

**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 2021
(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	2021-12-31
(4) Valuta di riferimento	1004	EUR
(5) Tasso di conversione Euro	1005	1
(6) Data di invio (aaaa-mm-gg)	1006	2022-04-15
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	2022-04-30
(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	14.293.621
(2) Valore nozionale cappato dei derivati di credito	1201	1.271.267
(3) Esposizione potenziale futura dei contratti derivati	1018	9.999.603
b. Operazioni di finanziamento tramite titoli (SFTs)		
(1) Valore lordo rettificato di SFTs	1013	26.673.004
(2) Esposizione inerente rischio di controparte di SFTs	1014	1.941.335
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	149.745.379
(2) Poste soggette a 20% di CCF	1022	8.217.346
(3) Poste soggette a 50% di CCF	1023	105.361.440
(4) Poste soggette a 100% di CCF	1024	25.797.046
e. Aggiustamenti regolamentari		
f. Indicatore dell'Esposizione totale ai fini dell'indice di leva finanziaria di Basilea 3	1103	938.267.247
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	212.038.339
(2) Esposizione potenziale futura inerente i derivati delle compagnie assicurative	1205	3.474.203
(3) Valori di investimento in soggetti consolidati	1208	7.889.555
h. Esposizioni intragruppo con compagnie assicurative riportate in 2.g che sono incluse in 2.f	2101	2.701.478
i. Indicatore dell'Esposizione totale, includendo le compagnie assicurative controllate	1117	1.143.188.756

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	75.267.635
(1) Certificati di deposito	2102	0
b. Linee impegnate non utilizzate estese ad altri enti finanziari	1217	22.872.575
c. Titoli detenuti ed emessi da altri enti finanziari:		
(1) Titoli di debito garantiti	2103	11.993.595
(2) Titoli di debito senior non garantiti	2104	23.124.874
(3) Titoli di debito subordinati	2105	3.073.652
(4) Commercial paper	2106	0
(5) Azioni	2107	112.347.253
(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	1.454.020
e. Derivati Over-the-counter con altri enti finanziari che hanno un fair value netto positivo:		
(1) Fair value netto positivo	2109	133.248
(2) Esposizione potenziale futura	2110	516.572
f. Indicatore delle attività verso altri enti finanziari, includendo le compagnie assicurative controllate	1215	250.783.423

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	18.731.120
(2) Depositi dovuti dagli enti finanziari non depositari	2112	37.156.624
(3) Prestiti ottenuti da altri enti finanziari	2113	14.829.337
b. Linee impegnate non utilizzate ottenute da altri enti finanziari	1223	87.515
c. Esposizione corrente netta negativa di SFTs con altri enti finanziari	1224	101.217
d. Derivati Over-the-counter con altri enti finanziari che hanno un fair value netto negativo:		
(1) Fair value netto negativo	2114	285.186
(2) Esposizione potenziale futura	2115	2.005.382
e. Indicatore delle passività verso altri enti finanziari, includendo le compagnie assicurative controllate	1221	73.196.382

Sezione 5 - Titoli in circolazione	GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Titoli di debito garantiti	2116	22.995.087
b. Titoli di debito senior non garantiti	2117	46.585.124
c. Titoli di debito subordinati	2118	13.934.849
d. Commercial paper	2119	8.576.152
e. Certificati di deposito	2120	250.879
f. Capitale primario	2121	44.115.221
g. Azioni privilegiate ed ogni altra forma di finanziamento subordinato non presente in 5.c.	2122	6.282.412
h. Indicatore dei titoli in circolazione, includendo le compagnie assicurative controllate	1226	142.739.724

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	17.088.662
b. Dollari canadesi (CAD)	1063	11.229.244
c. Franchi svizzeri (CHF)	1064	8.479.408
d. Yuan cinesi (CNY)	1065	8.514.744
e. Euro (EUR)	1066	8.202.699.831
f. Sterline britanniche (GBP)	1067	54.702.567
g. Dollari Hong Kong (HKD)	1068	16.933.134
h. Rupie indiane (INR)	1069	17.389
i. Yen giapponesi (JPY)	1070	10.801.919
j. Dollari neozelandesi (NZD)	1109	3.156.289
k. Corone svedesi (SEK)	1071	1.742.168
l. Dollari statunitensi (USD)	1072	1.497.199.159
m. Indicatore delle operazioni di pagamento	1073	9.832.564.514

Sezione 7 - Attività in custodia	GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Indicatore delle attività in custodia	1074	669.251.027

Sezione 8 - Operazioni di sottoscrizione	GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Operazioni di sottoscrizione azionaria	1075	1.238.519
b. Operazioni di sottoscrizione obbligazionaria	1076	28.345.075
c. indicatore delle operazioni di sottoscrizione	1077	29.583.594

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	1.151.914
b. Volumi di trading di altri titoli a reddito fisso, netto intragruppo	2124	157.749.547
c. Volumi di trading dei titoli a reddito fisso	2125	158.901.460
d. Volumi di trading delle azioni quotate, netto intragruppo	2126	126.802.443
e. Volumi di trading di altri titoli, netto intragruppo	2127	69.501.236
f. Volumi di trading delle azioni quotate ed altri titoli	2128	196.303.680

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	2.282.473.826
b. Derivati OTC regolati a livello bilaterale	1905	644.530.485
c. Indicatore del valore nozionale dei derivati OTC, includendo le compagnie assicurative controllate	1227	2.927.004.311

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	29.013.172
b. Titoli disponibili per la vendita (AFS)	1082	66.855.423
c. Titoli HFT e AFS che rispondono alla definizione di attività di primo livello	1083	83.344.181
d. Titoli HFT e AFS che rispondono alla definizione di attività di secondo livello, con haircuts	1084	7.318.101
e. Indicatore delle attività detenute per la negoziazione e disponibili per la vendita	1085	5.206.313

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	16.259.804

Indicatori di operatività internazionale

Sezione 13 - Attività transfrontaliere	GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Attività transfrontaliere (esclusi derivati)	1087	240.913.662
b. Derivati attivi transfrontalieri	1146	3.719.710
c. Indicatore delle attività e dei derivati transfrontalieri	2130	244.633.372

Sezione 14 - Passività transfrontaliere	GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Passività transfrontaliere (esclusi derivati)	2131	144.191.174
b. Derivati passivi transfrontalieri	1149	10.912.664
c. Indicatore delle passività e dei derivati transfrontalieri	1148	155.103.838

Riepilogo

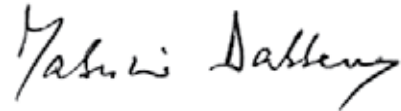
Sezione 22 - Valore degli indicatori	GSIB	Importo in migliaia di EURO
a. Sezione 2 - Esposizione totale, includendo le compagnie assicurative controllate	2001	1.143.188.756
b. Sezione 3 - Attività verso altri enti finanziari, includendo le compagnie assicurative controllate	2002	250.783.423
c. Sezione 4 - Passività verso altri enti finanziari, includendo le compagnie assicurative controllate	2003	73.196.382
d. Sezione 5 - Titoli in circolazione, includendo le compagnie assicurative controllate	2004	142.739.724
e. Sezione 6 - Operazioni di pagamento	2005	9.832.564.514
f. Sezione 7 - Attività in custodia	2006	669.251.027
g. Sezione 8 - Operazioni di sottoscrizione	2007	29.583.594
h. Section 9.c - Volume di trading dei titoli a reddito fisso	2008	158.901.460
i. Section 9.f - Volume di trading delle azioni quotate e degli altri titoli	2009	196.303.680
h. Sezione 9 - Derivati Over-The-Counter, includendo le compagnie assicurative controllate	2010	2.927.004.311
i. Sezione 10 - Attività detenute per la negoziazione e disponibili per la vendita	2011	5.206.313
j. Sezione 11 - Attività di terzo livello, includendo le compagnie assicurative controllate	2012	16.259.804
k. Sezione 12 - Attività transfrontaliere	2013	244.633.372
l. Sezione 13 - Passività transfrontaliere	2014	155.103.838

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 2022

Fabrizio Dabbene
Dirigente preposto alla redazione
dei documenti contabili societari

Handwritten signature of Fabrizio Dabbene in black ink.