

**INFORMATIVA DI DETTAGLIO DEI 13 INDICATORI USATI NELLA METODOLOGIA DI IDENTIFICAZIONE DELLE BANCHE A RILEVANZA SISTEMICA A LIVELLO GLOBALE ALLA DATA DI RIFERIMENTO DEL 31 DICEMBRE 2022
(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 13 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		2022-12-31
(4) Valuta di riferimento	1004		EUR
(5) Tasso di conversione Euro	1005		1
(6) Data di invio (aaaa-mm-gg)	1006		2023-04-15
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		2023-04-30
(4) Lingua di pubblicazione	1010		ITALIANO
(6) Codice LEI	1015		2W8N8UU78PMDQKZENC08

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		9.847.636	
(2) Valore nozionale cappato dei derivati di credito	1201		1.575.830	
(3) Esposizione potenziale futura dei contratti derivati	1018		9.619.257	
b. Operazioni di finanziamento tramite titoli (SFTs)				
(1) Valore lordo rettificato di SFTs	1013		19.843.241	
(2) Esposizione inerente rischio di controparte di SFTs	1014		3.104.572	
c. Altre poste dell'attivo				
d. Valore nozionale lordo delle poste fuori bilancio				
(1) Poste soggette a 0% di fattore di conversione creditizia (CCF)	1019		153.834.014	
(2) Poste soggette a 20% di CCF	1022		7.048.729	
(3) Poste soggette a 50% di CCF	1023		114.662.193	
(4) Poste soggette a 100% di CCF	1024		19.113.580	
e. Aggiustamenti regolamentari				
f. Indicatore dell'Esposizione totale ai fini dell'indice di leva finanziaria di Basilea 3				
g. Esposizione delle compagnie assicurative controllate non incluse in 2.f, netto intragruppo				
(1) Poste dell'attivo del comparto assicurativo (compreso il fuori bilancio)	1701		181.011.025	
(2) Esposizione potenziale futura inerente i derivati delle compagnie assicurative	1205		2.768.432	
(3) Valori di investimento in soggetti consolidati	1208		6.242.843	
h. Esposizioni intragruppo con compagnie assicurative riportate in 2.g che sono incluse in 2.f				
			2101	2.500.385
i. Indicatore dell'Esposizione totale, includendo le compagnie assicurative controllate		1117		1.040.727.402

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	1216	68.629.493
(1) Certificati di deposito	2102	0
b. Linee impegnate non utilizzate estese ad altri enti finanziari	1217	25.260.042
c. Titoli detenuti ed emessi da altri enti finanziari:		
(1) Titoli di debito garantiti	2103	15.023.096
(2) Titoli di debito senior non garantiti	2104	22.809.231
(3) Titoli di debito subordinati	2105	2.916.048
(4) Commercial paper	2106	0
(5) Azioni	2107	95.889.335
(6) Posizioni corte di segno opposto in relazione alle specifiche azioni detenute incluse in 3.c.(5)	2108	0
d. Esposizione corrente netta positiva di SFTs con altri enti finanziari	1219	1.529.146
e. Derivati Over-the-counter con altri enti finanziari che hanno un fair value netto positivo:		
(1) Fair value netto positivo	2109	2.665.131
(2) Esposizione potenziale futura	2110	1.782.255
f. Indicatore delle attività verso altri enti finanziari, includendo le compagnie assicurative controllate	1215	236.503.777

Sezione 4 - Passività verso altri enti finanziari	GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Depositi degli enti finanziari:		
(1) Depositi dovuti dagli enti depositari	2111	26.763.746
(2) Depositi dovuti dagli enti finanziari non depositari	2112	35.597.867
(3) Prestiti ottenuti da altri enti finanziari	2113	14.027.891
b. Linee impegnate non utilizzate ottenute da altri enti finanziari	1223	113.086
c. Esposizione corrente netta negativa di SFTs con altri enti finanziari	1224	323.227
d. Derivati Over-the-counter con altri enti finanziari che hanno un fair value netto negativo:		
(1) Fair value netto negativo	2114	268.618
(2) Esposizione potenziale futura	2115	527.090
e. Indicatore delle passività verso altri enti finanziari, includendo le compagnie assicurative controllate	1221	77.621.525

Sezione 5 - Titoli in circolazione	GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Titoli di debito garantiti	2116	19.221.496
b. Titoli di debito senior non garantiti	2117	44.712.812
c. Titoli di debito subordinati	2118	13.808.111
d. Commercial paper	2119	9.147.236
e. Certificati di deposito	2120	124.699
f. Capitale primario	2121	39.340.896
g. Azioni privilegiate ed ogni altra forma di finanziamento subordinato non presente in 5.c.	2122	7.211.075
h. Indicatore dei titoli in circolazione, includendo le compagnie assicurative controllate	1226	133.566.325

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	19.813.809
b. Dollari canadesi (CAD)	1063	12.794.444
c. Franchi svizzeri (CHF)	1064	11.007.307
d. Yuan cinesi (CNY)	1065	10.381.428
e. Euro (EUR)	1066	8.856.857.125
f. Sterline britanniche (GBP)	1067	82.497.141
g. Dollari Hong Kong (HKD)	1068	19.832.755
h. Rupie indiane (INR)	1069	75.711
i. Yen giapponesi (JPY)	1070	10.934.897
j. Dollari neozelandesi (NZD)	1109	2.159.703
k. Corone svedesi (SEK)	1071	1.620.707
l. Dollari statunitensi (USD)	1072	2.018.592.118
m. Indicatore delle operazioni di pagamento	1073	11.046.567.146

Sezione 7 - Attività in custodia	GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Indicatore delle attività in custodia	1074	582.593.489

Sezione 8 - Operazioni di sottoscrizione	GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Operazioni di sottoscrizione azionaria	1075	775.677
b. Operazioni di sottoscrizione obbligazionaria	1076	19.507.183
c. indicatore delle operazioni di sottoscrizione	1077	20.282.860

Section 9 - Volumi di trading	GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Volumi di trading dei titoli emessi da organismi del settore pubblico, netto intragruppo	2123	1.439.711
b. Volumi di trading di altri titoli a reddito fisso, netto intragruppo	2124	129.653.595
c. Volumi di trading dei titoli a reddito fisso	2125	131.093.307
d. Volumi di trading delle azioni quotate, netto intragruppo	2126	93.490.377
e. Volumi di trading di altri titoli, netto intragruppo	2127	57.705.187
f. Volumi di trading delle azioni quotate ed altri titoli	2128	151.195.563

Indicatori di complessità

Sezione 10 - Valore nozionale dei derivati Over-the-Counter (OTC)		GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Derivati OTC compensati attraverso controparte centrale		2129	2.732.366.520
b. Derivati OTC regolati a livello bilaterale		1905	626.799.723
c. Indicatore del valore nozionale dei derivati OTC, includendo le compagnie assicurative controllate		1227	3.359.166.244

Sezione 11 - Attività detenute per la negoziazione e disponibili per la vendita		GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Titoli detenuti per la negoziazione (HFT)		1081	16.196.303
b. Titoli disponibili per la vendita (AFS)		1082	48.008.213
c. Titoli HFT e AFS che rispondono alla definizione di attività di primo livello		1083	53.205.614
d. Titoli HFT e AFS che rispondono alla definizione di attività di secondo livello, con haircuts		1084	5.869.485
e. Indicatore delle attività detenute per la negoziazione e disponibili per la vendita		1085	5.129.417

Sezione 12 - Attività di terzo livello		GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Indicatore delle attività di terzo livello, includendo le compagnie assicurative controllate		1229	16.675.990

Indicatori di operatività internazionale

Sezione 13 - Attività transfrontaliere		GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Attività transfrontaliere (esclusi derivati)		1087	218.822.434
b. Derivati attivi transfrontalieri		1146	7.885.463
c. Indicatore delle attività e dei derivati transfrontalieri		2130	226.707.897

Sezione 14 - Passività transfrontaliere		GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Passività transfrontaliere (esclusi derivati)		2131	153.621.625
b. Derivati passivi transfrontalieri		1149	4.211.823
c. Indicatore delle passività e dei derivati transfrontalieri		1148	157.833.448

Riepilogo

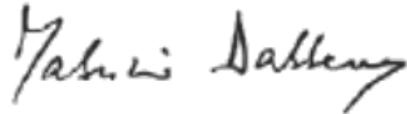
Sezione 22 - Valore degli indicatori		GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Sezione 2 - Esposizione totale, includendo le compagnie assicurative controllate		2001	1.040.727.402
b. Sezione 3 - Attività verso altri enti finanziari, includendo le compagnie assicurative controllate		2002	236.503.777
c. Sezione 4 - Passività verso altri enti finanziari, includendo le compagnie assicurative controllate		2003	77.621.525
d. Sezione 5 - Titoli in circolazione, includendo le compagnie assicurative controllate		2004	133.566.325
e. Sezione 6 - Operazioni di pagamento		2005	11.046.567.146
f. Sezione 7 - Attività in custodia		2006	582.593.489
g. Sezione 8 - Operazioni di sottoscrizione		2007	20.282.860
h. Section 9.c - Volume di trading dei titoli a reddito fisso		2008	131.093.307
i. Section 9.f - Volume di trading delle azioni quotate e degli altri titoli		2009	151.195.563
h. Sezione 9 - Derivati Over-The-Counter, includendo le compagnie assicurative controllate		2010	3.359.166.244
i. Sezione 10 - Attività detenute per la negoziazione e disponibili per la vendita		2011	5.129.417
j. Sezione 11 - Attività di terzo livello, includendo le compagnie assicurative controllate		2012	16.675.990
k. Sezione 12 - Attività transfrontaliere		2013	226.707.897
l. Sezione 13 - Passività transfrontaliere		2014	157.833.448

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, 28 aprile 2023

Fabrizio Dabbene
Dirigente preposto alla redazione
dei documenti contabili societari

Handwritten signature of Fabrizio Dabbene in black ink.