

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

Firmato digitalmente da



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

| 59° aggiornamento – agosto 2015



# Servizio Rilevazioni ed Elaborazioni 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.

**AGGIORNAMENTO N.54 – LUGLIO 2014**  
**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 C.1 a C.5, B.3.7.1, da B.4.1.1.1 a B.4.10.1, da C.1.1.1.1 a C.3.3.1, da C.4.1.1.1 a C.4.9.1

TOMO III: da A.1 a A.81, da B.16.1 a B.16.3, da B.17.1 a B.17.3, B.18.1, da B.19.1 a B.19.3, da B.20.1 a B.20.3, B.21.1, da B.22.1 a B.22.2, da B.23.1 a B.23.2, C.15.1

**AGGIORNAMENTO N.55 – SETTEMBRE 2014**  
**Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre**

---

TOMO I: da A.1 a A.16, da B.1 a B.15, da N.1 a N.6, da P.1 a P.6

TOMO II: da A.1 a A.59, B.1.1.1 a B.1.4.2, da B.2.1.1.1 a B.2.1.1.3, da B.2.3.1.1 a B.2.3.1.11, da B.3.6.1.1 a B.3.6.1.4

TOMO III: da A.1 a A.82, da C.6.1 a C.6.10, da C.9.1 a C.9.13, da C.14.1 a C.14.15, D.1 a D.6, D.13.1, D.14.1, D.17.1, D.20.1, D.21.1, E.1.1 a E.1.2, E.2.1, E.5.1, E.7.1, E.10.1, E.11.1, E.13.1, F.1.1 a F.1.2, F.2.1, F.6.1, F.9.1 e F.10.1.

**AGGIORNAMENTO N.56 – GENNAIO 2015**  
**Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre**

---

TOMO I: da B.1 a B.15, da C.1 a C.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.59, B.1.1.1 a B.1.4.2, da B.2.1.1.1 a B.2.1.1.6, da B.2.2.1 a B.2.2.3, da B.2.4.1.1 a B.2.4.1.2, da B.2.4.2.1 a B.2.4.2.5, da B.4.11.1 a B.4.11.9, da C.1 a C.5, da C.1.1.4.1 a C.1.1.4.3, da C.1.1.6.1 a C.1.1.6.8, da C.1.1.8.1 a C.1.1.8.2, da C.1.1.11.1 a C.1.1.11.4, da C.1.1.12.1 a C.1.1.12.11, da C.1.1.13.1 a C.1.1.13.11, da C.1.2.1.1 a C.1.2.1.7, da C.1.3.1.1 a C.1.3.1.2, C.2.1.2.1, da C.2.2.1.1 a C.2.2.1.4, da C.4.10.1 a C.4.10.8

TOMO III: da A.1 a A.82, D.20.1, F.9.1

**AGGIORNAMENTO N.57 – MARZO 2015**  
**Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre**

---

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

TOMO II: da A.1 a A.61, B.1.3.1 a B.1.3.22, da B.2.1.2.1 a B.2.1.4.5, da B.2.3.1 a B.2.3.13, da B.2.4.2.1 a B.2.4.2.5, da B.3.1.1 a B.3.1.4, da B.3.3.2.1 a B.3.3.5.3, da B.3.6.1 a B.3.6.5, da C.2.1.2.1 a C.2.1.2.3, da C.2.2.1.1 a C.2.2.5.6

TOMO III: da A.1 a A.82, B.3.1, B.18.1, da C.1 a C.6, da C.1.1 a C.1.3, da C.3.1 a C.3.4, da C.9.1 a C.11.5, da C.13.1 a C.14.15, da C.26.1 a C.26.3

**AGGIORNAMENTO N.58 – GIUGNO 2015**  
**Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre**

---

TOMO I: da A.1 a A.22, 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

TOMO II: da A.1 ad A.56, da B.2.1.4.1 a B.2.1.4.5, da B.3.3.2.1 a B.3.3.2.20, B.3.7.1, da B.4.1.1.1 a B.4.1.1.4, da B.4.2.2.1 a B.4.2.2.2, da B.4.2.7.1 a B.4.2.7.2, da B.4.4.1 a B.4.4.4, B.4.5.1, da B.4.6.1 a B.4.6.3, B.4.8.4.1, da B.4.9.1 a B.4.9.2, da C.2.1.2.1 a C.2.1.2.3, da C.4.1.1.1 a C.4.1.1.4, da C.4.2.2.1 a C.4.2.2.2, da C.4.2.7.1 a C.4.2.7.2, da C.4.4.1 a C.4.4.4, C.4.5.1, da C.4.6.1.1 a C.4.6.1.3, C.4.8.4.1, da C.4.9.1.1 a C.4.9.1.2

TOMO III: da A.1 a A.82, da C.1 a C.8, da C.1.1.1 a C.5.2.3, da C1.1.1.1.1 a C1.4.6.2.1, da C2.1 a C2.4, da C2.1.1.1 a C2.4.1.2, da C3.1.1.1 a C3.5.2.3, da D.1 a D.6

**Elenco delle pagine da eliminare**

---

TOMO III: da H.1. a H.4, da H.1.1 a H.6.2

**AGGIORNAMENTO N.59 – AGOSTO 2015**  
**Elenco delle pagine da sostituire o da introdurre**

---

TOMO II: da A.1 ad A.56, da B.4.1.1.1 a B.4.1.1.4, da B.4.1.2.1 a B.4.1.2.5, da B.4.3.1 a B.4.3.2, B.4.5.1, da C.4.1.1.1 a C.4.1.1.4, da C.4.1.2.1 a C.4.1.2.5, da C.4.3.1 a C.4.3.2, C.4.5.1

TOMO III: da A.1 ad A.84, da C.4.1.1.1 a C.4.1.1.4, da C.4.1.2.1 a C.4.1.2.4, da C.4.3.1 a C.4.3.2, da C1.4.1.1.1 a C1.4.1.1.4, da C1.4.1.2.1 a C1.4.1.2.4, da C1.4.3.1 a C1.4.3.2

# 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 e dei gruppi di sim quotati .....	C.1

## TOMO III

Capitolo 1	Sistema delle codifiche (enti finanziari non bancari e gruppi di SIM) .....	A.1
Capitolo 2	Schemi segnaletici: attivita' degli operatori del mercato mobiliare.....	B.1
Capitolo 3	Schemi segnaletici: attivita' degli intermediari finanziari ex art. 106 d.lgs. 385/93, degli istituti di pagamento e degli istituti di moneta elettronica .....	C.1
	Schemi segnaletici: attivita' degli intermediari finanziari iscritti agli elenchi generale e speciale ante riforma fino alla data di iscrizione al nuovo albo unico ex art. 106 d.lgs. 385/93 – PERIODO TRANSITORIO <sup>1</sup> .....	C2.1
Capitolo 4	Schemi segnaletici: organismi di investimento collettivo del risparmio (O.I.C.R.).....	D.1

---

<sup>1</sup> Medesimo regime segnaletico si applica agli Istituti di pagamento e agli Istituti di moneta elettronica fino alla data contabile del 30 settembre 2015.



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', 'A5' e 'W' .....	A.8
- Matrice dei conti: basi informativa 'LD' .....	A.26
- Segnalazioni di vigilanza consolidata (gruppi bancari e gruppi di SIM quotati): basi informative 'M1' e 'M2' .....	A.30
- Segnalazioni prudenziali individuali (banche e SIM) e consolidate (gruppi bancari e gruppi di SIM): basi informative 'Y', 'LY', '1', 'L1', 'EY' e 'E1' .....	A.36
- 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;
- 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, 1, M1, EY e E1) 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 indicazioni in merito al segno degli importi delle voci afferenti alla sezione IV "Segnalazioni Prudenziali" della matrice dei conti e delle segnalazioni di vigilanza su base consolidata (basi informative LY, Y, L1, 1, EY e E1) si rimanda alle disposizioni contenute in Circolare n. 286 del 17 dicembre 2013 "Istruzioni per la compilazione delle segnalazioni prudenziali per i soggetti vigilati";
- 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, 1, EY e E1) 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, A5, W)	segnalazioni prudenziali (basi Y, LY, 1, L1, EY, E1)	segnalazioni consolidate (basi EP, M1, M2)
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		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		
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		
00941	Tipo soggetto delegante/delegato	5	X		
00944	Canali distributivi	3	X		
01006	Causale frode	4	X		
01013	Sottosistema di appartenenza della controparte	5			
01014	Portafoglio contabile	3	X		X
01016	Natura attività sottostante dei contratti derivati	3	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	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	



codice campo	descrizione del campo	lunghezza del campo	matrice di conti (basi A1, A2, A3, A4, A5, W)	segnalazioni prudenziali (basi Y, LY, 1, L1, EY, E1)	segnalazioni consolidate (basi EP, M1, M2)
01133	Fattore di conversione	3		X	
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		
01192	Tipo strumento finanziario	4	X		
01193	Tipo scaduto	4			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		X
01217	Oggetto dei reclami	5	X		
01222	Metodologia di consolidamento	3		X	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	
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	

codice campo	descrizione del campo	lunghezza del campo	matrice di conti (basi A1, A2, A3, A4, A5, W)	segnalazioni prudenziali (basi Y, LY, 1, L1, EY, E1)	segnalazioni consolidate (basi EP, M1, M2)
01261	Identificativo dell'originator	45		X	
01262	Rinegoziato	1	X		
01279	Modalità di avvio	2	X		
01280	Tipo rettifica	3			X
01281	Tipo copertura	3			X
01282	Causale variazione	3			X
01283	Tipologia di fair value option	3			X
01284	Data di entrata	8			X
01286	Codice del titolo (non ISIN)	20			X
01285	Tipo relazione	3			X
01287	Metodologia di consolidamento – Gruppo contabile	3			X
01288	Codice identificativo cover pool	12		X	
01289	Compliance art. 129	1		X	
01290	Classe di attività primaria del cover pool	12		X	
01291	Nome CRA	30		X	
01292	Rating	12		X	
01293	Forma tecnica dell'attività	3		X	
01294	Forma tecnica della passività associata	3		X	
01295	Tipologia di misura di tolleranza	3			X
01296	Tipo approccio	4	X		X
01297	Esposizioni con/senza concessioni	3	X		X
01298	Importo dell'evento di perdita	3		X	
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', 'A5', 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	LUNGH. CAMPO	CODIFICHE
<b>Residenza</b>	-	-	<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"> <li>- rapporti con soggetti residenti in Italia ..... 1</li> <li>- rapporti con soggetti non residenti in Italia ..... 2</li> </ul>
<b>Durata</b>	-	-	<p>L'informazione è richiesta nella parte fissa del record "movimento".</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- imprecisabile o irrilevante..... 3</li> <li>- fino a un anno ..... 5</li> <li>- da oltre un anno fino a due anni..... 6</li> <li>- oltre due anni ..... 7</li> <li>- fino a due anni..... 13</li> <li>- fino a tre mesi..... 14</li> <li>- oltre tre mesi ..... 15</li> <li>- da oltre un anno fino a cinque anni ..... 16</li> <li>- oltre cinque anni..... 17</li> <li>- oltre un anno ..... 18</li> <li>- da oltre tre mesi fino a due anni..... 25</li> <li>- da oltre due anni fino a cinque anni ..... 35</li> <li>- da oltre cinque anni fino a sette anni ..... 43</li> <li>- da oltre sette anni fino a dieci anni ..... 44</li> <li>- da oltre dieci anni fino a quindici anni ..... 45</li> <li>- da oltre quindici anni fino a ventinove anni ..... 46</li> <li>- oltre ventinove anni ..... 47</li> </ul>
<b>Divisa</b>	-	-	<p>L'informazione è richiesta nella parte fissa del record "movimento". I codici da utilizzare sono:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- 1 = euro</li> <li>- 2 = altre valute</li> </ul>
<b>Codice valuta</b>	00007	3	<p>Unità di conto in cui sono espressi i fenomeni segnalati. I codici sono attribuiti dalla Banca d'Italia – Servizio RES.</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"> <li>- importi in euro, codice valuta = 398, divisa = 2</li> </ul>
<b>Settore istituzionale</b>	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"> <li>- Amministrazioni pubbliche (sottogruppi 100, da 102 a 191)..... 1</li> <li>- Imprese finanziarie e assicurative (sottogruppi da 249 a 250, da 258 a 264, 268, da 275 a 289, da 294 a 296, 329)..... 95</li> <li>- Imprese non finanziarie (sottogruppi 430, 432, 450, da 475 a 492) ..... 4</li> <li>- Famiglie produttrici (sottogruppi 614, 615) ..... 61</li> <li>- Famiglie consumatrici, Istituzioni sociali private e unità non classificabili (sottogruppi 500, 501, 551, 552, 600)..... 96</li> <li>- Autorità bancarie centrali e altre istituzioni finanziarie monetarie (sottogruppi 245, 247, 101, 248 e 300)..... 97</li> </ul>
<b>Settore istituzionale del garante</b>	00019	3	<ul style="list-style-type: none"> <li>- 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</li> </ul>
<b>Attività economica:</b>	01118	5	<p>Deve essere utilizzata la classificazione delle attività economiche ATECO 2007 predisposta dall'ISTAT. La classificazione prevede sei livelli. Gli</p>

## MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4', 'A5', 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	LUNGH. CAMPO	CODIFICHE
<b>ramo</b>			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"
<b>Codice sportello</b>	02028	5	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.
<b>Stato di residenza della controparte</b>	00016	3	Viene utilizzata la codifica predisposta e gestita dalla Banca d'Italia – Servizio RES. Per ciò che concerne i rapporti con gli Organismi Internazionali, devono essere utilizzati gli specifici codici assegnati ai suddetti organismi.
<b>Stato di residenza del garante</b>	00018	3	Viene utilizzata la codifica predisposta e gestita dalla Banca d'Italia – Servizio RES. Per ciò che concerne i rapporti con gli Organismi Internazionali, devono essere utilizzati gli specifici codici assegnati ai suddetti organismi.
<b>Stato ubicazione filiale/ controllata</b>	00063	3	Viene utilizzata la codifica predisposta e gestita dalla Banca d'Italia – Servizio RES. Per ciò che concerne i rapporti con gli Organismi Internazionali, devono essere utilizzati gli specifici codici assegnati ai suddetti organismi.  Per le voci 40812, 40813, 40814, 40980, 40981, 40993, 40994, 41065, 41087, 41088, 41089, 41090 e 41091 della base informativa "W" e per le voci 58360, 58366, 58370, 58381, 58810, 58875 e 58880 della base informativa "A2" i codici da utilizzare sono:  - Italia ..... 86 - Paesi diversi dall'Italia ..... 706  Per le voci 41402, 41403, 41404, 41405, 41419 della base informativa "A3" i codici da utilizzare sono:  - Italia ..... 86 - Paesi diversi dall'Italia ..... 706
<b>Stato di residenza della società veicolo</b>	01184	3	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  - Italia ..... 00086 - Paesi UEM diversi dall'Italia ..... 00703 - Paesi UE non UEM ..... 00704 - Paesi europei non UE ..... 59001 - Asia ..... 40220 - Africa ..... 40230 - Oceania ..... 40250
<b>Stato emittente</b>	01215	5	- Italia ..... 40230 - Oceania ..... 40250

## MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4', 'A5', 'W')

VARIABLE DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	LUNGH. CAMPO	CODIFICHE
<b>Rinegoziato</b>	01262	1	America del Nord ..... 40341
			America Centrale ..... 40342
			America del Sud..... 40343
			Non classificabile ..... 07777
			Sì..... 1 No.....2
<b>Vita residua delle operazioni (A)</b>	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
<b>Vita residua delle operazioni con riferimento alla data di revisione dei rendimenti (B)</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 40014, 40016, 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			

## MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4', 'A5', 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	LUNGH CAMP O	CODIFICHE		
			- 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
<b>Provincia di residenza della controparte</b>	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
<b>Provincia di operatività</b>	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
<b>Provincia di destinazione economica dell'investi- mento</b>	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
<b>Provincia di esecuzione dell'opera- zione</b>	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	Le operazioni con soggetti non residenti devono essere segnalate con il codice convenzionale di provincia 00998
			00028 FIRENZE	00138 PISTOIA	
00157 FOGGIA	00125 PORDENONE				
00132 FORLI'	00042 POTENZA				
00148 FROSINONE	00215 PRATO				
00014 GENOVA	00170 RAGUSA				
00124 GORIZIA	00131 RAVENNA				

## MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4', 'A5', 'W')

VARIABLE DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	LUNGH. CAMPO	CODIFICHE
			00143 GROSSETO      00163 REGGIO CALABRIA
<b>Aree geografiche Italia</b>	00015	5	Codifica valida per la voce 58306: - nord-ovest..... 20001 - nord-est..... 20002 - centro..... 20003 - sud..... 20004 - isole..... 20005
<b>Destinazione economica dell'investimento finanziato</b>	00022	3	Codifica valida per la voce 58320:  <b>INVESTIMENTI NON FINANZIARI</b> costruzioni: abitazioni ..... 010 fabbricati non residenziali: rurali..... 020 altri..... 030 opere del Genio Civile..... 040 macchine, attrezzature, mezzi di trasporto e prodotti vari: rurali ..... 050 altri..... 060  <b>ALTRI INVESTIMENTI</b> acquisto di immobili: abitazioni famiglie consumatrici ..... 070 altri soggetti ..... 080 altri immobili rurali..... 090 altri..... 105 acquisto di beni durevoli da parte delle famiglie consumatrici ..... 110 investimenti finanziari..... 120 altre destinazioni ..... 130  Codifica valida per le voci 58005, 58007, 58080, 58081, 58083, 58086, 58202, 58204, 58208, 58210, 58212, 58214, 58216, 58397 (base inf. "A1" e "A4"): - credito al consumo - finalizzato: - acquisto di beni durevoli ..... 110 - acquisto di autoveicoli..... 116 - altro..... 119 - non finalizzato..... 204 - prestiti per acquisto abitazioni ..... 212 - acquisto, costruzione, ristrutturazione immobili non residenziali ..... 226 - consolidamento di altri prestiti e/o costituzione di liquidità ..... 227 - altro..... 228  Codifica valida per le voci 40013, 40015, 40025, 40028, 40055 (base inf. "A1"), 41087, 41088, 41089, 41090, 41091 (base inf. "W") e 58366 (base inf. "A2"):  - credito al consumo..... 202 - prestiti per acquisto abitazioni ..... 212 - altro..... 222
<b>Finalità del credito</b>			- Mezzogiorno e altre aree      - Esportazioni ..... 690

## MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4', 'A5', 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	LUNGH CAMP O	CODIFICHE
<b>Legge di incentivazione del credito agevolato</b>	00024	3	depresse ..... 610 - Agricoltura, foresta e pesca ..... 710 - Industria - medie e piccole imprese ..... 630 - Edilizia e abitazioni ..... 750 - Industria - altre imprese ..... 650 - Artigianato ..... 755 - Commercio, attività finanziarie e assicurative, trasporti e comunicazioni, turismo, servizi vari ..... 670 - Calamità naturali ..... 765 - Altre destinazioni ..... 770
<b>Tipo tasso dell'operazione</b>	00113	2	I codici da utilizzare per la voce 58312 sono: - tasso agevolato ..... 80 - tasso fisso non agevolato ..... 81 - tasso indicizzato non agevolato ..... 82  I codici da utilizzare per la voce 58320 sono: - tasso agevolato ..... 80 - tasso fisso non agevolato ..... 81 - tasso indicizzato non agevolato con CAP ..... 89 - tasso indicizzato non agevolato senza CAP ..... 90  Per le restanti voci i codici previsti sono: - tasso fisso ..... 83 - tasso indicizzato ..... 84
<b>INFORMAZIONI NOMINATIVE</b>			<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>
<b>Codice Censito di tipo A</b>	00212	13	Il codice censito di tipo A deve essere utilizzato nelle seguenti voci (ove la sottovoce lo richieda): 58795, 40733.
<b>Codice censito di tipo B</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.
<b>Codice censito originator</b>	01186	13	Il codice censito originator deve essere utilizzato nelle seguenti voci (ove la sottovoce lo richieda): 58081, 58084, 58212, 58216
<b>Indicatore di</b>	00552	3	Codifiche valide per le voci dei servizi di investimento: - valori mobiliari quotati in mercati regolamentati ..... 028



## MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4', 'A5', 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	LUNGH. CAMPO	CODIFICHE
quotazione			- valori mobiliari non quotati in mercati regolamentati..... 029 - valori mobiliari in corso di quotazione in mercati regolamentati ..... 027 - non applicabile..... 770 Codifiche valide per le altre voci: - 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
<b>Clientela MIFID</b>	00800	3	- clientela Retail ..... 500 - clientela Professionale..... 510 - controparti qualificate ..... 520
<b>Servizio consulenza</b>	00806	1	- si ..... 1 - no..... 2 - non applicabile..... 7
<b>Gerarchia del fair value</b>	01190	1	- livello 1..... 1 - livello 2..... 2 - livello 3..... 3
<b>Tipologia valutazione</b>	01191	3	- valutazione al costo ..... 200 - valutazione al valore rivalutato ..... 201
<b>Tipo strumento finanziario</b>	01192	4	- strum. strutturati..... 1511 - altri..... 1512
<b>CLASSIFICAZIONE DEI VALORI MOBILIARI</b>			
<b>Codice del titolo</b>	00032	12	<p>La codifica dei titoli emessi da residenti e non residenti è gestita dalla Banca d'Italia – Servizio RES – 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 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:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- buoni fruttiferi e certificati di deposito in euro ..... 9</li> <li>- buoni fruttiferi e certificati di deposito in altre valute ..... 10</li> </ul> <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"> <li>- per i titoli in euro emessi da residenti ..... 1</li> <li>- per i titoli in altre valute emessi da residenti ..... 2</li> <li>- per i titoli in euro emessi da non residenti ..... 3</li> <li>- per i titoli in altre valute emessi da non residenti ..... 4</li> </ul> <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>

## MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4', 'A5', 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	LUNGH CAMP O	CODIFICHE
			Ovviamente, anche nel caso di utilizzo di codici titolo residuali, dovranno essere correttamente fornite, ove richieste, le informazioni per "codici di raggruppamento".
<b>1) Codice del raggruppamento dei titoli</b>	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><b>a) Titoli di Stato italiani</b> (sono esclusi i titoli garantiti dallo Stato Italiano)</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- B.O.T..... 0100101</li> <li>- C.C.T. a cedola variabile..... 0100102</li> <li>- C.T.E..... 0100104</li> <li>- C.T.O. (Certificati del Tesoro con opzione) ..... 0100105</li> <li>- C.T.Z..... 0100107</li> <li>- Altri C.C.T. (C.T.R., C.T.S., Certificati Ordinari, Certificati per enti mutualistici) ..... 0100108</li> <li>- B.T.P..... 0100103</li> <li>- Cartelle Cassa DD. PP..... 0100109</li> <li>- BTP oggetto di operazioni di coupon stripping: <ul style="list-style-type: none"> <li>- mantello..... 0100171</li> <li>- cedola..... 0100172</li> </ul> </li> <li>- Altri titoli dello Stato italiano 0100198</li> </ul> <p><b>b) Titoli di debito</b> (sono compresi i titoli di Stato esteri e di amministrazioni pubbliche italiane ed estere)</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- bb.ff. e cc.dd. di durata originaria fino a 18 mesi compresi ..... 0100201</li> <li>- altri titoli di mercato monetario (con durata originaria fino a 18 mesi compresi): <ul style="list-style-type: none"> <li>- 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</li> <li>- altri..... 0100213</li> </ul> </li> <li>- bb.f.f. e cc.dd. di durata originaria oltre 18 mesi..... 0100211</li> <li>- obbligazioni ordinarie ..... 0100204</li> <li>- obbligazioni convertibili ..... 0100205</li> <li>- obbligazioni con opzioni di rimborso anticipato..... 0100206</li> <li>- obbligazioni emesse da organismi internazionali ..... 0100214</li> <li>- titoli emessi per operazioni</li> </ul> <p><b>c) Titoli di capitale</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- azioni e quote <ul style="list-style-type: none"> <li>- ordinarie.....0100302</li> <li>- privilegiate.....0100303</li> <li>- di risparmio .....0100304</li> <li>- quote di risparmio .....0100305</li> <li>- altre .....0100306</li> </ul> </li> <li>- altri titoli di capitale .....0100399</li> </ul> <p><b>d) Parti di organismi di investimento collettivo del risparmio (o.i.c.r.)</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Oicr di diritto italiano: <ul style="list-style-type: none"> <li>- armonizzati aperti .....0100410</li> <li>- non armonizzati aperti ....0100411</li> <li>- chiusi .....0100412</li> <li>- riservati .....0100413</li> <li>- speculativi .....0100414</li> <li>- exchange traded funds ...0100500</li> </ul> </li> <li>- Oicr di altri stati UE: <ul style="list-style-type: none"> <li>- armonizzati .....0100415</li> <li>- non armonizzati aperti ....0100416</li> <li>- non armonizzati chiusi ....0100417</li> <li>- exchange traded funds ...0100501</li> </ul> </li> <li>- Oicr di stati no UE: <ul style="list-style-type: none"> <li>- aperti.....0100418</li> <li>- chiusi .....0100419</li> <li>- exchange traded funds ...0100502</li> </ul> </li> </ul> <p><b>e) Altri titoli</b> .....0100091</p> <p><b>f) Altri valori</b> .....0000995</p>

# MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4', 'A5', 'W')

VARIABLE DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	LUNGH. CAMPO	CODIFICHE	
			di cartolarizzazione: - senior .....0100217 - mezzanine.....0100218 - junior .....0100219	
<b>2)</b> <b>Codice del raggruppamento dei contratti derivati</b>  <b>2.a</b> <b>Codifiche relative ai contratti derivati valide per le segnalazioni statistiche sui servizi d'investimento (sez. 2.2 della matrice dei conti)</b>	00551	7	<b>DERIVATI FINANZIARI</b> <b>a) Futures</b> (i futures su titoli nozionali (es. MIF) sono da inserire nella categoria corrispondente al tipo di titolo nozionale) - 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 <b>b) Swaps e fras</b> - 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 <b>c) Opzioni su titoli</b> (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 italiano ..... 0200301 - opzioni put su titoli dello Stato italiano ..... 0200302 - 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 <b>d) Opzioni su futures o su indici di borsa</b> (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 <b>e) Opzioni su valute</b> - opzioni call ..... 0200501 - opzioni put..... 0200502 - altre opzioni su valute..... 0200503 <b>f) Opzioni su tassi di interesse</b> - cap ..... 0200601 - floor ..... 0200602 - opzioni su IRS (swaptions) ..... 0200603 - altre opz. Su tassi di interesse.... 0200604 <b>g) Opzioni su merci</b> - opzioni call ..... 0200231 - opzioni put..... 0200232 - altre opzioni..... 0200233 <b>h) Opzioni su altri valori o indicatori</b> ..... 0200070 <b>i) Forward</b> - titoli di debito ..... 0200223 - titoli di capitale..... 0200224 - quote di OICR..... 0200225 - valute e oro ..... 0200226 - merci ..... 0200227 - altro ..... 0200228 <b>j) Altri contratti derivati</b> ..... 0200230 <b>DERIVATI CREDITIZI</b> ..... 0200700
<b>2.b</b>			Derivati finanziari diversi dalle opzioni: - Futures..... 200010	

## MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4', 'A5', 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	LUNGH CAMP O	CODIFICHE
<b>Codifiche relative ai contratti derivati valide per i dati informativi diversi da quelli delle segnalazioni statistiche sui servizi d'investimento</b>	00551	7	- 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			
<b>Canali distributivi</b>	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
			Codifica valida per la voce 58665:
			- Canale telefonico ..... 86
			- Canale televisivo ..... 96
- Canale postale ..... 97			
- Altro ..... 109			
<b>Mercato di negoziazione</b>	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
<b>Categoria emittente</b>	00555	3	<b>Classificazione degli emittenti dei valori mobiliari.</b>
			<b>a) Categorie emittenti italiani</b>
			- Stato/Governo italiano – Banca Centrale (sottosettori 16 e 30)..... 812
			- Amministrazioni locali italiane (sottosettore 17)..... 017

## MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4', 'A5', 'W')

VARIABLE DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	LUNGH. CAMPO	CODIFICHE
			- Istituzioni finanziarie monetarie: - Banche (sottosectore 24)..... 024 - Fondi comuni di investimento monetario (sottosectore 21) ..... 021 - Altri intermediari (sottosectore 35)..... 035 - Istituzioni finanziarie italiane: - 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 operative finanziarie (sottogruppo 285) ..... 285 - Società di partecipazione (holding) di gruppi finanziari..... 287 - Società di partecipazione (holding) di gruppi non finanziari..... 288 - Altre (sottogruppi da 249 a 250, da 257 a 263, 268, da 275 a 284, 289, 329)..... 853 - Imprese di assicuraz. italiane (sottogruppo 294) ..... 294 - Società non finanziarie italiane: - Imprese controllate dalle Amministrazioni centrali..... 475 - Imprese controllate dalle Amministrazioni locali ..... 476 - Imprese controllate da altre Amministrazioni pubbliche..... 477 - Altre (sottogruppi da 430 a 450, da 480 a 492) ..... 854 - Altri residenti (sottogruppi di residenti non ricompresi nelle precedenti categorie) ..... 881 <b>b) Categorie emittenti esteri</b> - Stato/Governo estero - Banca centrale (sottogruppi da 704 a 707, da 724 a 726)..... 893 - Organismi internazionali (sottosectore 88) ..... 883 - Banche estere (sottogruppi da 727 a 729) ..... 884 - Istituzioni finanziarie estere dei paesi dell'Unione Europea (sottogruppi 717, 718, 746, 747, 753, 754, 756, 763, 765, 766, 776, 778)..... 868 - Imprese di assicurazione e fondi pensione esteri dei paesi dell'Unione Europea (sottogruppi 779, 782, 790, 800) ..... 869 - Altre finanziarie estere (sottogruppi 755, 764, 767 e 801) ..... 898 - Società non finanziarie estere (sottosectore 85) ..... 887 - Altri esteri (sottogruppi di non residenti non ricompresi nelle precedenti categorie) ..... 888
<b>Classificazione del deposito: classe di importo del cliente</b>	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

## MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4', 'A5', 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	LUNGH. CAMPO	CODIFICHE
			- fino a 12.500 euro ..... 66 - oltre 12.500 fino a 50.000 euro ..... 67 - oltre 50.000 euro ..... 89
<b>Tipo carta</b>	00902	2	- personale ..... 01 - aziendale ..... 02
<b>Categoria esercizi convenzionati</b>	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
<b>Tipo gestione</b>	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
<b>Rapporti con emittente</b>	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
<b>Natura del contratto derivato</b>	00940	3	- Non incorporato ..... 036 - Incorporati in passività finanziarie ..... 037 - Incorporati in attività finanziarie ..... 038 - Incorporati in altri derivati ..... 039
<b>Tipo soggetto delegante/delegato</b>	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
<b>Periodo iniziale di determinazione del tasso di interesse</b>	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
<b>Depositario</b>	01059	3	- Montetitoli ..... 082 - Altro depositario residente ..... 081 - Depositario non residente ..... 083 - Deposito presso il segnalante ..... 086 - Titolo non disponibile ..... 087

## MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4', 'A5', 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	LUNGH CAMP O	CODIFICHE
<b>Tipo cessione/ Attività proprie/ Cedute non cancellate</b>	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
<b>Classe importo tipologia titolo</b>	00594	3	fino a 50.000 euro ..... 088 oltre 50.000 fino a 150.000 euro ..... 090 oltre 150.000 euro ..... 091
<b>Tipo prodotto/ servizio</b>	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
<b>Qualità del credito  In bonis/ deteriorate</b>	00522	7	In bonis ..... 550010 Deteriorate ..... 550009  Codifiche da utilizzare per le "informazioni di vita residua" e per la voce 58892 (base inf. "A2"):

## MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4', 'A5', 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	LUNGH. CAMPO	CODIFICHE
			- Sofferenze ..... 551000 - Inadempienze probabili ..... 550028 - Scadute e/o sconfinanti deteriorate ..... 550016 - Altre attività ..... 550010  Codifiche da utilizzare per la voci 41065 "Finanziamenti ripartiti per forma tecnica" e 40993 "Interessi attivi e proventi assimilati su finanziamenti ripartiti per forma tecnica" (base inf. "W"):  - Sofferenze ..... 551000 - Inadempienze probabili ..... 550028 - Scadute e/o sconfinanti deteriorate approccio per debitore ..... 550022 - Scadute e/o sconfinanti deteriorate approccio per transazione con pulling effect ..... 550037 - Scadute e/o sconfinanti deteriorate approccio per transazione senza pulling effect ..... 550038 - Altri finanziamenti oggetto di concessioni ..... 550029 - Altri finanziamenti ..... 550030  Codifiche da utilizzare per la voce 40728 "Esposizioni creditizie garantite" (base inf. "W"):  - In bonis ..... 550030 - Altre attività oggetto di concessioni ..... 550029 - Deteriorate ..... 550009
<b>Accordo compensazione</b>	01169	1	- Sì ..... 1 - No ..... 2
<b>Causale frode</b>	01006	4	- Furto/smarrimento ..... 0871 - Contraffazione o duplicazione ..... 0872 - Mancata ricezione carta ..... 0873 - Frode "carta non presente" ..... 0875 - Altro ..... 0876
<b>Tecnologia chip</b>	01073	2	- Dispositivi compatibili con la tecnologia a microcircuito (standard SEPA/EMV) ..... 65 - Altro ..... 66
<b>Modalità di avvio</b>	01279	2	- File batch ..... 67 - Disposizione singola ..... 68
<b>Causale operazione</b>	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



## MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4', 'A5', 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	LUNGH CAMP O	CODIFICHE
			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
			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
<b>Portafoglio contabile</b>	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

## MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4', 'A5', 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	LUNGH CAMP O	CODIFICHE
			- 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
<b>Servizio in contropartita</b>	01175	4	- esecuzione di ordini per conto del cliente ..... 103 - gestione di portafogli ..... 104 - non applicabile ..... 770
<b>Natura attività sottostante dei contratti derivati</b>	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
<b>Tipologia esposizione</b>	01017	6	- senior..... 550005 - mezzanine ..... 550006 - junior..... 550007
<b>Tipologia di attività finanziaria</b>	00556	3	- titoli di debito ..... 203 - titoli di capitale..... 204 - quote di oicr ..... 205 - finanziamenti ..... 206
<b>Tipo garanzia</b>	00352	3	Codifica valida per le voci 58352, 58354, 58356: - garanzie reali e finanziarie..... 82 - garanzie personali ..... 59 - derivati creditizi ..... 83  Codifica valida per la voce 40728: Garanzie reali - pegni su depositi di contante ..... 70 - pegni su titoli ..... 71 - pegni su altri valori ..... 76 - ipoteche su immobili ..... 12

## MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4', 'A5', 'W')

VARIABLE DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	LUNGH. CAMPO	CODIFICHE
			- 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  Codifica valida per le voci 41087, 41088, 41089, 41091: - 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  (*) i valori entreranno in vigore a partire dal 01.01.2012
<b>Tipo servicer</b>	01185	5	Codifica valida per le voci 58083, 58086, 58202 e 58204: - banca originator ..... 20097 - altre banche residenti ..... 20098 - intermediari finanziari ex art. 107 TUB ..... 20099 - altri soggetti ..... 20101 - soggetti esteri ..... 20102
<b>Numero operazione</b>	00914	5	E' rappresentato mediante codici assegnati dalla Banca d'Italia. Per la segnalazione dei "crediti residui dopo il rimborso degli ABS" il numero operazione deve assumere il valore convenzionale 99998.
<b>Tipo contratto</b>	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

## MATRICE DEI CONTI (basi informative 'A1', 'A2', 'A3', 'A4', 'A5', 'W')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	LUNGH CAMP O	CODIFICHE
<b>Fascia scaduto</b>	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  Codifica valida per le voci 41061 e 41062 (base inf. "W"):  - Fino a 1 mese ..... 395 - Da oltre 1 mese fino a 3 mesi ..... 024 - Da oltre 3 mesi fino a 6 mesi..... 399 - Da oltre 6 mesi fino a 1 anno ..... 400 - Oltre 1 anno ..... 403
<b>Causale trattamento</b>	01071	3	- Interruzione di collegamento ..... 636 - Trattamento cartaceo ..... 637 - Altro..... 638
<b>Oggetto dei reclami</b>	01217	5	- Finanziamenti ..... 206 - Raccolta ..... 213 - Strumenti e servizi di pagamento..... 214 - Segnalazioni in CAI o sistemi di informazioni creditizie ..... 215 - Altro..... 216
<b>Tipo crediti</b>	04120	3	- Crediti temporaneamente inibiti ..... 49 - Crediti non inibiti..... 50
<b>Tipo approccio</b>	01296	4	- Per soggetto debitore..... 1501 - Per singola transazione..... 1502 - Per singola transazione con pulling effect..... 1503 - Per singola transazione senza pulling effect..... 1504
<b>Esposizioni con/senza concessioni</b>	01297	3	- Esposizioni creditizie oggetto di concessioni deteriorate ..... 285 - Altre esposizioni creditizie (diverse da 285)..... 286  Nei casi in cui non è richiesta la distinzione tra "esposizioni creditizie oggetto di concessioni deteriorate" e "altre esposizioni creditizie" deve essere utilizzato il codice "000".

## MATRICE DEI CONTI (base informativa 'LD')

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

## MATRICE DEI CONTI (base informativa 'LD')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	CODIFICHE
	<b>POSIZIONI CHIUSE ENTRO LA DATA DEL 31 DICEMBRE 2013</b> - 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
<b>Tipo garanzia</b>	- 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 e assicurativi: - 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 .....123 - Altro .....133 - Dati non ripartibili.....777
<b>Grado di copertura delle garanzie</b>	- 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
<b>Tipologia chiusura posizione</b>	- 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 - Accordo tra le parti - Forbearance.....1013 - Dati non ripartibili.....7777

## MATRICE DEI CONTI (base informativa 'LD')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	CODIFICHE
<b>Portafoglio regolamentare</b>	Deve essere utilizzata la codifica dei portafogli regolamentari di provenienza della controparte valida al momento dell'ingresso in default (cfr. Circolare n. 284 del 18 Giugno 2013, "Istruzioni per la compilazione delle segnalazioni delle perdite storicamente registrate sulle posizioni in default", paragrafo 11). Il valore "Dati non ripartibili" corrisponde a 77.
<b>Codice censito</b>	Codice identificativo attribuito dall'Anagrafe dei soggetti della Banca d'Italia.
<b>Progressivo transazione</b>	Codice numerico progressivo per ciascuna controparte debitrice attribuito dall'intermediario a ciascuna transazione.
<b>Provenienza precedente scaduto</b>	- Si ..... 1 - No ..... 2
<b>Status inizio</b>	<p>PER LE POSIZIONI CLASSIFICATE IN DEFAULT ENTRO IL 31 DICEMBRE 2014</p> <p>Sofferenza ..... 551000                      Incagli ..... 550002                      Ristrutturate ..... 550014                      Scadute e/o sconfinanti deteriorate ..... 550016                      Sofferenze già incomplete workout ..... 550026</p> <p>PER LE POSIZIONI CLASSIFICATE IN DEFAULT A PARTIRE DAL 1° GENNAIO 2015</p> <p>Sofferenza forbearance ..... 551003                      Sofferenza non forbearance ..... 551004                      Inadempienza probabile forbearance ..... 550039                      Inadempienza probabile non forbearance ..... 550040                      Scadute e/o sconfinanti deteriorate forbearance ..... 550041                      Scadute e/o sconfinanti deteriorate non forbearance ..... 550042                      Sofferenze già incomplete workout ..... 550026</p>
<b>Status fine</b>	<p>PER LE POSIZIONI CLASSIFICATE IN DEFAULT ENTRO IL 31 DICEMBRE 2014</p> <p>Sofferenza ..... 551000                      Incagli ..... 550002                      Crediti in bonis ..... 550010                      Ristrutturate ..... 550014                      Scadute e/o sconfinanti deteriorate ..... 550016                      Incomplete workout ..... 550027</p> <p>PER LE POSIZIONI CLASSIFICATE IN DEFAULT A PARTIRE DAL 1° GENNAIO 2015</p> <p>Sofferenza forbearance ..... 551003</p>

## MATRICE DEI CONTI (base informativa 'LD')

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	CODIFICHE
	Sofferenza non forbearance .....551004 Inadempienza probabile forbearance .....550039 Inadempienza probabile non forbearance .....550040 Crediti in bonis forbearance .....550043 Crediti in bonis non forbearance .....550044 Scadute e/o sconfinanti deteriorate forbearance .....550041 Scadute e/o sconfinanti deteriorate non forbearance .....550042 Incomplete workout.....550027



## SEGNALAZIONI DI VIGILANZA CONSOLIDATA (basi informative 'M1', 'M2')

VARIABLE DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	Lungh. campo	CODIFICHE
<b>Residenza</b>	-	-	<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"> <li>- rapporti con soggetti residenti in Italia.....1</li> <li>- rapporti con soggetti non residenti in Italia.....2</li> </ul>
<b>Divisa</b>	-	-	<p>L'informazione è richiesta nella parte fissa del record "movimento". I codici da utilizzare sono:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- euro .....1</li> <li>- altre valute.....2</li> </ul>
<b>Durata</b>	-	-	<p>L'informazione e' richiesta nella parte fissa nel record "movimento". Va utilizzato per convenzione il codice "00" (due volte zero).</p>
<b>Sottosistema di rilevazione</b>	02029	5	<ul style="list-style-type: none"> <li>- Consolidamento prudenziale ..... 104</li> <li>- Consolidamento contabile.....106</li> </ul>
<b>INFORMAZIONI NOMINATIVE</b>  <b>Soggetto di riferimento</b>	01165	13	<p><b>Codifica valida per le voci 23522, 23524, 23526 e 23528</b></p> <p>Tale attributo consente di individuare la partecipata del gruppo cui si riferiscono le informazioni (voci 23522, 23524, 23526) o la società di partecipazione nel gruppo che possiede l'investimento (23528).</p> <p>Per i dettagli sulle modalità di compilazione di tale variabile cfr. quanto detto per le informazioni nominative per la matrice dei conti.</p>
<b>INFORMAZIONI NOMINATIVE</b>  <b>Codice Censito di tipo B</b>	01172	13	<p><b>Codifica valida per la voce 23528</b></p> <p>Tale attributo consente di individuare la partecipata del gruppo cui si riferiscono le informazioni.</p> <p>Per i dettagli sulle modalità di compilazione di tale variabile cfr. quanto detto per le informazioni nominative per la matrice dei conti.</p>
<b>Vita residua delle operazioni con riferimento alla data di revisione dei rendimenti (B)</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"> <li>- a vista e a revoca .....010</li> <li>- da oltre 1 giorno a 7 giorni.....025</li> <li>- da oltre 7 giorni a 1 mese.....035</li> <li>- da oltre 1 mese a 3 mesi .....040</li> <li>- da oltre 3 mesi a 6 mesi .....050</li> <li>- da oltre 6 mesi a 1 anno .....060</li> <li>- da oltre 1 anno a 18 mesi .....070</li> <li>- da oltre 18 mesi a 2 anni .....080</li> <li>- da oltre 2 anni a 3 anni .....160</li> <li>- da oltre 3 anni a 4 anni .....170</li> <li>- da oltre 4 anni a 5 anni .....180</li> <li>- da oltre 5 anni a 7 anni .....310</li> <li>- da oltre 7 anni a 10 anni .....330</li> <li>- da oltre 10 anni a 15 anni .....430</li> <li>- da oltre 15 anni a 20 anni .....460</li> <li>- oltre 20 anni .....490</li> <li>- irredimibile .....903</li> <li>- durata indeterminata.....900</li> </ul> <p>Codifica valida per la sottosezione "3.5 Vita residua: Rischio di liquidità":</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- A vista e a revoca: .....010</li> <li>- oltre 1 giorno a 7 giorni .....025</li> </ul>

## SEGNALAZIONI DI VIGILANZA CONSOLIDATA (basi informative 'M1', 'M2')

VARIABLE DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	Lungh. campo	CODIFICHE			
<b>Vita residua delle operazioni (A)</b>	00040	3	- 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						
<b>Indicatore di quotazione</b>	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			
<b>Portafoglio contabile</b>	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			
			- passività finanziarie valutate al costo ammortizzato..... 522			
			- 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 da 36400 a 36404:
						- portafoglio di negoziazione di vigilanza..... 550
						- portafoglio bancario..... 553
			<b>Tipo garanzia</b>	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						
- banche..... 86						
- società finanziarie..... 87						
- società di assicurazione..... 88						

## SEGNALAZIONI DI VIGILANZA CONSOLIDATA (basi informative 'M1', 'M2')

VARIABILI DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	Lungh. campo	CODIFICHE
			- 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
<b>Codice valuta</b>	00007	3	Unità di conto in cui sono espressi i fenomeni segnalati. I codici sono attribuiti dalla Banca d'Italia – Servizio RES.
<b>Tipo tasso</b>	00113	2	- tasso fisso .....83 - tasso indicizzato .....84
<b>Tipologia esposizione</b>	01017	6	- senior.....550005 - mezzanine .....550006 - junior.....550007
<b>Stato di residenza della controparte</b>	00016	3	Viene utilizzata la codifica predisposta e gestita dalla Banca d'Italia - Servizio RES. Per ciò che concerne i rapporti con gli Organismi Internazionali, devono essere utilizzati gli specifici codici assegnati ai suddetti organismi. Per la base informativa M1 viene utilizzata la codifica predisposta e gestita dalla Banca d'Italia - Servizio RES in conformità alle indicazioni riportate nel Regolamento della Commissione Europea sulle norme tecniche di attuazione (ITS) in materia di segnalazioni armonizzate delle banche e delle imprese di investimento.
<b>Stato emittente</b>	01215	5	L'opzione "Altri paesi" (Regolamento di esecuzione (UE) 2015/227 della Commissione, Allegato V, Parte II, par. 17, riga 108) corrisponde al codice 796.
<b>Localizzazione geografica delle attività e passività</b>	00063	3	- 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  - Nazionali .....086 - Non nazionali .....706
<b>Settore controparte</b>	00011	3	Codifiche 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 e 771 ad eccezione della quota parte relativa alle banche multilaterali di sviluppo, 776 per la quota parte relativa all'ESM, 794) .....902

## SEGNALAZIONI DI VIGILANZA CONSOLIDATA (basi informative 'M1', 'M2')

VARIABLE DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	Lungh. campo	CODIFICHE
			- Autorità bancarie centrali (sg. 300, da 724 a 726, 791) ..... 903 - Banche (sg. 245, da 727 a 729, 770 e 771 per la quota parte relativa alle banche multilaterali di sviluppo)..... 904 - Altre società finanziarie (sg., 101, da 247 a 250, da 257 a 259, da 263 a 268, da 270 a 285, da 287 a 289, da 294 a 296, 329, 717, 718, 746, 747, da 753 a 756, da 763 a 767, 776 ad eccezione della quota parte relativa all'ESM, 778, 779, 782, 790, 800 e 801)..... 923 - Società non finanziarie (sg. 430, 432, 450, da 475 a 477, da 480 a 482, da 490 a 492, da 757 a 759 ..... 907 - Famiglie e istituzioni senza finalità di lucro (sg. 500, 501, 551, 552, da 600 a 615, da 768 a 785 esclusi i valori 770, 771 e 776) ..... 908  Le indicazioni dei Sottogruppi qui riportate sono puramente indicative. Sull'argomento si rimanda al Regolamento della Commissione Europea sulle norme tecniche di attuazione (ITS) in materia di segnalazioni statistiche armonizzate delle banche e delle imprese di investimento.
<b>Attività economica: ramo</b>	01118	5	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). Campo alfanumerico con allineamento a sinistra. La parte non utilizzata del campo deve contenere il carattere "blank"
<b>Qualità del credito</b>  <b>In bonis/ deteriorate</b>	00522	7	- In bonis ..... 550010 - Deteriorate ..... 550009  Codifiche da utilizzare per la voce 36332 "Finanziamenti ripartiti per forma tecnica":  - Sofferenze..... 551000 - Inadempienze probabili..... 550028 - Scadute e/o sconfinanti deteriorate approccio per debitore..... 550022 - Scadute e/o sconfinanti deteriorate approccio per transazione con pulling effect..... 550037 - Scadute e/o sconfinanti deteriorate approccio per transazione senza pulling effect ..... 550038 - Altri finanziamenti oggetto di concessioni ..... 550029 - Altri finanziamenti..... 550030  Codifiche da utilizzare per le "informazioni di vita residua":  - Sofferenza..... 551000 - Inadempienze probabili..... 550028 - Scadute e/o sconfinanti deteriorate ..... 550016 - Altre attività ..... 550010  Codifiche da utilizzare per la voce 36239 "Esposizioni creditizie garantite" (base inf. "M2"):  - In bonis ..... 550030 - Altre attività oggetto di concessioni..... 550029 - Deteriorate ..... 550009

## SEGNALAZIONI DI VIGILANZA CONSOLIDATA (basi informative 'M1', 'M2')

VARIABILI DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	Lungh. campo	CODIFICHE
<b>Tipo cessione/ Attività proprie/ Cedute non cancellate</b>	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 Cartolarizzazioni ..... 824 PCT ..... 258
<b>Metodologia di consolidamento</b>	01222	3	Gruppo CRR - integrazione totale ..... 337 Gruppo CRR – integrazione proporzionale ..... 338 Gruppo CRR – metodo del patrimonio netto ..... 339
<b>Metodologia di consolidamento – Gruppo contabile</b>	01287	3	Gruppo contabile – consolidamento totale ..... 340 Gruppo contabile – consolidamento proporzionale ..... 341 Gruppo contabile – metodo del patrimonio netto ..... 342
<b>Gerarchia del fair value</b>	01190	1	livello 1 ..... 1 livello 2 ..... 2 livello 3 ..... 3
<b>Tipo relazione</b>	01285	3	filiazione ..... 191 joint venture ..... 192 società collegata ..... 193
<b>Tipologia parte correlata</b>	02025	2	Impresa madre ed entità che controllano congiuntamente o esercitano un'influenza notevole ..... 81 Filiazioni ed altre entità dello stesso gruppo ..... 82 Società collegate e joint ventures ..... 83 Dirigenti con responsabilità strategica dell'ente o della sua impresa madre ..... 84 Altre parti correlate ..... 85
<b>Fascia scaduto</b>	01216	3	Inferiore o uguale a 30 giorni ..... 395 Maggiore di 30 giorni e inferiore o uguale a 60 giorni ..... 396 Maggiore di 60 giorni e inferiore o uguale a 90 giorni ..... 397 Maggiore di 90 giorni e inferiore o uguale a 180 giorni ..... 399 Maggiore di 180 giorni e inferiore o uguale a un anno ..... 400 Maggiore di un anno ..... 403  Codifiche da utilizzare per le voci: <b>23610, 23612, 23614 e 23616</b>  Non scaduto o scaduto inferiore o uguale a 30 giorni ..... 393 Maggiore di 30 giorni e inferiore o uguale a 60 giorni ..... 396 Maggiore di 60 giorni e inferiore o uguale a 90 giorni ..... 397  Codifiche da utilizzare per le voci: <b>23622, 23624, 23626, 23628, 23662, 23664, 23666 e 23668</b>  Inadempienze probabili o esposizioni scadute da non più di 90 giorni ..... 394 Maggiore di 90 giorni e inferiore o uguale a 180 giorni ..... 399 Maggiore di 180 giorni e inferiore o uguale a un anno ..... 400 Maggiore di un anno ..... 403

## SEGNALAZIONI DI VIGILANZA CONSOLIDATA (basi informative 'M1', 'M2')

VARIABLE DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	Lungh. campo	CODIFICHE
<b>Tipo rettifica</b>	01280	3	- Svalutazioni specifiche per attività finanziarie valutate individualmente ..... 250 - Svalutazioni specifiche per attività finanziarie valutate collettivamente ..... 251 - Svalutazioni collettive per perdite sostenute ma non riportate ..... 252 - Cancellazioni accumulate ..... 259
<b>Tipo copertura</b>	01281	3	- Fair value ..... 253 - Flussi finanziari ..... 254
<b>Causale variazione</b>	01282	3	- Aumenti dovuti a importi accantonati per perdite stimate su crediti nell'esercizio ..... 121 - Diminuzioni dovute a importi stornati per perdite stimate su crediti nell'esercizio ..... 122 - Diminuzioni dovute a importi assunti a fronte di svalutazioni ..... 123 - Trasferimenti tra svalutazioni ..... 124 - Altre rettifiche ..... 125
<b>Tipologia di fair value option</b>	01283	3	- Disallineamenti contabili ..... 255 - Gestione al fair value del portafoglio ..... 256 - Contratti ibridi ..... 257
<b>Data di entrata</b>	01284	8	Va indicata nel formato AAAAMMGG.
<b>Codice del titolo</b>	00032	12	Ai fini della segnalazione degli strumenti partecipativi di cui alle voci <b>23528</b> e <b>23530</b> deve essere utilizzato il "codice ISIN" comprensivo del valore di controllo.
<b>Codice del titolo (non ISIN)</b>	01286	20	Ai fini della segnalazione degli strumenti partecipativi di cui alle voci <b>23528</b> e <b>23530</b> , in mancanza del codice ISIN, deve essere utilizzato un codice che individui il titolo in modo univoco.  Campo alfanumerico con allineamento a sinistra. La parte non utilizzata del campo deve contenere il carattere "blank".
<b>Tipologia di misura di tolleranza</b>	01295	3	- Strumenti con modifiche nei loro termini e condizioni ..... 131 - Rifiinanziamenti ..... 132
<b>Tipo approccio</b>	01296	4	- Per soggetto debitore ..... 1501 - Per singola transazione ..... 1502 - Per singola transazione con pulling effect ..... 1503 - Per singola transazione senza pulling effect ..... 1504
<b>Esposizioni con/senza concessioni</b>	01297	3	- Esposizioni creditizie oggetto di concessioni deteriorate ..... 285 - Altre esposizioni creditizie (diverse da 285) ..... 286  Nei casi in cui non è richiesta la distinzione tra "esposizioni creditizie oggetto di concessioni deteriorate" e "altre esposizioni creditizie" deve essere utilizzato il codice "000".

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E  
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',  
'LY', '1' 'L1', 'EY' e 'E1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	Lungh. campo	CODIFICHE
<b>Durata</b>	-	-	L'informazione è richiesta nella parte fissa del record "movimento". - Imprecisabile o irrilevante..... 3
<b>Residenza</b>	-	-	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
<b>Divisa</b>	-	-	L'informazione è richiesta nella parte fissa del record "movimento". Va utilizzato per convenzione il codice "1".
<b>Appartenenza patrimonio</b>	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
<b>Approccio</b>	01255	3	- Approccio semplificato..... 321 - Approccio delta-plus: rischio gamma..... 322 - Approccio delta-plus: rischio vega ..... 323 - Approccio di scenario ..... 324 - Non applicabile ..... 777
<b>Assimilate Amministrazioni Centrali</b>	01225	1	- Sì ..... 1 - No ..... 2
<b>Attività economica: ramo</b>	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).
<b>Cartolarizzazione – posizioni fuori bilancio</b>	01244	3	- Garanzie con carattere di sostituti del credito ..... 643 - IRS/CRS..... 644 - Linee di liquidità idonee ..... 645 - Altro..... 646 - Non applicabile ..... 770
<b>Categoria esposizione</b>	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' 'L1', 'EY' e 'E1')**

VARIABLE DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	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
<b>Categoria intermediario</b>	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
<b>CCP qualificata</b>	01230	1	- Sì..... 1 - No ..... 2 - Non applicabile ..... 7
<b>Classe di merito creditizio</b>	01134	3	Numero ordinale che rappresenta la classe di merito creditizio. L'opzione "non applicabile" corrisponde al codice 0.
<b>Classe di merito di credito</b>	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



**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E  
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',  
'LY', '1' 'L1', 'EY' e 'E1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	Lungh. campo	CODIFICHE
			<b>Rischio di liquidità:</b> - CQS1 ..... 128 - CQS2 ..... 129 - CQS3 ..... 130 - Non applicabile ..... 77
<b>Classe di merito di credito originaria</b>	01235	3	<b>Cartolarizzazioni – metodologia standardizzata</b> - CQS1 ..... 128 - CQS2 ..... 129 - CQS3 ..... 130 - CQS4 ..... 131 - Altro e privo di rating ..... 168 - Non applicabile ..... 77  <b>Cartolarizzazioni – metodologia IRB</b> - 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 - Non applicabile ..... 77
<b>Classe di ponderazione</b>	01239	3	- Classe A ..... 175 - Classe B ..... 176 - Classe C ..... 177 - Classe D ..... 178 - Classe E ..... 179 - Non applicabile ..... 77
<b>Codice valuta</b>	00007	3	Unità di conto in cui sono espressi i fenomeni segnalati. I codici sono attribuiti dalla Banca d'Italia - Servizio RES.  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), HRK (229), HUF (153), ISK (62), JPY (71), 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), HRK (229), HUF (153), JPY (71), 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)

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E  
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',  
'LY', 'I' 'L1', 'EY' e 'E1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	Lungh. campo	CODIFICHE
			L'opzione "Altro" corrisponde al codice 824 L'opzione "Totale" corrisponde al codice 820  <u>Attività vincolate</u> L'opzione "Non applicabile" corrisponde al codice 777
<b>Clausola di rimborso anticipato</b>	01237	1	- Sì..... 1 - No ..... 2 - Non applicabile ..... 7
<b>Codice interno operazione di cartolarizzazione</b>	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.
<b>Condizioni di mercato</b>	02027	1	- Sì..... 1 - No ..... 2
<b>Conformità alla normativa</b>	01242	1	- Sì..... 1 - No ..... 2 - Non applicabile ..... 7
<b>Data di creazione</b>	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.
<b>Data di scadenza finale legale</b>	01260	8	Va indicata nel formato AAAAMMGG.
<b>Deflussi/ Afflussi</b>	04115	3	- Deflussi ..... 634 - Afflussi ..... 635
<b>Delibera quadro</b>	02023	1	- Sì..... 1 - No..... 2
<b>Deposito garantito</b>	01246	1	- Sì..... 1 - No ..... 2
<b>Detrazione</b>	01236	1	- Sì..... 1 - No ..... 2 - Non applicabile ..... 7
<b>Esposizione diretta/ indiretta</b>	01224	3	- Diretta ..... 166 - Indiretta ..... 167 - Non applicabile ..... 77
<b>Esposizione rotativa</b>	01238	3	- Sì..... 647 - No ..... 648 - Altro..... 649
<b>Eventi di perdita</b>	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

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E  
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',  
'LY', '1' 'L1', 'EY' e 'E1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	Lungh. campo	CODIFICHE			
			- Totale eventi di perdita ..... 118			
<b>Fattore di conversione</b>	01133	3	- 0% - rischio basso ..... 1			
			- 20% - rischio medio-basso ..... 2			
			- 50% - medio ..... 3			
			- 100% - pieno ..... 10			
			- 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			
			<b>Fattore di ponderazione</b>	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						

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E  
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',  
'LY', '1' 'L1', 'EY' e 'E1')**

VARIABLE DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	Lungh. campo	CODIFICHE
Fattore di ponderazione			<p><u>Rischi di mercato:</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- 7 -10%..... 47</li> <li>- 12 -18%..... 42</li> <li>- 20-35%..... 43</li> <li>- 40-75%..... 48</li> <li>- 100%..... 10</li> <li>- 150%..... 18</li> <li>- 200%..... 4</li> <li>- 225% ..... 21</li> <li>- 250%..... 19</li> <li>- 300% ..... 23</li> <li>- 350% ..... 30</li> <li>- 425% ..... 45</li> <li>- 500% ..... 24</li> <li>- 650% ..... 46</li> <li>- 750% ..... 25</li> <li>- 850% ..... 26</li> <li>- 1250% - con rating ..... 31</li> <li>- 1250% - privo di rating ..... 32</li> <li>- Look-through ..... 34</li> <li>- Metodo formula di vigilanza ..... 149</li> <li>- Approccio della valutazione interna (ABCP)..... 127</li> <li>- Altro ..... 169</li> <li>- Non applicabile ..... 77</li> </ul> <p><u>Leva finanziaria:</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- 0% ..... 1</li> <li>- maggiore di 0% e minore/uguale a 12% ..... 141</li> <li>- maggiore di 12% e minore/uguale a 20% ..... 142</li> <li>- maggiore di 20% e minore/uguale a 50% ..... 143</li> <li>- maggiore di 50% e minore/uguale a 75% ..... 44</li> <li>- maggiore di 75% e minore/uguale a 100% ..... 144</li> <li>- maggiore di 100% e minore/uguale a 425% ..... 145</li> <li>- maggiore di 425% e minore/uguale a 1250% ..... 146</li> <li>- esposizioni in stato di default ..... 147</li> <li>- esposizioni fuori bilancio a rischio basso (CCF 0%) ..... 148</li> </ul>
			<p><b>Forma giuridica societaria</b></p> <p>01254      4</p> <p>Campo alfanumerico con allineamento a sinistra. La parte non utilizzata del campo deve contenere il carattere "blank".</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Società per azioni ..... SPA</li> <li>- Mutua/cooperativa..... COPE</li> <li>- altro ..... VV1</li> </ul>
<b>Forma tecnica</b>	01234	3	<ul style="list-style-type: none"> <li>- Totale attività di rischio per cassa ..... 101</li> <li>- Garanzie rilasciate e impegni a erogare fondi ..... 103</li> <li>- Operazioni SFT ..... 104</li> <li>- Contratti derivati e operazioni con regolamento a lungo termine..... 105</li> <li>- Compensazione tra prodotti diversi ..... 106</li> <li>- Non applicabile ..... 777</li> </ul> <p><u>Cartolarizzazioni:</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Totale attività di rischio per cassa ..... 101</li> <li>- Attività di rischio fuori bilancio e derivati ..... 102</li> <li>- Non applicabile ..... 777</li> </ul>

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E  
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',  
'LY', '1' 'L1', 'EY' e 'E1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	Lungh. campo	CODIFICHE
			<b>Rischi di mercato:</b> - Attività e passività in bilancio..... 107 - Attività e passività fuori bilancio..... 108 - Derivati ..... 109 - Non applicabile ..... 777
<b>Garanzie rilasciate e impegni a erogare fondi</b>	01232	1	- Sì ..... 1 - No ..... 2 - Non applicabile ..... 7
<b>Grado di liquidità e qualità creditizia</b>	01223	3	- Elevatissime ..... 172 - Elevate..... 173 - Altro ..... 174 - Non applicabile ..... 77
<b>Identificativo della cartola- rizzazione</b>	01240	45	Campo alfanumerico con allineamento a sinistra. La parte non utilizzata del campo deve contenere il carattere "blank".
<b>Identificativo dell'originator</b>	01261	45	Campo alfanumerico con allineamento a sinistra. La parte non utilizzata del campo deve contenere il carattere "blank".
<b>INFORMA- ZIONI NOMINATIVE:</b>			<b>Grandi esposizioni su base individuale e consolidata:</b>
<b>Codice Censito di tipo A</b>	00212	13	Codice censito (cfr. quanto riportato per le informazioni nominative della matrice dei conti) della singola controparte ovvero della capogruppo per gli affidamenti concessi a gruppi di clienti connessi.  Voci 59102 e 34102: Codice censito (cfr. quanto riportato per le informazioni nominative della matrice dei conti) della singola controparte ovvero della componente del gruppo di clienti connessi.  Voci 34328, 34330, 34340: Codice censito (cfr. quanto riportato per le informazioni nominative della matrice dei conti) della componente del gruppo.
<b>Soggetto connesso</b>	02018	13	Codice censito (cfr. quanto riportato per le informazioni nominative della matrice dei conti) della componente del gruppo di clienti connessi.
<b>Importo dell'evento di perdita</b>	01298	3	- Superiore alla soglia minima di perdita ..... 101 - ≥10.000 e <20.000..... 102 - ≥20.000 e <100.000..... 103 - ≥100.000 e <1.000.000..... 104 - ≥1.000.000..... 105
<b>Infra-gruppo</b>	02024	1	- Sì..... 1 - No ..... 2
<b>Interesse economico netto</b>	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

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E  
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',  
'LY', 'I' 'L1', 'EY' e 'E1')**

VARIABLE DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	Lungh. campo	CODIFICHE
			- Esenzione ex CRR, art. 405(3) ..... 319 - Non applicabile ..... 777 - Altro..... 320
<b>Linee di business</b>	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
<b>Metodo utilizzato</b>	01206	3	- full look through..... 310 - partial look through ..... 311 - schema granulare ..... 312 - structured-based approach ..... 313 - Sottostanti tutti sconosciuti ..... 000
<b>Metodologia applicata</b>	01125	3	- Metodologia IRB – di base ..... 152 - Metodologia IRB – avanzata ..... 153  Voci 59067 e 34067: - Metodologia standard ..... 151 - Metodologia IRB – di base ..... 152 - Metodologia IRB – avanzata ..... 153 - Metodologia IRB..... 155 - Metodologia mista (Standard e IRB) ..... 327 - Non applicabile ..... 777  Voci 59078 e 34078: - Metodo avanzato ..... 333 - Metodologia standard ..... 332 - Metodo dell'esposizione originaria ..... 328 - Non applicabile..... 777  <u>Rischi di mercato:</u> - Metodo basato sulle fasce di scadenza ..... 329 - Metodo basato sulle fasce di scadenza ampliato ..... 330 - Metodo semplificato ..... 331  <u>Leva finanziaria:</u> - Metodologia Standard ..... 151 - Metodologia IRB ..... 155 - Non applicabile..... 777
<b>Metodologia di consolidamento</b>	01222	3	- Filiazione consolidata integralmente..... 334 - Filiazione consolidata parzialmente ..... 335
<b>Modalità di calcolo segnaletico</b>	01227	3	- 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

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E  
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',  
'LY', '1' 'L1', 'EY' e 'E1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	Lungh. campo	CODIFICHE
<b>Operatività ordinaria</b>	02020	1	- Si..... 1 - No ..... 2
<b>Paese del mercato di quotazione</b>	00934	5	Viene utilizzata la codifica predisposta e gestita dalla Banca d'Italia – Servizio RES.  Voci 59568 e 34568: Paesi segnalabili (utilizzando i corrispondenti codici numerici): Albania, Bulgaria, Croazia, Danimarca, Egitto, Giappone, Islanda, Liechtenstein, Macedonia, Norvegia, Polonia, Regno Unito, Repubblica Ceca, Romania, Russia, Serbia, Svezia, Svizzera, Turchia, Ucraina, Ungheria, USA.  L'opzione "Altro" corrisponde al codice 61013 L'opzione "Totale" corrisponde al codice 62009 L'opzione "Area Euro" corrisponde al codice 62002
<b>Parere positivo</b>	02022	1	- Si..... 1 - No ..... 2 - Non applicabile ..... 7
<b>INFORMAZIONI NOMINATIVE:</b>			<u>Soggetti collegati su base individuale e consolidata:</u>
<b>Parte correlata</b>	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.
<b>Soggetto connesso</b>	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.
<b>PMI</b>	01245	1	- Si ..... 1 - No ..... 2
<b>Portafoglio di negoziazione di correlazione</b>	1243	1	- Si ..... 1 - No ..... 2
<b>Portafoglio SA e IRB</b>	01130	3	<u>Rischio di credito e di controparte - metodologia standardizzata:</u> - 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

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E  
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',  
'LY', 'I' 'L1', 'EY' e 'E1')**

VARIABLE DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	Lungh. campo	CODIFICHE
			<ul style="list-style-type: none"> <li>- Organizzazioni internazionali ..... 57</li> <li>- Imprese e altri soggetti..... 58</li> <li>- Esposizioni al dettaglio..... 59</li> <li>- Esposizioni a breve termine verso imprese e altri soggetti o intermediari vigilati ..... 157</li> <li>- Esposizioni verso organismi di investimento collettivo del risparmio (O.I.C.R.)..... 61</li> <li>- Esposizioni garantite da immobili..... 62</li> <li>- Esposizioni sotto forma di obbligazioni bancarie garantite ..... 63</li> <li>- Esposizioni in stato di default..... 158</li> <li>- Esposizioni ad alto rischio..... 65</li> <li>- Esposizioni in strumenti di capitale ..... 159</li> <li>- Altre esposizioni ..... 185</li> </ul> <p><u>Rischio di credito e di controparte - metodologia IRB:</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Amministrazioni centrali e banche centrali..... 51</li> <li>- Intermediari vigilati, enti pubblici e territoriali e altri soggetti..... 160</li> <li>- Esposizioni verso o garantite da imprese: Finanziamenti specializzati ..... 72</li> <li>- Esposizioni verso o garantite da imprese: PMI ..... 66</li> <li>- Esposizioni verso o garantite da imprese: Altre imprese ..... 67</li> <li>- Esposizioni al dettaglio: Esposizioni garantite da immobili: PMI..... 162</li> <li>- -Esposizioni al dettaglio: Esposizioni garantite da immobili: persone fisiche</li> <li>- Esposizioni al dettaglio: Esposizioni rotative al dettaglio qualificate ..... 75</li> <li>- Esposizioni al dettaglio: Altre esposizioni al dettaglio: PMI..... 76</li> <li>- Esposizioni al dettaglio: Altre esposizioni al dettaglio: persone fisiche ..... 78</li> <li>- Totale ..... 184</li> </ul>
<b>Posizione diretta</b>	01228	1	<ul style="list-style-type: none"> <li>- Si..... 1</li> <li>- No ..... 2</li> </ul>
<b>Prima data di chiusura prevedibile</b>	01259	8	Va indicata nel formato AAAAMMGG.
<b>Rilevanza</b>	02019	1	<ul style="list-style-type: none"> <li>- Si..... 1</li> <li>- No..... 2</li> </ul>
<b>Ruolo nella cartolarizzazione</b>	01127	3	<ul style="list-style-type: none"> <li>- Originator ..... 101</li> <li>- Investitore ..... 102</li> <li>- Sponsor..... 103</li> <li>- Cedente ..... 104</li> <li>- Non applicabile ..... 890</li> </ul> <p>Nota. Si precisa che il cedente corrisponde al prestatore originario.</p>
<b>Scadenza dell'operazione di cartolarizzazione</b>	4367	8	Data contabile di riferimento della valutazione. Va indicata nel formato AAAAMMGG.
<b>Sottosistema di rilevazione</b>	02029	5	<ul style="list-style-type: none"> <li>- Consolidamento a fini prudenziali (CRR/CRD) ..... 104</li> <li>- Sottogruppo di liquidità ..... 105</li> </ul>
<b>Stato della controparte</b>	00016	3	Viene utilizzata la codifica predisposta e gestita dalla Banca d'Italia - Servizio RES in conformità alle indicazioni riportate nel Regolamento della Commissione Europea sulle norme tecniche di attuazione (ITS) in materia



**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E  
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',  
'LY', '1' 'L1', 'EY' e 'E1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	Lungh. campo	CODIFICHE
			<p>di segnalazioni prudenziali armonizzate delle banche e delle imprese di investimento.</p> <p>L'opzione "Altri paesi" (Regolamento (UE) n. 227/2015, Allegato II, Parte II, par. 3.4, riga 80) corrisponde al codice 796.</p> <p>Voci: 59067 e 34067: l'opzione "altro" (per il mancato superamento della soglia del 20%) corrisponde al codice 707</p> <p>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</p>
<b>Tempo di inadempimento</b>	00294	2	<ul style="list-style-type: none"> <li>- fino al 4° giorno lavorativo ..... 39</li> <li>- dal 5° al 15° giorno lavorativo ..... 21</li> <li>- dal 16° al 30° giorno lavorativo ..... 22</li> <li>- dal 31° al 45° giorno lavorativo ..... 23</li> <li>- oltre il 45° giorno lavorativo ..... 24</li> </ul>
<b>Tipo di cartolarizzazione</b>	01126	3	<ul style="list-style-type: none"> <li>- Tradizionale ..... 604</li> <li>- Sintetica ..... 605</li> <li>- Qualsiasi ..... 607</li> <li>- Non applicabile ..... 770</li> </ul>
<b>Tipo di rischio</b>	00356	3	<ul style="list-style-type: none"> <li>- Titoli di debito: totale ..... 111</li> <li>- Titoli di debito: rischio generico ..... 112</li> <li>- Titoli di debito: rischio specifico ..... 113</li> <li>- Titoli di capitale: totale ..... 114</li> <li>- Titoli di capitale: rischio generico ..... 115</li> <li>- Titoli di capitale: rischio specifico ..... 116</li> <li>- Rischio di cambio ..... 117</li> <li>- Rischio di posizione in merci ..... 118</li> <li>- Rischio generico: totale ..... 119</li> <li>- Rischio specifico: totale ..... 120</li> <li>- Totale posizioni ..... 121</li> </ul>
<b>Tipo garanzia</b>	00352	3	<p><u>Rischio di credito e di controparte - metodologia standardizzata:</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Garanzie personali ..... 59</li> <li>- Derivati su crediti ..... 56</li> <li>- Garanzie reali assimilate alle personali ..... 57</li> <li>- Garanzie reali - metodo semplificato ..... 58</li> <li>- Non applicabile ..... 777</li> </ul> <p><u>Rischio di credito e di controparte - metodologia IRB:</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Garanzie personali ..... 59</li> <li>- Derivati su crediti ..... 56</li> <li>- Garanzie reali assimilate alle personali ..... 57</li> <li>- Garanzie reali finanziarie ..... 134</li> <li>- Altre garanzie reali idonee: garanzie immobiliari ..... 135</li> <li>- Altre garanzie reali idonee: cessioni di crediti ..... 136</li> <li>- Altre garanzie reali idonee: altro ..... 137</li> <li>- <i>Double default</i>: garanzie personali e derivati su credito ..... 138</li> <li>- Non applicabile ..... 777</li> </ul>

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E  
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',  
'LY', 'I' 'L1', 'EY' e 'E1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	Lungh. campo	CODIFICHE
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 - 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  - 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 <sub>0</sub> ] alla data di emissione della prima <i>tranche</i> ..... 212 - Valore nominale complessivo <i>tranches</i> emesse ..... 213 - Esposizione originaria [E <sub>0</sub> ] ..... 214 - Esposizione originaria al netto delle rettifiche di valore complessive [E <sub>1</sub> ] ..... 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
Tipo importo			

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E  
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',  
'LY', '1' 'L1', 'EY' e 'E1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	Lungh. campo	CODIFICHE
Tipo importo			- 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 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 <sub>0</sub> ] connessa con esposizioni in stato di default ..... 239
			- Esposizione originaria [E <sub>0</sub> ] connessa con esposizioni in stato di default dall'ultima data di riferimento segnaletica ..... 240
			- Rettifiche specifiche ..... 241
			- 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
			- Requisiti di fondi propri prima della cartolarizzazione (%) ..... 320
			<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 ..... 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

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E  
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',  
'LY', '1' 'L1', 'EY' e 'E1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	Lungh. campo	CODIFICHE
Tipo importo			- 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
			- 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

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E  
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',  
'LY', '1' 'L1', 'EY' e 'E1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	Lungh. campo	CODIFICHE
			<b>Attività vincolate:</b> - Valore contabile..... 21 - Valore nominale..... 24 - Fair value..... 101 - Valore addizionale scenario 1 ..... 102 - Valore addizionale scenario 2 ..... 103 - Valore asset specific ..... 104 - Present value o market value ..... 105 - Ammontare ..... 68
<b>Tipologia controparte</b>	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 - Soggetto non regolamentato del settore finanziario ..... 77 - Non applicabile ..... 777
<b>Tipologia esposizione</b>	01017	6	- Senior ..... 550005 - Mezzanine ..... 550006 - Junior..... 550007 - Non applicabile ..... 777
<b>Tipologia impegno</b>	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
<b>Tipologia parte correlata</b>	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

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E  
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',  
'LY', '1' 'L1', 'EY' e 'E1')**

VARIABLE DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	Lungh. campo	CODIFICHE
<b>Tipologia posizione – Tipo X</b>	01252	3	- Posizione individuale ..... 10 - Gruppo di clienti connessi ..... 116 - Gruppo di clienti connessi – controllo..... 117 - Gruppo di clienti connessi – connessione economica..... 118
<b>Tipologia posizione – Tipo Y</b>	01253	3	- SPV, Fondi comuni o altri schemi ..... 119 - altro ..... 120
<b>Tipologia soggetto connesso</b>	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
<b>Tipologia soggetto finanziario</b>	01233	3	- Soggetto di grandi dimensioni o non regolamentato..... 76 - Altro..... 77 - Non applicabile ..... 890
<b>Tipologia sottostante</b>	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 - 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
<b>Trattamento contabile</b>	01166	3	- Esposizioni interamente non cancellate ..... 636 - Esposizioni parzialmente cancellate ..... 637 - Esposizioni interamente cancellate..... 638

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E  
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',  
'LY', '1' 'L1', 'EY' e 'E1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	Lungh. campo	CODIFICHE
			- Non applicabile per gli investitori ..... 771 - Non applicabile ..... 770
<b>Trattamento dei derivati</b>	1257	3	- Metodo dell'esposizione originaria ..... 156 - Metodo del valore di mercato ..... 157
<b>Trattamento prudenziale</b>	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 negoiazione di vigilanza ("TB") ..... 641 - Posizioni verso la cartolarizzazione incluse sia nel BB che nel TB ..... 642 - Non applicabile ..... 770
<b>Urgenza</b>	02021	1	- Si ..... 1 - No ..... 2
<b>Valutazione del merito di credito</b>	01231	3	- ECAI ..... 170 - Derivato dal merito di credito dell'Amministrazione Centrale ..... 171 - Non applicabile ..... 77
<b>Vita residua di tipo A</b>	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 - 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  <u>Attività vincolate</u> - A vista e a revoca ..... 10 - Overnight ..... 46 - Oltre 1 giorno a 7 giorni ..... 25 - Da oltre 7 giorni a 15 giorni ..... 41 - Da oltre 15 giorni a 1 mese ..... 42 - Da oltre 1 mese a 3 mesi ..... 40

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E  
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',  
'LY', '1' 'L1', 'EY' e 'E1')**

VARIABLE DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	Lungh. campo	CODIFICHE
			- Da oltre 3 mesi a 6 mesi ..... 50 - Da oltre 6 mesi a 12 mesi ..... 60 - Da oltre 1 anno a 2 anni..... 90 - Da oltre 2 anni a 3 anni..... 160 - Da oltre 3 anni a 5 anni..... 139 - Da oltre 5 anni a 10 anni..... 132 - Da oltre 10 anni..... 133
<b>Vita residua rischio di mercato</b>	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
<b>Vita residua rischio di liquidità</b>	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 - Da 9 a 12 mesi..... 52 - Oltre i 12 mesi..... 72
<b>Forma tecnica dell'attività</b>	01293	3	<u>Attività vincolate</u> - Finanziamenti a vista ..... 260 - Titoli di capitale ..... 204 - Titoli di debito: totale ..... 203



**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E  
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',  
'LY', '1' 'L1', 'EY' e 'E1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	Lungh. campo	CODIFICHE
			<ul style="list-style-type: none"> <li>- Titoli di debito: covered bond ..... 99</li> <li>- Titoli di debito: covered bond emessi da altre società appartenenti al gruppo ..... 261</li> <li>- Titoli di debito: abs..... 262</li> <li>- Titoli di debito: abs emessi da altre società appartenenti al gruppo..... 263</li> <li>- Titoli di debito: emessi da amministrazioni pubbliche ..... 264</li> <li>- Titoli di debito: emessi da intermediari finanziari ..... 265</li> <li>- Titoli di debito: emessi da società non finanziarie ..... 266</li> <li>- Finanziamenti diversi da quelli a vista: verso banche centrali e amministrazioni pubbliche ..... 267</li> <li>- Finanziamenti diversi da quelli a vista: verso intermediari finanziari ..... 268</li> <li>- Finanziamenti diversi da quelli a vista: verso controparti non finanziarie ..... 269</li> <li>- Finanziamenti diversi da quelli a vista verso controparti non finanziarie: mutui ipotecari..... 270</li> <li>- Finanziamenti diversi da quelli a vista: verso famiglie ..... 271</li> <li>- Finanziamenti diversi da quelli a vista verso famiglie: mutui ipotecari ..... 272</li> <li>- Altre attività' (&lt;&gt; da 260 a 272 e &lt;&gt; 99,203,204) ..... 273</li> <li>- Altre garanzie ricevute (&lt;&gt; da 260 a 273 e &lt;&gt; 99,203,204) ..... 274</li> <li>- Propri titoli di debito emessi diversi da covered bond o abs..... 275</li> </ul>
<b>Forma tecnica della passività associata</b>	01294	3	<u>Attività vincolate</u> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Finanziamenti da banca centrale ..... 276</li> <li>- Derivati su mercati regolamentati ..... 277</li> <li>- Derivati over the counter..... 278</li> <li>- Pronti contro termine passivi ..... 279</li> <li>- Depositi collateralizzati diversi dai pronti contro termine passivi ..... 280</li> <li>- Covered bond emessi dal segnalante ..... 281</li> <li>- Titoli abs emessi dal segnalante ..... 282</li> <li>- Titoli di debito emessi diversi da covered bond e titoli abs del segnalante ..... 283</li> <li>- Altre passività finanziarie (&lt;&gt; da 276 a 283) ..... 284</li> </ul>
<b>Codice identificativo Cover Pool</b>	01288	12	<u>Attività vincolate</u>  Campo alfanumerico con allineamento a sinistra. La parte non utilizzata del campo deve contenere il carattere "blank".
<b>Compliance art. 129</b>	01289	1	<u>Attività vincolate</u> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Sì ..... 1</li> <li>- No ..... 2</li> <li>- Non applicabile ..... 7</li> </ul>
<b>Classe di attività primaria del Cover Pool</b>	01290	12	<u>Attività vincolate</u>  Campo alfanumerico con allineamento a sinistra. La parte non utilizzata del campo deve contenere il carattere "blank".  L'opzione "non applicabile" corrisponde al codice 999999999997.
<b>Nome CRA</b>	01291	30	<u>Attività vincolate</u>  Campo alfanumerico con allineamento a sinistra. La parte non utilizzata del campo deve contenere il carattere "blank".

**SEGNALAZIONI PRUDENZIALI INDIVIDUALI (BANCHE E SIM) E  
CONSOLIDATE (GRUPPI BANCARI E GRUPPI DI SIM) (basi informative 'Y',  
'LY', '1' 'L1', 'EY' e 'E1')**

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	Lungh. campo	CODIFICHE
Rating	01292	12	<u>Attività vincolate</u>  Campo alfanumerico con allineamento a sinistra. La parte non utilizzata del campo deve contenere il carattere "blank".

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

VARIABLE DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	Lungh. campo	CODIFICHE
<b>Residenza</b>	-	-	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
<b>Divisa</b>	-	-	L'informazione è richiesta nella parte fissa del record "movimento". I codici da utilizzare sono: - euro ..... 1 - altre valute ..... 2
<b>Durata</b>	-	-	L'informazione è richiesta nella parte fissa nel record "movimento". Va utilizzato per convenzione il codice "00" (due volte zero).
<b>Codice valuta</b>	00007	3	Unità di conto in cui sono espressi i fenomeni segnalati. I codici sono attribuiti dalla Banca d'Italia - Servizio RES. 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
<b>Sottosistema di rilevazione</b>	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
<b>Stato controparte</b>	00016	3	Viene utilizzata la codifica predisposta e gestita dalla Banca d'Italia - Servizio RES. Per ciò che concerne i rapporti con gli Organismi Internazionali, devono essere utilizzati gli specifici codici assegnati ai suddetti organismi.
<b>Settore controparte</b>	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 289, 329, 717, 718, da 753 a 756, da 763 a 767, 776, 778, 746, 747, 801 (eccetto imprese di assicurazione e fondi pensione extra UE) ..... 905 - Imprese di assicurazione e fondi pensione (sg. da 294 a 296, 779, 782, 790, 800 e 801 (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, 771 e 782) ..... 908 - Unità non classificabili (sg. 551, 552) ..... 055
<b>Stato di residenza del garante</b>	00018	3	Viene utilizzata la codifica predisposta e gestita dalla Banca d'Italia - Servizio RES. 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')**

VARIABLE DI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMPO	Lungh. campo	CODIFICHE
<b>Attività economica: Settore del garante</b>	00019	3	<p>Codifica da utilizzare (indicata negli schemi con la lettera N):</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Amministrazioni pubbliche e organismi internazionali (sg. 100, da 102 a 191, da 704 a 715, 770, 771, 794) ..... 902</li> <li>- Autorità bancarie centrali (sg. 300, da 724 a 726, 791) ..... 903</li> <li>- Banche (sg. 245, da 727 a 729) ..... 904</li> <li>- Altri intermediari finanziari (sg. 101, da 247 a 289, 329, 717, 718, da 753 a 756, da 763 a 767, 776, 778, 746, 747 e 801 (eccetto imprese di assicurazione e fondi pensione extra UE) ..... 905</li> <li>- Imprese di assicurazione e fondi pensione (sg. da 294 a 296, 779, 782, 790, 800 e 801 (limitatamente alle imprese di assicurazione e fondi pensione extra UE) ..... 906</li> <li>- Società non finanziarie (sg. da 430 a 492, da 757 a 759) ..... 907</li> <li>- Famiglie e istituzioni senza finalità di lucro (sg. 500, 501, da 600 a 615, da 768 a 785 esclusi i valori 770, 771, 776, 778, 779 e 782) ..... 908</li> <li>- Unità non classificabili (sg. 551, 552) ..... 055</li> </ul> <p>Qualora non si verifichi la traslazione del rischio deve essere utilizzato il codice 000.</p>
<b>Tipo garanzia</b>	02064	2	<ul style="list-style-type: none"> <li>- garanzie reali e finanziarie ..... 82</li> <li>- garanzie personali ..... 59</li> <li>- derivati creditizi ..... 83</li> </ul> <p>Qualora non si verifichi la traslazione del rischio deve essere utilizzato il codice 00.</p>
<b>Vita residua</b>	00040	3	<ul style="list-style-type: none"> <li>- a vista e fino a 1 anno ..... 68</li> <li>- da 1 anno a 2 anni ..... 90</li> <li>- oltre 2 anni ..... 162</li> <li>- non applicabile ..... 777</li> </ul>
<b>Localizzazione unità segnalante (Stato)</b>	00063	3	Viene utilizzata la codifica predisposta e gestita dalla Banca d'Italia – Servizio RES.
<b>Portafoglio contabile</b>	01014	3	<ul style="list-style-type: none"> <li>- attività finanziarie di negoziazione ..... 501</li> <li>- attività finanziarie valutate al fair value ..... 502</li> <li>- attività finanziarie disponibili per la vendita ..... 503</li> <li>- attività finanziarie detenute sino alla scadenza ..... 504</li> <li>- crediti verso banche ..... 505</li> <li>- crediti verso clientela ..... 506</li> <li>- attività non correnti e gruppi di attività in via di dismissione ..... 507</li> </ul>
<b>INFORMAZIONI NOMINATIVE</b>  <b>Soggetto di riferimento</b>	01165	13	Tale attributo è richiesto per i rapporti tra le imprese del gruppo bancario (voce 36381), tale variabile individua la controparte "attiva" secondo le istruzioni fornite nella Circolare 115.
<b>INFORMAZIONI NOMINATIVE</b>	01172	13	Tale attributo è richiesto per i rapporti tra le imprese del gruppo bancario (voce 36381) e consente di individuare la controparte "passiva" secondo le

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

VARIABLEI CLASSIFICAZIONE	COD. CAMP O	Lungh. campo	CODIFICHE
<b>Codice Censito di tipo B</b>			istruzioni fornite nella Circolare 115.
<b>Attività proprie/ Cedute non cancellate</b>	01166	3	- Proprie ..... 095 - Cedute non cancellate a fini prudenziali e di bilancio ..... 097 - Cedute non cancellate solo a fini di bilancio ..... 096
<b>Tipo scaduto</b>	01193	4	- soggetto debitore ..... 1501 - singola transazione ..... 1502
<b>Fascia scaduto</b>	01216	3	Codifiche da utilizzare per le voci <b>36197 e 36199</b> :  - Da 1 a 90 giorni ..... 398 - Maggiore di 90 giorni e inferiore o uguale a 180 giorni ..... 399 - Maggiore di 180 giorni e inferiore o uguale a un anno ..... 400 - Maggiore di un anno ..... 403  Codifiche da utilizzare per le voci <b>36196 e 36198</b> :  - Fino a 1 mese ..... 395 - Da oltre 1 mese fino a 3 mesi ..... 024 - Da oltre 3 mesi fino a 6 mesi ..... 399 - Da oltre 6 mesi fino a 1 anno ..... 400 - Oltre 1 anno ..... 403
<b>Tipo approccio</b>	01296	4	- Per soggetto debitore ..... 1501 - Per singola transazione ..... 1502 - Per singola transazione con pulling effect ..... 1503 - Per singola transazione senza pulling effect ..... 1504
<b>Esposizioni con/senza concessioni</b>	01297	3	- Esposizioni creditizie oggetto di concessioni deteriorate ..... 285 - Altre esposizioni creditizie (diverse da 285) ..... 286  Nei casi in cui non è richiesta la distinzione tra "esposizioni creditizie oggetto di concessioni deteriorate" e "altre esposizioni creditizie" deve essere utilizzato il codice "000".

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 PRIMARIO DI CLASSE 1 (COMMON EQUITY TIER 1 - CET1).....	59010						
	STRUMENTI DI CET1:							
	CAPITALE VERSATO.....	02		3	1	1	T	XD
	DI CUI: CAPITALE VERSATO DALLE PUBBLICHE							
	AUTORITÀ IN SITUAZIONI DI EMERGENZA.....	03		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 PRIMA DELLA DEDUZIONE							
	DELLE PASSIVITÀ FISCALI DIFFERITE.....	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							

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					
	REDDITIVITÀ FUTURA E NON DERIVANO DA DIFFERENZE TEMPORANEE AL NETTO DELLE RELATIVE PASSIVITÀ						
	FISCALI DIFFERITE.....	52	3	1	1	T	XD
	(-) ENTI IRB - ECCEDENZIA DELLE PERDITE ATTESE						
	RISPETTO ALLE RETTIFICHE DI VALORE.....	54	3	1	1	T	XD
	FONDI PENSIONE A PRESTAZIONE DEFINITA:						
	(-) ATTIVITA' DEI FONDI PENSIONE A PRESTAZIONE DEFINITE .....	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
	(-) ECCEDENZIA 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
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

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					
	(-) 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
	(-) ECCEDEXZA 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
	ECCEDEXZA 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
<b>Y</b>	CAPITALE DI CLASSE 1.....	<b>59014</b>					
	TOTALE CAPITALE DI CLASSE 1.....	00	3	1	1	T	XD
<b>Y</b>	CAPITALE DI CLASSE 2 (TIER 2 - T2).....	<b>59016</b>					
	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 - ECCEDEXZA 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



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

**MATRICE DEI CONTI**

---

**IV SEZIONE - SEGNALAZIONI PRUDENZIALI**

---

<b>B A S E  I N F .</b>	<b>4.1.2 FONDI PROPRI SU BASE INDIVIDUALE</b>	<b>VOCE</b>	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
	<b>ALTRE INFORMAZIONI</b>	sotvoci					

<b>Y</b>	INFORMAZIONI SU SOGLIE PER DETRAZIONI E CAPITALE AMMISSIBILE.....	<b>59026</b>						
	SOGLIA PER GLI INVESTIMENTI NON SIGNIFICATIVI IN STRUMENTI DI CET1 DI ALTRI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO (10%).....	<b>02</b>	3	1	1	T	XD	
	SOGLIA 10% EX ARTICOLO 48 CRR.....	<b>04</b>	3	1	1	T	XD	
	SOGLIA 17,65% EX ARTICOLO 48 CRR.....	<b>06</b>	3	1	1	T	XD	
	CAPITALE AMMISSIBILE AI FINI DELLA DISCIPLINA DELLE PARTECIPAZIONI QUALIFICATE AL DI FUORI DEL SETTORE FINANZIARIO.....	<b>10</b>	3	1	1	T	XD	
	CAPITALE AMMISSIBILE AI FINI DELLA DISCIPLINA DELLE GRANDI ESPOSIZIONI.....	<b>12</b>	3	1	1	T	XD	

<b>Y</b>	INFORMAZIONI SU INVESTIMENTI NON SIGNIFICATIVI IN FONDI PROPRI DI ALTRI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO.....	<b>59028</b>						
	STRUMENTI DI CET1 AL NETTO DELLE POSIZIONI CORTE:							
	STRUMENTI DI CET1 DETENUTI DIRETTAMENTE:							
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	<b>02</b>	3	1	1	T	XD	
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE.....	<b>04</b>	3	1	1	T	XD	
	STRUMENTI DI CET1 DETENUTI INDIRETTAMENTE:							
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	<b>06</b>	3	1	1	T	XD	
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE.....	<b>08</b>	3	1	1	T	XD	
	STRUMENTI DI CET1 DETENUTI SINTETICAMENTE:							
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	<b>10</b>	3	1	1	T	XD	
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE.....	<b>12</b>	3	1	1	T	XD	
	STRUMENTI DI AT1 AL NETTO DELLE POSIZIONI CORTE:							
	STRUMENTI DI AT1 DETENUTI DIRETTAMENTE:							
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	<b>14</b>	3	1	1	T	XD	
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE.....	<b>16</b>	3	1	1	T	XD	
	STRUMENTI DI AT1 DETENUTI INDIRETTAMENTE:							
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	<b>18</b>	3	1	1	T	XD	
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE.....	<b>20</b>	3	1	1	T	XD	
	STRUMENTI DI AT1 DETENUTI SINTETICAMENTE:							
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	<b>22</b>	3	1	1	T	XD	
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE.....	<b>24</b>	3	1	1	T	XD	
	STRUMENTI DI T2 AL NETTO DELLE POSIZIONI CORTE:							
	STRUMENTI DI T2 DETENUTI DIRETTAMENTE:							
	POSIZIONE LUNGA LORDA.....	<b>26</b>	3	1	1	T	XD	
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE.....	<b>28</b>	3	1	1	T	XD	
	STRUMENTI DI T2 DETENUTI INDIRETTAMENTE:							

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						N O T E
			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		
		SOTVOC						
	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	
<b>Y</b>	INFORMAZIONI SU INVESTIMENTI SIGNIFICATIVI IN FONDI PROPRI DI ALTRI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO:.....	<b>59030</b>						
	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							

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						N O T E
		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			
		SOTVOC						
	COMPENSAZIONE.....		36	3	1	1	T	XD
<b>Y</b>	ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO DI INVESTIMENTI NON DEDOTTI DAI CORRISPONDENTI TIER DEI FONDI PROPRI DI ALTRI SOGGETTI APPARTENENTI AL SETTORE FINANZIARIO.....		<b>59032</b>					
	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
<b>Y</b>	DEROGA TEMPORANEA ALLA DEDUZIONE DAI FONDI PROPRI EX ART. 79 CRR.....		<b>59034</b>					
	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
<b>Y</b>	ALTRI REQUISITI.....		<b>59036</b>					
	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...		08	3	1	1	T	XD
	RISERVA PER ENTI DI IMPORTANZA SISTEMICA.....		10	3	1	1	T	XD
	RISERVA PER GLI O-SII.....		14	3	1	1	T	XD
<b>Y</b>	FLOOR.....		<b>59037</b>					
	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
<b>Y</b>	SOGLIA DI RILEVANZA PER LA SEGNALAZIONE DELLE ESPOSIZIONI NON-DOMESTICHE.....		<b>59042</b>					

<b>MATRICE DEI CONTI</b>
<b>IV SEZIONE - SEGNALAZIONI PRUDENZIALI</b>

B A S E  I N F .		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
	<b>4.1.2 FONDI PROPRI SU BASE INDIVIDUALE</b>						
	<b>ALTRE INFORMAZIONI</b>						
		SOTVOC					
	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 .	4.3 GRANDI ESPOSIZIONI SU BASE INDIVIDUALE	VOCE													P E R I O D I C I T A	N O T E
		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	S O G G I E C O N N E S S I T O A	C O D I C E C E N S I T O A	P O S I Z I O N E D I R E T T O	T I P O I M P O R T O	T I P O L O G O C O N T R O P P	T I P O L O G O P O S I Z I O N E	T I P O L O G O P O S I Z I O N E	T I P O L O G O P O S I Z I O N E	T I P O L O G O P O S I Z I O N E		
		sotvoco														
	-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
<b>Y</b>	GRANDI ESPOSIZIONI: IDENTIFICAZIONE DELLA CONTROPARTE... <sup>1</sup>	<b>59102</b>														
	-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	
	<sup>1</sup> (601) - La voce deve essere segnalata indicando convenzionalmente " 1 " nel campo importo.															
<b>Y</b>	GRANDI ESPOSIZIONI: LIMITI APPLICATI.....	<b>59104</b>														
	-ENTI(*)..... <sup>1</sup>	02	3	1	1					X					T	XD
	-CONTROPARTI DIVERSE DA ENTI.....	04	3	1	1					X					T	XD

<sup>1</sup> (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 .	4.5 RISCHIO OPERATIVO 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	E V E N T I  P E R D I T A	L I N E E  B U S I N E S S	I M P O R T O  E V E N T O  P E R D	P E R I O D I C I T A	N O T E
		SOTVOC								
<b>Y</b>	INDICATORE RILEVANTE.....	<b>59610</b>								
	METODO BASE									
	INDICATORE RILEVANTE 31.12. ANNO T.....	<b>02</b>	3	1	1				T	XD
	INDICATORE RILEVANTE 31.12. ANNO T-1.....	<b>04</b>	3	1	1				T	XD
	INDICATORE RILEVANTE 31.12. ANNO T-2.....	<b>06</b>	3	1	1				T	XD
	METODO STANDARDIZZATO									
	INDICATORE RILEVANTE 31.12. ANNO T.....	<b>12</b>	3	1	1		X		T	XD
	INDICATORE RILEVANTE 31.12. ANNO T-1.....	<b>14</b>	3	1	1		X		T	XD
	INDICATORE RILEVANTE 31.12. ANNO T-2.....	<b>16</b>	3	1	1		X		T	XD
	METODO STANDARDIZZATO ALTERNATIVO									
	INDICATORE RILEVANTE 31.12. ANNO T.....	<b>28</b>	3	1	1		X		T	XD
	INDICATORE RILEVANTE 31.12. ANNO T-1.....	<b>30</b>	3	1	1		X		T	XD
	INDICATORE RILEVANTE 31.12. ANNO T-2.....	<b>32</b>	3	1	1		X		T	XD
	CREDITI E ANTICIPI 31.12. ANNO T.....	<b>34</b>	3	1	1		X		T	XD
	CREDITI E ANTICIPI 31.12. ANNO T-1.....	<b>36</b>	3	1	1		X		T	XD
	CREDITI E ANTICIPI 31.12. ANNO T-2.....	<b>38</b>	3	1	1		X		T	XD
	METODI AVANZATI									
	INDICATORE RILEVANTE 31.12. ANNO T.....	<b>22</b>	3	1	1				T	XD
	INDICATORE RILEVANTE 31.12. ANNO T-1.....	<b>24</b>	3	1	1				T	XD
	INDICATORE RILEVANTE 31.12. ANNO T-2.....	<b>26</b>	3	1	1				T	XD
<b>Y</b>	METODI AVANZATI.....	<b>59612</b>								
	REQUISITO PATRIMONIALE LORDO.....	<b>02</b>	3	1	1				T	XD
	RIDUZIONI DEL REQUISITO PATRIMONIALE LORDO									
	- POLIZZE ASSICURATIVE E ALTRI MECCANISMI DI									
	TRASFERIMENTO: QUOTA DEDUCIBILE.....	<b>05</b>	3	1	1				T	XD
	- ACCANTONAMENTI A FRONTE DEL RISCHIO OPERATIVO.....	<b>08</b>	3	1	1				T	XD
	- CORRELAZIONE TRA LE PERDITE.....	<b>10</b>	3	1	1				T	XD
	REQUISITO PATRIMONIALE CONNESSO A MECCANISMI DI									
	ALLOCAZIONE.....	<b>12</b>	3	1	1				T	XD
<b>Y</b>	RIPARTIZIONE DELLE PERDITE OPERATIVE E DEI RECUPERI PER	<b>59614</b>								
	LINEE DI BUSINESS E PER EVENTI DI PERDITA.....	<b>02</b>	3	1	1	X	X	X	S	XD
	NUMERO EVENTI DI PERDITA.....									
	PERDITE									
	- IMPORTO TOTALE.....	<b>06</b>	3	1	1	X	X	X	S	XD
	- PERDITA MASSIMA.....	<b>08</b>	3	1	1	X	X		S	XD
	- SOMMA DELLE CINQUE MAGGIORI PERDITE.....	<b>07</b>	3	1	1	X	X		S	XD
	- TOTALE PERDITE RECUPERATE.....	<b>09</b>	3	1	1	X	X		S	XD
	SOGLIA MINIMA DI PERDITA PIU' BASSA.....	<b>21</b>	3	1	1		X		S	XD
	SOGLIA MINIMA DI PERDITA PIU' ALTA.....	<b>22</b>	3	1	1		X		S	XD
	SOGLIA MINIMA DI PERDITA PIU' BASSA: SEGNALAZIONE									
	NEGATIVA.....	<b>31</b>	3	1	1				S	XD
	SOGLIA MIMINA DI PERDITA PIU' ALTA:SEGNALAZIONE									
	NEGATIVA.....	<b>32</b>	3	1	1				S	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	D	R	P	N
				U	I	E	E	O
				R	V	S	R	T
				A	A	I	I	E
				T	A	D	O	
				A	A	E	D	
						N	I	
						Z	C	
						A	I	
							T	
							A	
			SOTVOC					
<b>1</b>		CAPITALE PRIMARIO DI CLASSE 1 (COMMON EQUITY TIER 1 - CET1).....	<b>34010</b>					
		STRUMENTI DI CET1:						
		CAPITALE VERSATO.....	<b>02</b>	3	1	1	T	XD
		DI CUI: CAPITALE VERSATO DALLE PUBBLICHE						
		AUTORITÀ IN SITUAZIONI DI EMERGENZA.....	<b>03</b>	3	1	1	T	XD
		SOVRAPPREZZI DI EMISSIONE.....	<b>04</b>	3	1	1	T	XD
		(-) STRUMENTI DI CET1 PROPRI:.....	<b>06</b>	3	1	1	T	XD
		(-) STRUMENTI DI CET1 DETENUTI DIRETTAMENTE.....	<b>08</b>	3	1	1	T	XD
		(-) STRUMENTI DI CET1 DETENUTI INDIRETTAMENTE.....	<b>10</b>	3	1	1	T	XD
		(-) STRUMENTI DI CET1 DETENUTI SINTETICAMENTE.....	<b>12</b>	3	1	1	T	XD
		(-) STRUMENTI DI CET1 SUI QUALI L'ENTE HA OBBLIGO						
		REALE O EVENTUALE DI ACQUISTO.....	<b>14</b>	3	1	1	T	XD
		RISERVE:						
		RISERVE DI UTILI:						
		UTILI O PERDITE PORTATI A NUOVO.....	<b>16</b>	3	1	1	T	XD
		UTILI O PERDITA DI PERIODO:.....	<b>18</b>	3	1	1	T	XD
		UTILE O PERDITA DI PERTINENZA DELLA CAPOGRUPPO.....	<b>20</b>	3	1	1	T	XD
		(-) QUOTA DELL'UTILE DEL PERIODO NON INCLUSA						
		NEL CET1.....	<b>22</b>	3	1	1	T	XD
		ALTRE COMPONENTI DI CONTO ECONOMICO ACCUMULATE						
		(OCI) (*).....	<b>24</b>	3	1	1	T	XD
		RISERVE - ALTRO.....	<b>26</b>	3	1	1	T	XD
		FONDI PER RISCHI BANCARI GENERALI.....	<b>27</b>	3	1	1	T	XD
		STRUMENTI DI CET1 OGGETTO DI DISPOSIZIONI TRANSITORIE						
		(GRANDFATHERING).....	<b>28</b>	3	1	1	T	XD
		INTERESSI DI MINORANZA INCLUSI NEL CET1.....	<b>30</b>	3	1	1	T	XD
		INTERESSI DI MINORANZA AGGIUNTIVI OGGETTO DI						
		DISPOSIZIONI TRANSITORIE.....	<b>31</b>	3	1	1	T	XD
		FILTRI PRUDENZIALI:						
		(-) INCREMENTO DI CET1 CONNESSO CON ATTIVITÀ						
		CARTOLARIZZATE.....	<b>32</b>	3	1	1	T	XD
		COPERTURA DEI FLUSSI DI CASSA (CASH FLOW HEDGE).....	<b>34</b>	3	1	1	T	XD
		UTILI O PERDITE SULLE PASSIVITÀ VALUTATE AL VALORE						
		EQUO DOVUTI AL PROPRIO MERITO DI CREDITO.....	<b>36</b>	3	1	1	T	XD
		UTILI O PERDITE DI VALORE EQUO DERIVANTI DAL						
		RISCHIO DI CREDITO PROPRIO DELL'ENTE CORRELATO A						
		PASSIVITÀ DERIVATIVE.....	<b>38</b>	3	1	1	T	XD
		RETTIFICHE DI VALORE DI VIGILANZA.....	<b>40</b>	3	1	1	T	XD
		DETRAZIONI:						
		AVVIAMENTO:						
		(-) AVVIAMENTO CONNESSO CON ATTIVITÀ IMMATERIALI.....	<b>42</b>	3	1	1	T	XD
		(-) AVVIAMENTO INCLUSO NELLA VALUTAZIONE DEGLI						
		INVESTIMENTI SIGNIFICATIVI.....	<b>44</b>	3	1	1	T	XD
		PASSIVITÀ FISCALI DIFFERITE ASSOCIATE						
		ALL'AVVIAMENTO.....	<b>46</b>	3	1	1	T	XD
		ALTRE ATTIVITÀ IMMATERIALI:						
		(-) ALTRE ATTIVITÀ IMMATERIALI PRIMA DELLA DEDUZIONE						

**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	D	R	P	N
			U	I	E	E	O
			R	V	S	R	T
			A	I	I	I	E
			T	S	D	O	
			A	A	E	D	
					N	I	
					Z	C	
					A	I	
						T	
						A	
		SOTVOC					
	DELLE PASSIVITA' FISCALI DIFFERITE.....	48	3	1	1	T	XD
	PASSIVITA' FISCALI DIFFERITE CONNESSE CON LE ALTRE						
	ATTIVITA' IMMATERIALI.....	50	3	1	1	T	XD
	(-) ATTIVITA' FISCALI DIFFERITE CHE SI BASANO SULLA						
	REDDITIVITA' FUTURA E NON DERIVANO DA DIFFERENZE						
	TEMPORANEE AL NETTO DELLE RELATIVE PASSIVITA'						
	FISCALI DIFFERITE.....	52	3	1	1	T	XD
	(-) ENTI IRB - ECCEDEZZA DELLE PERDITE ATTESE						
	RISPETTO ALLE RETTIFICHE DI VALORE.....	54	3	1	1	T	XD
	FONDI PENSIONE A PRESTAZIONE DEFINITA:						
	(-) ATTIVITA' DEI FONDI PENSIONE A PRESTAZIONE DEFINITE	56	3	1	1	T	XD
	PASSIVITA' FISCALI DIFFERITE CONNESSE AD ATTIVITA'						
	DI FONDI PENSIONE A PRESTAZIONE DEFINITA.....	58	3	1	1	T	XD
	ATTIVITA' DEI FONDI PENSIONE A PRESTAZIONE						
	DEFINITA CHE L'ENTE PUO' UTILIZZARE SENZA						
	RESTRIZIONI.....	60	3	1	1	T	XD
	(-) PARTECIPAZIONI INCROCIATE IN STRUMENTI DI CET1.....	62	3	1	1	T	XD
	(-) ECCEDEZZA 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%:						
	(-) ATTIVITA' FISCALI DIFFERITE CHE SI BASANO						
	SULLA REDDITIVITA' 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
1	CAPITALE AGGIUNTIVO DI CLASSE 1 (ADDITIONAL TIER 1 -						
	AT1).....	34012					
	STRUMENTI DI AT1:						

**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	D	R	P	N
			U	I	E	E	O
			R	V	S	R	T
			A	I	I	I	E
			T	S	D	O	
			A	A	E	D	
					N	I	
					Z	C	
					A	I	
						T	
						A	
		SOTVOC					
	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
	(-) ECCEDEXIA 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
	ECCEDEXIA 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
1	CAPITALE DI CLASSE 1.....	34014					
	TOTALE CAPITALE DI CLASSE 1.....	00	3	1	1	T	XD
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

**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	D	R	P	N
			U	I	E	E	O
			R	V	S	R	T
			A	I	I	I	E
			T	S	D	O	
			A	A	E	D	
					N	I	
					Z	C	
					A	I	
						T	
						A	
		SOTVOC					
	ENTI IRB - ECCEDEZZA 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
	ECCEDEZZA 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
<b>1</b>	FONDI PROPRI.....	<b>34018</b>					
	TOTALE FONDI PROPRI.....	<b>00</b>	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					
<b>1</b>	INFORMAZIONI SU STRUMENTI DI CAPITALE CON CARATTERISTICHE REVERSIBILI.....	<b>34020</b>					
	STRUMENTI DI CAPITALE LA CUI INCLUSIONE NEL CET1 DIPENDE DA CARATTERISTICHE REVERSIBILI.....	<b>02</b>	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI CAPITALE LA CUI INCLUSIONE NELL'ATL DIPENDE DA CARATTERISTICHE REVERSIBILI.....	<b>04</b>	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI CAPITALE LA CUI INCLUSIONE NEL T2 DIPENDE DA CARATTERISTICHE REVERSIBILI.....	<b>06</b>	3	1	1	T	XD
<b>1</b>	INFORMAZIONI SULLA FISCALITÀ.....	<b>34022</b>					
	TOTALE ATTIVITÀ FISCALI DIFFERITE (DTA):						
	DTA CHE NON SI BASANO SULLA REDDITIVITÀ FUTURA.....	<b>02</b>	3	1	1	T	XD
	DTA CHE SI BASANO SULLA REDDITIVITÀ FUTURA E NON DERIVANO DA DIFFERENZE TEMPORANEE.....	<b>04</b>	3	1	1	T	XD
	DTA CHE SI BASANO SULLA REDDITIVITÀ FUTURA E DERIVANO DA DIFFERENZE TEMPORANEE.....	<b>06</b>	3	1	1	T	XD
	TOTALE PASSIVITÀ FISCALI DIFFERITE (DTL):						
	DTL NON DEDUCIBILI DALLE DTA E CHE SI BASANO SULLA REDDITIVITÀ FUTURA.....	<b>08</b>	3	1	1	T	XD
	DTL DEDUCIBILI DALLE DTA E CHE SI BASANO SULLA REDDITIVITÀ FUTURA:						
	DI CUI NON DERIVANTI DA DIFFERENZE TEMPORANEE.....	<b>10</b>	3	1	1	T	XD
	DI CUI DERIVANTI DA DIFFERENZE TEMPORANEE.....	<b>12</b>	3	1	1	T	XD
<b>1</b>	INFORMAZIONI SUI MODELLI INTERNI ENTI IRB (SHORTFALL/EXCESS RESERVE).....	<b>34024</b>					
	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.....	<b>01</b>	3	1	1	T	XD
	RETTIFICHE SPECIFICHE.....	<b>02</b>	3	1	1	T	XD
	RETTIFICHE DI VALORE PRUDENZIALI E ALTRE RIDUZIONI DEI FONDI PROPRI.....	<b>04</b>	3	1	1	T	XD
	TOTALE PERDITE ATTESE.....	<b>06</b>	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.....	<b>08</b>	3	1	1	T	XD
	TOTALE PERDITE ATTESE.....	<b>10</b>	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						

**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					
	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
<b>1</b>	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.....	10	3	1	1	T	XD
	CAPITALE AMMISSIBILE AI FINI DELLA DISCIPLINA DELLE GRANDI ESPOSIZIONI.....	12	3	1	1	T	XD
<b>1</b>	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

**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					
	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
<b>1</b>	INFORMAZIONI SU INVESTIMENTI SIGNIFICATIVI IN FONDI PROPRI DI ALTRI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO.....	<b>34030</b>					
	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:						



**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	D	R	P	N
			U	I	E	E	O
			R	V	S	R	T
			A	I	I	I	E
			T	S	D	O	D
			A	A	E	I	C
					N	C	I
					Z	I	T
					A	T	A
		SOTVOC					
	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
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.....	08	3	1	1	T	XD
	RISERVA PER ENTI DI IMPORTANZA SISTEMICA.....	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						

**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	D	R	P	N
			U R A T A	I V I S A	E I D E N Z A	E R I O D I C I T A	O T E
		SOTVOC					
	DEL FLOOR DI BASILEA 1.....		<b>04</b>	3	1	1	T XD
	REQUISITI DI FONDI PROPRI PER IL FLOOR DI BASILEA 1.....		<b>06</b>	3	1	1	T XD
	REQUISITI DI FONDI PROPRI PER IL FLOOR DI BASILEA 1 - ALTERNATIVA PER IL METODO STANDARD.....		<b>08</b>	3	1	1	T XD
<b>1</b>	SOGLIA DI RILEVANZA PER LA SEGNALAZIONE DELLE ESPOSIZIONI NON-DOMESTICHE.....		<b>34042</b>				
	ESPOSIZIONE ORIGINARIA NON DOMESTICA.....		<b>02</b>	3	1	1	T XD
	TOTALE DELLE ESPOSIZIONI ORIGINARIE.....		<b>04</b>	3	1	1	T XD

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E  I N F .	4.3 GRANDI ESPOSIZIONI SU BASE CONSOLIDATA	VOCE													N O T E			
		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 O N N E S S I T O A	S O G G I N D I C I	P O S I Z I O N I	T I P O L O G I E	T I P O L O G I E	T I P O L O G I E	V I T A R E S I D U A	P E R I O D I C I T A					
		sotvoc																
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 (*)..... 1	04	3	1	1		X			X	X	X					T	XD
	- TOTALE DELLE ATTIVITA' 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

1 (163) (\*) Ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali

1	TECNICHE DI ATTENUAZIONE DELLE ATTIVITA' 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	ATTIVITA' 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 (*)..... 1	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	X							T	XD

1 (163) (\*) Ove richiesta la percentuale va riportata con tre cifre decimali

1	TECNICHE DI ATTENUAZIONE DELLE ATTIVITA' DI																	
	RISCHIO:COMPOSIZIONE DEI GRUPPI DI CLIENTI CONNESSI.....	34096																
	EFFETTO DI SOSTITUZIONE: RIPARTIZIONE PER SOTTOSTANTE																	



SEGNALAZIONI DI VIGILANZA SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E	I N F .	4.5 RISCHIO OPERATIVO 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	E V E N T I	L I N E E	I M P O R T O	P E R I O D I C I T A	N O T E
			sotvoco								
1		INDICATORE RILEVANTE.....	36570								
		METODO BASE									
		INDICATORE RILEVANTE 31.12. ANNO T.....	02	3	1	1				T	XD
		INDICATORE RILEVANTE 31.12. ANNO T-1.....	04	3	1	1				T	XD
		INDICATORE RILEVANTE 31.12. ANNO T-2.....	06	3	1	1				T	XD
		METODO STANDARDIZZATO									
		INDICATORE RILEVANTE 31.12. ANNO T.....	12	3	1	1		X		T	XD
		INDICATORE RILEVANTE 31.12. ANNO T-1.....	14	3	1	1		X		T	XD
		INDICATORE RILEVANTE 31.12. ANNO T-2.....	16	3	1	1		X		T	XD
		METODO STANDARDIZZATO ALTERNATIVO									
		INDICATORE RILEVANTE 31.12. ANNO T.....	28	3	1	1		X		T	XD
		INDICATORE RILEVANTE 31.12. ANNO T-1.....	30	3	1	1		X		T	XD
		INDICATORE RILEVANTE 31.12. ANNO T-2.....	32	3	1	1		X		T	XD
		CREDITI E ANTICIPI 31.12. ANNO T.....	34	3	1	1		X		T	XD
		CREDITI E ANTICIPI 31.12. ANNO T-1.....	36	3	1	1		X		T	XD
		CREDITI E ANTICIPI 31.12. ANNO T-2.....	38	3	1	1		X		T	XD
		METODI AVANZATI									
		INDICATORE RILEVANTE 31.12. ANNO T.....	22	3	1	1				T	XD
		INDICATORE RILEVANTE 31.12. ANNO T-1.....	24	3	1	1				T	XD
		INDICATORE RILEVANTE 31.12. ANNO T-2.....	26	3	1	1				T	XD
1		METODI AVANZATI.....	36572								
		REQUISITO PATRIMONIALE LORDO.....	02	3	1	1				T	XD
		RIDUZIONI DEL REQUISITO PATRIMONIALE LORDO									
		- POLIZZE ASSICURATIVE E ALTRI MECCANISMI DI									
		TRASFERIMENTO: QUOTA DEDUCIBILE.....	05	3	1	1				T	XD
		- ACCANTONAMENTI A FRONTE DEL RISCHIO OPERATIVO.....	08	3	1	1				T	XD
		- CORRELAZIONE TRA LE PERDITE.....	10	3	1	1				T	XD
1		RIPARTIZIONE DELLE PERDITE OPERATIVE E DEI RECUPERI PER LINEE									
		DI BUSINESS E PER EVENTI DI PERDITA.....	36574								
		NUMERO DI EVENTI DI PERDITA.....	02	3	1	1	X	X	X	S	XD
		PERDITE									
		- IMPORTO TOTALE.....	06	3	1	1	X	X	X	S	XD
		- PERDITA MASSIMA.....	08	3	1	1	X	X		S	XD
		- SOMMA DELLE CINQUE MAGGIORI PERDITE.....	07	3	1	1	X	X		S	XD
		- TOTALE PERDITE RECUPERATE.....	09	3	1	1	X	X		S	XD
		SOGLIA MINIMA DI PERDITA PIU' BASSA.....	21	3	1	1		X		S	XD
		SOGLIA MINIMA DI PERDITA PIU' ALTA.....	22	3	1	1		X		S	XD
		SOGLIA MINIMA DI PERDITA PIU' BASSA: SEGNALAZIONE									
		NEGATIVA.....	31	3	1	1				S	XD
		SOGLIA MINIMA DI PERDITA PIU' ALTA: SEGNALAZIONE									
		NEGATIVA.....	32	3	1	1				S	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 106 d.lgs. 385/93, degli istituti di pagamento e degli istituti di moneta elettronica.....	C.1
Attività degli intermediari finanziari iscritti agli elenchi generale e speciale ante riforma fino alla data di iscrizione al nuovo albo unico ex art 106 d.lgs. 385/93 – periodo transitorio (1) .....	C2.1
Capitolo 4 Schemi di segnalazione	
Organismi di investimento collettivo del risparmio (O.I.C.R.) .....	D.1

---

1 ) Medesimo regime segnaletico si applica agli Istituti di pagamento e agli Istituti di moneta elettronica fino alla data contabile del 30 settembre 2015.





# 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.

Per la segnalazione delle basi informative YF, 1F, 3F si precisa quanto segue:

- i valori espressi in percentuale (basi informative YF, 1F, 3F) 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. In generale, per indicazioni in merito al segno degli importi (basi informative YF, 1F) si rimanda alle disposizioni contenute in Circolare n. 286 del 17 dicembre 2013 “Istruzioni per la compilazione delle segnalazioni prudenziali per le banche, le società di intermediazione mobiliare e gli intermediari finanziari”;

# 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 statistiche dei gruppi di SIM quotati (basi M1, M2)	segnalazioni attività di intermediaz. mobiliare (basi Y, LY, 1, L1, EY, E1)	segnalazioni intermediari finanziari ex art 106, IP e IMEL-periodo transitorio (basi 3, 3S, 4)	segnalazioni intermediari finanziari elenco speciale-periodo transitorio (base 5)	segnalazioni intermediari finanziari ex art 106, IP e IMEL (basi YF, 1F)	segnalazioni gruppi finanziari (basi 3F, 4F)	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	X	X	X	
011	Settore istituzionale	3		X		X			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		X	
022	Destinazione	3				X				X	
032	Titoli: codice titolo	12	X	X		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			X	X	
042	Scaglioni di vita residua (con riferimento alla data di revisione dei rendimenti)	3		X		X			X		
063	Localizzazione geografica delle attività e passività	3		X							
075	Stato emittente	3	X								
113	Tipo tasso	2		X		X			X		
139	Tipo investimento	2								X	
212	Codice Censito di tipo A	13			X	X	X	X			
294	Tempo di inadempimento	2			X			X			
350	Tipo importo	3			X	X	X	X			
352	Tipo garanzia	3			X	X	X	X			
353	Controparte o garante	3			X	X		X			
356	Tipo rischio	3			X	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	

Codice campo	Descrizione del campo	lunghezza del campo	segnalazioni attività di intermediaz. mobiliare (basi S, T, U, V2)	Segnalazioni statistiche dei gruppi di SIM quotati (basi M1, M2)	segnalazioni attività di intermediaz. mobiliare (basi Y, LY, 1, L1, EY, E1)	segnalazioni intermediari finanziari ex art 106, IP e IMEL-periodo transitorio (basi 3, 3S, 4)	segnalazioni intermediari finanziari elenco speciale-periodo transitorio (base 5)	segnalazioni intermediari finanziari ex art 106, IP e IMEL (basi YF, 1F)	segnalazioni gruppi finanziari (basi 3F, 4F)	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)
522	Qualità del credito	7		X		X	X		X	X	
541	Depositaria	2								X	
551	Categoria valori mobiliari/Raggruppamento titoli	7	X			X				X	
552	Indicatore quotazione	3	X			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			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	

Codice campo	Descrizione del campo	lunghezza del campo	segnalazioni attività di intermediaz. mobiliare (basi S, T, U, V2)	Segnalazioni statistiche dei gruppi di SIM quotati (basi M1, M2)	segnalazioni attività di intermediaz. mobiliare (basi Y, LY, 1, L1, EY, E1)	segnalazioni intermediari finanziari ex art. 106, IP e IMEL-periodo transitorio (basi 3, 3S, 4)	segnalazioni intermediari finanziari elenco speciale-periodo transitorio (base 5)	segnalazioni intermediari finanziari ex art. 106, IP e IMEL (basi YF, 1F)	segnalazioni gruppi finanziari (basi 3F, 4F)	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)
995	Tipologia partecipazione	2								X	
996	Base di calcolo	2								X	
997	Stato ubicazione immobile	3								X	
1006	Tipo frode	4				X	X				
1014	Portafoglio contabile	3		X		X			X		
1017	Esposizioni derivanti da cartolarizzazione – Tipologia esposizione	6			X	X	X	X			
1020	Appartenenza patrimonio	3			X						
1025	Eventi di perdita	3			X		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	X		X	X		
1125	Metodologia applicata	3			X		X	X			
1126	Tipo di cartolarizzazione	3			X		X	X			
1127	Ruolo nella cartolarizzazione	3			X		X	X			
1130	Portafoglio	3			X		X	X			
1133	Fattore di conversione	3			X		X	X			
1134	Classe di merito creditizio	3			X		X	X			
1136	Fattore di ponderazione	3	X		X		X	X			
1165	Soggetto di riferimento	13		X					X		
1166	Trattamento contabile/ Attività proprie/ Cedute non cancellate	3		X	X	X		X	X		
1172	Codice Censito di tipo B/ Banca depositaria	13			X	X			X		
1182	Settore istituzionale del debitore	5									X
1184	Stato di residenza della società veicolo	3				X					
1186	Codice Censito originator	13				X					
1190	Gerarchia del fair value	1		X					X		
1206	Metodologia utilizzata	3			X			X			
1207	Zone VP	3					X				
1208	Patrimonio destinato/azienda	3				X					
1209	Categoria esposizione	3			X			X			
1212	Tipologia sottostante	3			X			X			
1215	Stato emittente titolo	5				X			X		
1216	Fascia scaduto	3		X		X			X		

Codice campo	Descrizione del campo	lunghezza del campo	segnalazioni attività di intermediaz. mobiliare (basi S, T, U, V2)	Segnalazioni statistiche dei gruppi di SIM quotati (basi M1, M2)	segnalazioni attività di intermediaz. mobiliare (basi Y, LY, 1, L1, EY, E1)	segnalazioni intermediari finanziari ex art 106, IP e IMEL-periodo transitorio (basi 3, 3S, 4)	segnalazioni intermediari finanziari elenco speciale-periodo transitorio (base 5)	segnalazioni intermediari finanziari ex art 106, IP e IMEL (basi YF, 1F)	segnalazioni gruppi finanziari (basi 3F, 4F)	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)
1217	Oggetto dei reclami	5				X					
1222	Metodologia di consolidamento	3		X	X				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						
1230	CCP qualificata	1			X			X			
1231	Valutazione del merito di credito	3			X			X			
1232	Garanzie rilasciate e impegni a erogare fondi	1			X			X			
1233	Tipologia soggetto finanziario	3			X			X			
1234	Forma tecnica	3			X			X			
1235	Classe di merito di credito originaria	3			X			X			
1236	Detrazione	1			X			X			
1237	Clausola di rimborso anticipato	1			X			X			
1238	Esposizione rotativa	3			X						
1239	Classe di ponderazione	3			X			X			
1240	Identificativo della cartolarizzazione	45			X			X			
1241	Trattamento prudenziale	3			X			X			
1242	Conformità alla normativa	1			X			X			
1243	Portafoglio di negoziazione di correlazione	1			X			X			
1244	Cartolarizzazione – posizioni fuori bilancio	3			X			X			
1245	PMI	1			X						
1246	Deposito garantito	1			X						
1247	Tipologia impegno	3			X			X			
1248	Codice interno operazione di cartolarizzazione	10			X			X			
1249	Vita residua rischio di mercato	3			X			X			
1250	Vita residua rischio di liquidità	3			X						
1251	Classe di merito di credito	3			X			X			
1252	Tipologia posizione-Tipo X	3			X			X			

Codice campo	Descrizione del campo	lunghezza del campo	segnalazioni attività di intermediaz. mobiliare (basi S, T, U, V2)	Segnalazioni statistiche dei gruppi di SIM quotati (basi M1, M2)	segnalazioni attività di intermediaz. mobiliare (basi Y, LY, 1, L1, EY, E1)	segnalazioni intermediari finanziari ex art. 106, IP e IMEL-periodo transitorio (basi 3, 3S, 4)	segnalazioni intermediari finanziari elenco speciale-periodo transitorio (base 5)	segnalazioni intermediari finanziari ex art. 106, IP e IMEL (basi YF, 1F)	segnalazioni gruppi finanziari (basi 3F, 4F)	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)
1253	Tipologia posizione-Tipo Y	3			X			X			
1254	Forma giuridica societaria	4			X						
1255	Approccio	3			X			X			
1256	Interesse economico netto	3			X			X			
1257	Trattamento dei derivati	3			X			X			
1258	Data di creazione	8			X			X			
1259	Prima data di chiusura prevedibile	8			X			X			
1260	Data di scadenza finale legale	8			X			X			
1261	Identificativo dell'originator	45			X			X			
1279	Modalità di avvio	2				X					
1280	Tipo rettifica	3		X					X		
1281	Tipo copertura	3		X					X		
1282	Causale variazione	3		X					X		
1283	Tipologia di fair value option	3		X					X		
1284	Data di entrata	8		X					X		
1285	Tipo relazione	3		X					X		
1286	Codice del titolo (non ISIN)	20		X					X		
1287	Metodologia di consolidamento – Gruppo contabile	3		X					X		
1288	Codice identificativo cover pool	12			X						
1289	Compliance art. 129	1			X						
1290	Classe di attività primaria del cover pool	12			X						
1291	Nome CRA	30			X						
1292	Rating	12			X						
1293	Forma tecnica dell'attività	3			X						
1294	Forma tecnica della passività associata	3			X						
1295	Tipologia di misura di tolleranza	3		X					X		
1296	Tipo approccio	4				X			X		
1297	Esposizioni con/senza concessioni	3				X			X		
2018	Soggetto connesso	13						X			
2025	Tipologia parte correlata	2		X					X		
2029	Sottosistema di rilevazione	5		X	X				X		
2068	Stato di esecuzione dell'operazione	3				X					
4009	Oggetto delle rettifiche – Linee di business	3			X	X	X	X			



Codice campo	Descrizione del campo	lunghezza del campo	segnalazioni attività di intermediaz. mobiliare (basi S, T, U, V2)	Segnalazioni statistiche dei gruppi di SIM quotati (basi M1, M2)	segnalazioni attività di intermediaz. mobiliare (basi Y, LY, 1, L1, EY, E1)	segnalazioni intermediari finanziari ex art 106, IP e IMEL-periodo transitorio (basi 3, 3S, 4)	segnalazioni intermediari finanziari elenco speciale-periodo transitorio (base 5)	segnalazioni intermediari finanziari ex art 106, IP e IMEL (basi YF, 1F)	segnalazioni gruppi finanziari (basi 3F, 4F)	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)
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:

	<b>LIVELLO</b>	<b>CODICE</b>
- <b>categoria controparti "A"</b> .....	<b>2</b>	<b>810</b>
- Stato / Governo italiano - Banca d'Italia .....	1	812
- Stati / Governi / Banche centrali di altri paesi "zona A" e Istituzioni dell'UE .....	1	816
- <b>categoria controparti "B"</b> .....	<b>2</b>	<b>830</b>

- 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
- <b>categoria controparti "C" .....</b>	<b>2</b>	<b>870</b>
- 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
- famiglie (consumatrici e produttrici) .....	1	867
- altri.....	1	889
- <b>non applicabile.....</b>	<b>2</b>	<b>890</b>
- 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	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
- aziende partecipate dallo Stato.....	1	475
- Imprese controllate dalle Amministrazioni locali.....	1	476
- Imprese controllate da altre Amministrazioni pubbliche .....	1	477
- holding operative finanziarie.....	1	285
- società di partecipazione (holding) di gruppi finanziari .....	1	287
- società di partecipazione (holding) di gruppi		

non finanziari .....	1 .....	288
- altri.....	1 .....	879
- <b>non applicabile.....</b>	<b>2 .....</b>	<b>890</b>
- 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:

<u>TITOLI</u>	<u>LIVELLO</u>	<u>CODICE</u>
- <b>titoli di Stato italiano.....</b>	<b>2 .....</b>	<b>0100010</b>
- 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
- <b>titoli di debito .....</b>	<b>2 .....</b>	<b>0100020</b>
- 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
- <b>titoli di capitale</b> .....	<b>2</b>	<b>0100030</b>
- azioni e quote .....	1	0100301
- altri titoli di capitale .....	1	0100399
- <b>parti di organismi di investimento collettivo del risparmio (O.I.C.R.)</b> .....	<b>2</b>	<b>0100040</b>
- 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
- <b>altri titoli</b> .....	<b>2</b>	<b>0100090</b>
- altri titoli .....	1	0100090
<b>CONTRATTI DERIVATI</b> .....	<b>LIVELLO</b> .....	<b>CODICE</b>
- <b>futures</b> .....	<b>2</b>	<b>0200010</b>
- 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
- <b>swaps e fras</b> .....	<b>2</b>	<b>0200020</b>
- 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
-	<b>opzioni su titoli.....</b>	<b>2</b>	<b>0200030</b>
-	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
-	<b>opzioni su futures .....</b>	<b>2</b>	<b>0200040</b>
-	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
-	<b>opzioni su valute.....</b>	<b>2</b>	<b>0200050</b>
-	opzioni call.....	1	0200501
-	opzioni put .....	1	0200502
-	altre opzioni su valute.....	1	0200503
-	<b>opzioni su tassi di interesse .....</b>	<b>2</b>	<b>0200060</b>
-	cap.....	1	0200601
-	floor .....	1	0200602
-	opzioni su IRS (swaptions) .....	1	0200603
-	altre opzioni su tassi di interesse.....	1	0200604
-	<b>opzioni su altri valori o indici .....</b>	<b>2</b>	<b>0200070</b>
-	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
-	<b>covered warrant .....</b>	<b>2</b>	<b>0201310</b>
-	covered warrant.....	1	0201310
-	<b>certificates .....</b>	<b>2</b>	<b>0104012</b>
-	certificates .....	1	0104012

- <b>derivati di credito</b> .....	<b>2</b> .....	<b>0200700</b>
- credit default swaps.....	1.....	0200803
- credit linked notes .....	1.....	0104011
- total rate of return swaps.....	1.....	0200804
- altri derivati di credito .....	1.....	0200807
- <b>titoli strutturati</b> .....	<b>2</b> .....	<b>0200809</b>
- titoli strutturati (componente derivativa).....	1.....	0200809
- <b>altri contratti derivati</b> .....	<b>2</b> .....	<b>0200813</b>
- altri contratti derivati .....	1.....	0200813
- <b>non applicabile</b> .....	<b>2</b> .....	<b>0777770</b>
- 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 RES - 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
- 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 investimento ..... 873
- banche di paesi della "zona B"..... 872
- casse di compensazione e garanzia di paesi extra UE..... 848
- organismi di deposito centralizzato di paesi extra UE..... 850
- altri soggetti appartenenti a paesi extra UE ..... 852

H) 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.

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 attivi..... 021
- Valori mobiliari quotati su mercati ufficiali non attivi..... 022
- Valori mobiliari quotati su altri mercati attivi ..... 023
- Valori mobiliari non quotati..... 005
- Non applicabile ..... 770

Con riferimento alla Sez. VI – Segnalazioni statistiche, deve essere utilizzata la seguente codifica:

- 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

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:

<b>CODICE</b>	<b>PROVINCIA</b>
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 RES.

Q) 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

R) TIPO SOGGETTO DELEGANTE/DELEGATO (codice campo 941): E' rappresentato mediante codici di 5 posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- banca italiana.....	00245
- banca estera .....	00884
- SIM italiana .....	00264
- impresa di investimento estera .....	10021
- fondi comuni d'investimento italiani .....	10055
- sicav italiana .....	10049
- sicav estera.....	10050
- fondi comuni di diritto estero .....	10057
- società di gestione italiana.....	10019
- società di gestione estera .....	10051
- fondo pensione .....	10029
- altro.....	10041

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:

- fisso .....	83
- indicizzato .....	84
- indeterminato .....	86
- 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:

	<b>CODICE</b>
- 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 RES 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

## 2.2 Gruppi di SIM – Segnalazioni statistiche consolidate

### 2.2.1 Gruppi di SIM non quotati

#### 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 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

### 2.2.2 Gruppi di SIM quotati

Le variabili cui occorre far riferimento sono riportate nel Tomo II – Capitolo 1 “Segnalazioni di vigilanza consolidate”: basi informative 'M1' e 'M2'.

## **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 iscritti all'albo unico (art. 106 D.lgs. 385/93), degli istituti di pagamento e degli istituti di moneta elettronica.

#### 3.1 Segnalazioni statistiche su base individuale.

##### 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 RES – 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 euro .....9
- 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 residenti .....2
- 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:

<b><u>CODICE</u></b>	<b><u>PROVINCIA</u></b>
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 02068 per la voce 58560, codice campo 00016 per tutte le altre voci): viene utilizzata la codifica (3 posizioni numeriche) predisposta e gestita dalla Banca d'Italia – Servizio RES.

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 residente .....	081
- Depositario non residente .....	083
- Deposito presso il segnalante .....	086
- Titolo non disponibile .....	087

N) Divisa. L'informazione è richiesta nella parte fissa del record "movimento". I codici da utilizzare sono:

- euro .....1
- altre valute .....2

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 irrilevante .....3
- fino a 1 anno .....5
- da oltre 1 anno fino a 5 anni .....16
- oltre 5 anni .....17

P) Esposizioni con/senza concessioni (codice campo 01297): è rappresentato mediante codici di 3 posizioni numeriche. I codici da utilizzare sono i seguenti:

- esposizioni creditizie oggetto di concessioni deteriorate .....285
- altre esposizioni creditizie .....286

Q) Esposizioni derivanti da cartolarizzazione (codice campo 01017).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- senior .....550005
- mezzanine. ....550006
- junior .....550007

R) Fascia scaduto (codice campo 01216): è rappresentato mediante codici di 3 posizioni numeriche.

Per le voci 52190 e 52192 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 anno .....400
- Oltre 1 anno .....403

Per le voci 52371, 52373 e 52395 i codici da utilizzare sono i seguenti:

- Fino a 1 mese .....395



- Da oltre 1 mese fino a 3 mesi ..... 024
- Da 3 mesi fino a 6 mesi ..... 399
- Da 6 mesi fino a 1 anno..... 400
- Oltre 1 anno ..... 403

S) 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

T) 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

U) Modalità di avvio (codice campo 1279): E' rappresentata mediante codice numerico di due posizioni. I valori previsti sono:

- file batch ..... 67
- disposizione singola ..... 68

V) 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

W) 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

X) 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 RES - Divisione "Informazioni anagrafiche soggetti e strumenti finanziari") richiesta dalle società veicolo e comunicata alle stesse, al servicer e all'originator dell'operazione.

Per la segnalazione dei "crediti residui dopo il rimborso degli "ABS" il numero operazione deve assumere il valore convenzionale 99998.

Y) Oggetto rettifiche (codice campo 04009).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- rettifiche su anticipi .....	535
- rettifiche su corrispettivi per factoring pro soluto.....	536
- rettifiche su corrispettivi per altre cessioni di factoring.....	537

Z) 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

AA) Portafoglio contabile (codice campo 01014).

Per la voce 52338 i codici da utilizzare sono i seguenti:

- 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 .....	516
-----------------	-----

Per le voci 52371, 52373 e 52394 i codici da utilizzare sono i seguenti:

- attività finanziarie valutate al fair value .....	502
- attività finanziarie disponibili per la vendita .....	503
- attività finanziarie detenute sino alla scadenza .....	504
- crediti .....	516
- attività non correnti e gruppi di attività in via di dismissione .....	507

Per la voce 52395 i codici da utilizzare sono i seguenti:

- 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
- 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 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
- 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 a fini di vigilanza.....550
- portafoglio bancario .....553

BB) Qualità del credito (codice campo 00522).

Per le voci 40728, 52004, 52006, 52008, 52010, 52012, 52014, 52170, 52212, 52288, 52292, 52511, 52515, 52804, 52806, 52808, 52810, 52812 e 52814 i codici da utilizzare sono i seguenti:

- in bonis .....550010
- deteriorati.....550009

Per le voci 46495, 46500, 52122, 52151, 52164, 52166, 52184, 52186, 52254, 52296, 52298, 52393.10, 52393.14, 52420, 52521, 52600, 52601, 52622, 58410, 58415, e 58892 i codici da utilizzare sono i seguenti:

- in bonis: esposizioni oggetto di concessioni .....550029
- in bonis: altre esposizioni.....550030
- sofferenze: esposizioni oggetto di concessioni.....550031
- sofferenze: altre esposizioni .....550032
- inadempienze probabili: esposizioni oggetto di concessioni.....550033
- inadempienze probabili: altre esposizioni .....550034
- esposizioni scadute deteriorate: esposizioni oggetto di concessioni 550035
- esposizioni scadute deteriorate: altre esposizioni .....550036
- non applicabile.....000777  
(l'opzione "non applicabile" è ammessa esclusivamente con riferimento alle voci 52600 e 52601)

Per le voci 52393.02 e 52393.06 i codici da utilizzare sono i seguenti:

- in bonis: esposizioni oggetto di concessioni .....550029

- in bonis: altre esposizioni..... 550030

CC) 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:	
- aperti .....	0100418
- chiusi .....	0100419
- exchange traded funds .....	0100502

e) Altri titoli .....0100091

f) Altri valori .....0000995

### 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 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

**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 agreements..... 0200207
- altri swaps ..... 0200299

**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 italiano..... 0200301
- opzioni put su titoli dello Stato italiano ..... 0200302
- 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
<b>f) Opzioni su tassi di interesse</b>	
- cap.....	0200601
- floor.....	0200602
- opzioni su IRS (swaptions) .....	0200603
- altre opz. Su tassi di interesse.....	0200604
<b>g) Opzioni su merci</b>	
- opzioni call.....	0200231
- opzioni put .....	0200232
- altre opzioni .....	0200233
<b>h) Opzioni su altri valori o indicatori .....</b>	<b>0200070</b>
<b>i) Forward</b>	
- titoli di debito.....	0200223
- titoli di capitale .....	0200224
- quote di OICR.....	0200225
- valute e oro.....	0200226
- merci.....	0200227
- altro.....	0200228
<b>i) Altri contratti derivati.....</b>	<b>0200230</b>
<b>DERIVATI CREDITIZI.....</b>	<b>0200700</b>

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 Italia ..... 1
- soggetti non residenti in Italia ..... 2

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 RES.

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 Approccio (codice campo 01296): è rappresentato mediante codici di 4 posizioni numeriche.

Per le voci 52371.06/14/22/30, 52378.66 e 52394.06, i codici da utilizzare sono i seguenti:

- Per soggetto debitore.....1501
- Per singola transazione .....1502

Per le voci 52371.10 e 52394.10, i codici da utilizzare sono i seguenti:

- Per soggetto debitore.....1501
- Per singola transazione con pulling effect.....1503
- Per singola transazione senza pulling effect.....1504

AH) 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
- prestiti su pegno ..... 524
- altri finanziamenti..... 523

AI) Tipo carta (codice campo 00902).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- Personale..... 01
- Aziendale ..... 02

AJ) Tipo controllo (codice campo 04517).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- controllate ..... 31
- controllate congiuntamente..... 32
- sottoposte a influenza notevole ..... 33
- altre..... 34

AK) 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

AL) 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

AM) Tipo garante (codice campo 00353).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- banche.....51
- intermediari finanziari. ....57
- enti pubblici.....54
- altri.....56

AO) 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

AP) Tipo impegno (codice campo 01072).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- impegni a utilizzo certo .....	1
- impegni a utilizzo incerto.....	2

AQ) Tipo importo (codice campo 00350).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- numero.....	8
- importo.....	9

AR) Tipo locazione finanziaria (codice campo 00901).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- Leasing finanziario agevolato .....094
- Leasing finanziario non agevolato .....095

AS) Tipo rischio (codice campo 00356).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- a rischio proprio .....15
- non a rischio proprio .....16

AT) Tipo tasso dell'operazione (codice campo 00113).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- Tasso fisso .....83
- Tasso indicizzato .....84

AU) Tipo tecnologia (codice campo 01073).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- EMV compliant .....65
- non EMV compliant .....66

AV) 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 RES.

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".

AW) 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 e assicurativi 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 .....	123
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
Accordo tra le parti - Forbearance.....	1013
Dati non ripartibili .....	7777

H) Portafoglio regolamentare

Deve essere utilizzata la codifica dei portafogli regolamentari di provenienza della controparte valida al momento dell'ingresso in default (cfr. Circolare n. 284 del 18 Giugno 2013, "Istruzioni per la compilazione delle segnalazioni delle perdite storicamente registrate sulle posizioni in default", paragrafo 11).

Il valore "Dati non ripartibili" corrisponde a 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

Per le posizioni classificate in default entro il 31 Dicembre 2014:

Sofferenza .....	551000
Incagli.....	550002
Ristrutturate .....	550014
Scadute e/o sconfinanti deteriorate .....	550016
Sofferenze già incomplete workout.....	550026

Per le posizioni classificate in default a partire dal 1° Gennaio 2015:

Sofferenza forbearance .....	551003
Sofferenza non forbearance .....	551004
Inadempienza probabile forbearance .....	550039
Inadempienza probabile non forbearance .....	550040
Scadute e/o sconfinanti deteriorate forbearance .....	550041
Scadute e/o sconfinanti deteriorate non forbearance .....	550042
Sofferenze già incomplete workout.....	550026

M) Status fine

Per le posizioni classificate in default entro il 31 Dicembre 2014:

Sofferenza .....	551000
Incagli.....	550002
Crediti in bonis .....	550010
Ristrutturate .....	550014
Scadute e/o sconfinanti deteriorate .....	550016
Incomplete workout .....	550027

Per le posizioni classificate in default a partire dal 1° Gennaio 2015:

Sofferenza forbearance .....	551003
Sofferenza non forbearance .....	551004
Inadempienza probabile forbearance .....	550039
Inadempienza probabile non forbearance .....	550040
Crediti in bonis forbearance .....	550043
Crediti in bonis non forbearance .....	550044

Scadute e/o sconfinanti deteriorate forbearance .....	550041
Scadute e/o sconfinanti deteriorate non forbearance .....	550042
Incomplete workout .....	550027

### 3.3 Segnalazioni statistiche su base 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)” parr. “Segnalazioni di vigilanza consolidata (basi informative 'M1', 'M2’)” e “Segnalazioni su base consolidata relative alle informazioni per paese di controparte (base informativa “EP”)”).

### 3.4 Segnalazioni prudenziali su base individuale.

#### 3.4.1 Intermediari finanziari con esclusione di quelli di cui al successivo par. 3.4.2

Le variabili cui occorre far riferimento sono le medesime indicate per le corrispondenti segnalazioni delle banche (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’)”).

#### 3.4.2 Istituti di pagamento puri e ibridi non finanziari, istituti di moneta elettronica puri e ibridi non finanziari

#### 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 irrilevante .....3

B) Tipo importo (codice campo 00350)

a) Metodologia standardizzata e metodologia standardizzata semplificata:

- Valore ponderato .....3
- 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 prudenziali .....	86
- Equivalente creditizio derivati/SFT/operazioni con regolamento a lungo termine.....	89
- Equivalente creditizio dei contratti derivati finanziari.....	97

b) Metodologia IRB:

- Valore ponderato .....	3
- 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 RES.

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:

- Senior.....	550005
- Mezzanine.....	550006
- Junior.....	550007

N) Tipo cartolarizzazione (codice campo 01126).

I codici da utilizzare sono i seguenti:

- tradizionale.....	604
- 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 (payment and settlement) .....	615
- gestioni fiduciarie (agency services) .....	616
- gestioni patrimoniali (asset management) .....	617
- intermediazione al dettaglio (retail brokerage) .....	618
- totale linee di business .....	629

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

### **3.5 Segnalazioni prudenziali su base 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')”).

## **4 Segnalazioni degli intermediari finanziari dell'elenco generale e speciale ante riforma (2) fino alla data di iscrizione all'Albo unico (art. 106 D.lgs. 385/93) (3).**

### **4.1 Intermediari finanziari dell'elenco generale non iscritti all'Albo unico (4).**

#### **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".

---

2 ) Di seguito, rispettivamente elenco generale ed elenco speciale.

3 ) Medesimo regime segnaletico si applica agli Istituti di pagamento e agli Istituti di moneta elettronica fino alla data contabile del 30 settembre 2015.

4) Si tratta degli obblighi segnaletici che gli intermediari finanziari iscritti all'elenco generale che a regime saranno iscritti nel nuovo Albo unico sono tenuti ad adottare fino all'iscrizione al nuovo albo e degli obblighi segnaletici che gli intermediari finanziari iscritti all'elenco generale che a regime non saranno iscritti nel nuovo Albo unico sono tenuti ad adottare fino alla data in cui avverrà la loro cancellazione dall'elenco generale.

D) Regione intermediario (codice campo 00013):

<b>CODICE</b>	<b>REGIONE</b>
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):

<b>CODICE</b>	<b>REGIONE</b>
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 RES – 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'area dell'euro .....	768
- Famiglie produttrici dei paesi UE non membri dell'area dell'euro .....	769
- Famiglie produttrici dei paesi non UE .....	772
- Famiglie consumatrici dei paesi UE membri dell'area dell'euro .....	773
- Famiglie consumatrici dei paesi UE non membri dell'area dell'euro .....	774
- Famiglie consumatrici dei paesi non UE .....	775

## **4.2 Intermediari finanziari dell'elenco speciale non iscritti all'Albo unico (5)(6).**

Le variabili cui occorre far riferimento sono le medesime indicate ai precedenti paragrafi 3.1, 3.2, 3.4.2.

---

5) Si tratta degli obblighi segnaletici che gli intermediari finanziari iscritti all'elenco speciale che a regime saranno iscritti nel nuovo Albo unico sono tenuti ad adottare fino all'iscrizione al nuovo albo e degli obblighi segnaletici che gli intermediari finanziari iscritti all'elenco speciale che a regime non saranno iscritti nel nuovo Albo unico sono tenuti ad adottare fino alla data in cui avverrà la loro cancellazione dall'elenco speciale.

6 ) Medesimo regime segnaletico si applica agli Istituti di pagamento e agli Istituti di moneta elettronica fino alla data contabile del 30 settembre 2015.

## 5 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:

- 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 dei dati.

C) DURATA: L'informazione è richiesta nella parte fissa del record "movimento - segnalazione".

Per la base informativa "T7" (fondi monetari), i codici da utilizzare sono:

- fino a un anno..... 5
- da oltre un anno fino a due anni ..... 6
- oltre due anni ..... 7

Per le basi informative "T3" (fondi aperti) e "TS" (fondi speculativi), i codici da utilizzare sono:

- fino a un anno.....5
- oltre un anno.....18

N.B.: Ove l'informazione non è richiesta indicare convenzionalmente **00** (due volte zero) nel campo corrispondente, previsto nei tracciati dei supporti per la trasmissione dei dati.

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:

	<b>LIVELLO</b>	<b>CODICE</b>
- <b>categoria controparte: Stati, Amministrazioni centrali</b>		
- Stato / Governo italiano, Banca d'Italia.....	1	812
- Stati / Governi / Banche centrali di altri paesi "zona A" e Istituzioni dell'UE .....	1	816
- <b>categoria controparte: soggetti qualificati</b>		
- 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 .....	1	840
- enti del settore pubblico di paesi della "zona A" .....	1	841
- altre controparti qualificate .....	1	849
- <b>categoria controparte: altri soggetti</b>		
- 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
- famiglie (consumatrici e produttrici) .....	1	867
- altri.....	1	889
- <b>non applicabile</b>		
- non applicabile .....	1	890

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:

	<b>LIVELLO</b>	<b>CODICE</b>
- <b>categoria emittenti "A"</b>		
- Stato / Governo italiano, Banca d'Italia.....	1	812

-	Stati / Governi / Banche centrali di altri paesi "zona A" e Istituzioni dell'U.E.....	1	.....816
-	<b>categoria emittenti "B"</b>		
-	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.....	1	.....840
-	enti del settore pubblico di paesi della "zona A" .....	1	.....841
-	altri emittenti qualificati .....	1	.....859
-	<b>categoria emittenti "C"</b>		
-	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
-	aziende partecipate dallo Stato.....	1	.....475
-	imprese controllate dalle Amministrazioni locali .....	1	.....476
-	imprese controllate da altre Amministrazioni pubbliche .....	1	.....477
-	holding operative finanziarie.....	1	.....285
-	società di partecipazione (holding) di gruppi finanziari .....	1	.....287
-	società di partecipazione (holding) di gruppi non finanziari .....	1	.....288
-	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) TITOLI	LIVELLO	CODICE
- <b>titoli di Stato italiano</b> .....	<b>2</b> .....	<b>0101010</b>
- 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
- <b>titoli di debito</b> .....	<b>2</b> .....	<b>0101020</b>
- 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
- <b>titoli di capitale .....</b>	<b>2</b>	<b>0100030</b>
- 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
- <b>parti di organismi di investimento collettivo del risparmio (O.I.C.R.).....</b>	<b>2</b>	<b>0101040</b>
- 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
- <b>altri titoli .....</b>	<b>2</b>	<b>0100091</b>
- altri titoli .....	1	0100091
- <b>diritti e warrant.....</b>	<b>2</b>	<b>0101039</b>
- su titoli di capitale .....	1	0101030
- su titoli di debito .....	1	0101031

## **CONTRATTI DERIVATI**

	<b>LIVELLO</b>	<b>CODICE</b>
- <b>futures .....</b>	<b>2</b>	<b>0200010</b>
- 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
-	<b>swaps e fras .....</b>	<b>2</b>	<b>0200020</b>
-	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
-	<b>opzioni su titoli.....</b>	<b>2</b>	<b>0201030</b>
-	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
-	<b>opzioni su futures .....</b>	<b>2</b>	<b>0200040</b>
-	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
-	<b>opzioni su valute.....</b>	<b>2</b>	<b>0200050</b>
-	opzioni call su valute .....	1	0200501
-	opzioni put su valute.....	1	0200502
-	altre opzioni su valute.....	1	0200503
-	<b>opzioni su tassi di interesse .....</b>	<b>2</b>	<b>0200060</b>
-	cap.....	1	0200601
-	floor .....	1	0200602
-	opzioni su IRS (swaptions) .....	1	0200603
-	altre opzioni su tassi di interesse.....	1	0200604

- <b>opzioni su altri valori o indici</b> .....	<b>2</b> .....	<b>0201070</b>
- 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
- <b>derivati su crediti</b> .....	<b>2</b> .....	<b>0200700</b>
- derivati su crediti .....	1 .....	0200700
- <b>compravendite a termine di valuta</b> .....	<b>2</b> .....	<b>0200470</b>
- compravendite a termine di valuta .....	1 .....	0200470
- <b>altri contratti derivati</b> .....	<b>2</b> .....	<b>0200481</b>
- 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:

<b>TITOLI</b>	<b>LIVELLO</b>	<b>CODICE</b>
- <b>titoli di stato e assimilati</b> .....	<b>2</b> .....	<b>0101010</b>
- <b>titoli di debito e diritti e warrant su titoli di debito</b> .....	<b>2</b> .....	<b>0102020</b>
- <b>titoli di capitale, diritti e warrant su titoli di capitale</b> .....	<b>2</b> .....	<b>0103030</b>
- <b>parti di O.I.C.R.</b> .....	<b>2</b> .....	<b>0101040</b>
- <b>altri titoli</b> .....	<b>2</b> .....	<b>0109090</b>
- <b>strumenti derivati aventi ad oggetto titoli di stato e assimilati</b> .....	<b>2</b> .....	<b>0201010</b>
- <b>strumenti derivati aventi ad oggetto titoli di debito</b> .....	<b>2</b> .....	<b>0202010</b>
- <b>strumenti derivati aventi ad oggetto tassi di interesse</b> .....	<b>2</b> .....	<b>0206010</b>
- <b>strumenti derivati aventi ad oggetto titoli di capitale e relativi indici</b> .....	<b>2</b> .....	<b>0204010</b>
- <b>strumenti derivati aventi ad oggetto valute o tassi di cambio</b> .....	<b>2</b> .....	<b>0205010</b>
- <b>altri strumenti finanziari derivati</b> .....	<b>2</b> .....	<b>0209010</b>

J) CODICE CLASSE (codice campo 938): Corrisponde alla codifica ISIN gestita dalla Banca d'Italia – Servizio RES – 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 RES – 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:

- Montetitoli ..... 82
- Altra depositaria residente ..... 81
- Depositaria non residente ..... 83

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
- agricola ..... 090
- residenziale (es.: abitazioni e relative pertinenze) ..... 095
- logistica (es.: magazzini)..... 096
- uffici (esclusi quelli pubblici)..... 528
- altra..... 529

P) FINALITA' (codice campo 910): È rappresentato da codici di due posizioni numeriche. I valori previsti sono:

- copertura .....08
- non copertura .....09

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 RES.

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 italiano ..... 10033
- Società di gestione/SICAV di diritto estero ..... 10035
- altro soggetto ..... 10036

Y) PERIODICITA' DI CALCOLO DELLE PROVVIGIONI (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 applicabile ..... 00

Z) PERIODICITA' DI PRELIEVO DELLE PROVVIGIONI (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 applicabile .....	00

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:

<b>CODICE</b>	<b>PROVINCIA</b>
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
- inadempienze probabili.....0550028
- esposizioni scadute deteriorate .....0550020

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 Monetaria ..... 704
- altro ..... 705

JJ) TIPO GESTIONE SGR (codice campo 513): È rappresentato da codici di quattro posizioni numeriche XXYZ.

XX assume i seguenti valori:

- fondo aperto non speculativo ..... 01
- fondo chiuso mobiliare non speculativo ..... 02

- fondo chiuso immobiliare non speculativo .....	03
- fondo speculativo.....	04
- fondo pensione aperto.....	05
- fondo pensione negoziale.....	06
- altre forme/gestioni pensionistiche .....	07
- patrimonio o comparto di SICAV .....	08
- gestione individuale in valori mobiliari .....	09
- gestione individuale in fondi .....	10
- gestione individuale in valori mobiliari e fondi.....	11
- gestione di partecipazioni bancarie .....	12
- altro.....	13

Y assume i seguenti valori:

- armonizzato italiano.....	1
- non armonizzato italiano.....	2
- armonizzato estero .....	3
- non armonizzato estero .....	4
- non applicabile.....	0

Z assume i seguenti valori:

- di fondi.....	1
- riservato .....	2
- 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 RES.

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

**SEGNALAZIONI PER GLI INTERMEDIARI FINANZIARI ISCRITTI NELL'ALBO UNICO, PER GLI ISTITUTI DI PAGAMENTO E PER GLI ISTITUTI DI MONETA ELETTRONICA IBRIDI FINANZIARI**

**IV SEZIONE - PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI 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						
YF		CAPITALE PRIMARIO DI CLASSE 1 (COMMON EQUITY TIER 1 - CET1).....	<b>59010</b>						
		STRUMENTI DI CET1:							
		CAPITALE VERSATO.....	<b>02</b>	3	1	1	T	XD	
		DI CUI: CAPITALE VERSATO DALLE PUBBLICHE AUTORITA' IN SITUAZIONI DI EMERGENZA.....	<b>03</b>	3	1	1	T	XD	
		SOVRAPPREZZI DI EMISSIONE.....	<b>04</b>	3	1	1	T	XD	
		(-) STRUMENTI DI CET1 PROPRI:.....	<b>06</b>	3	1	1	T	XD	
		(-) STRUMENTI DI CET1 DETENUTI DIRETTAMENTE.....	<b>08</b>	3	1	1	T	XD	
		(-) STRUMENTI DI CET1 DETENUTI INDIRETTAMENTE.....	<b>10</b>	3	1	1	T	XD	
		(-) STRUMENTI DI CET1 DETENUTI SINTETICAMENTE.....	<b>12</b>	3	1	1	T	XD	
		(-) STRUMENTI DI CET1 SUI QUALI L'ENTE HA OBBLIGO REALE O EVENTUALE DI ACQUISTO.....	<b>14</b>	3	1	1	T	XD	
		RISERVE:							
		RISERVE DI UTILI:							
		UTILI O PERDITE PORTATI A NUOVO.....	<b>16</b>	3	1	1	T	XD	
		UTILI O PERDITA DI PERIODO:.....	<b>18</b>	3	1	1	T	XD	
		UTILE O PERDITA DI PERTINENZA DELLA CAPOGRUPPO.....	<b>20</b>	3	1	1	T	XD	
		(-) QUOTA DELL'UTILE DEL PERIODO NON INCLUSA NEL CET1.....	<b>22</b>	3	1	1	T	XD	
		ALTRE COMPONENTI DI CONTO ECONOMICO ACCUMULATE (OCI) (*).....	<b>24</b>	3	1	1	T	XD	
		RISERVE - ALTRO.....	<b>26</b>	3	1	1	T	XD	
		STRUMENTI DI CET1 OGGETTO DI DISPOSIZIONI TRANSITORIE (GRANDFATHERING).....	<b>28</b>	3	1	1	T	XD	
		FILTRI PRUDENZIALI:							
		(-) INCREMENTO DI CET1 CONNESSO CON LE ATTIVITÀ CARTOLARIZZATE.....	<b>32</b>	3	1	1	T	XD	
		COPERTURA DEI FLUSSI DI CASSA (CASH FLOW HEDGE).....	<b>34</b>	3	1	1	T	XD	
		UTILI O PERDITE SULLE PASSIVITÀ VALUTATE AL VALORE EQUO DOVUTI AL PROPRIO MERITO DI CREDITO.....	<b>36</b>	3	1	1	T	XD	
		UTILI O PERDITE DI VALORE EQUO DERIVANTI DAL RISCHIO DI CREDITO PROPRIO DELL'ENTE CORRELATO A PASSIVITÀ DERIVATIVE.....	<b>38</b>	3	1	1	T	XD	
		(-) RETTIFICHE DI VALORE DI VIGILANZA.....	<b>40</b>	3	1	1	T	XD	
		DETRAZIONI:							
		AVVIAMENTO:							
		(-) AVVIAMENTO CONNESSO CON ATTIVITÀ IMMATERIALI.....	<b>42</b>	3	1	1	T	XD	
		(-) AVVIAMENTO INCLUSO NELLA VALUTAZIONE DEGLI INVESTIMENTI SIGNIFICATIVI.....	<b>44</b>	3	1	1	T	XD	
		PASSIVITÀ FISCALI DIFFERITE ASSOCIATE ALL'AVVIAMENTO.....	<b>46</b>	3	1	1	T	XD	
		ALTRE ATTIVITÀ IMMATERIALI:							
		(-) ALTRE ATTIVITÀ IMMATERIALI PRIMA DELLA DEDUZIONE DELLE PASSIVITÀ FISCALI DIFFERITE.....	<b>48</b>	3	1	1	T	XD	
		PASSIVITÀ FISCALI DIFFERITE CONNESSE CON LE ALTRE ATTIVITÀ IMMATERIALI.....	<b>50</b>	3	1	1	T	XD	

**SEGNALAZIONI PER GLI INTERMEDIARI FINANZIARI ISCRITTI NELL'ALBO UNICO, PER GLI ISTITUTI DI PAGAMENTO E PER GLI ISTITUTI DI MONETA ELETTRONICA IBRIDI FINANZIARI**

**IV SEZIONE - PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI 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	
	(-) 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 - ECCEDENZIA DELLE PERDITE ATTESE RISPETTO ALLE RETTIFICHE DI VALORE.....	54	3	1	1	T	XD		
	FONDI PENSIONE A PRESTAZIONE DEFINITA: (-) ATTIVITÀ DI FONDI PENSIONE A PRESTAZIONE DEFINITA.....	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		
	(-) ECCEDENZIA 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		
YF	CAPITALE AGGIUNTIVO DI CLASSE 1 (ADDITIONAL TIER 1 - AT1).....	59012							
	STRUMENTI DI AT1: CAPITALE VERSATO (*).....	02	3	1	1	T	XD		

**SEGNALAZIONI PER GLI INTERMEDIARI FINANZIARI ISCRITTI NELL'ALBO UNICO, PER GLI ISTITUTI DI PAGAMENTO E PER GLI ISTITUTI DI MONETA ELETTRONICA IBRIDI FINANZIARI**

**IV SEZIONE - PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI 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					
	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
	(-) ECCEDENZA 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
	ECCEDENZA 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

(\*) Segnalazione a carico dei soli intermediari che raccolgono risparmio presso il pubblico

YF	CAPITALE DI CLASSE 1.....	59014					
	TOTALE CAPITALE DI CLASSE 1.....	00	3	1	1	T	XD

YF	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						



**SEGNALAZIONI PER GLI INTERMEDIARI FINANZIARI ISCRITTI NELL'ALBO UNICO, PER  
GLI ISTITUTI DI PAGAMENTO E PER GLI ISTITUTI DI MONETA ELETTRONICA IBRIDI  
FINANZIARI**

**IV SEZIONE - PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI 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					
	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
	ECCEDEXZA 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
<b>YF</b>	FONDI PROPRI.....	<b>59018</b>					
	TOTALE FONDI PROPRI.....	00	3	1	1	T	XD

**SEGNALAZIONI PER GLI INTERMEDIARI FINANZIARI ISCRITTI NELL'ALBO UNICO,  
PER GLI ISTITUTI DI PAGAMENTO E PER GLI ISTITUTI DI MONETA ELETTRONICA  
IBRIDI FINANZIARI**

**IV SEZIONE - PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI 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					
<b>YF</b>	INFORMAZIONI SU STRUMENTI DI CAPITALE CON CARATTERISTICHE REVERSIBILI.....	<b>59020</b>					
	STRUMENTI DI CAPITALE LA CUI INCLUSIONE NEL CET1 DIPENDE DA CARATTERISTICHE REVERSIBILI.....	<b>02</b>	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI CAPITALE LA CUI INCLUSIONE NELL'AT1 DIPENDE DA CARATTERISTICHE REVERSIBILI (*).....	<b>04</b>	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI CAPITALE LA CUI INCLUSIONE NEL T2 DIPENDE DA CARATTERISTICHE REVERSIBILI.....	<b>06</b>	3	1	1	T	XD
	(*) Segnalazione a carico dei soli intermediari che raccolgono risparmio presso il pubblico						
<b>YF</b>	INFORMAZIONI SULLA FISCALITÀ:.....	<b>59022</b>					
	TOTALE ATTIVITÀ FISCALI DIFFERITE (DTA):						
	DTA CHE NON SI BASANO SULLA REDDITIVITÀ FUTURA.....	<b>02</b>	3	1	1	T	XD
	DTA CHE SI BASANO SULLA REDDITIVITÀ FUTURA E NON DERIVANO DA DIFFERENZE TEMPORANEE.....	<b>04</b>	3	1	1	T	XD
	DTA CHE SI BASANO SULLA REDDITIVITÀ FUTURA E DERIVANO DA DIFFERENZE TEMPORANEE.....	<b>06</b>	3	1	1	T	XD
	TOTALE PASSIVITÀ FISCALI DIFFERITE (DTL):						
	DTL NON DEDUCIBILI DALLE DTA E CHE SI BASANO SULLA REDDITIVITÀ FUTURA.....	<b>08</b>	3	1	1	T	XD
	DTL DEDUCIBILI DALLE DTA E CHE SI BASANO SULLA REDDITIVITÀ FUTURA:						
	- DI CUI NON DERIVANTI DA DIFFERENZE TEMPORANEE...	<b>10</b>	3	1	1	T	XD
	- DI CUI DERIVANTI DA DIFFERENZE TEMPORANEE.....	<b>12</b>	3	1	1	T	XD
<b>YF</b>	INFORMAZIONI SUI MODELLI INTERNI ENTI IRB (SHORTFALL/EXCESS RESERVE).....	<b>59024</b>					
	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 SPECIFICHE.....	<b>02</b>	3	1	1	T	XD
	RETTIFICHE DI VALORE PRUDENZIALI E ALTRE RIDUZIONI DEI FONDI PROPRI.....	<b>04</b>	3	1	1	T	XD
	TOTALE PERDITE ATTESE.....	<b>06</b>	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 SPECIFICHE E POSTE SIMILI.....	<b>08</b>	3	1	1	T	XD
	TOTALE PERDITE ATTESE.....	<b>10</b>	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						

**SEGNALAZIONI PER GLI INTERMEDIARI FINANZIARI ISCRITTI NELL'ALBO UNICO,  
PER GLI ISTITUTI DI PAGAMENTO E PER GLI ISTITUTI DI MONETA ELETTRONICA  
IBRIDI FINANZIARI**

**IV SEZIONE - PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI**

<b>B A S E  I N F .</b>	<b>4.1.2 FONDI PROPRI SU BASE INDIVIDUALE  ALTRE INFORMAZIONI</b>	<b>VOCE</b>	<b>D U R A T A</b>	<b>D I V I S A</b>	<b>R E S I D E N Z A</b>	<b>P E R I O D I C I T A</b>	<b>N O T E</b>
		SOTVOC					
	ALTRE RIDUZIONI DEI FONDI PROPRI RISPETTO ALLE PERDITE ATTESE.....	<b>12</b>	3	1	1	T	XD

<b>YF</b>	INFORMAZIONI SU SOGLIE PER DETRAZIONI E CAPITALE AMMISSIBILE.....	<b>59026</b>					
	SOGLIA PER GLI INVESTIMENTI NON SIGNIFICATIVI IN STRUMENTI DI CET1 DI ALTRI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO (10%).....	<b>02</b>	3	1	1	T	XD
	SOGLIA 10% EX ARTICOLO 48 CRR.....	<b>04</b>	3	1	1	T	XD
	SOGLIA 17,65% EX ARTICOLO 48 CRR.....	<b>06</b>	3	1	1	T	XD
	CAPITALE AMMISSIBILE AI FINI DELLA DISCIPLINA DELLE PARTECIPAZIONI QUALIFICATE AL DI FUORI DEL SETTORE FINANZIARIO .....	<b>10</b>	3	1	1	T	XD
	CAPITALE AMMISSIBILE AI FINI DELLA DISCIPLINA DELLE GRANDI ESPOSIZIONI .....	<b>12</b>	3	1	1	T	XD

<b>YF</b>	INFORMAZIONI SU INVESTIMENTI NON SIGNIFICATIVI IN FONDI PROPRI DI ALTRI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO.....	<b>59028</b>					
	STRUMENTI DI CET1 AL NETTO DELLE POSIZIONI CORTE: STRUMENTI DI CET1 DETENUTI DIRETTAMENTE: POSIZIONE LUNGA LORDA.....	<b>02</b>	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE.....	<b>04</b>	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI CET1 DETENUTI INDIRETTAMENTE: POSIZIONE LUNGA LORDA.....	<b>06</b>	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE.....	<b>08</b>	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI CET1 DETENUTI SINTETICAMENTE: POSIZIONE LUNGA LORDA.....	<b>10</b>	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE.....	<b>12</b>	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI AT1 AL NETTO DELLE POSIZIONI CORTE: STRUMENTI DI AT1 DETENUTI DIRETTAMENTE: POSIZIONE LUNGA LORDA.....	<b>14</b>	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE.....	<b>16</b>	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI AT1 DETENUTI INDIRETTAMENTE: POSIZIONE LUNGA LORDA.....	<b>18</b>	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE.....	<b>20</b>	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI AT1 DETENUTI SINTETICAMENTE: POSIZIONE LUNGA LORDA.....	<b>22</b>	3	1	1	T	XD
	(-) POSIZIONE CORTA AMMISSIBILE PER LA COMPENSAZIONE.....	<b>24</b>	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI T2 AL NETTO DELLE POSIZIONI CORTE: STRUMENTI DI T2 DETENUTI DIRETTAMENTE: POSIZIONE LUNGA LORDA.....	<b>26</b>	3	1	1	T	XD

**SEGNALAZIONI PER GLI INTERMEDIARI FINANZIARI ISCRITTI NELL'ALBO UNICO,  
PER GLI ISTITUTI DI PAGAMENTO E PER GLI ISTITUTI DI MONETA ELETTRONICA  
IBRIDI FINANZIARI**

**IV SEZIONE - PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI 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					
	(-) 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
<b>YF</b>	INFORMAZIONI SU INVESTIMENTI SIGNIFICATIVI IN FONDI PROPRI DI ALTRI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO:.....	<b>59030</b>					
	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						

**SEGNALAZIONI PER GLI INTERMEDIARI FINANZIARI ISCRITTI NELL'ALBO UNICO,  
PER GLI ISTITUTI DI PAGAMENTO E PER GLI ISTITUTI DI MONETA ELETTRONICA  
IBRIDI FINANZIARI**

**IV SEZIONE - PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI 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					
	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
<b>YF</b>	ESPOSIZIONI PONDERATE PER IL RISCHIO DI INVESTIMENTI NON DEDOTTI DAI CORRISPONDENTI TIER DEI FONDI PROPRI DI ALTRI SOGGETTI APPARTENENTI AL SETTORE FINANZIARIO.....	<b>59032</b>					
	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
<b>YF</b>	DEROGA TEMPORANEA ALLA DEDUZIONE DAI FONDI PROPRI EX ART. 79 CRR.....	<b>59034</b>					
	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
<b>YF</b>	FLOOR.....	<b>59037</b>					
	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
<b>YF</b>	SOGLIA DI RILEVANZA PER LA SEGNALAZIONE DELLE ESPOSIZIONI NON-DOMESTICHE.....	<b>59042</b>					
	ESPOSIZIONE ORIGINARIA NON DOMESTICA.....	02	3	1	1	T	XD
	TOTALE DELLE ESPOSIZIONI ORIGINARIE.....	04	3	1	1	T	XD

**SEGNALAZIONI PER GLI INTERMEDIARI FINANZIARI ISCRITTI NELL'ALBO UNICO, PER GLI ISTITUTI DI PAGAMENTO E PER GLI ISTITUTI DI MONETA ELETTRONICA IBRIDI FINANZIARI**

**IV SEZIONE - PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI**

B A S E  I N F .	4.3 GRANDI ESPOSIZIONI SU BASE INDIVIDUALE	VOCE													P E R I O D I C I T A	N O T E	
		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 A	S O G G E T T O C O N N E S S O	P O S I Z I O N I D I R E T T A	T I P O L O G I E I M P O R T O	T I P O L O G I E C O N T R O P	T I P O L O G I E P O S I Z I O N I	T I P O L O G I E P O S I Z I O N I	T I P O L O G I E P O S I Z I O N I				
YF	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

YF	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

YF	ATTIVITÀ DI RISCHIO: COMPOSIZIONE DEI GRUPPI DI	59094															
	CLIENTI CONNESSI.....																
	-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

YF	TECNICHE DI ATTENUAZIONE DELLE ATTIVITÀ DI RISCHIO:	59096															
	COMPOSIZIONE DEI GRUPPI DI CLIENTI CONNESSI.....																
	EFFETTO DI SOSTITUZIONE: RIPARTIZIONE PER SOTTOSTANTE																

**SEGNALAZIONI PER GLI INTERMEDIARI FINANZIARI ISCRITTI NELL'ALBO UNICO, PER GLI ISTITUTI DI PAGAMENTO E PER GLI ISTITUTI DI MONETA ELETTRONICA IBRIDI FINANZIARI**

**IV SEZIONE - PATRIMONIO DI VIGILANZA E COEFFICIENTI PRUDENZIALI**

B A S E  I N F .	4.3 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 D I C E	S O G G E T T O	P O S I Z I O N I	T I P 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	
		sotvoco													
	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

YF	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	

(601) - La voce deve essere segnalata indicando convenzionalmente " 1 " nel campo importo.

YF	GRANDI ESPOSIZIONI: LIMITI APPLICATI.....	59104													
	-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 DEI GRUPPI FINANZIARI 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
		sotvoco										
<b>1F</b>	CAPITALE PRIMARIO DI CLASSE 1 (COMMON EQUITY TIER 1 - CET1).....	<b>34010</b>										
	STRUMENTI DI CET1:											
	CAPITALE VERSATO.....	<b>02</b>	3	1	1	T	XD					
	DI CUI: CAPITALE VERSATO DALLE PUBBLICHE AUTORITA' IN SITUAZIONI DI EMERGENZA.....	<b>03</b>	3	1	1	T	XD					
	SOVRAPPREZZI DI EMISSIONE.....	<b>04</b>	3	1	1	T	XD					
	(-) STRUMENTI DI CET1 PROPRI:.....	<b>06</b>	3	1	1	T	XD					
	(-) STRUMENTI DI CET1 DETENUTI DIRETTAMENTE.....	<b>08</b>	3	1	1	T	XD					
	(-) STRUMENTI DI CET1 DETENUTI INDIRETTAMENTE.....	<b>10</b>	3	1	1	T	XD					
	(-) STRUMENTI DI CET1 DETENUTI SINTETICAMENTE.....	<b>12</b>	3	1	1	T	XD					
	(-) STRUMENTI DI CET1 SUI QUALI L'ENTE HA OBBLIGO REALE O EVENTUALE DI ACQUISTO.....	<b>14</b>	3	1	1	T	XD					
	RISERVE:											
	RISERVE DI UTILI:											
	UTILI O PERDITE PORTATI A NUOVO.....	<b>16</b>	3	1	1	T	XD					
	UTILI O PERDITA DI PERIODO:.....	<b>18</b>	3	1	1	T	XD					
	UTILE O PERDITA DI PERTINENZA DELLA CAPOGRUPPO.....	<b>20</b>	3	1	1	T	XD					
	(-) QUOTA DELL'UTILE DEL PERIODO NON INCLUSA NEL CET1.....	<b>22</b>	3	1	1	T	XD					
	ALTRE COMPONENTI DI CONTO ECONOMICO ACCUMULATE (OCI) (*). .....	<b>24</b>	3	1	1	T	XD					
	RISERVE - ALTRO.....	<b>26</b>	3	1	1	T	XD					
	FONDI PER RISCHI BANCARI GENERALI.....	<b>27</b>	3	1	1	T	XD					
	STRUMENTI DI CET1 OGGETTO DI DISPOSIZIONI TRANSITORIE (GRANDFATHERING ).....	<b>28</b>	3	1	1	T	XD					
	INTERESSI DI MINORANZA INCLUSI NEL CET1.....	<b>30</b>	3	1	1	T	XD					
	INTERESSI DI MINORANZA AGGIUNTIVI OGGETTO DI DISPOSIZIONI TRANSITORIE.....	<b>31</b>	3	1	1	T	XD					
	FILTRI PRUDENZIALI:											
	(-) INCREMENTO DI CET1 CONNESSO CON ATTIVITÀ CARTOLARIZZATE.....	<b>32</b>	3	1	1	T	XD					
	COPERTURA DEI FLUSSI DI CASSA (CASH FLOW HEDGE).....	<b>34</b>	3	1	1	T	XD					
	UTILI O PERDITE SULLE PASSIVITÀ VALUTATE AL VALORE EQUO DOVUTI AL PROPRIO MERITO DI CREDITO.....	<b>36</b>	3	1	1	T	XD					
	UTILI O PERDITE DI VALORE EQUO DERIVANTI DAL RISCHIO DI CREDITO PROPRIO DELL'ENTE CORRELATO A PASSIVITÀ DERIVATIVE.....	<b>38</b>	3	1	1	T	XD					
	RETTIFICHE DI VALORE DI VIGILANZA.....	<b>40</b>	3	1	1	T	XD					
	DETRAZIONI:											
	AVVIAMENTO:											
	(-) AVVIAMENTO CONNESSO CON ATTIVITÀ IMMATERIALI.....	<b>42</b>	3	1	1	T	XD					
	(-) AVVIAMENTO INCLUSO NELLA VALUTAZIONE DEGLI INVESTIMENTI SIGNIFICATIVI.....	<b>44</b>	3	1	1	T	XD					
	PASSIVITÀ FISCALI DIFFERITE ASSOCIATE ALL'AVVIAMENTO.....	<b>46</b>	3	1	1	T	XD					
	ALTRE ATTIVITÀ IMMATERIALI:											
	(-) ALTRE ATTIVITÀ IMMATERIALI PRIMA DELLA DEDUZIONE											



**SEGNALAZIONI DI VIGILANZA DEI GRUPPI FINANZIARI 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	
		sotvoco					
	DELLE PASSIVITA' FISCALI DIFFERITE.....	48	3	1	1	T	XD
	PASSIVITA' FISCALI DIFFERITE CONNESSE CON LE ALTRE						
	ATTIVITA' IMMATERIALI.....	50	3	1	1	T	XD
	(-) ATTIVITA' FISCALI DIFFERITE CHE SI BASANO SULLA						
	REDDITIVITA' FUTURA E NON DERIVANO DA DIFFERENZE						
	TEMPORANEE AL NETTO DELLE RELATIVE PASSIVITA'						
	FISCALI DIFFERITE.....	52	3	1	1	T	XD
	(-) ENTI IRB - ECCEDEZZA DELLE PERDITE ATTESE						
	RISPETTO ALLE RETTIFICHE DI VALORE.....	54	3	1	1	T	XD
	FONDI PENSIONE A PRESTAZIONE DEFINITA:						
	(-) ATTIVITA' DEI FONDI PENSIONE						
	A PRESTAZIONE DEFINITA.....	56	3	1	1	T	XD
	PASSIVITA' FISCALI DIFFERITE CONNESSE AD ATTIVITA'						
	DI FONDI PENSIONE A PRESTAZIONE DEFINITA.....	58	3	1	1	T	XD
	ATTIVITA' DEI FONDI PENSIONE A PRESTAZIONE						
	DEFINITA CHE L'ENTE PUO' UTILIZZARE SENZA						
	RESTRIZIONI.....	60	3	1	1	T	XD
	(-) PARTECIPAZIONI INCROCIATE IN STRUMENTI DI CET1.....	62	3	1	1	T	XD
	(-) ECCEDEZZA 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 ANZICHE' 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 E' 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%:						
	(-) ATTIVITA' FISCALI DIFFERITE CHE SI BASANO						
	SULLA REDDITIVITA' 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
<b>1F</b>	CAPITALE AGGIUNTIVO DI CLASSE 1 (ADDITIONAL TIER 1 -						
	AT1).....	<b>34012</b>					

SEGNALAZIONI DI VIGILANZA DEI GRUPPI FINANZIARI 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
		sotvoco										
	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					
	(-) 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					

(\*) Segnalazione a carico dei soli gruppi di intermediari che raccolgono risparmio presso il pubblico

<b>1F</b>	CAPITALE DI CLASSE 1.....	<b>34014</b>					
	TOTALE CAPITALE DI CLASSE 1.....	00	3	1	1	T	XD

<b>1F</b>	CAPITALE DI CLASSE 2 (TIER 2 - T2).....	<b>34016</b>					
	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

**SEGNALAZIONI DI VIGILANZA DEI GRUPPI FINANZIARI 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	D	R	P	N
			U	I	E	E	O
			R	V	S	R	T
			A	I	I	I	E
			T	S	D	O	
			A	A	E	D	
					N	I	
					Z	C	
					A	I	
						T	
						A	
		sotvoco					
	STRUMENTI EMESSI DA FILIAZIONI INCLUSI NEL T2 PER						
	EFFETTO DI DISPOSIZIONI TRANSITORIE.....	19	3	1	1	T	XD
	ENTI IRB - ECCEDEENZA 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
	ECCEDEENZA 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
<b>1F</b>	FONDI PROPRI.....	<b>34018</b>					
	TOTALE FONDI PROPRI.....	<b>00</b>	3	1	1	T	XD

**SEGNALAZIONI DI VIGILANZA DEI GRUPPI FINANZIARI 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
		sotvoco					
<b>1F</b>	INFORMAZIONI SU STRUMENTI DI CAPITALE CON CARATTERISTICHE REVERSIBILI.....	<b>34020</b>					
	STRUMENTI DI CAPITALE LA CUI INCLUSIONE NEL CET1						
	DIPENDE DA CARATTERISTICHE REVERSIBILI.....	<b>02</b>	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI CAPITALE LA CUI INCLUSIONE NELL'AT1						
	DIPENDE DA CARATTERISTICHE REVERSIBILI (*).....	<b>04</b>	3	1	1	T	XD
	STRUMENTI DI CAPITALE LA CUI INCLUSIONE NEL T2						
	DIPENDE DA CARATTERISTICHE REVERSIBILI.....	<b>06</b>	3	1	1	T	XD
	(*) Segnalazione a carico dei soli gruppi di intermediari che raccolgono risparmio presso il pubblico						
<b>1F</b>	INFORMAZIONI SULLA FISCALITÀ.....	<b>34022</b>					
	TOTALE ATTIVITÀ FISCALI DIFFERITE (DTA):						
	DTA CHE NON SI BASANO SULLA REDDITIVITÀ FUTURA.....	<b>02</b>	3	1	1	T	XD
	DTA CHE SI BASANO SULLA REDDITIVITÀ FUTURA E NON						
	DERIVANO DA DIFFERENZE TEMPORANEE.....	<b>04</b>	3	1	1	T	XD
	DTA CHE SI BASANO SULLA REDDITIVITÀ FUTURA E						
	DERIVANO DA DIFFERENZE TEMPORANEE.....	<b>06</b>	3	1	1	T	XD
	TOTALE PASSIVITÀ FISCALI DIFFERITE (DTL):						
	DTL NON DEDUCIBILI DALLE DTA E CHE SI BASANO SULLA						
	REDDITIVITÀ FUTURA.....	<b>08</b>	3	1	1	T	XD
	DTL DEDUCIBILI DALLE DTA E CHE SI BASANO SULLA						
	REDDITIVITÀ FUTURA:						
	DI CUI NON DERIVANTI DA DIFFERENZE TEMPORANEE.....	<b>10</b>	3	1	1	T	XD
	DI CUI DERIVANTI DA DIFFERENZE TEMPORANEE.....	<b>12</b>	3	1	1	T	XD
<b>1F</b>	INFORMAZIONI SUI MODELLI INTERNI ENTI IRB (SHORTFALL/EXCESS RESERVE).....	<b>34024</b>					
	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 GENERICHE.....	<b>01</b>	3	1	1	T	XD
	RETTIFICHE SPECIFICHE.....	<b>02</b>	3	1	1	T	XD
	RETTIFICHE DI VALORE PRUDENZIALI E ALTRE						
	RIDUZIONI DEI FONDI PROPRI.....	<b>04</b>	3	1	1	T	XD
	TOTALE PERDITE ATTESE.....	<b>06</b>	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 DI VALORE SPECIFICHE E POSTE SIMILI.....	<b>08</b>	3	1	1	T	XD
	TOTALE PERDITE ATTESE.....	<b>10</b>	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						

**SEGNALAZIONI DI VIGILANZA DEI GRUPPI FINANZIARI 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
		sotvoco										
	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					
<b>1F</b>	INFORMAZIONI SU SOGLIE PER DETRAZIONI E CAPITALE											
	AMMISSIBILE.....	34026										
	SOGLIA PER GLI INVESTIMENTI NON SIGNIFICATIVI IN											
	STRUMENTI DI CETI 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 .....	10	3	1	1	T	XD					
	CAPITALE AMMISSIBILE AI FINI DELLA DISCIPLINA DELLE											
	GRANDI ESPOSIZIONI.....	12	3	1	1	T	XD					
<b>1F</b>	INFORMAZIONI SU INVESTIMENTI NON SIGNIFICATIVI IN FONDI											
	PROPRI DI ALTRI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO.....	34028										
	STRUMENTI DI CETI AL NETTO DELLE POSIZIONI CORTE:											
	STRUMENTI DI CETI 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 CETI 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 CETI 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											

**SEGNALAZIONI DI VIGILANZA DEI GRUPPI FINANZIARI 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	
		sotvoco					
	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
<b>1F</b>	INFORMAZIONI SU INVESTIMENTI SIGNIFICATIVI IN FONDI PROPRI DI ALTRI SOGGETTI DEL SETTORE FINANZIARIO.....	<b>34030</b>					
	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

**SEGNALAZIONI DI VIGILANZA DEI GRUPPI FINANZIARI 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
			sotvoco					
	STRUMENTI DI T2 DETENUTI INDIRECTAMENTE:							
	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
1F	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
1F	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
1F	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
1F	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 DEI GRUPPI FINANZIARI SU BASE CONSOLIDATA**

**IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI**

B A S E  I N F .	4.3 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	S O G G E T T O C O N T E N E S S O	P O S I Z I O N I D I R E T T E	T I P O L O G I E D I M P O R T A T E	T I P O L O G I E C O N T R O P P O	T I P O L O G I E P O S I Z I O N I	T I P O L O G I E P O S I Z I O N I	V I T A R E S I D U A L E	P E R I O D I C I T A	N O T E	
																	SOTVOC
<b>1F</b>	ATTIVITÀ DI RISCHIO.....	<b>34090</b>															
	PORTAFOGLIO NON DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA.....	<b>02</b>	3	1	1		X			X						T	XD
	TOTALE DELLE ATTIVITÀ DI RISCHIO (*).....	<b>04</b>	3	1	1		X			X		X	X			T	XD
	- TOTALE DELLE ATTIVITÀ DI RISCHIO: DI CUI																
	POSIZIONI IN STATO DI DEFAULT.....	<b>06</b>	3	1	1		X			X						T	XD
	TOTALE DELLE ATTIVITÀ DI RISCHIO: TIPOLOGIA																
	ESPOSIZIONE																
	-DI CUI: STRUMENTI DI DEBITO.....	<b>10</b>	3	1	1		X		X	X						T	XD
	-DI CUI: STRUMENTI DI CAPITALE.....	<b>12</b>	3	1	1		X		X	X						T	XD
	-DI CUI: STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI.....	<b>14</b>	3	1	1		X		X	X						T	XD
	-DI CUI: IMPEGNI A EROGARE FONDI.....	<b>16</b>	3	1	1		X		X	X						T	XD
	-DI CUI: GARANZIE REALI FINANZIARIE.....	<b>18</b>	3	1	1		X		X	X						T	XD
	-DI CUI: ALTRE GARANZIE E IMPEGNI.....	<b>20</b>	3	1	1		X		X	X						T	XD
	-DI CUI: SCHEMI DI INVESTIMENTO.....	<b>22</b>	3	1	1		X			X						T	XD

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

<b>1F</b>	TECNICHE DI ATTENUAZIONE DELLE ATTIVITÀ DI RISCHIO.....	<b>34092</b>															
	-EFFETTO DI SOSTITUZIONE: RIPARTIZIONE PER																
	SOTTOSTANTE GARANTITO																
	-DI CUI: STRUMENTI DI DEBITO.....	<b>02</b>	3	1	1		X			X						T	XD
	-DI CUI: STRUMENTI DI CAPITALE.....	<b>04</b>	3	1	1		X			X						T	XD
	-DI CUI: STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI.....	<b>06</b>	3	1	1		X			X						T	XD
	-DI CUI: IMPEGNI A EROGARE FONDI.....	<b>08</b>	3	1	1		X			X						T	XD
	-DI CUI: GARANZIE REALI FINANZIARIE.....	<b>10</b>	3	1	1		X			X						T	XD
	-DI CUI: ALTRE GARANZIE E IMPEGNI.....	<b>12</b>	3	1	1		X			X						T	XD
	-METODOLOGIA INTEGRALE.....	<b>14</b>	3	1	1		X			X						T	XD
	-GARANZIE IMMOBILIARI.....	<b>16</b>	3	1	1		X			X						T	XD

<b>1F</b>	ATTIVITÀ DI RISCHIO: COMPOSIZIONE DEI GRUPPI DI																
	CLIENTI CONNESSI.....	<b>34094</b>															
	-PORTAFOGLIO NON DI NEGOZIAZIONE A FINI DI VIGILANZA.....	<b>02</b>	3	1	1		X	X		X						T	XD
	-TOTALE DELLE ATTIVITÀ DI RISCHIO (*).....	<b>04</b>	3	1	1		X	X		X		X	X			T	XD
	-TOTALE DELLE ATTIVITÀ DI RISCHIO: DI CUI POSIZIONI																
	IN STATO DI DEFAULT.....	<b>06</b>	3	1	1		X	X		X						T	XD
	-TOTALE DELLE ATTIVITÀ DI RISCHIO: TIPOLOGIA																
	ESPOSIZIONE																
	-DI CUI: STRUMENTI DI DEBITO.....	<b>10</b>	3	1	1		X	X	X	X						T	XD
	-DI CUI: STRUMENTI DI CAPITALE.....	<b>12</b>	3	1	1		X	X	X	X						T	XD
	-DI CUI: STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI.....	<b>14</b>	3	1	1		X	X	X	X						T	XD
	-DI CUI: IMPEGNI A EROGARE FONDI.....	<b>16</b>	3	1	1		X	X	X	X						T	XD
	-DI CUI: GARANZIE REALI FINANZIARIE.....	<b>18</b>	3	1	1		X	X	X	X						T	XD
	-DI CUI: ALTRE GARANZIE E IMPEGNI.....	<b>20</b>	3	1	1		X	X	X	X						T	XD
	-DI CUI: SCHEMI DI INVESTIMENTO.....	<b>22</b>	3	1	1		X	X		X						T	XD

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

<b>1F</b>	TECNICHE DI ATTENUAZIONE DELLE ATTIVITÀ DI																
	RISCHIO:COMPOSIZIONE DEI GRUPPI DI CLIENTI CONNESSI.....	<b>34096</b>															
	EFFETTO DI SOSTITUZIONE: RIPARTIZIONE PER SOTTOSTANTE																



SEGNALAZIONI DI VIGILANZA DEI GRUPPI FINANZIARI SU BASE CONSOLIDATA

IV SEZIONE: SEGNALAZIONI PRUDENZIALI

B A S E  I N F .	4.3 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 C E N S I T O A	S O G G E T T O C O N T R O P P O	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 G C O N T R O P P O	T I P O L O G G P O S I Z I O N E	T I P O L O G G P O S I Z I O N E	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
	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
<b>1F</b>	ATTIVITA' DI RISCHIO: ESPOSIZIONI PIU' RILEVANTI.....	<b>34098</b>														
	-ESPOSIZIONI.....	02	3	1	1		X			X				X	T	XD
<b>1F</b>	ATTIVITA' DI RISCHIO: ESPOSIZIONI PIU' RILEVANTI - COMPOSIZIONE DEI GRUPPI DI CLIENTI CONNESSI.....	<b>34100</b>														
	-ESPOSIZIONI.....	02	3	1	1		X	X		X				X	T	XD
<b>1F</b>	GRANDI ESPOSIZIONI: IDENTIFICAZIONE DELLA CONTROPARTE.....	<b>34102</b>														
	-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.															
<b>1F</b>	GRANDI ESPOSIZIONI: LIMITI APPLICATI.....	<b>34104</b>														
	-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