



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
