.....	TERAMO
00144.....	TERNI
00010.....	TORINO
00164.....	TRAPANI
00018.....	TRENTO
00120.....	TREVISO
00022.....	TRIESTE
00123.....	UDINE
00108.....	VARESE
00020.....	VENEZIA
00224.....	VERBANO-CUSIO-OSSOLA
00100.....	VERCELLI
00117.....	VERONA
00428.....	VIBO VALENTIA
00118.....	VICENZA
00145.....	VITERBO
00998.....	NON RESIDENTI IN ITALIA

M) RAPPORTO CON L'EMITTENTE (codice campo 909): È rappresentato da codici di due posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- società o ente controllante 01
- altro soggetto appartenente al gruppo (compresi fondi o SICAV) 05
- soggetti non appartenenti al gruppo 07

N) RESIDENZA: ai fini della classificazione va assunta la definizione vigente nell'ambito della disciplina valutaria italiana. L'informazione è richiesta nella parte fissa del record "movimento". I codici da utilizzare sono:

- Soggetti residenti in Italia 1
- Soggetti non residenti in Italia 2

N.B.: Ove l'informazione non è richiesta indicare convenzionalmente **1** nel campo corrispondente, previsto nei tracciati dei supporti per la trasmissione dati.

O) SERVIZIO DI CONSULENZA (codice campo 806): E' rappresentato da codici di 1 posizione numerica. I valori previsti sono:

- Si 1
- No 2
- Non applicabile 7

P) STATO EMITTENTE (codice campo 075): Viene utilizzata la codifica (3 posizioni numeriche) predisposta e gestita dalla Banca d'Italia – Servizio RST.

Q) TIPO GESTIONE (codice campo 906): E' rappresentato mediante codici di 2 posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- fondo aperto armonizzato di diritto italiano20
- fondo aperto riservato di diritto italiano non speculativo21
- fondo speculativo di diritto italiano22
- fondo chiuso riservato di diritto italiano non speculativo23
- fondo chiuso mobiliare di diritto italiano non speculativo24
- fondo chiuso immobiliare di diritto italiano non speculativo25
- patrimonio o compartimento di SICAV di diritto italiano03
- fondo pensione negoziale (ex art. 4 D. Lgs. 124/93)04
- fondo pensione aperto (ex art. 9 D. Lgs. 124/93)05
- gestione di patrimoni mobiliari su base individuale06
- gestione di patrimoni in fondi su base individuale08
- altro30

R) TIPO SOGGETTO DELEGANTE/DELEGATO (codice campo 941): E' rappresentato mediante codici di 5 posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- banca italiana00245
- banca estera00884
- SIM italiana00264
- impresa di investimento estera10021
- fondi comuni d'investimento italiani10055
- sicav italiana10049
- sicav estera10050
- fondi comuni di diritto estero10057
- società di gestione italiana10019
- società di gestione estera10051
- fondo pensione10029
- altro10041

S) TIPO TASSO (codice campo 357): E' rappresentato mediante codici di 2 posizioni numeriche. Di seguito sono riportati i valori previsti per le diverse sezioni e sottosezioni cui si riferisce.

Nella sezione III, sottosez. I (Strumenti finanziari in portafoglio) indica la caratteristica dei tassi applicati ai titoli obbligazionari in portafoglio. I valori previsti sono:

- fisso83
- indicizzato84
- indeterminato86

- non applicabile 90

T) TIPOLOGIA OPERAZIONI (codice campo 558): Classificazione delle diverse tipologie di operazioni aventi ad oggetto valori mobiliari. E' rappresentata mediante codici di due posizioni numeriche. I valori previsti sono:

	CODICE
- a pronti (regolamento entro 5 gg.)	10
- a termine (regolamento entro 30 gg.)	21
- a termine (regolamento entro 1 anno)	24
- a termine (regolamento oltre 1 anno).....	25
- pronti contro termine (entro 30 gg.)	31
- pronti contro termine (oltre 30 gg.).....	32
- riporti entro 30 gg.....	41
- riporti oltre 30 gg.....	42
- prestiti di titoli entro 30 gg.....	51
- prestiti di titoli oltre 30 gg.....	52
- sottoscrizioni	60
- rimborsi a scadenza.....	80
- altre.....	99
- non applicabile	77

U) VALUTA (codice campo 007): Unità di conto in cui sono espressi i fenomeni segnalati. E' rappresentata mediante codici di tre posizioni numeriche. I codici sono attribuiti dalla Banca d'Italia – Servizio RST tranne il codice 399 che raccoglie le valute residuali.

V) VITA RESIDUA / DURATA FINANZIARIA MODIFICATA (codice campo 040): E' rappresentata per scaglioni temporali identificati da codici di tre posizioni numeriche. Di seguito sono riportati i valori previsti per le diverse sezioni e sottosezioni cui si riferiscono.

Con riferimento alle attività e passività della Sez. I - Dati Patrimoniali. Deve essere utilizzata la seguente codifica:

- a vista e fino a 1 mese compreso	020
- tra 1 e 3 mesi compresi	040
- tra 3 e 6 mesi compresi	050
- tra 6 e 12 mesi compresi	060
- oltre 12 mesi (compresi i crediti/debiti scaduti o a durata indeterminata) ..	072

Con riferimento alle posizioni lunghe e corte della Sez. V - Coefficienti patrimoniali - Sottosez. 1 - Rischio generico su titoli di debito - Metodo basato sulla scadenza. Deve essere utilizzata la seguente codifica:

SCAGLIONE		
CON CEDOLA < 3%	CON CEDOLA >= 3%	CODICE
fino a 1 mese	fino a 1 mese	501
> 1 fino a 3 mesi	> 1 fino a 3 mesi	502
> 3 fino a 6 mesi	> 3 fino a 6 mesi	503
> 6 fino a 12 mesi	> 6 fino a 12 mesi	504
> 1 fino a 1,9 anni	> 1 fino a 2 anni	505
> 1,9 fino a 2,8 anni	> 2 fino a 3 anni	506
> 2,8 fino a 3,6 anni	> 3 fino a 4 anni	507
> 3,6 fino a 4,3 anni	> 4 fino a 5 anni	508
> 4,3 fino a 5,7 anni	> 5 fino a 7 anni	509
> 5,7 fino a 7,3 anni	> 7 fino a 10 anni	510
> 7,3 fino a 9,3 anni	> 10 fino a 15 anni	511
> 9,3 fino a 10,6 anni	> 15 fino a 20 anni	512
> 10,6 fino a 12 anni	> 20 anni	513
> 12 fino a 20 anni		514
> 20 anni		515

La cifra dopo la virgola indica frazioni decimali di anno (es.: 1,9 anni sta a significare 1 anno e 9/10 di anno).

Con riferimento alle posizioni lunghe e corte della Sez. V - Coefficienti patrimoniali - Sottosez. 2 - Rischio generico su titoli di debito - Metodo basato sulla durata finanziaria. Deve essere utilizzata la seguente codifica:

- da 0 a 1,0 anno compreso.....068
- oltre 1,0 a 3,6 anni compresi071
- oltre 3,6 anni.....074

La cifra dopo la virgola indica frazioni decimali di anno.

Con riferimento alle posizioni lunghe e corte della Sez. V - Coefficienti patrimoniali - Sottosez. 3 - Rischio specifico su titoli di debito. Deve essere utilizzata la seguente codifica:

- fino a 6 mesi compresi.....045
- da oltre 6 mesi e fino a 2 anni compresi.....069
- oltre 2 anni.....162

2.2 Gruppi di SIM – Segnalazioni statistiche consolidate

Variabili di classificazione.

A) DIVISA: L'informazione è richiesta nella parte fissa del record "movimento". I codici da utilizzare sono:

- euro 1
- altre valute 2

N.B.: Ove l'informazione non è richiesta indicare convenzionalmente 1 nel campo corrispondente, previsto nei tracciati dei supporti per la trasmissione dati.

B) RESIDENZA: ai fini della classificazione va assunta la definizione vigente nell'ambito della disciplina valutaria italiana. L'informazione è richiesta nella parte fissa del record "movimento". I codici da utilizzare sono:

- Soggetti residenti in Italia.....1
- Soggetti non residenti in Italia..... 2

N.B.: Ove l'informazione non è richiesta indicare convenzionalmente 1 nel campo corrispondente, previsto nei tracciati dei supporti per la trasmissione dati.

C) TIPO GESTIONE (codice campo 906): E' rappresentato mediante codici di 2 posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- fondo aperto armonizzato di diritto italiano 20
- fondo aperto riservato di diritto italiano non speculativo 21
- fondo speculativo di diritto italiano 22
- fondo chiuso riservato di diritto italiano non speculativo 23
- fondo chiuso mobiliare di diritto italiano non speculativo 24
- fondo chiuso immobiliare di diritto italiano non speculativo 25
- patrimonio o compartimento di SICAV di diritto italiano 03
- fondo pensione negoziale (ex art. 4 D. Lgs. 124/93) 04
- fondo pensione aperto (ex art. 9 D. Lgs. 124/93) 05
- gestione di patrimoni mobiliari su base individuale 06
- gestione di patrimoni in fondi su base individuale..... 08
- altro..... 30

D) VITA RESIDUA / DURATA FINANZIARIA MODIFICATA (codice campo 040):
E' rappresentata per scaglioni temporali identificati da codici di tre posizioni numeriche. Di seguito sono riportati i valori previsti per le diverse sezioni e sottosezioni cui si riferiscono.

Con riferimento alle attività e passività della Sez. I - Dati Patrimoniali.
Deve essere utilizzata la seguente codifica:

- a vista e fino a 1 mese compreso020
- tra 1 e 3 mesi compresi040
- tra 3 e 6 mesi compresi050
- tra 6 e 12 mesi compresi060
- oltre 12 mesi (compresi i crediti/debiti scaduti o a durata indeterminata) ...072

2.3 SIM e gruppi di SIM – Segnalazioni prudenziali su base individuale e consolidata.

Le variabili cui occorre far riferimento sono le medesime indicate per le corrispondenti segnalazioni dei gruppi bancari (Cfr. Tomo II – Capitolo 1 “Sistema delle codifiche (banche e gruppi bancari)” par. “Segnalazioni prudenziali individuali e consolidate (basi informative 'Y', 'LY', '1' e 'L1')”).

3 Segnalazioni degli intermediari finanziari ex art. 107 D.lgs. 385/93, degli istituti di pagamento e degli istituti di moneta elettronica.

3.1 Dati patrimoniali, altre informazioni, dati di conto economico e dati di fine esercizio.

Istruzioni di carattere generale.

I dati vanno segnalati come segue:

- le informazioni di quantità (numero dei conti, numero dei movimenti, numero dei dipendenti, ecc.): in unità;
- le segnalazioni di importi: in unità di euro.

Variabili di classificazione.

A) Attività proprie/cedute non cancellate (codice campo 01166): è rappresentato mediante codici di 3 posizioni numeriche. I codici da utilizzare sono i seguenti:

- Proprie..... 095
- Cedute non cancellate a fini prudenziali e di bilancio..... 097
- Cedute non cancellate solo a fini di bilancio 096

B) Canali distributivi (codice campo 00944).

Per la voce 46392 i codici da utilizzare sono i seguenti:

- Proprie dipendenze..... 83
- Agenti in attività finanziaria 76
- Mediatori creditizi 77
- Promotori finanziari..... 85
- Banche..... 78
- SIM 79
- Altri intermediari finanziari..... 80
- Assicurazioni..... 90
- Esercizi convenzionati 92
- Altri canali distributivi 93
- Canale telefonico 86

- Internet	87
- Altri collegamenti telematici	94

Per le voci 46416 e 52525 i codici da utilizzare sono i seguenti:

- Agenti in attività finanziaria	76
- Mediatori creditizi	77
- Promotori finanziari	85
- Banche	78
- SIM	79
- Altri intermediari finanziari	80
- Assicurazioni	90
- Esercizi convenzionati	92
- Istituti di pagamento	160
- Istituti di moneta elettronica	161
- Altro	95

Per la voce 58560 i codice da utilizzare sono i seguenti:

- Agenti in attività finanziaria	76
- Banche	78
- Intermediari finanziari ex art. 107	162
- Esercizi convenzionati	92
- Istituti di pagamento	160
- Istituti di moneta elettronica	161
- Altro	163

Per le voci 46444/12 e 46468/10 i codici da utilizzare sono i seguenti:

- Telefonico	86
- Televisivo	96
- Postale	97
- Altro	109

C) Categoria esercizi convenzionati (codice campo 00903).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- Alberghi e ristoranti	068
- Autonoleggi	901
- Linee aeree	902
- Agenzie di viaggio	771
- Ipermercati, supermercati e grandi magazzini	903
- Distributori carburante	652
- Vendita per corrispondenza	904
- Abbigliamento	645
- Altri esercizi al dettaglio	905

D) Causale operazione (codice campo 00591).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- operazioni di copertura specifica	633
- operazioni di copertura generica	634
- operazioni di negoziazione	635

E) Causale trattamento (codice campo 01071).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- interruzione di collegamento	636
- trattamento cartaceo	637
- altro	638

F) Classe di importo del cliente (codice campo 00599): è rappresentato mediante codici di 2 posizioni numeriche. I codici da utilizzare sono i seguenti:

- Fino a 12.500 euro	66
- Oltre 12.500 fino a 50.000 euro	67
- Oltre 50.000 euro	89

G) Classificazione della clientela per settori istituzionali (codice campo 00011). E' rappresentato da codici di 3 posizioni numeriche. Le finalità ed i valori previsti dalla classificazione adottata sono illustrate nelle istruzioni relative alla classificazione della clientela divulgate dalla Banca d'Italia. Negli schemi di segnalazione (cfr. cap. 3) è indicato il grado di settorizzazione a cui si deve fare riferimento.

H) Codice Censito di tipo "A" (codice campo 00212) e Codice Censito di tipo "B"/ Banca depositaria (codice campo 1172). Per la classificazione nominativa della controparte deve essere utilizzato il codice censito. Nel caso in cui il soggetto da segnalare non risulti censito nell'Anagrafe dei soggetti l'intermediario deve fare richiesta del codice attenendosi alle modalità previste dalla Circ. 139 dell'11/02/91 ("Centrale dei Rischi – Istruzioni per gli intermediari creditizi"), cap.III sez. 2. Per gli intermediari non aderenti alla Rete Nazionale Interbancaria tale richiesta può essere effettuata tramite supporto cartaceo.

H1) "Codice Censito di tipo B" (campo 01172). L'attributo deve essere utilizzato nelle seguenti voci: 58208, 58210, 58214 e 58216, ove la sottovoce lo richieda;

H2) "Banca depositaria" (campo 01172). L'attributo deve essere utilizzato nella sottovoce 52503.04.

I) Codice Censito originator (codice campo 01186)

Tale attributo deve essere utilizzato esclusivamente per le voci 58212 e 58216.

Per i dettagli sulle modalità di compilazione di tale variabile cfr. quanto detto per le variabili Codice Censito di tipo "A" e Codice censito di tipo "B".

J) Codice titolo (codice campo 00032). La codifica dei titoli emessi da residenti e non residenti è gestita dalla Banca d'Italia – Servizio RST – Divisione "Informazioni anagrafiche soggetti e strumenti finanziari", la quale provvede alla divulgazione dell'anagrafe. Ai fini delle segnalazioni deve essere utilizzato il "codice ISIN" comprensivo del valore di controllo.

Fanno eccezione i certificati di deposito e i buoni fruttiferi di proprietà dell'istituzione segnalante emessi da istituzioni creditizie residenti i quali, non formando oggetto di codifica centralizzata, devono essere segnalati (laddove sia richiesta l'indicazione del codice titolo) con i seguenti codici convenzionali:

- buoni fruttiferi e certificati di deposito in euro9
- buoni fruttiferi e certificati di deposito in altre valute 10

In mancanza del codice del titolo, ovvero del codice ISIN, è consentito, in via del tutto eccezionale, l'uso dei seguenti codici residuali:

- per i titoli in euro emessi da residenti 1
- per i titoli in altre valute emessi da residenti2

- per i titoli in euro emessi da non residenti..... 3
- per i titoli in altre valute Emessi da non residenti..... 4

Per la voce 52326 la segnalazione nominativa delle esposizioni diverse dai titoli deve essere effettuata utilizzando, in luogo del codice ISIN, il codice convenzionale 995.

K) Distribuzione territoriale delle operazioni/ provincia di sportello. Riguarda le segnalazioni per le quali sono richiesti i seguenti dettagli:

K.1 Codice di provincia (codice campo 00598 per le voci 46545 06, 58550, 58555, 58560, 58565, 58567, 58575, 58577, 58630, 58640, 58675 codice campo 00013 per le voci 3229 12, 3229 14, 46558 00, 58590 e 58595, codice campo 00015 per tutte le altre voci): viene utilizzato il codice C.A.B. dei comuni capoluogo di provincia utilizzandone le prime 3 posizioni cui vanno anteposti due zeri: ad esempio il codice di Roma (identificato dal codice 03200) viene rappresentato con il valore 00032. Con riferimento ai non residenti in Italia, andrà convenzionalmente utilizzato il codice 00998. I valori previsti sono:

CODICE	PROVINCIA
00166	AGRIGENTO
00104	ALESSANDRIA
00026	ANCONA
00012	AOSTA
00141	AREZZO
00135	ASCOLI PICENO
00103	ASTI
00151	AVELLINO
00040	BARI
00206	BARLETTA-ANDRIA-TRANI
00119	BELLUNO
00150	BENEVENTO
00111	BERGAMO
00223	BIELLA
00024	BOLOGNA
00116	BOLZANO
00112	BRESCIA
00159	BRINDISI
00048	CAGLIARI
00167	CALTANISSETTA
00038	CAMPOBASSO
00175	CARBONIA-IGLESIAS
00149	CASERTA
00169	CATANIA
00044	CATANZARO
00155	CHIETI
00109	COMO

00162 COSENZA
 00114 CREMONA
 00222 CROTONE
 00102 CUNEO
 00168 ENNA
 00205 FERMO
 00130 FERRARA
 00028 FIRENZE
 00157 FOGGIA
 00132 FORLI'
 00148 FROSINONE
 00014 GENOVA
 00124 GORIZIA
 00143 GROSSETO
 00105 IMPERIA
 00156 ISERNIA
 00036 L'AQUILA
 00107 LA SPEZIA
 00147 LATINA
 00160 LECCE
 00229 LECCO
 00139 LIVORNO
 00203 LODI
 00137 LUCCA
 00134 MACERATA
 00115 MANTOVA
 00136 MASSA CARRARA
 00161 MATERA
 00178 MEDIO-CAMPIDANO
 00165 MESSINA
 00016 MILANO
 00129 MODENA
 00204 MONZA-BRIANZA
 00034 NAPOLI
 00101 NOVARA
 00173 NUORO
 00176 OGLIASTRA
 00177 OLBIA-TEMPIO
 00174 ORISTANO
 00121 PADOVA
 00046 PALERMO
 00127 PARMA
 00113 PAVIA
 00030 PERUGIA
 00133 PESARO E URBINO
 00154 PESCARA
 00126 PIACENZA
 00140 PISA
 00138 PISTOIA
 00125 PORDENONE
 00042 POTENZA
 00215 PRATO
 00170 RAGUSA
 00131 RAVENNA
 00163 REGGIO DI CALABRIA
 00128 REGGIO NELL'EMILIA
 00146 RIETI
 00242 RIMINI
 00032 ROMA

00122	ROVIGO
00152	SALERNO
00172	SASSARI
00106	SAVONA
00142	SIENA
00171	SIRACUSA
00110	SONDRIO
00158	TARANTO
00153	TERAMO
00144	TERNI
00010	TORINO
00164	TRAPANI
00018	TRENTO
00120	TREVISO
00022	TRIESTE
00123	UDINE
00108	VARESE
00020	VENEZIA
00224	VERBANO-CUSIO-OSSOLA
00100	VERCELLI
00117	VERONA
00428	VIBO VALENTIA
00118	VICENZA
00145	VITERBO
00998	NON RESIDENTI IN ITALIA

K.2 codice di Stato (codice campo 00016): viene utilizzata la codifica (3 posizioni numeriche) predisposta e gestita dalla Banca d'Italia – Servizio RST.

Codifica da utilizzare nella sezione II sottosezione 12 “Servizi di pagamento e moneta elettronica” per le voci che vanno dalla 58550 fino alla 58770:

- Italia	86
- Paesi UME	703
- Altri Paesi UE (non UME)	704
- Extra UE	705

L) Data di riferimento (codice campo 912): Va indicata nel formato AAAAMMGG. E' prevista per le voci 52401, 58100, 58115, 58117, 58135, 58218, 58230 e deve riportare le date contabili di fine mese per ciascuno dei mesi compresi nel trimestre oggetto della segnalazione.

M) Depositario (codice campo 1059): Indica la categoria alla quale appartiene il soggetto depositario. E' rappresentato mediante codici di 3 posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- Montetitoli	082
---------------------	-----

- Altro depositario residente081
- Depositario non residente.....083
- Deposito presso il segnalante.....086
- Titolo non disponibile087

N) Divisa. L'informazione è richiesta nella parte fissa del record "movimento". I codici da utilizzare sono:

- euro1
- altre valute2

O) Durata. L'informazione è richiesta nella parte fissa del record "movimento". I codici da utilizzare sono:

- a breve termine (fino a 18 mesi)1
- a medio e lungo termine (oltre 18 mesi)2
- imprecisabile o irrilevante3
- fino a 1 anno5
- da oltre 1 anno fino a 5 anni16
- oltre 5 anni17

P) Esposizioni derivanti da cartolarizzazione (codice campo 01017).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- senior550005
- mezzanine.550006
- junior550007

Q) Fascia scaduto (codice campo 01216): è rappresentato mediante codici di 3 posizioni numeriche. I codici da utilizzare sono i seguenti:

- Da 1 giorno fino a 90 gg.398
- Da oltre 90 gg. fino a 180 gg.399
- Da oltre 180 gg. fino a 1 anno400
- Oltre 1 anno403

R) Finalità del credito (codice campo 00022): è rappresentato da codici di 3 posizioni numeriche. I codici da utilizzare sono i seguenti:

- credito al consumo finalizzato: acquisto di beni durevoli 110
- credito al consumo finalizzato: acquisto di autoveicoli..... 116
- credito al consumo finalizzato: altro 119
- credito al consumo non finalizzato..... 204
- prestiti per acquisto abitazioni..... 212
- altro..... 222

S) Indicatore di quotazione (codice campo 552): E' rappresentata mediante codice numerico di tre posizioni. I valori previsti sono:

- quotati in mercati regolamentati attivi 021
- quotati in mercati regolamentati non attivi 022
- quotati in altri mercati attivi 023
- non quotati 005
- in corso di quotazione 004

T) Natura Garanzia (codice campo 01074).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- Garanzie di natura finanziaria a prima richiesta 74
- Altre garanzie di natura finanziaria..... 75
- Garanzia di natura commerciale 81

U) Oggetto dei reclami (codice campo 01217): è rappresentato mediante codici di 5 posizioni numeriche. I codici da utilizzare sono i seguenti:

- Finanziamenti 206
- Raccolta 213
- Strumenti e servizi di pagamento 214
- Segnalazioni in CAI o sistemi di informazioni creditizie 215
- Altro 216

V) Numero operazione (codice campo 00914): è rappresentato mediante codici di 5 posizioni numeriche. Deve essere utilizzata la codifica dell'operazione di cartolarizzazione attribuita dalla Banca d'Italia (Servizio RST - Divisione "Informazioni anagrafiche soggetti e strumenti finanziari") richiesta dalle società veicolo e comunicata alle stesse, al servicer e all'originator dell'operazione.

W) Oggetto rettifiche (codice campo 04009).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- rettifiche su anticipi535
- rettifiche su corrispettivi per factoring pro soluto536
- rettifiche su corrispettivi per altre cessioni di factoring.....537

X) Patrimonio destinato/azienda (codice campo 01208): è rappresentato mediante codici di 3 posizioni numeriche. I codici da utilizzare sono i seguenti:

- Patrimonio azienda.....700
- Patrimonio destinato.....701
- Non applicabile.....077

Y) Portafoglio contabile (codice campo 01014).

Per la voce 52338 i codici da utilizzare sono i seguenti:

- attività finanziarie di negoziazione501
- attività finanziarie disponibili per la vendita.....503
- attività finanziarie valutate al fair value502
- attività finanziarie detenute sino alla scadenza504
- crediti516

Per la voce 52396 i codici da utilizzare sono i seguenti:

- attività finanziarie di negoziazione501
- attività finanziarie disponibili per la vendita.....503
- attività finanziarie valutate al fair value502
- attività finanziarie detenute sino alla scadenza504
- crediti verso banche.....505
- crediti verso clientela506

- gruppi di attività in via di dismissione 517

Per le voci 58100, 58115 i codici da utilizzare sono i seguenti:

- attività finanziarie di negoziazione 501
- attività finanziarie disponibili per la vendita 503
- attività finanziarie valutate al fair value 502
- attività finanziarie detenute sino alla scadenza 504
- crediti verso banche 505
- crediti verso clientela 506
- crediti 516
- attività non correnti e gruppi di attività in via di dismissione 507
- gruppi di attività in via di dismissione 517
- passività finanziarie di negoziazione 508
- passività finanziarie valutate al fair value 509
- debiti verso banche 510
- debiti verso clientela 511
- titoli in circolazione 512
- passività associate a singole attività e gruppi di attività in via di dismissione 513
- derivati di copertura 515
- partecipazioni sottoposte a influenza notevole 519
- partecipazioni sottoposte a controllo congiunto 520
- partecipazioni sottoposte a controllo esclusivo 521

Per le voci 52600, 52601, 52603, 52605, 52607 i codici da utilizzare sono i seguenti:

- portafoglio di negoziazione di vigilanza 550
- portafoglio immobilizzato 554

Z) Qualità del credito (codice campo 00522).

Per le voci 40728, 52002, 52004, 52006, 52008, 52010, 52012, 52014, 52170, 52212, 52288, 52292, 52511, 52515, 52802, 52804, 52806, 52808, 52810, 52812 e 52814 i codici da utilizzare sono i seguenti:

- in bonis 550010
- deteriorati 550009

Per le voci 46495, 46500, 46535, 52122, 52151, 52164, 52166, 52184, 52186, 52254, 52296, 52298, 52420 e 52521 i codici da utilizzare sono i seguenti:

- in bonis: esposizioni scadute non deteriorate.....	550021
- in bonis: altro	550011
- in sofferenza	551000
- incagli	550002
- esposizioni ristrutturate.....	550014
- esposizioni scadute deteriorate	550020

Per le voci 52600, 52601, 52622, 58403, 58410, 58415 e 58892 i codici da utilizzare sono i seguenti:

- in bonis	550010
- in sofferenza	551000
- incagli	550002
- esposizioni ristrutturate.....	550014
- esposizioni scadute deteriorate	550020

AA) Raggruppamento titoli (codice campo 551): E' rappresentato mediante codici di 7 posizioni numeriche.

L'informazione e' richiesta a diversi livelli di dettaglio:

- 1) codice del raggruppamento dei titoli;
- 2) codice del raggruppamento dei contratti derivati.

a) Titoli di Stato italiani (sono esclusi i titoli garantiti dallo Stato Italiano)

- B.O.T.	0100101
- C.C.T. a cedola variabile	0100102
- C.T.E.	0100104
- C.T.O. (Certificati del Tesoro con opzione)	0100105
- C.T.Z.....	0100107
- Altri C.C.T. (C.T.R., C.T.S., Certificati Ordinari, Certificati per enti mutualistici).....	0100108
- B.T.P.....	0100103
- Cartelle Cassa DD. PP.	0100109
- BTP oggetto di operazioni di coupon stripping:	
- mantello.....	0100171
- cedola.....	0100172
- Altri titoli dello Stato italiano.....	0100198

b) Titoli di debito (sono compresi i titoli di Stato esteri e di amministrazioni pubbliche italiane ed estere)

- bb.ff. e cc.dd. di durata originaria fino a 18 mesi compresi..... 0100201
- altri titoli di mercato monetario (con durata originaria fino a 18 mesi compresi):
 - cambiali finanziarie, certificati di investimento, accettazioni bancarie e valori assimilati e altri investimenti finanziari 0100212
 - altri..... 0100213
- bb.f.f. e cc.dd. di durata originaria oltre 18 mesi..... 0100211
- obbligazioni ordinarie 0100204
- obbligazioni convertibili 0100205
- obbligazioni con opzioni di rimborso anticipato..... 0100206
- obbligazioni emesse da organismi internazionali..... 0100214
- titoli emessi per operazioni di cartolarizzazione:
 - senior..... 0100217
 - mezzanine 0100218
 - junior..... 0100219
- titoli di debito oggetto di operazioni di coupon stripping:
 - mantello..... 0100271
 - cedola..... 0100250
- Altri titoli di debito (con durata originaria oltre i 18 mesi):
 - prestiti subordinati emessi sotto forma di obbligazioni 0100215
 - certificati di investimento 0100216
 - covered bonds..... 0100230
 - altri..... 0100233
- Titoli strutturati 0100220

c) Titoli di capitale

- azioni e quote
 - ordinarie 0100302
 - privilegiate 0100303
 - di risparmio..... 0100304
 - quote di risparmio..... 0100305
 - altre 0100306
- altri titoli di capitale 0100399

d) Parti di organismi di investimento collettivo del risparmio (o.i.c.r.)

- Oicr di diritto italiano:
 - armonizzati aperti 0100410
 - non armonizzati aperti 0100411
 - chiusi 0100412
 - riservati..... 0100413
 - speculativi..... 0100414
 - exchange traded funds..... 0100500
- Oicr di altri stati UE:
 - armonizzati 0100415
 - non armonizzati aperti 0100416
 - non armonizzati chiusi..... 0100417
 - exchange traded funds..... 0100501

- Oicr di stati no UE:
 - aperti0100418
 - chiusi0100419
 - exchange traded funds0100502

e) Altri titoli0100091

f) Altri valori0000995

DERIVATI FINANZIARI

a) Futures (i futures su titoli nozionali (es. MIF) sono da inserire nella categoria corrispondente al tipo di titolo nozionale)

- su titoli dello Stato italiano0200101
- su titoli di debito0200102
- su titoli di capitale0200103
- su tassi di interesse0200104
- su indici di borsa0200105
- su valute0200106
- su merci0200107
- altri0200198

b) Swaps e fras

- interest rate swaps (IRS) tasso fisso/tasso variabile (con capitali di riferimento denominati nella medesima valuta)0200201
- IRS tasso variabile/tasso variabile (Basis swaps)0200202
- IRS cross-currency
(consistono nello scambio di un tasso di interesse in una valuta con un altro tasso di interesse in una valuta differente)0200203
- currency swaps euro/valuta
(consistono nello scambio di un ammontare prefissato di euro contro un altro di valuta)0200204
- currency swaps valuta/valuta
(consistono nello scambio di due ammontari prefissati di valute differenti)0200205
- domestic currency swaps
(consistono nello scambio, ad una data prestabilita, di un importo determinato in base al differenziale tra il tasso di cambio contrattuale e quello corrente alla data di scadenza dell'operazione)0200206
- forward rate agreements0200207
- altri swaps0200299

c) Opzioni su titoli (Sono inclusi i warrant e i diritti. Le opzioni su un titolo nozionale sono da inserire nella categoria corrispondente al tipo del titolo nozionale)

- opzioni call su titoli dello Stato italiano0200301
- opzioni put su titoli dello Stato italiano0200302

- opzioni call su titoli di debito	0200303
- opzioni put su titoli di debito	0200304
- opzioni call su titoli di capitale (sono inclusi i premi dont).....	0200305
- opzioni put su titoli di capitale (sono inclusi i premi put)	0200306
- altre opzioni su titoli di capitale (sono inclusi i premi composti).....	0200307
- opzioni su altri titoli.....	0200399
d) Opzioni su futures o su indici di borsa (Le opzioni su futures su un titolo nozionale sono da inserire nella categoria corrispondente al tipo del titolo nozionale)	
- opzioni call su futures su titoli dello Stato italiano.....	0200401
- opzioni put su futures su titoli dello Stato italiano	0200402
- opzioni call su futures su titoli di debito o tassi	0200403
- opzioni put su futures su titoli di debito o tassi.....	0200404
- opzioni call su indici di borsa o su futures su indici di borsa	0200405
- opzioni put su indici di borsa o su futures su indici di borsa	0200406
- opzioni su altri futures	0200407
e) Opzioni su valute	
- opzioni call	0200501
- opzioni put	0200502
- altre opzioni su valute	0200503
f) Opzioni su tassi di interesse	
- cap	0200601
- floor.....	0200602
- opzioni su IRS (swaptions)	0200603
- altre opz. Su tassi di interesse	0200604
g) Opzioni su merci	
- opzioni call	0200231
- opzioni put	0200232
- altre opzioni	0200233
h) Opzioni su altri valori o indicatori	0200070
i) Forward	
- titoli di debito.....	0200223
- titoli di capitale	0200224
- quote di OICR.....	0200225
- valute e oro	0200226
- merci	0200227
- altro.....	0200228
i) Altri contratti derivati	0200230
DERIVATI CREDITIZI	0200700

AB) Ramo di attività economica (codice campo 01118). E' rappresentato da codici di 5 posizioni alfanumeriche. Il codice deve essere inserito partendo dalla prima posizione disponibile (allineato a sinistra); la parte non utilizzata del campo deve essere completata utilizzando il carattere "blank" (esempio: se si ha necessità di segnalare una sezione con il codice "A" occorrerà digitare il carattere A seguito da quattro spazi blank, cioè "A ". Invece se si ha la necessità di segnalare una divisione con il codice "01" occorrerà digitare il numero 01 seguito da tre spazi blank, cioè "01 "). Si precisa inoltre che nel caso di settore diverso da 'società non finanziarie' e 'famiglie produttrici' il campo 01118 assume il valore "00000 " (5 zeri).

Deve essere utilizzata la classificazione delle attività economiche ATECO 2007 predisposta dall'ISTAT. La classificazione prevede sei livelli. Gli schemi prevedono la segnalazione di quelli corrispondenti alle Divisioni ("D" negli schemi) e delle Sezioni ("S" negli schemi). I valori previsti in tale classificazione sono illustrati nelle istruzioni relative alla classificazione della clientela divulgate dalla Banca d'Italia.

AC) Residenza. Ai fini della classificazione va assunta la definizione vigente nell'ambito della disciplina valutaria italiana. L'informazione è richiesta nella parte fissa del record "movimento". I codici da utilizzare sono:

- soggetti residenti in Italia1
- soggetti non residenti in Italia2

AD) Stato contratto (codice campo 01070).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- leasing su beni in costruzione.....531
- altro.....541

AE) Stato del veicolo (codice campo 01184): è rappresentato mediante codici di 3 posizioni numeriche. L'informazione deve essere fornita solo se lo Stato della società veicolo appartiene all'area dell'Unione Monetaria Europea; in caso contrario la variabile deve essere appostata a zero. Viene utilizzata la codifica predisposta e gestita dalla Banca d'Italia – Servizio RST.

AF) Stato emittente titolo (codice campo 1215). E' rappresentata mediante codice numerico di 5 posizioni. I codici da utilizzare sono i seguenti:

- Italia	00086
- Paesi UEM diversi dall'Italia.....	00703
- Paesi UE non UEM.....	00704
- Paesi europei non UE.....	59001
- Asia.....	40220
- Africa.....	40230
- Oceania	40250
- America del Nord	40341
- America Centrale.....	40342
- America del Sud	40343
- Non classificabile	07777

AG) Tipo Attività (codice campo 00556).

Per la voce 52424 è previsto il codice segnalazione XY, dove X assume i seguenti valori:

- denaro.....	6
- titoli	7
- altre attività	9

e Y i seguenti valori:

- attività proprie	31
- attività in gestione da terze controparti pubbliche.....	32
- attività in gestione da altre terze controparti	33

Per la voce 52426 i codici da utilizzare sono i seguenti:

- denaro.....	6
---------------	---

- titoli	7
- altre attività	9

Per le voci 52452 e 52496 i codici da utilizzare sono i seguenti:

- leasing finanziario	525
- factoring e altre cessioni	526
- credito al consumo	527
- garanzie e impegni	528
- altri finanziamenti.....	529

AH) Tipo carta (codice campo 00902).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- Personale	01
- Aziendale.....	02

AI) Tipo controllo (codice campo 04517).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- controllate	31
- controllate congiuntamente	32
- sottoposte a influenza notevole	33
- altre.....	34

AJ) Tipo crediti (codice campo 04120).

Per la voce 52151 i codici da utilizzare sono i seguenti:

- crediti temporaneamente inibiti.....	049
- altri crediti (crediti non inibiti)	050

Per le voci 52511, 52515, 52521 e 52530 i codici da utilizzare sono i seguenti:

- credito al consumo..... 527
- altro..... 532

AK) Tipo Frode (codice campo 01006).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- Furto o smarrimento della carta 871
- Contraffazione o duplicazione della carta e/o delle informazioni rilevanti 872
- Mancata ricezione della carta 873
- Frode “carta non presente” 875
- Altro 876

AL) Tipo garante (codice campo 00353).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- banche 51
- intermediari iscritti nell’Elenco speciale ex Articolo 107 del T.U.B..... 52
- intermediari iscritti nell’Elenco generale ex Articolo 106 del T.U.B. 53
- enti pubblici..... 54
- altri 56

AM) Tipo garanzia (codice campo 00352).

Per la voce 40728 i codici da utilizzare sono i seguenti:

garanzie reali

- pegni su depositi di contante 70
- pegni su titoli..... 71
- pegni su altri valori..... 76
- ipoteche su immobili 12
- immobili oggetto di operazioni di leasing finanziario 73
- altre garanzie reali 77

garanzie personali: derivati di credito (diversi da CLN)

- governi e banche centrali.....	84
- altri enti pubblici.....	85
- banche.....	86
- società finanziarie.....	87
- società di assicurazione.....	88
- imprese non finanziarie.....	89
- altri soggetti.....	90

garanzie personali: derivati di credito (credit-link notes – CLN).....72

garanzie personali: crediti di firma

- governi e banche centrali.....	91
- altri enti pubblici.....	92
- banche.....	93
- società finanziarie.....	94
- società di assicurazione.....	95
- imprese non finanziarie.....	96
- altri soggetti.....	97

- non garantito.....98

Per tutte le altre voci i codici da utilizzare sono i seguenti:

- garanzie collettive.....	78
- altre garanzie.....	79

AN) Tipo impegno (codice campo 01072).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- impegni a utilizzo certo.....	1
- impegni a utilizzo incerto.....	2

AO) Tipo importo (codice campo 00350).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- numero..... 8
- importo..... 9

AP) Tipo locazione finanziaria (codice campo 00901).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- Leasing finanziario agevolato 094
- Leasing finanziario non agevolato 095

AQ) Tipo rischio (codice campo 00356).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- a rischio proprio 15
- non a rischio proprio 16

AR) Tipo Scaduto (codice campo 01193): è rappresentato mediante codici di 4 posizioni numeriche. I codici da utilizzare sono i seguenti:

- Per soggetto debitore 1501
- Per singola transazione..... 1502

AS) Tipo tasso dell'operazione (codice campo 00113).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- Tasso fisso..... 83
- Tasso indicizzato 84

AT) Tipo tecnologia (codice campo 01073).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- EMV compliant..... 65
- non EMV compliant..... 66

AU) Valuta (codice campo 00007). Unità di conto in cui sono espressi i fenomeni segnalati. E' rappresentata mediante codici di 3 posizioni numeriche. I codici sono attribuiti dalla Banca d'Italia – Servizio RST.

Le valute il cui peso, misurato come quota sul totale attivo oppure sul passivo del portafoglio immobilizzato, non superi il 5% sono aggregate fra loro e segnalate con il codice di valuta "residuale".

AV) Vita residua delle operazioni (codice campo 00040) - Vita residua delle operazioni con riferimento alla data di revisione dei rendimenti (codice campo 00042). Sono rappresentate per scaglioni temporali identificati da codici di 3 posizioni numeriche.

Codifica valida per la sottosezione II.11 – Parte prima: Vita residua – rischio di liquidità:

- a vista o a revoca	010
- da oltre 1 giorno fino a 7 giorni	025
- da oltre 7 giorni fino a 15 giorni	041
- da oltre 15 giorni fino a 1 mese	042
- da oltre 1 mese fino a 2 mesi	043
- da oltre 2 mesi fino a 3 mesi.....	044
- da oltre 3 mesi fino a 6 mesi.....	050
- da oltre 6 mesi fino a 1 anno	060
- da oltre 1 anno fino a 18 mesi	070
- da oltre 18 mesi fino a 2 anni	080
- da oltre 2 anni fino a 3 anni	160
- da oltre 3 anni fino a 4 anni	170
- da oltre 4 anni fino a 5 anni	180
- oltre 5 anni.....	300
- irredimibile	903
- indeterminata.....	900

Codifica valida per la sottosezione II.11 – Parte seconda: Vita residua – rischio di tasso di interesse:

- a vista o a revoca	010
- da oltre 1 giorno fino a 7 giorni	025
- da oltre 7 giorni fino a 1 mese	035
- da oltre 1 mese fino a 3 mesi	040

- da oltre 3 mesi fino a 6 mesi.....	050
- da oltre 6 mesi fino a 1 anno	060
- da oltre 1 anno fino a 18 mesi	070
- da oltre 18 mesi fino a 2 anni.....	080
- da oltre 2 anni fino a 3 anni	160
- da oltre 3 anni fino a 4 anni	170
- da oltre 4 anni fino a 5 anni	180
- da oltre 5 anni fino a 7 anni	310
- da oltre 7 anni fino a 10 anni	330
- da oltre 10 anni fino a 15 anni	430
- da oltre 15 anni fino a 20 anni	460
- oltre 20 anni	490
- irredimibile	903
- indeterminata	900

3.2 Segnalazione delle perdite storicamente registrate sulle posizioni in *default*.

Istruzioni di carattere generale.

I dati vanno segnalati come segue:

- le segnalazioni di importi: in unità di euro.

Variabili di classificazione

A) Data inizio status: data di ingresso in default della posizione o data del passaggio ad uno stadio successivo di default rispetto al quello iniziale

B) Data fine status: data di chiusura della posizione o data immediatamente precedente l'eventuale passaggio ad uno stadio successivo di default rispetto a quello iniziale

C) Fascia temporale: data di manifestazione dei flussi di cassa

D) Forme tecniche:

1) Per le posizioni chiuse successivamente al 31 dicembre 2013, i codici da utilizzare sono i seguenti:

- Mutui ipotecari	840
- Mutui diversi da ipotecari	841
- Carte di credito	815
- Prestiti personali e cessioni del quinto	842
- Credito al consumo :finanziamenti finalizzati	858
- Leasing finanziario immobiliare	843
- Leasing finanziario strumentale	844
- Leasing finanziario targato	845
- Leasing finanziario energy	846
- Leasing finanziario: altro	847
- Factoring pro-solvendo	34
- Factoring pro-soluto: acquisti di crediti deteriorati	834
- Factoring pro-soluto: altro	835

- Acquisto di crediti deteriorati.....	852
- Specialised lending.....	848
- Altri finanziamenti: garanzie concesse escusse	854
- Altri finanziamenti : derivati scaduti.....	853
- Altri finanziamenti a breve termine.....	849
- Altri finanziamenti a medio e lungo termine	850
- Titoli di debito.....	203
Esposizioni fuori bilancio:	
- Crediti di firma: connessi con operazioni di natura commerciale.....	856
- Crediti di firma :connessi con operazioni di natura finanziaria.....	857
- Impegni.....	859

2) Per le sofferenze antecedenti al 1° gennaio 2008, i codici da utilizzare sono i seguenti:

- Mutui ipotecari	840
- Leasing finanziario immobiliare.....	843
- Leasing finanziario strumentale	844
- Leasing finanziario targato.....	845
- Leasing finanziario energy	846
- Leasing finanziario: altro	847
- Factoring pro-solvendo	34
- Factoring pro-soluto: acquisti di crediti deteriorati.....	834
- Factoring pro-soluto: altro	835
- Acquisto di crediti deteriorati.....	852
- Credito al consumo	527
- Altro: garanzie concesse escusse	854
- Altro: altre esposizioni.....	855

3) Per le posizioni chiuse entro la data del 31 dicembre 2013, i codici da utilizzare sono i seguenti:

- Mutui ipotecari	840
- Leasing finanziario immobiliare.....	843
- Leasing finanziario strumentale	844
- Leasing finanziario targato.....	845
- Leasing finanziario energy	846

- Leasing finanziario: altro.....	847
- Factoring pro-solvendo	34
- Factoring pro-soluto: acquisti di crediti deteriorati	834
- Factoring pro-soluto: altro.....	835
- Acquisto di crediti deteriorati.....	852
- Credito al consumo.....	527
- Altro: garanzie concesse escusse	854
- Altro: altre esposizioni.....	855

E) Tipo garanzia

I valori previsti sono:

Non garantito	98
Pegno su deposito di contante.....	70
Pegno su titoli	71
Pegno su altri valori	76
Ipoteca	12
Altre garanzie reali	127
Garanzie personali rilasciate da Stati o da altri enti pubblici.....	52
Garanzie personali di banche	86
Garanzie personali di intermediari finanziari confidi	128
altri	129
Garanzie personali di altri soggetti.....	130
Derivati su crediti	83
Multigarantito: garanzie reali + personali	131
Multigarantito: più garanzie personali	132
Multigarantito: più garanzie reali	118
Altro.....	133
Dati non ripartibili	777

F) Grado di copertura delle garanzie

I valori previsti sono:

Inferiore a 1.....	260
Uguale o superiore a 1 e inferiore a 1,5.....	261

Uguale o superiore a 1,5 e inferiore a 2	262
Uguale o superiore a 2	263
Dati non ripartibili	777

G) Tipologia chiusura posizione

I valori previsti sono:

Cessione pro-soluto: a società appartenenti al gruppo	1000
Cessione pro-soluto: a soggetti terzi	1008
Chiusura della posizione senza perdite.....	1009
Accordo tra le parti	1002
Procedure fallimentari	1003
Procedure esecutive	1004
Recupero da beni ex leasing.....	1005
Passaggio a perdita	1006
Ritorno in bonis	1007
Escussione della garanzia.....	1010
Utilizzo linea di credito.....	1012
Incomplete workout	1011
Dati non ripartibili	7777

H) Portafoglio regolamentare

1) Metodologia standardizzata:

- Amministrazioni centrali e banche centrali.....	51
- Intermediari vigilati	52
- Enti territoriali.....	53
- Enti senza scopo di lucro ed enti del settore pubblico	55
- Banche multilaterali di sviluppo.....	56
- Organizzazioni internazionali	57
- Imprese e altri soggetti.....	58
- Esposizioni al dettaglio	59
- Esposizioni a breve termine verso imprese	60
- Esposizioni verso organismi di investimento collettivo del risparmio (O.I.C.R.)	61
- Esposizioni garantite da immobili.....	62
- Esposizioni sotto forma di obbligazioni bancarie garantite	63

- Esposizioni scadute	64
- Esposizioni ad alto rischio	65
- Altre esposizioni.	79
- Dati non ripartibili.	77

2) Metodologia standardizzata semplificata:

- Esposizioni verso soggetti sovrani e banche centrali	50
- Esposizioni verso intermediari vigilati	52
- Esposizioni verso enti del settore pubblico non appartenenti alle amministrazioni centrali.	90
- Esposizioni verso banche multilaterali di sviluppo	56
- Esposizioni verso imprese non finanziarie	91
- Esposizioni al dettaglio (retail)	59
- Esposizioni verso organismi di investimento collettivo del risparmio (O.I.C.R.)	61
- Esposizioni verso O.I.C.R. non soggetti a limitazioni nell'utilizzo della leva finanziaria (hedge funds)	92
- Esposizioni garantite da ipoteca o derivanti da operazioni di leasing su immobili residenziali.....	93
- Esposizioni garantite da ipoteca o derivanti da operazioni di leasing su immobili non residenziali.....	94
- Esposizioni scadute	64
- Altre esposizioni.	98
- Dati non ripartibili.	77

3) Metodologia IRB:

- Amministrazioni centrali e banche centrali	51
- Intermediari vigilati e altri soggetti: intermediari vigilati	52
- Intermediari vigilati e altri soggetti: enti pubblici.....	70
- Intermediari vigilati e altri soggetti: altri.....	71
- Esposizioni verso o garantite da imprese: finanziamenti specializzati.....	72
- Esposizioni verso o garantite da imprese: PMI.....	66
- Esposizioni verso o garantite da imprese: altre imprese.	67
- Esposizioni al dettaglio: esposizioni garantite da immobili residenziali: PMI	73
- Esposizioni al dettaglio: esposizioni garantite da immobili residenziali: persone fisiche	74
- Esposizioni al dettaglio: esposizioni rotative al dettaglio qualificate	75
- Esposizioni al dettaglio: altre esposizioni al dettaglio: PMI	76
- Esposizioni al dettaglio: altre esposizioni al dettaglio: persone fisiche	78

- Crediti commerciali acquistati: rischio di diluizione	80
- Finanziamenti specializzati: slotting criteria	81
- Trattamento alternativo delle ipoteche immobiliari.....	82
- Rischio di regolamento: esposizioni per transazioni non DVP con fattori di ponderazione regolamentari	83
- Altre attività	69
- Dati non ripartibili	77

I) Progressivo transazione

Codice numerico progressivo per ciascuna controparte debitrice attribuito dall'intermediario a ciascuna transazione.

J) Codice censito

Codice identificativo attribuito dall'Anagrafe dei soggetti della Banca d'Italia.

K) Provenienza precedente scaduto

Si	1
No	2

L) Status inizio

Sofferenza.....	551000
Incagli.....	550002
Ristrutturate.....	550014
Scadute e/o confinanti deteriorate	550016
Sofferenze già incomplete workout	550026

M) Status fine

Sofferenza.....	551000
Incagli.....	550002
Crediti in bonis	550010
Ristrutturate.....	550014
Scadute e/o confinanti deteriorate	550016
Incomplete workout	550027

3.3 Patrimonio di vigilanza e requisiti patrimoniali.

Istruzioni di carattere generale.

I dati vanno segnalati come segue:

- le informazioni di quantità (numero dei conti, numero dei movimenti, numero dei dipendenti, ecc.): in unità;
- le segnalazioni di importi: in unità di euro.

Variabili di classificazione.

A) Durata (informazione richiesta nella parte fissa del record "movimento"):

- imprecisabile o irrilevante3

B) Tipo importo (codice campo 00350)

a) Metodologia standardizzata e metodologia standardizzata semplificata:

- Valore ponderato3
- Valore dell'esposizione [E].....80
- Valore dell'esposizione rettificato per la volatilità [E(1+He)]81
- Valore corretto dell'esposizione [E*]82
- Equivalente creditizio di garanzie e impegni [E* x FCC]83
- Valore della garanzia reale al netto degli scarti prudenziali [Cvam].....85
- Valore della garanzia personale, derivati su crediti e altre garanzie assimilate (incluse le garanzie reali alle quali si applica il metodo semplificato) al netto degli scarti prudenziali86
- Equivalente creditizio derivati/SFT/operazioni con regolamento a lungo termine.....89
- Equivalente creditizio dei contratti derivati finanziari97

b) Metodologia IRB:

- Valore ponderato3
- Durata residua media (numero giorni)76
- Valore dell'esposizione [E].....80
- Valore corretto dell'esposizione [E*]82
- Equivalente creditizio di garanzie e impegni [E* x FCC] o [E x FCC]83
- Valore della garanzia reale al netto degli scarti prudenziali [Cvam].....85
- LGD media ponderata per l'esposizione.....87

- Equivalente creditizio derivati/SFT/operazioni con regolamento a lungo termine..... 89
- Valore ponderato dell'esposizione al netto delle rettifiche di valore specifiche..... 94
- Equivalente creditizio dei contratti derivati finanziari..... 97

c) Per le voci da 5800 a 5810:

- Valore non ponderato 1
- Valore ponderato 3

C) Tipo garanzia (codice campo 00352)

- Derivati su crediti..... 56
- Garanzie assimilate alle personali..... 57
- Garanzie reali – Metodo semplificato 58
- Garanzie personali 59

D) Valuta (codice campo 00007). Unità di conto in cui sono espressi i fenomeni segnalati. E' rappresentata mediante codici di tre posizioni numeriche. I codici sono attribuiti dalla Banca d'Italia – Servizio RST.

Le valute per le quali la somma di tutte le attività e passività, comprese le operazioni fuori bilancio, non superi il 2% del complesso delle attività e passività (in bilancio e fuori bilancio) in valuta sono aggregate fra loro e segnalate con il codice di valuta "residuale".

E) Codice Censito di tipo "A" (codice campo 00212)

Deve essere utilizzato il codice censito del cliente o della capogruppo per gli affidamenti concessi a gruppi di clienti connessi. In caso di raggruppamento i cui componenti siano legati soltanto da "connessione economica" va segnalato il codice censito di uno qualunque dei soggetti componenti il raggruppamento. Tale codice accompagnerà la posizione fino all'estinzione della stessa. Nel caso in cui il soggetto da segnalare non risulti censito nell'Anagrafe dei soggetti l'intermediario deve fare richiesta del codice attenendosi scrupolosamente alle modalità previste dalla Circ. 139 dell'11/02/91 ("Centrale dei Rischi – Istruzioni per gli intermediari creditizi"), cap.III sez. 2. Per gli intermediari non aderenti alla Rete Nazionale Interbancaria tale richiesta può essere effettuata tramite supporto cartaceo.

F) Tipologia posizione XY (codice campo 00363)

Classifica la tipologia della controparte. E' rappresentato mediante codici di 3 posizioni numeriche XY (es.: per la segnalazione della combinazione "Posizione individuale - Cliente generico" deve essere indicato "101").

Dove X assume i seguenti valori:

- Posizione individuale 1
- Gruppo di clienti connessi in virtù di un legame di natura soltanto giuridica 2
- Gruppo di clienti connessi in virtù di un legame di natura soltanto economica 3
- Gruppo di clienti connessi in virtù di legami di natura sia giuridica sia economica 4

e Y i seguenti valori:

- Cliente generico 01
- Debitore ceduto in operazioni di acquisto crediti con clausola pro soluto con trasferimento sostanziale dei rischi e benefici al cessionario 04
- Debitore ceduto in operazioni di acquisto crediti con clausola pro solvendo 05
- Cedente in operazioni di acquisto crediti con clausola pro solvendo 06
- Debitore ceduto per operazioni di acquisto crediti con clausola pro soluto senza trasferimento sostanziale dei rischi e benefici al cessionario 07
- Cedente per operazioni di acquisto crediti con clausola pro soluto senza trasferimento sostanziale dei rischi e benefici al cessionario 09

G) Classe di merito creditizio (codice campo 01134)

Numero ordinale che rappresenta la classe di merito creditizio.

H) Metodologia applicata (codice campo 01125)

- Metodologia IRB – di base 152
- Metodologia IRB - avanzata 153

I) Fattore di conversione (codice campo 01133).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- 0% - rischio basso 1
- 20 % - rischio medio-basso. 2
- 50 % - rischio medio. 3
- 100 % - rischio pieno 10
- non applicabile 77

J) Fattore di ponderazione (codice campo 01136).

a) Metodologia standardizzata e Metodologia standardizzata semplificata:

- 0 %.....	1
- 10 %.....	5
- 20 %	2
- 35 %.....	6
- 50 %	3
- 75 %.....	9
- 100 %	10
- 150 %.....	18
- 200 %.....	4
- metodologia standardizzata: altre ponderazioni	27
- 350 %.....	30
- 1250 % - con rating	31
- 1250 % - privo di rating.....	32
- look-through – second loss in ABCP.....	33
- look-through – altro	34
- 1666,67 % - con rating.....	87
- 1666,67 % - privo di rating	88

b) Metodologia IRB:

- 0 %.....	1
- 10 %.....	5
- 20 %	2
- 35 %.....	6
- 50 %	3
- 70 % - con vita residua uguale o superiore a 2,5 anni.....	7
- 70 % - con vita residua inferiore a 2,5 anni.....	8
- 75 %.....	9
- 90 %.....	40
- 100 %	10
- 115 %.....	17
- 150 %.....	18
- 200 %.....	4
- 250 %.....	19
- metodologia IRB: altre ponderazioni.....	28
- 190 %.....	84

- 290 %	85
- 370 %	86
- 6-10 %	41
- 12-18 %	42
- 20-35 %	43
- 50-75 %	44
- 425 %	45
- 650 %	46
- 1250 % - con rating .	31
- 1250 % - privo di rating.....	32

K) Portafoglio (codice campo 01130).

a) Metodologia standardizzata:

- Amministrazioni centrali e banche centrali	51
- Intermediari vigilati.....	52
- Enti territoriali.....	53
- Enti senza scopo di lucro ed enti del settore pubblico	55
- Banche multilaterali di sviluppo	56
- Organizzazioni internazionali	57
- Imprese e altri soggetti.	58
- Esposizioni al dettaglio	59
- Esposizioni a breve termine verso imprese	60
- Esposizioni verso organismi di investimento collettivo del risparmio (O.I.C.R.)	61
- Esposizioni garantite da immobili.	62
- Esposizioni sotto forma di obbligazioni bancarie garantite	63
- Esposizioni scadute	64
- Esposizioni ad alto rischio	65
- Altre esposizioni.	79

b) Metodologia standardizzata semplificata:

- Esposizioni verso soggetti sovrani e banche centrali	50
- Esposizioni verso intermediari vigilati	52
- Esposizioni verso enti del settore pubblico non appartenenti alle amministrazioni centrali.	90
- Esposizioni verso banche multilaterali di sviluppo	56
- Esposizioni verso imprese non finanziarie.....	91
- Esposizioni al dettaglio (retail)	59

- Esposizioni verso organismi di investimento collettivo del risparmio (O.I.C.R.)	61
- Esposizioni verso O.I.C.R. non soggetti a limitazioni nell'utilizzo della leva finanziaria (hedge funds)	92
- Esposizioni garantite da ipoteca o derivanti da operazioni di leasing su immobili residenziali.....	93
- Esposizioni garantite da ipoteca o derivanti da operazioni di leasing su immobili non residenziali.....	94
- Esposizioni scadute	64
- Altre esposizioni.....	98

c) Metodologia IRB:

- Amministrazioni centrali e banche centrali.....	51
- Intermediari vigilati e altri soggetti: intermediari vigilati	52
- Intermediari vigilati e altri soggetti: enti pubblici.....	70
- Intermediari vigilati e altri soggetti: altri	71
- Esposizioni verso o garantite da imprese: finanziamenti specializzati.	72
- Esposizioni verso o garantite da imprese: PMI	66
- Esposizioni verso o garantite da imprese: altre imprese.....	67
- Esposizioni al dettaglio: esposizioni garantite da immobili residenziali: PMI	73
- Esposizioni al dettaglio: esposizioni garantite da immobili residenziali: persone fisiche.....	74
- Esposizioni al dettaglio: esposizioni rotative al dettaglio qualificate	75
- Esposizioni al dettaglio: altre esposizioni al dettaglio: PMI	76
- Esposizioni al dettaglio: altre esposizioni al dettaglio: persone fisiche	78
- Crediti commerciali acquistati: rischio di diluizione	80
- Finanziamenti specializzati: slotting criteria.	81
- Trattamento alternativo delle ipoteche immobiliari.....	82
- Rischio di regolamento: esposizioni per transazioni non DVP con fattori di ponderazione regolamentari	83
- Altre attività.	69

L) Ruolo nella cartolarizzazione (codice campo 01127).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- Originator	101
- Investitore.	102
- Sponsor.	103

M) Tipologia esposizione (codice campo 01017).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- Senior550005
- Mezzanine.550006
- Junior.....550007

N) Tipo cartolarizzazione (codice campo 01126).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- tradizionale604
- sintetica.605

O) Linee di business (codice campo 04009).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- servizi finanziari per l'impresa (corporate finance).....611
- negoziazione e vendita (trading and sales).612
- servizi bancari al dettaglio (retail banking).....613
- servizi bancari a carattere commerciale (commercial banking)614
- servizi di pagamento e regolamento (payement and settlement)615
- gestioni fiduciarie (agency services).....616
- gestioni patrimoniali (asset management).....617
- intermediazione al dettaglio (retail brokerage).....618
- totale linee di business629

P) Eventi di perdita (codice campo 01025).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- frode interna 111
- frode esterna 112
- rapporto di impiego e sicurezza sul lavoro..... 113
- clientela, prodotti e prassi professionali..... 114
- danni da eventi esterni 115
- interruzioni dell'operatività e disfunzioni dei sistemi 116
- esecuzione, consegna e gestione dei processi 117

- totale eventi di perdita..... 118

Q) Zone VP – volumi di pagamento – (codice campo 01207): è rappresentato mediante codici di 3 posizioni numeriche. I codici da utilizzare sono i seguenti:

- VP fino a 5 mln di euro..... 200
- VP al di sopra di 5 mln di euro e fino a 10 mln di euro..... 201
- VP al di sopra di 10 mln di euro e fino a 100 mln di euro..... 202
- VP al di sopra di 100 mln di euro e fino a 250 mln di euro..... 203
- VP al di sopra di 250 mln di euro 204

4 Segnalazioni statistiche e di vigilanza degli organismi di investimento collettivo del risparmio (O.I.C.R.).

Istruzioni di carattere generale.

In generale, i dati vanno segnalati come segue:

- le informazioni di quantità: in unità;
- le segnalazioni di importi: in unità di euro.

Qualora siano richieste informazioni con decimali, come indicato in nota alle singole voci (cfr. cap. 4), i valori risultanti devono essere segnalati senza indicazione della virgola (es. 3,15% = 315; 24,18 euro = 2418).

Variabili di classificazione.

A) RESIDENZA: ai fini della classificazione va assunta la definizione vigente nell'ambito della disciplina valutaria italiana. L'informazione è richiesta nella parte fissa del record "movimento". I codici da utilizzare sono:

- Soggetti residenti in Italia.....1
- Soggetti non residenti in Italia.....2

N.B.: Ove l'informazione non è richiesta indicare convenzionalmente **1** nel campo corrispondente, previsto nei tracciati dei supporti per la trasmissione dati.

B) DIVISA: L'informazione è richiesta nella parte fissa del record "movimento - segnalazione". I codici da utilizzare sono:

- euro1
- altre valute2

N.B.: Ove l'informazione non è richiesta indicare convenzionalmente **1** nel campo corrispondente, previsto nei tracciati dei supporti per la trasmissione dei dati.

C) DURATA: Questa informazione non è richiesta ai fini delle segnalazioni. Indicare convenzionalmente **00** (due volte zero) nel campo corrispondente, previsto nel tracciato dei supporti per la trasmissione dei dati nella parte fissa del record "movimento - segnalazione".

D) APPARTENENZA AL GRUPPO (codice campo 937): È rappresentato da codici di due posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- appartenenza al gruppo 16
- non appartenenza al gruppo 07

E) ARCO TEMPORALE DI CONFRONTO (codice campo 991): È rappresentato da codici di due posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- giorno 31
- mese 38
- trimestre 39
- semestre 40
- anno 41
- altro 42
- non applicato o non applicabile 00

F) BASE DI CALCOLO (codice campo 996): È rappresentato da codici di due posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- extra-performance rispetto al rendimento di un parametro di riferimento 70
- extra-performance rispetto ad un obiettivo di rendimento..... 76
- performance assoluta 77
- prelievo sul partecipante 78
- altro 79

G) CATEGORIA CONTROPARTE (codice campo 559): Classificazione delle controparti. È rappresentata mediante codici di tre posizioni numeriche. Di seguito sono riportati i valori previsti ed il livello cui si riferiscono:

	LIVELLO	CODICE
- categoria controparte: Stati, Amministrazioni centrali		
- Stato / Governo italiano, Banca d'Italia.....	1	812
- Stati / Governi / Banche centrali di altri paesi "zona A" e Istituzioni dell'UE	1	816
- categoria controparte: soggetti qualificati		
- banche italiane	1	245
- banche di altri paesi zona "A"	1	825
- S.I.M.	1	264
- imprese di investimento di altri paesi UE e G-10 nonché altri paesi della "zona A" dove sussistono regole di vigilanza prudenziale giudicate dalla Banca d'Italia equivalenti a quelle vigenti nell'U.E.	1	836

- borse valori, mercati regolamentati e organismi di compensazione nazionali ed esteri riconosciuti dalla Consob.....	1840
- enti del settore pubblico di paesi della "zona A"	1841
- altre controparti qualificate	1849
- categoria controparte: altri soggetti		
- Stati / Governi / Banche Centrali di paesi della "zona B"	1871
- banche di Paesi della "zona B"	1872
- altre imprese di investimento	1873
- altre borse valori, mercati regolamentati e organismi di compensazione nazionali ed esteri	1874
- enti del settore pubblico di paesi della "zona B"	1875
- società di gestione del risparmio e SICAV italiane	1817
- altre istituzioni finanziarie	1864
- società di assicurazione	1865
- società e quasi società non finanziarie	1866
- agenti di cambio	1276
- famiglie (consumatrici e produttrici).....	1867
- altri.....	1889
- non applicabile		
- non applicabile	1890

H) CATEGORIA EMITTENTI (codice campo 555): Classificazione degli emittenti dei valori mobiliari. È rappresentata mediante codici di tre posizioni numeriche. Di seguito sono riportati i valori previsti ed il livello cui si riferiscono:

	LIVELLO	CODICE
- categoria emittenti "A"		
- Stato / Governo italiano, Banca d'Italia	1812
- Stati / Governi / Banche centrali di altri paesi "zona A" e Istituzioni dell'U.E.....	1816
- categoria emittenti "B"		
- banche italiane	1245
- banche di altri paesi "zona A"	1825
- S.I.M.....	1264
- imprese di investimento di altri paesi UE e G-10 nonché altri paesi della "zona A" dove sussistono regole di vigilanza prudenziale giudicate dalla Banca d'Italia equivalenti a quelle vigenti nell'U.E.....	1836
- borse valori, mercati regolamentati e organismi di compensazione nazionali ed esteri riconosciuti		

dalla Consob.....	1	840
- enti del settore pubblico di paesi della "zona A"	1	841
- altri emittenti qualificati	1	859
- categoria emittenti "C"		
- Stati / Governi / Banche Centrali di paesi della "zona B"	1	871
- banche di paesi della "zona B"	1	872
- altre imprese di investimento	1	873
- altre borse valori, mercati regolamentati e organismi di compensazione nazionali ed esteri	1	874
- enti del settore pubblico di Paesi della "zona B"	1	875
- società di gestione del risparmio e SICAV italiane	1	817
- altre istituzioni finanziarie italiane	1	861
- altre istituzioni finanziarie estere	1	862
- imprese di assicurazione e fondi pensione italiani	1	029
- imprese di assicurazione e fondi pensione esteri.....	1	863
- società non finanziarie italiane	1	004
- società non finanziarie estere.....	1	085
- holding finanziarie pubbliche	1	255
- holding pubbliche.....	1	474
- imprese partecipate dallo Stato	1	471
- altri.....	1	879
- non applicabile		
- non applicabile	1	890

I) CATEGORIA VALORI MOBILIARI (codice campo 551): Classificazione dei valori mobiliari oggetto di segnalazione. L'indicazione della Categoria Valori Mobiliari può avvenire a due diversi livelli di dettaglio (vedi capitolo 4 per la corrispondenza fra ciascuna voce e livello di dettaglio richiesto). Di seguito sono riportati i valori previsti, da allineare a destra (lunghezza del campo = 7), ed il livello cui si riferiscono:

I.1) <u>TITOLI</u>	<u>LIVELLO</u>	<u>CODICE</u>
- titoli di Stato italiano	2	0101010
- bot	1	0100101
- cct (a cedola variabile).....	1	0100102
- cct altri	1	0100108
- btp	1	0100103
- cte.....	1	0100104
- cto.....	1	0100105
- bte	1	0100106
- ctz.....	1	0100107

-	btp oggetto di operazioni di coupon stripping:		
-	- mantello	1	0100171
-	- cedola	1	0100172
-	cartelle Cassa DD.PP.....	1	0100109
-	altri titoli dello stato italiano	1	0100188
-	titoli di debito	2	0101020
-	certificati di deposito:		
-	- di durata originaria fino a 18 mesi compresi	1	0101201
-	- di durata originaria oltre 18 mesi.....	1	0101211
-	accettazioni bancarie.....	1	0100242
-	polizze di credito commerciale	1	0100244
-	obbligazioni ordinarie	1	0101204
-	obbligazioni convertibili	1	0101205
-	obbligazioni con opzioni	1	0101206
-	altri titoli di mercato monetario	1	0100249
-	titoli di stati esteri.....	1	0100240
-	reverse convertible	1	0100209
-	altri titoli strutturati	1	0100220
-	preference shares	1	0100221
-	titoli emessi per operazioni di cartolarizzazione:		
-	- senior	1	0100217
-	- mezzanine.....	1	0100218
-	- junior	1	0100219
-	titoli oggetto di operazioni di coupon stripping:		
-	- mantello	1	0100271
-	- cedola	1	0100250
-	altri titoli di debito.....	1	0100222
-	titoli di capitale	2	0100030
-	azioni e quote:		
-	- ordinarie	1	0100302
-	- privilegiate.....	1	0100303
-	- azioni di risparmio	1	0100304
-	- quote di risparmio	1	0100305
-	- altre	1	0100306
-	altri titoli di capitale	1	0100399
-	parti di organismi di investimento		
-	collettivo del risparmio (O.I.C.R.)	2	0101040
-	O.I.C.R. di diritto italiano:		
-	- armonizzati aperti.....	1	0100410
-	- non armonizzati aperti.....	1	0100411
-	- chiusi.....	1	0100412

- riservati.....	1	0100413
- speculativi.....	1	0100414
- O.I.C.R. di altri stati UE:		
- armonizzati aperti.....	1	0100415
- non armonizzati aperti.....	1	0100416
- non armonizzati chiusi.....	1	0100417
- O.I.C.R. di stati no UE:		
- aperti.....	1	0100418
- chiusi.....	1	0100419
- altri titoli.....	2	0100091
- altri titoli.....	1	0100091
- diritti e warrant.....	2	0101039
- su titoli di capitale.....	1	0101030
- su titoli di debito.....	1	0101031

CONTRATTI DERIVATI	LIVELLO	CODICE
- futures.....	2	0200010
- su titoli dello stato italiano.....	1	0200101
- su titoli di debito.....	1	0200102
- su titoli di capitale.....	1	0200103
- su tassi di interesse.....	1	0200104
- su indici di borsa.....	1	0200105
- su valute.....	1	0200106
- su merci.....	1	0200107
- altri.....	1	0200198
- swaps e fras.....	2	0200020
- IRS tasso fisso/tasso variabile.....	1	0200201
- IRS tasso variabile/tasso variabile (basis swaps)....	1	0200202
- IRS cross-currency.....	1	0200203
- currency swaps euro/valuta.....	1	0200204
- currency swaps valuta/valuta.....	1	0200205
- domestic currency swaps (DCS).....	1	0200206
- altri swaps.....	1	0200299
- forward rate agreements (fras).....	1	0200207
- opzioni su titoli.....	2	0201030
- opzioni call su titoli dello stato italiano.....	1	0200301
- opzioni put su titoli dello stato italiano.....	1	0200302
- opzioni call su titoli di debito.....	1	0200303
- opzioni put su titoli di debito.....	1	0200304
- opzioni call su titoli di capitale.....	1	0201305
- opzioni put su titoli di capitale.....	1	0201306

-	altre opzioni su titoli di capitale.....	1	0201307
-	opzioni call su altri titoli.....	1	0200392
-	opzioni put su altri titoli.....	1	0200391
-	altre opzioni su altri titoli.....	1	0200395
-	opzioni su futures.....	2	0200040
-	opzioni call su futures su titoli dello stato italiano....	1	0200401
-	opzioni put su futures su titoli dello stato italiano....	1	0200402
-	opzioni call su futures su titoli di debito o tassi.....	1	0200403
-	opzioni put su futures su titoli di debito o tassi.....	1	0200404
-	opzioni call su futures su indici di borsa.....	1	0200455
-	opzioni put su futures su indici di borsa.....	1	0200456
-	opzioni call su altri futures.....	1	0200410
-	opzioni put su altri futures.....	1	0200411
-	opzioni su valute.....	2	0200050
-	opzioni call su valute.....	1	0200501
-	opzioni put su valute.....	1	0200502
-	altre opzioni su valute.....	1	0200503
-	opzioni su tassi di interesse.....	2	0200060
-	cap.....	1	0200601
-	floor.....	1	0200602
-	opzioni su IRS (swaptions).....	1	0200603
-	altre opzioni su tassi di interesse.....	1	0200604
-	opzioni su altri valori o indici.....	2	0201070
-	opzioni call su indici di borsa.....	1	0200465
-	opzioni put su indici di borsa.....	1	0200466
-	opzioni su merci.....	1	0200467
-	opzioni su altri valori o indici.....	1	0200468
-	derivati su crediti.....	2	0200700
-	derivati su crediti.....	1	0200700
-	compravendite a termine di valuta.....	2	0200470
-	compravendite a termine di valuta.....	1	0200470
-	altri contratti derivati.....	2	0200481
-	altri contratti derivati.....	1	0200481

I.2) Per le voci 50660, 50662 e 50664 della sez. VI dei fondi aperti e dei fondi chiusi e della sez. II delle SICAV la classificazione da utilizzare è la seguente:

<u>TITOLI</u>	<u>LIVELLO</u>	<u>CODICE</u>
- titoli di stato e assimilati.....	2	0101010

- titoli di debito e diritti e warrant su titoli di debito....2	0102020
- titoli di capitale, diritti e warrant su titoli di capitale 2	0103030
- parti di O.I.C.R.....2	0101040
- altri titoli.....2	0109090
- strumenti derivati aventi ad oggetto titoli di stato e assimilati	2 0201010
- strumenti derivati aventi ad oggetto titoli di debito..2	0202010
- strumenti derivati aventi ad oggetto tassi di interesse	2 0206010
- strumenti derivati aventi ad oggetto titoli di capitale e relativi indici.....2	0204010
- strumenti derivati aventi ad oggetto valute o tassi di cambio	2 0205010
- altri strumenti finanziari derivati	2 0209010

- J) CODICE CLASSE (codice campo 938): Corrisponde alla codifica ISIN gestita dalla Banca d'Italia – Servizio RST – Divisione “Codifica e informazioni valori mobiliari”. Il codice deve essere comprensivo del valore di controllo. Nel caso in cui il fondo/comparto non sia suddiviso in classi, deve essere indicato il codice ISIN del fondo/comparto. Qualora siano attribuiti due differenti codici ISIN per una stessa classe o fondo/comparto, deve essere segnalato il codice associato al titolo emesso al portatore.
- K) CODICE CENSITO DI TIPO “C” (codice campo 810): Per la classificazione nominativa della controparte deve essere utilizzato il codice censito. Nel caso in cui il soggetto da segnalare non risulti censito nell’Anagrafe dei soggetti, l’intermediario deve fare richiesta del codice attenendosi alle modalità previste dalla Circolare 139 dell’11/02/91 (“Centrale dei Rischi – Istruzioni per gli intermediari creditizi”), cap. III, sez. 2. Per gli intermediari non aderenti alla Rete Nazionale Interbancaria tale richiesta può essere effettuata tramite supporto cartaceo.
- L) CODICE TITOLO (codice campo 032): La codifica dei titoli emessi da residenti e da non residenti è gestita dalla Banca d'Italia – Servizio RST – Divisione “Informazioni anagrafiche soggetti e strumenti finanziari”, la quale provvede alla divulgazione dell’anagrafe. Andrà utilizzato il “codice Isin” comprensivo del valore di controllo. Per ogni tipologia di valore mobiliare per la quale non è prevista l’attribuzione della codifica ISIN (esempio, quote di srl) occorre utilizzare il codice convenzionale “995”.
- M) DATA DI RIFERIMENTO (codice campo 912): Data di riferimento della valutazione. Va indicata nel formato AAAAMMGG.

N) DEPOSITARIA (codice campo 541): E' rappresentato da codici di 2 posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- Montetitoli82
- Altra depositaria residente81
- Depositaria non residente83

O) DESTINAZIONE (codice campo 022): È rappresentato da codici di tre posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- industriale (es.: fabbriche, centrali elettriche, centrali telefoniche)300
- turistico-ricettiva (es.: alberghi, residence, villaggi turistici)525
- intrattenimento (es.: sale cinematografiche, parchi gioco, parchi zoologici)526
- commerciale (es.: negozi, centri commerciali, supermarket)810
- pubblica (es.: scuole, ospedali, caserme, uffici pubblici)527
- agricola090
- residenziale (es.: abitazioni e relative pertinenze)095
- logistica (es.: magazzini)096
- uffici (esclusi quelli pubblici)528
- altra529

P) FINALITA' (codice campo 910): È rappresentato da codici di due posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- copertura08
- non copertura09

Q) FONDO/COMPARTO (codice campo 905): È rappresentato da codici di sette posizioni numeriche. Contiene:

- il codice del comparto, assegnato dalla Banca d'Italia, in caso di fondi o SICAV multicompartimentali;
- il codice del fondo, assegnato dalla Banca d'Italia, nel caso di fondi monocompartimentali;
- il codice ABI della SICAV, privo del carattere di controllo, seguito da '00' (due volte zero) in caso di SICAV monocompartimentali.

R) INDICATORE QUOTAZIONE (codice campo 552): Classificazione dei valori mobiliari oggetto di segnalazione. È rappresentata mediante codice numerico di tre posizioni. I valori previsti sono:

- quotato..... 001
- non quotato..... 002
- non applicabile..... 770

S) MODALITA' DI CESSIONE (codice campo 034): È rappresentato da codici di tre posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- cessione in borsa..... 101
- cessione ad altri soci dell'azienda partecipata..... 102
- cessione ad altra impresa..... 103
- altro..... 104
- non applicabile..... 000

T) MODALITA' DI COLLOCAMENTO (codice campo 506): È rappresentato da codici di due posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- in proprio..... 61
- tramite terzi..... 62

U) MODALITA' DI UTILIZZO (codice campo 519): È rappresentato da codici di tre posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- in locazione..... 105
- in locazione finanziaria..... 106
- a disposizione..... 107
- altro..... 108

V) NATURA DEL DEPOSITO (codice campo 500): È rappresentato da codici di quattro posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- depositi a vista o con preavviso inferiore a 15 giorni..... 1500
- depositi con vincolo non superiore a 12 mesi..... 3020
- depositi con vincolo superiore a 12 mesi..... 3030
- altri depositi..... 9000

W) PAESE (codice campo 987): Viene utilizzata la codifica (3 posizioni numeriche) predisposta e gestita dalla Banca d'Italia – Servizio RST.

X) PERCETTORE (codice campo 907): È rappresentato da codici di cinque posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- banca.....10022
- SIM o impresa di investimento estera.....10023
- SGR/SICAV di diritto italiano10033
- Società di gestione/SICAV di diritto estero10035
- altro soggetto.....10036

Y) PERIODICITA' DI CALCOLO DELLE PROVVISIIONI (codice campo 988): È rappresentato da codici di due posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- giorno.....31
- mese.....38
- trimestre.....39
- semestre.....40
- anno.....41
- altro.....42
- non applicato o non applicabile00

Z) PERIODICITA' DI PRELIEVO DELLE PROVVISIIONI (codice campo 990): È rappresentato da codici di due posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- giorno.....31
- mese.....38
- trimestre.....39
- semestre.....40
- anno.....41
- altro.....42
- non applicato o non applicabile00

AA) PROVINCIA (codice campo 015): Viene utilizzato il codice C.A.B. dei comuni capoluogo di provincia utilizzandone le prime 3 posizioni cui vanno anteposti due zeri: ad esempio il codice di Roma (identificato dal codice 03200) viene rappresentato con il valore 00032. Con riferimento ai non residenti in Italia, andrà convenzionalmente utilizzato il codice 00998. I valori previsti sono:

CODICE	PROVINCIA
00166	AGRIGENTO
00104	ALESSANDRIA
00026	ANCONA
00012	AOSTA
00141	AREZZO
00135	ASCOLI PICENO
00103	ASTI
00151	AVELLINO

00040.....BARI
00206.....BARLETTA-ANDRIA-TRANI
00119.....BELLUNO
00150.....BENEVENTO
00111.....BERGAMO
00223.....BIELLA
00024.....BOLOGNA
00116.....BOLZANO
00112.....BRESCIA
00159.....BRINDISI
00048.....CAGLIARI
00167.....CALTANISSETTA
00038.....CAMPOBASSO
00175.....CARBONIA-IGLESIAS
00149.....CASERTA
00169.....CATANIA
00044.....CATANZARO
00155.....CHIETI
00109.....COMO
00162.....COSENZA
00114.....CREMONA
00222.....CROTONE
00102.....CUNEO
00168.....ENNA
00205.....FERMO
00130.....FERRARA
00028.....FIRENZE
00157.....FOGGIA
00132.....FORLI'
00148.....FROSINONE
00014.....GENOVA
00124.....GORIZIA
00143.....GROSSETO
00105.....IMPERIA
00156.....ISERNIA
00036.....L'AQUILA
00107.....LA SPEZIA
00147.....LATINA
00160.....LECCE
00229.....LECCO
00139.....LIVORNO
00203.....LODI
00137.....LUCCA
00134.....MACERATA
00115.....MANTOVA
00136.....MASSA CARRARA
00161.....MATERA
00178.....MEDIO-CAMPIDANO
00165.....MESSINA
00016.....MILANO
00129.....MODENA
00204.....MONZA-BRIANZA
00034.....NAPOLI
00101.....NOVARA
00173.....NUORO
00176.....OGLIASTRA
00177.....OLBIA-TEMPIO

00174	ORISTANO
00121	PADOVA
00046	PALERMO
00127	PARMA
00113	PAVIA
00030	PERUGIA
00133	PESARO E URBINO
00154	PESCARA
00126	PIACENZA
00140	PISA
00138	PISTOIA
00125	PORDENONE
00042	POTENZA
00215	PRATO
00170	RAGUSA
00131	RAVENNA
00163	REGGIO DI CALABRIA
00128	REGGIO NELL'EMILIA
00146	RIETI
00242	RIMINI
00032	ROMA
00122	ROVIGO
00152	SALERNO
00172	SASSARI
00106	SAVONA
00142	SIENA
00171	SIRACUSA
00110	SONDRIO
00158	TARANTO
00153	TERAMO
00144	TERNI
00010	TORINO
00164	TRAPANI
00018	TRENTO
00120	TREVISO
00022	TRIESTE
00123	UDINE
00108	VARESE
00020	VENEZIA
00224	VERBANO-CUSIO-OSSOLA
00100	VERCELLI
00117	VERONA
00428	VIBO VALENTIA
00118	VICENZA
00145	VITERBO
00998	NON RESIDENTI IN ITALIA

BB) QUALITA' CREDITO (codice campo 522): È rappresentato da codici di sette posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- in bonis	0550010
- sofferenze	0551000
- incagli	0550002
- esposizioni ristrutturate	0550014

- esposizioni scadute da oltre 90 giorni..... 0550017

CC) RAPPORTO CON EMITTENTE/CEDENTE (codice campo 909): È rappresentato da codici di due posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- società o ente controllante 01
- altro soggetto appartenente al gruppo (compresi fondi o SICAV) 05
- soggetti non appartenenti al gruppo 07

DD) RESIDENZA DEL PERCETTORE, DEL SOTTOSCRITTORE, DELLA CONTROPARTE, DEL SOGGETTO DELEGANTE, DEL SOGGETTO DELEGATO, DEL CEDENTE (codice campo 016): È rappresentato da codici di tre posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- Italia 086
- paese dell'Unione Monetaria 703
- paese dell'Unione Europea non aderente all'Unione Monetaria..... 704
- altro..... 705

EE) RESIDENZA DEL COLLOCATORE (codice campo 092): È rappresentato da codici di tre posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- Italia 086
- Paese dell'Unione Monetaria..... 703
- Paese dell'Unione Europea non aderente all'Unione Monetaria 704
- altro..... 705

FF) SCAGLIONE (codice campo 913): Identifica ciascuna delle fasce di importo o di tempo in cui trovano applicazione le commissioni e provvigioni, nell'ipotesi in cui queste ultime siano di entità variabile in relazione a taluni elementi (patrimonio gestito, tempo di permanenza nel fondo, ecc.). È rappresentato da codici di due posizioni numeriche. I valori previsti sono identificati con i numeri da 1 a 19.

GG) SETTORE ISTITUZIONALE (codice campo 011): Le finalità ed i valori previsti nella classificazione adottata sono illustrate nelle istruzioni relative alla classificazione della clientela divulgate dalla Banca d'Italia. È rappresentato mediante codici di tre posizioni numeriche. Negli schemi di segnalazione (cfr. cap. 4) è indicato il grado di settorizzazione a cui si deve fare riferimento.

HH) SOGGETTO COLLOCATORE (codice campo 911): È rappresentato da codici di cinque posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- banca.....10022
- SIM o impresa di investimento estera.....10023
- altro soggetto.....10025

II) STATO UBICAZIONE IMMOBILE (codice campo 997): È rappresentato da codici di tre posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- Italia.....086
- Paese dell'Unione Monetaria.....703
- Paese dell'Unione Europea non aderente all'Unione Monetaria704
- altro.....705

JJ) TIPO GESTIONE SGR (codice campo 513): È rappresentato da codici di quattro posizioni numeriche XYZ.

XX assume i seguenti valori:

- fondo aperto non speculativo01
- fondo chiuso mobiliare non speculativo.....02
- fondo chiuso immobiliare non speculativo03
- fondo speculativo.....04
- fondo pensione aperto.....05
- fondo pensione negoziale.....06
- altre forme/gestioni pensionistiche07
- patrimonio o comparto di SICAV08
- gestione individuale in valori mobiliari09
- gestione individuale in fondi10
- gestione individuale in valori mobiliari e fondi.....11
- gestione di partecipazioni bancarie12
- altro.....13

Y assume i seguenti valori:

- armonizzato italiano.....1
- non armonizzato italiano.....2
- armonizzato estero3
- non armonizzato estero4
- non applicabile.....0

Z assume i seguenti valori:

- di fondi.....1
- riservato2

- con garanzia	3
- altro.....	4
- non applicabile.....	0

KK) TIPO INDICATORE (codice campo 993): È rappresentato da codici di due posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- indicatore azionario semplice (un solo indice azionario).....	60
- indicatore azionario composto (più di un indice azionario)	61
- indicatore obbligazionario semplice (un solo indice obbligazionario).....	62
- indicatore obbligazionario composto (più di un indice obbligazionario) ...	63
- indicatore globale (presenza contemporanea di indici azionari e obbligazionari senza prevalenza).....	64
- indicatore di mercato monetario	65
- indicatore di mercato monetario con spread.....	66
- indicatore di prezzo.....	67
- altro.....	68
- non applicato o non applicabile	00

LL) TIPO INVESTIMENTO (codice campo 139): È rappresentato da codici di due posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- stadio iniziale	08
- fase di sviluppo	09
- finalizzato alla quotazione in borsa	10
- leverage buy-out	11
- ristrutturazione d'impresa.....	12
- altro.....	13
- non applicabile.....	17

MM) TIPOLOGIA OPERAZIONI (codice campo 558): Classificazione delle diverse tipologie di operazioni aventi ad oggetto valori mobiliari. È rappresentata mediante codici di due posizioni numeriche. Di seguito sono riportati i valori previsti.

MM.1) Valori previsti:

- a pronti	13
- a termine	14
- sottoscrizioni	15
- rimborsi a scadenza.....	16

- vendita allo scoperto.....	22
- trasferimento di portafoglio per operazioni straordinarie	26
- altre.....	27

MM.2) Nelle sezioni III, relativa ai fondi aperti, e IV, relativa alle SICAV, la classificazione da utilizzare è la seguente:

- connesse con sottoscrizioni/rimborsi ordinari di clientela “retail”	33
- derivanti da operazioni di switch di clientela “retail”	34
- derivanti da piani di accumulazione di clientela “retail”	35
- connesse con sottoscrizioni/rimborsi ordinari di operatori qualificati	36
- derivanti da operazioni di switch di operatori qualificati	37
- derivanti da operazioni straordinarie tra fondi/comparti.....	38

MM.3) Nella sezione III, relativa alle SICAV, la classificazione da utilizzare è la seguente:

- a pronti	13
- a termine	14
- sottoscrizioni	15
- rimborsi a scadenza	16
- trasferimento di portafoglio per operazioni straordinarie	26
- altre.....	28

NN) TIPO SOGGETTO DELEGANTE/DELEGATO (codice campo 941): È rappresentato da codici di cinque posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- banca italiana	00245
- banca estera.....	00884
- SIM italiana.....	00264
- impresa di investimento estera.....	10021
- SICAV italiana	10049
- SICAV estera	10050
- SGR italiana	10019
- società di gestione estera	10051
- fondo pensione	10029
- altro.....	10038

OO) TIPOLOGIA CREDITO (codice campo 994): È rappresentato da codici di sei posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- mutuo.....	553001
--------------	--------

- credito al consumo..... 553002
- leasing 553003
- altri crediti 553004

PP) TIPOLOGIA PARTECIPAZIONE (codice campo 995): È rappresentato da codici di due posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- partecipazione di minoranza 13
- partecipazione di maggioranza 14
- partecipazione di maggioranza in sindacato 15
- non applicabile 00

QQ) VALUTA (codice campo 007): Unità di conto in cui sono espressi i fenomeni segnalati. È rappresentata mediante codici di tre posizioni numeriche. I codici sono attribuiti dalla Banca d'Italia – Servizio RST.

RR) VITA RESIDUA (codice campo 040): È rappresentato da codici di tre posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- fino a 6 mesi 045
- da 6 a 12 mesi 060
- da 12 a 24 mesi 090
- oltre 24 mesi 162

5 Segnalazioni degli intermediari finanziari ex art. 106 D.lgs. 385/93.

Istruzioni di carattere generale.

I dati vanno segnalati:

- le informazioni di quantità: in unità;
- le segnalazioni di importi: in unità di euro.

Variabili di classificazione.

A) Durata. Fatto salvo quanto di seguito specificato, questa informazione non è richiesta ai fini delle segnalazioni. Indicare convenzionalmente **3** nel campo corrispondente, previsto nei tracciati dei supporti per la trasmissione dati nella parte fissa del record "movimento - segnalazione".

B) Residenza. Questa informazione non è richiesta ai fini delle segnalazioni. Indicare convenzionalmente **1** nel campo corrispondente, previsto nei tracciati dei supporti per la trasmissione dati nella parte fissa del record "movimento - segnalazione".

C) Divisa. Questa informazione non è richiesta ai fini delle segnalazioni. Indicare convenzionalmente **1** nel campo corrispondente, previsto nei tracciati dei supporti per la trasmissione dati nella parte fissa del record "movimento - segnalazione".

D) Regione intermediario (codice campo 00013):

<u>CODICE</u>	<u>REGIONE</u>
10036.....	ABRUZZI
10042.....	BASILICATA
10044.....	CALABRIA
10034.....	CAMPANIA
10024.....	EMILIA ROMAGNA
10022.....	FRIULI VENEZIA GIULIA
10032.....	LAZIO
10014.....	LIGURIA
10016.....	LOMBARDIA
10026.....	MARCHE
10038.....	MOLISE
10010.....	PIEMONTE
10040.....	PUGLIA
10048.....	SARDEGNA
10046.....	SICILIA
10028.....	TOSCANA

10018 TRENTINO ALTO ADIGE
 10030 UMBRIA
 10012 VALLE D'AOSTA
 10020 VENETO

E) Regione residenza controparte (codice campo 00015):

<u>CODICE</u>	<u>REGIONE</u>
10036	ABRUZZI
10042	BASILICATA
10044	CALABRIA
10034	CAMPANIA
10024	EMILIA ROMAGNA
10022	FRIULI VENEZIA GIULIA
10032	LAZIO
10014	LIGURIA
10016	LOMBARDIA
10026	MARCHE
10038	MOLISE
10010	PIEMONTE
10040	PUGLIA
10048	SARDEGNA
10046	SICILIA
10028	TOSCANA
10018	TRENTINO ALTO ADIGE
10030	UMBRIA
10012	VALLE D'AOSTA
10020	VENETO
10998	diverso da regione italiana

F) Codice titolo (codice campo 00032): la codifica dei titoli emessi da residenti e da non residenti è gestita dalla Banca d'Italia – Servizio RST – Divisione “Informazioni anagrafiche soggetti e strumenti finanziari”. Andrà utilizzato il “codice Isin” comprensivo del valore di controllo.

G) Banca depositaria (codice campo 01172): per la classificazione nominativa della controparte deve essere utilizzato il “codice censito”. Il codice può essere richiesto attenendosi alle modalità previste dalla Circ. n.139 dell'11/02/91 (“Centrale dei rischi – Istruzioni per gli intermediari creditizi”), cap. III sez. 2. Tale richiesta può essere effettuata anche tramite supporto cartaceo.

H) Settore istituzionale (codice campo 011): le finalità ed i valori previsti nella classificazione adottata sono illustrate nelle istruzioni relative alla classificazione della clientela divulgate dalla Banca d'Italia. E' rappresentato mediante codici di tre posizioni numeriche.

Per le voci: 58322 e 58323 i valori previsti sono:

- Famiglie consumatrici	600
- Famiglie produttrici: artigiani	614
- Famiglie produttrici che esercitano attività diversa da quella artigiana	615
- Famiglie produttrici dei paesi UE membri dell'UEM	768
- Famiglie produttrici dei paesi UE non membri dell'UEM	769
- Famiglie produttrici dei paesi non UE	772
- Famiglie consumatrici dei paesi UE membri dell'UEM.....	773
- Famiglie consumatrici dei paesi UE non membri dell'UEM.....	774
- Famiglie consumatrici dei paesi non UE	775

Capitolo 3

Segnalazioni sull'attività degli intermediari finanziari ex art. 107 d.lgs. 385/93, degli Istituti di pagamento e degli Istituti di moneta elettronica

ATTIVITÀ' DEGLI INTERMEDIARI FINANZIARI EX ART 107 D.LGS. 385/93, DEGLI
ISTITUTI DI PAGAMENTO E DEGLI ISTITUTI DI MONETA ELETTRONICA

I N D I C E

Legenda dei simboli..... C.5

**INTERMEDIARI FINANZIARI EX ART 107 D.LGS. 385/93, DEGLI ISTITUTI DI
PAGAMENTO E DEGLI ISTITUTI DI MONETA ELETTRONICA**

I Sezione : Dati patrimoniali

1.1 Attivo C.1.1
1.2 Passivo..... C.2.1

II Sezione : Altre informazioni

2.1 Leasing..... C.3.1
2.2 Factoring e altre cessioni..... C.4.1
2.3 Crediti al consumo C.5.1
2.4 Garanzie e impegni..... C.6.1
2.5 Altre attività finanziarie..... C.7.1
2.6 Rapporti con società del gruppo C.8.1
2.7 Cartolarizzazioni C.9.1
2.8 Qualità e flussi..... C.10.1
2.9 Dati integrativi..... C.11.1
2.10 Saldi medi..... C.12.1
2.11 Vita residua - parte prima: rischio di liquidità..... C.13.1
2.11 Vita residua - parte seconda: rischio di tasso d'interesse C.13.4
2.12 Servizi di pagamento e moneta elettronica C.14.1
2.13 Perdite storicamente registrate sulle posizioni in default..... C.15.1

III Sezione : Dati di conto economico

3.1 Componenti negative di reddito C.16.1
3.2 Componenti positive di reddito..... C.17.1
3.3 Altre informazioni..... C.18.1

IV Sezione : Patrimonio di vigilanza e requisiti patrimoniali

4.1 Patrimonio di vigilanza C.19.1
4.2 Rischio di credito e di controparte..... C.20.1
4.3 Determinazione della posizione netta in cambi C.21.1
4.4 Grandi rischi C.22.1
4.5 Rischio operativo C.23.1
4.6 Requisito patrimoniale a fronte dei servizi di pagamento prestati e della
moneta elettronica emessa..... C.24.1
4.7 Posizione patrimoniale..... C.25.1

V Sezione : Dati di fine esercizio

5.1 Attivo C.26.1
5.2 Passivo..... C.27.1

LEGENDA DEI SIMBOLI

DURATA	
1	1
2	2
3	3
A	1,2
B	1,2,3
C	5,16,17
D	5,6,7
J	1,3
Q	16,17
W	2,3

RESIDENZA	
1	1 (RESIDENTI IN ITALIA)
2	2 (NON RESIDENTI IN ITALIA)
X	1,2

DIVISA	
1	EURO
2	ALTRE VALUTE
X	1,2

GRADO DI SETTORIZZAZIONE	
D	DIVISIONE
S	SEZIONE
SG	SOTTOGRUPPO
SS	SOTTOSETTORE
M	SOTTOSETTORE PER I RESIDENTI E SOTTOGRUPPO PER I NON RESIDENTI

PERIODICITA'	
A	ANNUALE
S	SEMESTRALE
T	TRIMESTRALE
M	MENSILE

QUALIFICA DELLA CONTROPARTE	
A	ACQUIRENTE
Af	AFFIDATO
C	CEDENTE
Cl	CLIENTE
Cn	CONCEDENTE
Cnp	CONTROPARTE
Co	CESSIONARIO
Cr	CREDITORE
D	DEBITORE
De	DEPOSITANTE
Do	DEPOSITARIO
E	EMITTENTE
G	(C/D/E)
H	(OR/CNP)
Ec	ESERCIZIO CONVENZIONATO
L	LOCATARIO
Or	ORDINANTE
P	PARTECIPANTE
Po	POSSESSORE DI CARTA DI CREDITO
V	VENDITORE
K	(C/D/L/Po)

NOTE	
RL	NON AMMESSO 'RESIDENTI (1)/ALTRE VALUTE (2)'
NN	AMMESSO 'RESIDENTI (1)/EURO (1)' E 'NON RESIDENTI(2)/ALTRE VALUTE(2)'
XD	OPERAZIONI DA ATTRIBUIRE CONVENZIONALMENTE PER L'AMMONTARE GLOBALE NELL'UNICA COMBINAZIONE 'RESIDENZA/DIVISA' PREVISTA. OVVERO: OPERAZIONE DA RIPARTIRE NELLE COMBINAZIONI 'RESIDENZA/DIVISA' PREVISTE TENENDO CONTO DELLA 'DIVISA'. I RAPPORTI IN EURO VANNO ATTRIBUITI AI 'RESIDENTI(1)/EURO(1)'; I RAPPORTI IN ALTRE MONETE AI 'NON RESIDENTI(2)/ALTRE VALUTE(2)'. R L'INDICAZIONE DELLA VARIABILE 'RAMO' RIGUARDA SOLTANTO LA CLIENTELA CLASSIFICATA NEL SETTORE 4 (SOCIETA' NON FINANZIARIE) E NEL SETTORE 6 - SOTTOSETTORE 61 (FAMIGLIE PRODUTTRICI)
F	L'INDICAZIONE DELLA VARIABILE 'FINALITA' DEL CREDITO' RIGUARDA SOLTANTO LE 'FAMIGLIE' E LE 'ISTITUZIONI SENZA SCOPO DI LUCRO' (SOTTOSETTORI 51, 60, 61, 86 E 87)

