



INFORMATIVA SUGLI INDICATORI RILEVANTI NELLA METODOLOGIA DI IDENTIFICAZIONE DELLE BANCHE A RILEVANZA SISTEMICA A LIVELLO GLOBALE ALLA DATA 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 200 miliardi di Euro, di pubblicare su base annuale i 13 indicatori impiegati nella metodologia di valutazione. Banco BPM, pur non essendo una G-SIB, rientra tra le banche con una esposizione ai fini dell'indice di leva finanziaria che supera il predetto limite ed è pertanto tenuta agli obblighi di informativa e pubblicazione.

Gli indicatori esposti nel seguito sono calcolati sulla base delle disposizioni del Comitato di Basilea per la vigilanza bancaria e quindi potrebbero non essere direttamente comparabili con altre informazioni pubblicate dal Gruppo Banco BPM.

Per maggiori informazioni si fa rinvio al sito: www.bis.org/bcbs/gsib.

Si precisa che le informazioni oggetto di pubblicazione potrebbero subire variazioni in quanto oggetto di analisi da parte dell'Autorità nazionale di vigilanza e del Comitato di Basilea per la vigilanza bancaria.

Dati generali della Banca

Sezione 1 - Informazioni generali		GSIB	
a. Informazioni generali fornite dall'autorità di vigilanza competente:			
(1) Codice nazione		1001	IT
(2) Nome Banca		1002	BANCO BPM SPA
(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 rendicontazione		1007	1.000
(2) Principi contabili		1008	IFRS
(3) Data di pubblicazione (aaaa-mm-gg)		1009	2024-04-29
(4) Lingua di pubblicazione		1010	Italiano
(5) Indirizzo web di pubblicazione		1011	https://gruppo.bancobpm.it/
(6) Codice LEI		1015	815600E4E6DCD2D25E30

Indicatore di dimensione

Sezione 2 - Esposizione Totale	GSIB	Importo in migliaia di Euro
a. Derivati		
(1) Esposizione della controparte dei contratti derivati	1012	333.830
(2) Valore nozionale effettivo dei derivati di credito	1201	0
(3) Esposizione potenziale futura dei contratti derivati	1018	1.294.629
b. Operazioni di finanziamento tramite titoli (SFTs)		
(1) Valore lordo rettificato di SFTs	1013	5.701.785
(2) Esposizione della controparte di SFTs	1014	910.675
c. Altre attività	1015	178.187.025
d. Valore nozionale lordo delle poste fuori bilancio		
(1) Poste soggette a 10% di fattore di conversione creditizia (CCF)	1019	39.758.879
(2) Poste soggette a 20% di CCF	1022	2.702.113
(3) Poste soggette a 40% di CCF	2300	0
(4) Poste soggette a 50% di CCF	1023	17.511.387
(5) Poste soggette a 100% di CCF	1024	2.439.250
e. Aggiustamenti regolamentari	1031	2.524.916
f. Esposizione totale prima delle rettifiche regolamentari (somma delle voci da 2.a.(1) a 2.c, 0,1 volte 2.d.(1), 0,2 volte 2.d.(2), 0,4 volte 2.d.(3), 0,5 volte 2.d.4, e 2.d.(5))	1103	202.139.197
g. Esposizione delle controllate assicurative non incluse in 2.f, al netto delle poste infragruppo		
(1) Attività in bilancio e fuori bilancio delle controllate assicurative	1701	16.495.981
(2) Esposizione potenziale futura dei derivati delle controllate assicurative	1205	0
(3) Valori dell'investimento in entità consolidate	1208	0
h. Esposizioni infragruppo di cui al punto 2.f verso controllate assicurative di cui al punto 2.g	2101	1.028.412
i. Indicatore delle esposizioni totali, comprese le controllate assicurative (somma delle voci 2.f, 2.g.(1) - 2.g.(2) meno 2.g.(3) - 2.h)	1117	217.606.766

Indicatori di interconnessione

Sezione 3 - Attività verso enti finanziari	GSIB	Importo in migliaia di Euro
a. Fondi depositati o dati in prestito ad altri enti finanziari	1216	13.295.640
(1) Certificati di deposito	2102	-
b. Quota non utilizzata di linee impegnate concesse ad altri enti finanziari	1217	5.416.650
c. Titoli detenuti ed emessi da altri enti finanziari:	-	
(1) Titoli di debito garantiti	2103	-
(2) Titoli di debito senior non garantiti	2104	7.864.712
(3) Titoli di debito subordinati	2105	95.638
(4) Commercial paper	2106	-
(5) Titoli azionari	2107	7.620.239
(6) Compensazione di posizioni corte in relazione agli specifici titoli azionari inclusi nella voce 3.c.(5)	2108	-
d. Esposizione corrente netta positiva di SFTs con altri enti finanziari	1219	655.681
e. Derivati OTC con altri enti finanziari che hanno un fair value netto positivo:	-	
(1) Fair value netto positivo	2109	918.435
(2) Esposizione potenziale futura	2110	382.189
f. Indicatore delle attività verso enti finanziari, comprese le controllate assicurative (somma delle voci 3.a, 3.b fino a 3.c.(5), 3.d, 3.e.(1) e 3.e.(2), meno 3.c.(6))	1215	36.249.184

Sezione 4 - Passività verso enti finanziari	GSIB	Importo in migliaia di Euro
a. Fondi depositati o presi in prestito da altri enti finanziari	-	
(1) Depositi verso enti depositari	2111	852.811
(2) Depositi verso enti finanziari non depositari	2112	3.923.084
(3) Finanziamenti ottenuti da altri enti finanziari	2113	-
b. Quota non utilizzata di linee impegnate ottenute da altri enti finanziari	1223	-
c. Esposizione corrente netta negativa di SFTs con altri enti finanziari	1224	437.737
d. Derivati OTC con altri enti finanziari che hanno un fair value netto negativo:	-	
(1) Fair value netto negativo	2114	305.916
(2) Esposizione potenziale futura	2115	211.480
e. Indicatore delle passività verso enti finanziari, comprese le controllate assicurative (somma delle voci da 4.a.(1) a 4.d.(2))	1221	5.731.028

Sezione 5 - Titoli in circolazione	GSIB	Importo in migliaia di Euro
a. Titoli di debito garantiti	2116	10.527.249
b. Titoli di debito senior non garantiti	2117	6.775.407
c. Titoli di debito subordinati	2118	1.899.600
d. Commercial paper	2119	-
e. Certificati di deposito	2120	5.303.860
f. Capitale primario	2121	7.077.064
g. Azioni privilegiate ed ogni altra forma di finanziamento subordinato non presente nella voce 5.c.	2122	1.465.843
h. Indicatore dei titoli in circolazione, includendo le compagnie assicurative controllate (somma delle voci da 5.a a 5.g)	1226	33.049.023

Sostituibilità/Indicatori di infrastruttura degli enti finanziari

Sezione 6 - Operazioni di pagamento nell'anno di riferimento (escluse operazioni infragruppo)	GSIB	Importo in migliaia di Euro
a. Dollari australiani (AUD)	1061	1.922.006
b. Dollari canadesi (CAD)	1063	1.521.938
c. Franchi svizzeri (CHF)	1064	21.137.261
d. Yuan cinesi (CNY)	1065	305.364
e. Euro (EUR)	1066	4.673.802.655
f. Sterline inglesi (GBP)	1067	19.996.537
g. Dollari Hong Kong (HKD)	1068	1.017.821
h. Rupie indiane (INR)	1069	4.024
i. Yen giapponesi (JPY)	1070	11.457.419
j. Dollari neozelandesi (NZD)	1109	956.340
k. Corone svedesi (SEK)	1071	30.399
l. Dollari statunitensi (USD)	1072	193.372.352
m. Indicatore delle attività di pagamento (somma delle voci da 6.a a 6.l)	1073	4.925.524.116

Sezione 7 - Attività in custodia	GSIB	Importo in migliaia di Euro
a. Indicatore delle attività in custodia	1074	102.678.644

Sezione 8 - Operazioni di sottoscrizione nei mercati dei titoli di debito e azionari	GSIB	Importo in migliaia di Euro
a. Operazioni di sottoscrizione azionaria	1075	-
b. Operazioni di sottoscrizione obbligazionaria	1076	189.565
c. Indicatore delle operazioni di sottoscrizione (somma delle voci 8.a e 8.b)	1077	189.565

Sezione 9 - Volumi di trading	GSIB	Importo in migliaia di Euro
a. Volumi di trading dei titoli emessi da organismi del settore pubblico, escluse le operazioni infragruppo	2123	375.949
b. Volumi di trading di altri titoli a reddito fisso, escluse le operazioni infragruppo	2124	156.228.574
c. Sottoindicatore dei volumi di trading dei titoli a reddito fisso (somma delle voci 9.a e 9.b)	2125	156.604.523
d. Volumi di trading delle azioni quotate, escluse le operazioni infragruppo	2126	22.064.962
e. Volumi di trading di altri titoli, escluse le operazioni infragruppo	2127	-
f. Sottoindicatore dei volumi di trading delle azioni quotate ed altri titoli (somma delle voci 9.d e 9.e)	2128	22.064.962

Indicatori di complessità

Sezione 10 - Valore nozionale dei derivati Over-the-Counter (OTC)	GSIB	Importo in migliaia di Euro
a. Derivati OTC compensati attraverso una controparte centrale	2129	95.268.341
b. Derivati OTC regolati a livello bilaterale	1905	79.140.683
c. Valore nozionale dei derivati OTC, incluse le controllate assicurative (somma delle voci 10.a e 10.b)	1227	174.409.024

Sezione 11 - Titoli detenuti per la negoziazione e disponibili per la vendita	GSIB	Importo in migliaia di Euro
a. Titoli detenuti per la negoziazione (HFT)	1081	2.391.245
b. Titoli disponibili per la vendita (AFS)	1082	10.692.718
c. Titoli di negoziazione e AFS che rispondono alla definizione di attività di Livello 1	1083	8.107.832
d. Titoli di negoziazione e AFS che rispondono alla definizione di attività di Livello 2, con "haircut"	1084	689.354
e. Indicatore dei titoli detenuti per la negoziazione e AFS (somma delle voci 11.a e 11.b, meno la somma di 11.c e 11.d)	1085	4.286.777

Sezione 12 - Attività di Livello 3	GSIB	Importo in migliaia di Euro
a. Indicatore delle attività di Livello 3, incluse le controllate assicurative	1229	2.010.879

Indicatori di operatività transfrontaliera

Sezione 13 - Attività transfrontaliere	GSIB	Importo in migliaia di Euro
a. Totale attività transfrontaliere sulla base del rischio ultimo	1087	29.474.390
b. Derivati attivi transfrontalieri sulla base del rischio ultimo	1146	2.405.796
c. Indicatore delle attività e dei derivati transfrontalieri (somma delle voci 13.a e 13.b)	2130	31.880.186

Sezione 14 - Passività transfrontaliere	GSIB	Importo in migliaia di Euro
a. Passività transfrontaliere, sulla base del rischio immediato, esclusi i derivati e incluse le passività locali in valuta locale	2131	21.568.388
b. Derivati passivi transfrontalieri sulla base del rischio immediato	1149	1.757.352
c. Indicatore delle passività transfrontaliere (somma delle voci 14.a e 14.b)	1148	23.325.740

Riepilogo

Sezione 23 - Valore degli indicatori (metodologia rivista)	GSIB	Importo in migliaia di Euro
a. Sezione 2 - Esposizione totale, incluse le controllate assicurative	2001	217.606.766
b. Sezione 3 - Attività verso enti finanziari, incluse le controllate assicurative	2002	36.249.184
c. Sezione 4 - Passività verso enti finanziari, incluse le controllate assicurative	2003	5.731.028
d. Sezione 5 - Titoli in circolazione, incluse le controllate assicurative	2004	33.049.023
e. Sezione 6 - Operazioni di pagamento	2005	4.925.524.116
f. Sezione 7 - Attività in custodia	2006	102.678.644
g. Sezione 8 - Operazioni di sottoscrizione	2007	189.565
h. Sezione 9.c - Volume di trading dei titoli a reddito fisso	2008	156.604.523
i. Sezione 9.f - Volume di trading delle azioni e degli altri titoli	2009	22.064.962
h. Sezione 10 - Derivati OTC, incluse le controllate assicurative	2010	174.409.024
i. Sezione 11 - Attività detenute per la negoziazione e AFS	2011	4.286.777
j. Sezione 12 - Attività di Livello 3, incluse le controllate assicurative	2012	2.010.879
k. Sezione 13 - Attività transfrontaliere	2013	31.880.186
l. Sezione 14 - Passività transfrontaliere	2014	23.325.740

DICHIARAZIONE DEL DIRIGENTE PREPOSTO ALLA REDAZIONE DEI DOCUMENTI CONTABILI SOCIETARI

Il sottoscritto, Gianpietro Val, in qualità di Dirigente Preposto alla redazione dei documenti contabili societari di Banco BPM S.p.A. attesta, in conformità a quanto previsto dal comma 2 dell'art. 154-bis del decreto legislativo 24 febbraio 1998, n. 58, che l'informativa contabile contenuta nel presente documento corrisponde alle risultanze documentali, ai libri e alle scritture contabili.

Milano, 29 aprile 2024



Gianpietro Val

Dirigente preposto alla redazione
dei documenti contabili societari
