

**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 2023
(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.

Si riporta infine che, l'informativa al pubblico viene redatta nel rispetto dei processi e dei sistemi di controllo interno di cui la Banca si è dotata. In tale ambito, si evidenzia che:

- il processo di raccolta e di elaborazione dell'informativa è presidiato dal Chief Risk Officer, in coerenza con le istruzioni del Comitato di Basilea;
- in quanto informativa al pubblico, il documento è corredato dalla dichiarazione del Dirigente Preposto, ai sensi del comma 2 dell'art. 154-bis del TUF, la quale conferma che l'informativa contabile contenuta nel documento corrisponde alle risultanze documentali, ai libri ed alle scritture contabili.

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	2023-12-31
(4) Valuta di riferimento	1004	EUR
(5) Tasso di conversione Euro	1005	1
(6) Data di invio (aaaa-mm-gg)	1006	2024-04-26
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	2024-04-30
(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	8.190.593
(2) Valore nozionale dei derivati di credito venduti	1201	6.622.612
(3) Esposizione potenziale futura dei contratti derivati	1018	9.385.154
b. Operazioni di finanziamento tramite titoli (SFTs)		
(1) Valore lordo rettificato di SFTs	1013	19.174.075
(2) Esposizione inerente rischio di controparte di SFTs	1014	7.999.584
c. Altre poste dell'attivo		
d. Valore nozionale lordo delle poste fuori bilancio		
(1) Poste soggette a 10% di fattore di conversione creditizia (CCF)	1019	151.363.583
(2) Poste soggette a 20% di CCF	1022	8.571.293
(3) Poste soggette a 40% di CCF	2300	0
(4) Poste soggette a 50% di CCF	1023	116.358.083
(5) Poste soggette a 100% di CCF	1024	15.867.725
e. Aggiustamenti regolamentari		
(1) Indicatore dell'Esposizione totale ai fini dell'indice di leva finanziaria di Basilea 3	1031	11.462.000
(2) Indicatore dell'Esposizione totale ai fini dell'indice di leva finanziaria di Basilea 3	1103	861.218.839
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	181.472.074
(2) Esposizione potenziale futura inerente i derivati delle compagnie assicurative	1205	2.867.996
(3) Valori di investimento in soggetti consolidati	1208	6.878.600
h. Esposizioni intragruppo con compagnie assicurative riportate in 2.g che sono incluse in 2.f		
	2101	2.439.344
i. Indicatore dell'Esposizione totale, includendo le compagnie assicurative controllate		
	1117	1.036.240.965

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	73.978.496
(1) Certificati di deposito	2102	0
b. Linee impegnate non utilizzate estese ad altri enti finanziari	1217	35.199.749
c. Titoli detenuti ed emessi da altri enti finanziari:		
(1) Titoli di debito garantiti	2103	15.116.256
(2) Titoli di debito senior non garantiti	2104	32.249.381
(3) Titoli di debito subordinati	2105	2.952.030
(4) Commercial paper	2106	0
(5) Azioni	2107	93.438.861
(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	3.042.733
e. Derivati Over-the-counter con altri enti finanziari che hanno un fair value netto positivo:		
(1) Fair value netto positivo	2109	1.814.345
(2) Esposizione potenziale futura	2110	1.537.939
f. Indicatore delle attività verso altri enti finanziari, includendo le compagnie assicurative controllate	1215	259.329.791

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	23.011.869
(2) Depositi dovuti dagli enti finanziari non depositari	2112	36.599.805
(3) Prestiti ottenuti da altri enti finanziari	2113	34.913.954
b. Linee impegnate non utilizzate ottenute da altri enti finanziari	1223	82.198
c. Esposizione corrente netta negativa di SFTs con altri enti finanziari	1224	410.903
d. Derivati Over-the-counter con altri enti finanziari che hanno un fair value netto negativo:		
(1) Fair value netto negativo	2114	151.586
(2) Esposizione potenziale futura	2115	701.721
e. Indicatore delle passività verso altri enti finanziari, includendo le compagnie assicurative controllate	1221	95.872.035

Sezione 5 - Titoli in circolazione	GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Titoli di debito garantiti	2116	29.416.352
b. Titoli di debito senior non garantiti	2117	72.506.038
c. Titoli di debito subordinati	2118	13.484.844
d. Commercial paper	2119	14.288.200
e. Certificati di deposito	2120	743.249
f. Capitale primario	2121	48.170.360
g. Azioni privilegiate ed ogni altra forma di finanziamento subordinato non presente in 5.c.	2122	7.948.353
h. Indicatore dei titoli in circolazione, includendo le compagnie assicurative controllate	1226	186.557.396

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	13.627.447
b. Dollari canadesi (CAD)	1063	7.857.812
c. Franchi svizzeri (CHF)	1064	6.946.856
d. Yuan cinesi (CNY)	1065	5.727.741
e. Euro (EUR)	1066	9.131.045.968
f. Sterline britanniche (GBP)	1067	59.636.153
g. Dollari Hong Kong (HKD)	1068	27.959.833
h. Rupie indiane (INR)	1069	77.755
i. Yen giapponesi (JPY)	1070	12.037.778
j. Corone svedesi (SEK)	1071	917.687
k. Dollari Singapore (SGD)	2133	2.138.900
l. Dollari statunitensi (USD)	1072	1.631.810.015
m. Indicatore delle operazioni di pagamento	1073	10.899.783.946

Sezione 7 - Attività in custodia	GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Indicatore delle attività in custodia	1074	661.821.645

Sezione 8 - Operazioni di sottoscrizione	GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Operazioni di sottoscrizione azionaria	1075	300.971
b. Operazioni di sottoscrizione obbligazionaria	1076	22.062.715
c. Indicatore delle operazioni di sottoscrizione	1077	22.363.686

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	813.071
b. Volumi di trading di altri titoli a reddito fisso, netto intragruppo	2124	202.559.298
c. Volumi di trading dei titoli a reddito fisso	2125	203.372.369
d. Volumi di trading delle azioni quotate, netto intragruppo	2126	91.101.348
e. Volumi di trading di altri titoli, netto intragruppo	2127	62.190.122
f. Volumi di trading delle azioni quotate ed altri titoli	2128	153.291.470

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	3.361.266.247
b. Derivati OTC regolati a livello bilaterale		1905	780.285.425
c. Indicatore del valore nozionale dei derivati OTC, includendo le compagnie assicurative controllate		1227	4.141.551.672
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	17.113.885
b. Titoli disponibili per la vendita (AFS)		1082	67.716.437
c. Titoli HFT e AFS che rispondono alla definizione di attività di primo livello		1083	72.613.624
d. Titoli HFT e AFS che rispondono alla definizione di attività di secondo livello, con haircuts		1084	6.049.561
e. Indicatore delle attività detenute per la negoziazione e disponibili per la vendita		1085	6.167.137
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	17.082.890

Indicatori di operatività internazionale

Sezione 13 - Attività transfrontaliere		GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Attività transfrontaliere (esclusi derivati)		1087	245.503.998
b. Derivati attivi transfrontalieri		1146	5.566.251
c. Indicatore delle attività e dei derivati transfrontalieri		2130	251.070.249
Sezione 14 - Passività transfrontaliere		GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Passività transfrontaliere (esclusi derivati)		2131	187.818.529
b. Derivati passivi transfrontalieri		1149	4.078.728
c. Indicatore delle passività e dei derivati transfrontalieri		1148	191.897.257

Riepilogo

Sezione 22 - Valore degli indicatori		GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Sezione 2 - Esposizione totale, includendo le compagnie assicurative controllate		2001	1.036.240.965
b. Sezione 3 - Attività verso altri enti finanziari, includendo le compagnie assicurative controllate		2002	259.329.791
c. Sezione 4 - Passività verso altri enti finanziari, includendo le compagnie assicurative controllate		2003	95.872.035
d. Sezione 5 - Titoli in circolazione, includendo le compagnie assicurative controllate		2004	186.557.396
e. Sezione 6 - Operazioni di pagamento		2005	10.899.783.946
f. Sezione 7 - Attività in custodia		2006	661.821.645
g. Sezione 8 - Operazioni di sottoscrizione		2007	22.363.686
h. Section 9.c - Volume di trading dei titoli a reddito fisso		2008	203.372.369
i. Section 9.f - Volume di trading delle azioni quotate e degli altri titoli		2009	153.291.470
h. Sezione 9 - Derivati Over-The-Counter, includendo le compagnie assicurative controllate		2010	4.141.551.672
i. Sezione 10 - Attività detenute per la negoziazione e disponibili per la vendita		2011	6.167.137
j. Sezione 11 - Attività di terzo livello, includendo le compagnie assicurative controllate		2012	17.082.890
k. Sezione 12 - Attività transfrontaliere		2013	251.070.249
l. Sezione 13 - Passività transfrontaliere		2014	191.897.257

Dichiarazione del Dirigente preposto alla redazione dei documenti contabili societari

Il Dirigente preposto alla redazione dei documenti contabili societari, Elisabetta Stegher, 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 2024

Elisabetta Stegher
Dirigente preposto alla redazione
dei documenti contabili societari

A handwritten signature in black ink, appearing to read 'Elisabetta Stegher', positioned below the typed name and title.