

**INFORMATIVA DI DETTAGLIO DEI 12 INDICATORI USATI NELLA METODOLOGIA DI IDENTIFICAZIONE DELLE BANCHE A RILEVANZA SISTEMICA A LIVELLO GLOBALE ALLA DATA DI RIFERIMENTO DEL 31 DICEMBRE 2019
(Art. 441 del Regolamento UE 575/2013)**

Il Comitato di Basilea per la vigilanza bancaria ha elaborato una metodologia di valutazione volta ad identificare le banche a rilevanza sistemica a livello globale (G-SIBs), basata sulle raccomandazioni fornite dal Financial Stability Board (FSB). Tale metodologia si fonda su un sistema di misurazione basato su più indicatori. Gli indicatori prescelti riflettono diversi aspetti di ciò che crea esternalità negative e rende una banca determinante per la stabilità del sistema finanziario.

L'Autorità Bancaria Europea (EBA) ha richiesto a tutte le banche che presentano una misura dell'esposizione ai fini dell'indice di leva finanziaria superiore a EUR 200 miliardi, di rendere pubblicamente noti i 12 indicatori impiegati nella metodologia di valutazione. Intesa Sanpaolo, pur non essendo una G-SIB, rientra tra le Banche con una esposizione ai fini dell'indice di leva finanziaria oltre il limite indicato ed è tenuta agli obblighi di informativa e pubblicazione.

Gli indicatori pubblicati di seguito sono calcolati su specifiche istruzioni del Comitato di Basilea per la vigilanza bancaria e quindi potrebbero non essere direttamente comparabili con altre informazioni pubblicate dal Gruppo Intesa Sanpaolo.

Maggiori informazioni: <https://www.bis.org/bcbs/gsib/>

Si evidenzia come le informazioni oggetto di pubblicazione potrebbero subire variazioni poiché costituiscono ancora oggetto di analisi da parte dell'Autorità nazionale di vigilanza e del Comitato di Basilea per la vigilanza bancaria.

Dati generali

Sezione 1 - Informazioni generali	GSIB	
a. Informazioni generali fornite dal Supervisore:		
(1) Codice nazione	1001	IT
(2) Nome Banca	1002	INTESA SANPAOLO
(3) Data di riferimento (aaaa-mm-gg)	1003	2019-12-31
(4) Valuta di riferimento	1004	EUR
(5) Tasso di conversione Euro	1005	1
(6) Data di invio (aaaa-mm-gg)	1006	2020-04-16
b. Informazioni generali fornite dalla Banca segnalante:		
(1) Unità di riferimento del report	1007	1.000
(2) Standard contabili	1008	IFRS
(3) Data di pubblicazione (aaaa-mm-gg)	1009	2020-04-30
(4) Lingua di pubblicazione	1010	ITALIANO

Indicatore di dimensione

Sezione 2 - Esposizione Totale	GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Derivati		
(1) Esposizione inerente rischio di controparte dei contratti derivati	1012	9.998.190
(2) Valore nozionale cappato dei derivati di credito	1201	2.348.647
(3) Esposizione potenziale futura dei contratti derivati	1018	13.197.260
b. Operazioni di finanziamento tramite titoli (SFTs)		
(1) Valore lordo rettificato di SFTs	1013	27.739.570
(2) Esposizione inerente rischio di controparte di SFTs	1014	4.454.006
c. Altre poste dell'attivo	1015	565.020.357
d. Valore nozionale lordo delle poste fuori bilancio		
(1) Poste soggette a 0% di fattore di conversione creditizia (CCF)	1019	131.724.637
(2) Poste soggette a 20% di CCF	1022	6.343.147
(3) Poste soggette a 50% di CCF	1023	84.811.303
(4) Poste soggette a 100% di CCF	1024	13.616.328
e. Aggiustamenti regolamentari	1031	9.055.000
f. Indicatore dell'Esposizione totale ai fini dell'indice di leva finanziaria di Basilea 3	1103	693.221.103

Indicatori di interconnessione

Sezione 3 - Attività verso altri enti finanziari	GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Fondi depositati o dati in prestito ad altri enti finanziari	1033	88.948.165
(1) Certificati di deposito	1034	0
b. Linee impegnate non utilizzate estese ad altri enti finanziari	1035	30.498.294
c. Titoli detenuti ed emessi da altri enti finanziari:		
(1) Titoli di debito garantiti	1036	12.682.774
(2) Titoli di debito senior non garantiti	1037	8.661.613
(3) Titoli di debito subordinati	1038	1.519.702
(4) Commercial paper	1039	0
(5) Azioni	1040	3.994.864
(6) Posizioni corte di segno opposto in relazione alle specifiche azioni detenute incluse in 3.c.(5)	1041	0
d. Esposizione corrente netta positiva di SFTs con altri enti finanziari	1213	741.707
e. Derivati Over-the-counter con altri enti finanziari che hanno un fair value netto positivo:		
(1) Fair value netto positivo	1043	202.887
(2) Esposizione potenziale futura	1044	2.193.519
f. Indicatore delle attività verso altri enti finanziari	1045	149.443.524

Sezione 4 - Passività verso altri enti finanziari	GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Depositi degli enti finanziari:		
(1) Depositi dovuti dagli enti depositari	1046	17.346.345
(2) Depositi dovuti dagli enti finanziari non depositari	1047	34.121.274
(3) Prestiti ottenuti da altri enti finanziari	1105	38.221.074
b. Linee impegnate non utilizzate ottenute da altri enti finanziari	1048	0
c. Esposizione corrente netta negativa di SFTs con altri enti finanziari	1214	1.101.967
d. Derivati Over-the-counter con altri enti finanziari che hanno un fair value netto negativo:		
(1) Fair value netto negativo	1050	2.093.808
(2) Esposizione potenziale futura	1051	8.428.512
e. Indicatore delle passività verso altri enti finanziari	1052	101.312.980

Sezione 5 - Titoli in circolazione	GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Titoli di debito garantiti	1053	15.560.308
b. Titoli di debito senior non garantiti	1054	45.479.897
c. Titoli di debito subordinati	1055	9.307.779
d. Commercial paper	1056	5.388.243
e. Certificati di deposito	1057	4.575.479
f. Capitale primario	1058	41.101.659
g. Azioni privilegiate ed ogni altra forma di finanziamento subordinato non presente in 5.c.	1059	4.091.000
h. Indicatore dei titoli in circolazione	1060	125.504.365

Indicatori di sostituibilità come operatore di mercato e fornitore di servizi

Sezione 6 - Operazioni di pagamento nell'anno di riferimento (escluse operazioni infragruppo)	GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Dollari australiani (AUD)	1061	15.426.080
b. Real brasiliani (BRL)	1062	0
c. Dollari canadesi (CAD)	1063	14.343.293
d. Franchi svizzeri (CHF)	1064	9.229.109
e. Yuan cinesi (CNY)	1065	5.430.442
f. Euro (EUR)	1066	8.132.174.198
g. Sterline britanniche (GBP)	1067	104.394.029
h. Dollari Hong Kong (HKD)	1068	17.061.522
i. Rupie indiane (INR)	1069	22.777
j. Yen giapponesi (JPY)	1070	28.259.628
k. Peso messicani (MXN)	1108	1.411.796
l. Corone svedesi (SEK)	1071	2.494.005
m. Dollari statunitensi (USD)	1072	2.331.338.996
n. Indicatore delle operazioni di pagamento	1073	10.661.585.874

Sezione 7 - Attività in custodia	GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Indicatore delle attività in custodia	1074	460.851.000

Sezione 8 - Operazioni di sottoscrizione	GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Operazioni di sottoscrizione azionaria	1075	390.715
b. Operazioni di sottoscrizione obbligazionaria	1076	23.692.249
c. indicatore delle operazioni di sottoscrizione	1077	24.082.964

Indicatori di complessità

Sezione 9 - Valore nozionale dei derivati Over-the-Counter (OTC)	GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Derivati OTC compensati attraverso controparte centrale	1078	1.719.746.971
b. Derivati OTC regolati a livello bilaterale	1079	642.471.121
c. Indicatore del valore nozionale dei derivati OTC	1080	2.362.218.092

Sezione 10 - Attività detenute per la negoziazione e disponibili per la vendita	GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Titoli detenuti per la negoziazione (HFT)	1081	18.923.574
b. Titoli disponibili per la vendita (AFS)	1082	75.678.844
c. Titoli HFT e AFS che rispondono alla definizione di attività di primo livello	1083	81.173.661
d. Titoli HFT e AFS che rispondono alla definizione di attività di secondo livello, con haircuts	1084	8.863.825
e. Indicatore delle attività detenute per la negoziazione e disponibili per la vendita	1085	4.564.931

Sezione 11 - Attività di terzo livello	GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Indicatore delle attività di terzo livello	1086	3.379.280

Indicatori di operatività internazionale

Sezione 12 - Attività transfrontaliere	GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Indicatore delle attività transfrontaliere	1087	193.628.324

Sezione 13 - Passività transfrontaliere	GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Passività transfrontaliere (esclusi derivati e passività locali in valuta locale)	1088	113.928.908
(1) Passività transfrontaliere verso uffici correlati di cui al punto 13.a.	1089	28.989.300
b. Passività locali in valuta locale (esclusa l'operatività in derivati)	1090	45.609.456
c. Indicatore delle passività transfrontaliere	1091	130.549.064

Riepilogo

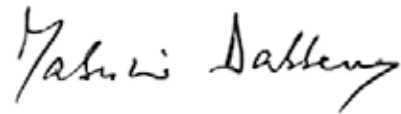
Sezione 22 - Valore degli indicatori	GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Sezione 2 - Esposizione totale ai fini dell'indice di leva finanziaria di Basilea 3	1166	693.221.103
b. Sezione 3 - Attività verso altri enti finanziari	1167	149.443.524
c. Sezione 4 - Passività verso altri enti finanziari	1168	101.312.980
d. Sezione 5 - Titoli in circolazione	1169	125.504.365
e. Sezione 6 - Operazioni di pagamento	1170	10.661.585.874
f. Sezione 7 - Attività in custodia	1171	460.851.000
g. Sezione 8 - Operazioni di sottoscrizione	1172	24.082.964
h. Sezione 9 - Derivati Over-The-Counter	1173	2.362.218.092
i. Sezione 10 - Attività detenute per la negoziazione e disponibili per la vendita	1174	4.564.931
j. Sezione 11 - Attività di terzo livello	1175	3.379.280
k. Sezione 12 - Attività transfrontaliere	1176	193.628.324
l. Sezione 13 - Passività transfrontaliere	1177	130.549.064

Dichiarazione del Dirigente preposto alla redazione dei documenti contabili societari

Il Dirigente preposto alla redazione dei documenti contabili societari, Fabrizio Dabbene, dichiara, ai sensi del comma 2 articolo 154 bis del Testo Unico della Finanza, che l'informativa contabile contenuta nel presente documento corrisponde alle risultanze documentali, ai libri ed alle scritture contabili.

Milano, 29 aprile 2020

Fabrizio Dabbene
Dirigente preposto alla redazione
dei documenti contabili societari

Handwritten signature of Fabrizio Dabbene in black ink.