



## INFORMATIVA SUGLI INDICATORI RILEVANTI NELLA METODOLOGIA DI IDENTIFICAZIONE DELLE BANCHE A RILEVANZA SISTEMICA A LIVELLO GLOBALE ALLA DATA 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 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, espressi in migliaia di euro, 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](http://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.

### G-SIB Assessment Exercise 31 dicembre 2022

#### 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 S.p.A.
(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	2023-04-13
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	2023-04-28
(4) Lingua di pubblicazione	1010	Italiano
(5) Indirizzo web di pubblicazione	1011	<a href="http://www.gruppo.bancobpm.it">www.gruppo.bancobpm.it</a>
(6) Codice LEI	1015	815600E4E6DCD2D25E30

**Indicatore di dimensione**

<b>Sezione 2 - Esposizione Totale</b>	<b>GSIB</b>	<b>Importo</b>
a. Derivati		
(1) Esposizione della controparte dei contratti derivati	1012	224.265
(2) Valore nozionale cappato dei derivati di credito	1201	-
(3) Esposizione potenziale futura dei contratti derivati	1018	1.275.998
b. Operazioni di finanziamento tramite titoli (SFTs)		
(1) Valore lordo rettificato di SFTs	1013	2.833.243
(2) Esposizione della controparte di SFTs	1014	164.514
c. Altre attività	1015	176.713.114
d. Valore nozionale lordo delle poste fuori bilancio		
(1) Poste soggette a 0% di fattore di conversione creditizia (CCF)	1019	38.134.035
(2) Poste soggette a 20% di CCF	1022	2.378.655
(3) Poste soggette a 50% di CCF	1023	15.330.356
(4) Poste soggette a 100% di CCF	1024	1.224.118
e. Aggiustamenti regolamentari	1031	3.353.337
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), 0,5 volte 2.d.(3) e 2.d.(4))	1103	194.389.565
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	6.282.133
(2) Esposizione potenziale futura dei derivati delle controllate assicurative	1205	-
(3) Valori dell'investimento in entità consolidate	1208	321.507
h. Esposizioni infragruppo di cui al punto 2.f verso controllate assicurative di cui al punto 2.g	2101	20.267
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	200.329.924

**Indicatori di interconnessione**

<b>Sezione 3 - Attività verso enti finanziari</b>	<b>GSIB</b>	<b>Importo</b>
a. Fondi depositati o dati in prestito ad altri enti finanziari	1216	15.918.985
(1) Certificati di deposito	2102	-
b. Quota non utilizzata di linee impegnate concesse ad altri enti finanziari	1217	3.927.860
c. Titoli detenuti ed emessi da altri enti finanziari:		
(1) Titoli di debito garantiti	2103	-
(2) Titoli di debito senior non garantiti	2104	6.267.090
(3) Titoli di debito subordinati	2105	193.816
(4) Commercial paper	2106	-
(5) Titoli azionari	2107	2.516.541
(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	353.774
e. Derivati OTC con altri enti finanziari che hanno un fair value netto positivo:		
(1) Fair value netto positivo	2109	177.365
(2) Esposizione potenziale futura	2110	438.914
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	29.794.345

<b>Sezione 4 - Passività verso enti finanziari</b>	GSIB	<b>Importo</b>
a. Fondi depositati o presi in prestito da altri enti finanziari		
(1) Depositi verso enti depositari	2111	-
(2) Depositi verso enti finanziari non depositari	2112	18.385.317
(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	111.885
d. Derivati OTC con altri enti finanziari che hanno un fair value netto negativo:		
(1) Fair value netto negativo	2114	3.644
(2) Esposizione potenziale futura	2115	61.585
e. Indicatore delle passività verso enti finanziari, comprese le controllate assicurative (somma delle voci da 4.a.(1) a 4.d.(2))	1221	18.562.431
<b>Sezione 5 - Titoli in circolazione</b>	GSIB	<b>Importo</b>
a. Titoli di debito garantiti	2116	6.840.323
b. Titoli di debito senior non garantiti	2117	4.165.950
c. Titoli di debito subordinati	2118	1.863.610
d. Commercial paper	2119	-
e. Certificati di deposito	2120	4.270.993
f. Capitale primario	2121	7.081.734
g. Azioni privilegiate ed ogni altra forma di finanziamento subordinato non presente nella voce 5.c.	2122	1.389.794
h. Indicatore dei titoli in circolazione, includendo le compagnie assicurative controllate (somma delle voci da 5.a a 5.g)	1226	25.612.404
<b>Sostituibilità/Indicatori di infrastruttura degli enti finanziari</b>		
<b>Sezione 6 - Operazioni di pagamento nell'anno di riferimento (escluse operazioni infragruppo)</b>	GSIB	<b>Importo</b>
a. Dollari australiani (AUD)	1061	4.143.478
b. Dollari canadesi (CAD)	1063	3.209.580
c. Franchi svizzeri (CHF)	1064	10.876.359
d. Yuan cinesi (CNY)	1065	262.780
e. Euro (EUR)	1066	2.379.733.258
f. Sterline inglesi (GBP)	1067	21.740.134
g. Dollari Hong Kong (HKD)	1068	791.936
h. Rupie indiane (INR)	1069	2.489
i. Yen giapponesi (JPY)	1070	14.536.029
j. Dollari neozelandesi (NZD)	1109	124.022
k. Corone svedesi (SEK)	1071	1.115.222
l. Dollari statunitensi (USD)	1072	245.990.537
m. Indicatore delle attività di pagamento (somma delle voci da 6.a a 6.l)	1073	2.682.525.824
<b>Sezione 7 - Attività in custodia</b>	GSIB	<b>Importo</b>
a. Indicatore delle attività in custodia	1074	86.845.938
<b>Sezione 8 - Operazioni di sottoscrizione nei mercati dei titoli di debito e azionari</b>	GSIB	<b>Importo</b>
a. Operazioni di sottoscrizione azionaria	1075	7.265.269
b. Operazioni di sottoscrizione obbligazionaria	1076	230.961
c. Indicatore delle operazioni di sottoscrizione (somma delle voci 8.a e 8.b)	1077	7.496.229

<b>Sezione 9 - Volumi di trading</b>		GSIB	<b>Importo</b>
a. Volumi di trading dei titoli emessi da organismi del settore pubblico, escluse le operazioni infragruppo	2123		133.092.632
b. Volumi di trading di altri titoli a reddito fisso, escluse le operazioni infragruppo	2124		1.506.371
c. Sottoindicatore dei volumi di trading dei titoli a reddito fisso (somma delle voci 9.a e 9.b)	2125		134.599.003
d. Volumi di trading delle azioni quotate, escluse le operazioni infragruppo	2126		201.908.372
e. Volumi di trading di altri titoli, escluse le operazioni infragruppo	2127		8.466.281
f. Sottoindicatore dei volumi di trading delle azioni quotate ed altri titoli (somma delle voci 9.d e 9.e)	2128		210.374.653
<b>Indicatori di complessità</b>			
<b>Sezione 10 - Valore nozionale dei derivati Over-the-Counter (OTC)</b>		GSIB	<b>Importo</b>
a. Derivati OTC compensati attraverso una controparte centrale	2129		77.435.043
b. Derivati OTC regolati a livello bilaterale	1905		92.471.116
c. Valore nozionale dei derivati OTC, incluse le controllate assicurative (somma delle voci 10.a e 10.b)	1227		169.906.159
<b>Sezione 11 - Titoli detenuti per la negoziazione e disponibili per la vendita</b>		GSIB	<b>Importo</b>
a. Titoli detenuti per la negoziazione (HFT)	1081		1.627.310
b. Titoli disponibili per la vendita (AFS)	1082		9.380.520
c. Titoli di negoziazione e AFS che rispondono alla definizione di attività di Livello 1	1083		6.814.753
d. Titoli di negoziazione e AFS che rispondono alla definizione di attività di Livello 2, con "haircut"	1084		459.096
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		3.733.981
<b>Sezione 12 - Attività di Livello 3</b>		GSIB	<b>Importo</b>
a. Indicatore delle attività di Livello 3, incluse le controllate assicurative	1229		1.388.214
<b>Indicatori di operatività transfrontaliera</b>			
<b>Sezione 13 - Attività transfrontaliere</b>		GSIB	<b>Importo</b>
a. Totale attività transfrontaliere sulla base del rischio ultimo	1087		27.297.911
b. Derivati attivi transfrontalieri sulla base del rischio ultimo	1146		3.823.095
c. Indicatore delle attività e dei derivati transfrontalieri (somma delle voci 13.a e 13.b)	2130		31.121.006
<b>Sezione 14 - Passività transfrontaliere</b>		GSIB	<b>Importo</b>
a. Passività transfrontaliere, sulla base del rischio immediato, esclusi i derivati e incluse le passività locali in valuta locale	2131		16.100.240
b. Derivati passivi transfrontalieri sulla base del rischio immediato	1149		2.097.748
c. Indicatore delle passività transfrontaliere (somma delle voci 14.a e 14.b)	1148		18.197.988

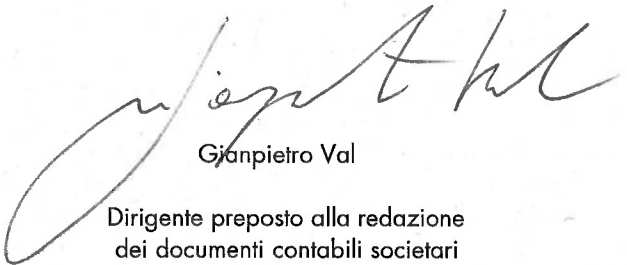
**Riepilogo**

<b>Sezione 23 - Valore degli indicatori</b>	<b>GSIB</b>	<b>Importo</b>
a. Sezione 2 - Esposizione totale, incluse le controllate assicurative	2001	200.329.924
b. Sezione 3 - Attività verso enti finanziari, incluse le controllate assicurative	2002	29.794.345
c. Sezione 4 - Passività verso enti finanziari, incluse le controllate assicurative	2003	18.562.431
d. Sezione 5 - Titoli in circolazione, incluse le controllate assicurative	2004	25.612.404
e. Sezione 6 - Operazioni di pagamento	2005	2.682.525.824
f. Sezione 7 - Attività in custodia	2006	86.845.938
g. Sezione 8 - Operazioni di sottoscrizione	2007	7.496.229
h. Sezione 9.c - Volume di trading dei titoli a reddito fisso	2008	134.599.003
i. Sezione 9.f - Volume di trading delle azioni e degli altri titoli	2009	210.374.653
h. Sezione 10 - Derivati OTC, incluse le controllate assicurative	2010	169.906.159
i. Sezione 11 - Attività detenute per la negoziazione e AFS	2011	3.733.981
j. Sezione 12 - Attività di Livello 3, incluse le controllate assicurative	2012	1.388.214
k. Sezione 13 - Attività transfrontaliere	2013	31.121.006
l. Sezione 14 - Passività transfrontaliere	2014	18.197.988

## 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, 28 aprile 2023



Gianpietro Val  
Dirigente preposto alla redazione  
dei documenti contabili societari