

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 2015 (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 (G-SIBs). 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-SIBs, 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. I 12 indicatori sono riportati di seguito.

Maggiori informazioni: <https://www.bis.org/bchbs/esib/>

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 | 2015-12-31 |
| (4) Valuta di riferimento | 1004 | EUR |
| (5) Tasso di conversione Euro | 1005 | 1 |
| (6) Data di invio (aaaa-mm-gg) | 1006 | 2016-04-20 |
| 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 | 2016-04-30 |
| (4) Lingua di pubblicazione | 1010 | ITALIANO / INGLESE |

Indicatore di dimensione

| Sezione 2 - Esposizione Totale | GSIB | Importi in migliaia di Euro |
|--|------|-----------------------------|
| a. Derivati | | |
| (1) Esposizione inerente rischio di controparte dei contratti derivati | 1012 | 9.238.340 |
| (2) Valore nozionale cappato dei derivati di credito | 1201 | 883.460 |
| (3) Esposizione potenziale futura dei contratti derivati | 1018 | 12.661.793 |
| b. Operazioni di finanziamento tramite titoli (SFTs) | | |
| (1) Valore lordo rettificato di SFTs | 1013 | 27.106.719 |
| (2) Esposizione inerente rischio di controparte di SFTs | 1014 | 5.800.617 |
| c. Altre poste dell'attivo | | |
| d. Valore nozionale lordo delle poste fuori bilancio | 1015 | 470.414.200 |
| (1) Poste soggette a 0% di fattore di conversione creditizia (CCF) | 1019 | 150.573.608 |
| (2) Poste soggette a 20% di CCF | 1022 | 8.117.373 |
| (3) Poste soggette a 50% di CCF | 1023 | 70.286.677 |
| (4) Poste soggette a 100% di CCF | 1024 | 17.931.333 |
| e. Aggiustamenti regolamentari | | |
| | 1031 | 8.271.818 |
| f. Indicatore dell'Esposizione totale ai fini dell'indice di leva finanziaria di Basilea 3 | | |
| | 1103 | 595.860.636 |

Indicatori di interconnessione

| Sezione 3 - Attività verso altri enti finanziari | GSIB | Importi in migliaia di Euro |
|--|------|-----------------------------|
| a. Fondi depositati o dati in prestito ad altri enti finanziari | | |
| (1) Certificati di deposito | 1033 | 66.886.865 |
| | 1034 | 0 |
| b. Linee impegnate non utilizzate estese ad altri enti finanziari | | |
| | 1035 | 43.664.400 |
| c. Titoli detenuti ed emessi da altri enti finanziari: | | |
| (1) Titoli di debito garantiti | 1036 | 4.697.248 |
| (2) Titoli di debito senior non garantiti | 1037 | 5.972.313 |
| (3) Titoli di debito subordinati | 1038 | 0 |
| (4) Commercial paper | 1039 | 0 |
| (5) Azioni | 1040 | 610.535 |
| (6) Posizioni corte di segno opposto in relazione alle specifiche azioni detenute incluse in 3.c.(5) | 1041 | 29.573 |
| d. Esposizione corrente netta positiva di SFTs con altri enti finanziari | | |
| | 1042 | 5.555.153 |
| e. Derivati Over-the-counter con altri enti finanziari che hanno un fair value netto positivo: | | |
| (1) Fair value netto positivo | 1043 | 0 |
| (2) Esposizione potenziale futura | 1044 | 0 |
| f. Indicatore delle attività verso altri enti finanziari | | |
| | 1045 | 127.356.941 |

| Sezione 4 - Passività verso altri enti finanziari | GSIB | Importi in migliaia di Euro |
|--|-------------|-----------------------------|
| a. Depositi degli enti finanziari: | | |
| (1) Depositi dovuti dagli enti depositari | 1046 | 22.649.538 |
| (2) Depositi dovuti dagli enti finanziari non depositari | 1047 | 3.597.624 |
| (3) Prestiti ottenuti da altri enti finanziari | 1105 | 47.303.913 |
| b. Linee impegnate non utilizzare ottenute da altri enti finanziari | 1048 | 0 |
| c. Esposizione corrente netta negativa di SFTs con altri enti finanziari | 1049 | 674.401 |
| d. Derivati Over-the-counter con altri enti finanziari che hanno un fair value netto negativo: | | |
| (1) Fair value netto negativo | 1050 | 0 |
| (2) Esposizione potenziale futura | 1051 | 0 |
| e. Indicatore delle passività verso altri enti finanziari | 1052 | 74.225.476 |

| Sezione 5 - Titoli in circolazione | GSIB | Importi in migliaia di Euro |
|--|-------------|-----------------------------|
| a. Titoli di debito garantiti | 1053 | 16.787.707 |
| b. Titoli di debito senior non garantiti | 1054 | 79.973.392 |
| c. Titoli di debito subordinati | 1055 | 13.545.976 |
| d. Commercial paper | 1056 | 2.221.633 |
| e. Certificati di deposito | 1057 | 6.076.483 |
| f. Capitale primario | 1058 | 49.006.789 |
| g. Azioni privilegiate ed ogni altra forma di finanziamento subordinato non presente in 5.c. | 1059 | 3.519.880 |
| h. Indicatore dei titoli in circolazione | 1060 | 171.131.860 |

Indicatori di sostituibilità come operatore di mercato e fornitore di servizi

| Sezione 6 - Operazioni di pagamento nell'anno di riferimento (escluse operazioni infragruppo) | GSIB | Importi in migliaia di Euro |
|--|-------------|-----------------------------|
| a. Dollari australiani (AUD) | 1061 | 13.026.235 |
| b. Real brasiliani (BRL) | 1062 | 4 |
| c. Dollari canadesi (CAD) | 1063 | 22.145.720 |
| d. Franchi svizzeri (CHF) | 1064 | 23.992.123 |
| e. Yuan cinesi (CNY) | 1065 | 10.199.305 |
| f. Euro (EUR) | 1066 | 7.094.975.169 |
| g. Sterline britanniche (GBP) | 1067 | 190.560.054 |
| h. Dollari Hong Kong (HKD) | 1068 | 19.249.976 |
| i. Rupie indiane (INR) | 1069 | 27.037 |
| j. Yen giapponesi (JPY) | 1070 | 91.379.173 |
| k. Corone svedesi (SEK) | 1071 | 15.162.389 |
| l. Dollari statunitensi (USD) | 1072 | 2.895.513.067 |
| m. Indicatore delle operazioni di pagamento | 1073 | 10.376.230.252 |

| Sezione 7 - Attività in custodia | GSIB | Importi in migliaia di Euro |
|---|-------------|-----------------------------|
| a. Indicatore delle attività in custodia | 1074 | 379.008.000 |

| Sezione 8 - Operazioni di sottoscrizione | GSIB | Importi in migliaia di Euro |
|---|-------------|-----------------------------|
| a. Operazioni di sottoscrizione azionaria | 1075 | 2.573.495 |
| b. Operazioni di sottoscrizione obbligazionaria | 1076 | 27.299.288 |
| c. indicatore delle operazioni di sottoscrizione | 1077 | 29.872.783 |

Indicatori di complessità

| Sezione 9 - Valore nozionale dei derivati Over-the-Counter (OTC) | GSIB | Importi in migliaia di Euro |
|---|-------------|-----------------------------|
| a. Derivati OTC compensati attraverso controparte centrale | 1078 | 1.619.437.230 |
| b. Derivati OTC regolati a livello bilaterale | 1079 | 731.236.086 |
| c. Indicatore del valore nozionale dei derivati OTC | 1080 | 2.350.673.316 |

| Sezione 10 - Attività detenute per la negoziazione e disponibili per la vendita | GSIB | Importi in migliaia di Euro |
|--|-------------|-----------------------------|
| a. Titoli detenuti per la negoziazione (HFT) | 1081 | 21.345.224 |
| b. Titoli disponibili per la vendita (AFS) | 1082 | 55.499.872 |
| c. Titoli HFT e AFS che rispondono alla definizione di attività di primo livello | 1083 | 54.521.225 |
| d. Titoli HFT e AFS che rispondono alla definizione di attività di secondo livello, con haircuts | 1084 | 2.518.979 |
| e. Indicatore delle attività detenute per la negoziazione e disponibili per la vendita | 1085 | 19.804.892 |

| Sezione 11 - Attività di terzo livello | GSIB | Importi in migliaia di Euro |
|--|-------------|-----------------------------|
| a. Indicatore delle attività di terzo livello | 1086 | 2.954.177 |

Indicatori di operatività internazionale

| Sezione 12 - Attività transfrontaliere | GSIB | Importi in migliaia di Euro |
|--|-------------|-----------------------------|
| a. Indicatore delle attività transfrontaliere | 1087 | 138.398.000 |

| Sezione 13 - Passività transfrontaliere | GSIB | Importi in migliaia di Euro |
|--|-------------|-----------------------------|
| a. Passività transfrontaliere (esclusi derivati e passività locali in valuta locale) | 1088 | 112.571.000 |
| (1) Passività transfrontaliere verso uffici correlati di cui al punto 13.a. | 1089 | 34.400.290 |
| b. Passività locali in valuta locale (esclusa l'operatività in derivati) | 1090 | 34.204.000 |
| c. Indicatore delle passività transfrontaliere | 1091 | 112.374.710 |

Riepilogo

| Sezione 22 - Valore degli indicatori | GSIB | Importi in migliaia di Euro |
|--|-------------|------------------------------------|
| a. Sezione 2 - Esposizione totale ai fini dell'indice di leva finanziaria di Basilea 3 | 1166 | 595.860.636 |
| b. Sezione 3 - Attività verso altri enti finanziari | 1167 | 127.356.941 |
| c. Sezione 4 - Passività verso altri enti finanziari | 1168 | 74.225.476 |
| d. Sezione 5 - Titoli in circolazione | 1169 | 171.131.860 |
| e. Sezione 6 - Operazioni di pagamento | 1170 | 10.376.230.252 |
| f. Sezione 7 - Attività in custodia | 1171 | 379.008.000 |
| g. Sezione 8 - Operazioni di sottoscrizione | 1172 | 29.872.783 |
| h. Sezione 9 - Derivati Over-The-Counter | 1173 | 2.350.673.316 |
| i. Sezione 10 - Attività detenute per la negoziazione e disponibili per la vendita | 1174 | 19.804.892 |
| j. Sezione 11 - Attività di terzo livello | 1175 | 2.954.177 |
| k. Sezione 12 - Attività transfrontaliere | 1176 | 138.398.000 |
| l. Sezione 13 - Passività transfrontaliere | 1177 | 112.374.710 |