

IT
ALLEGATO I

SEGNALAZIONE DEL REQUISITO MINIMO DI FONDI PROPRI E PASSIVITÀ AMMISSIBILI

MODELLI PER IL MREL E LA TLAC			
Numero del modello	Codice del modello	Nome del modello/gruppo di modelli	Nome abbreviato
		IMPORTI: PRINCIPALI METRICHE PER IL MREL E LA TLAC	
1	M 01.00	Principali metriche del MREL e della TLAC (gruppi/entità soggetti a risoluzione)	KM2
		COMPOSIZIONE E DURATA	
2	M 02.00	Composizione e capacità per il MREL e la TLAC (gruppi/entità soggetti a risoluzione)	TLAC1
3	M 03.00	MREL interno e TLAC interna	ILAC
4	M 04.00	Struttura di finanziamento delle passività ammissibili	LIAB-MREL
		RANGO NELLA GRADUATORIA DEI CREDITORI	
5	M 05.00	Rango nella graduatoria dei creditori (soggetto che non è un'entità soggetta a risoluzione)	TLAC2
6	M 06.00	Rango nella graduatoria dei creditori (entità soggetta a risoluzione)	TLAC3
		INFORMAZIONI SPECIFICHE PER CONTRATTO	
7	M 07.00	Strumenti disciplinati dal diritto di un paese terzo	MTCI

IT
ALLEGATO I

M 01.00 - Principali metriche per il MREL e la TLAC (gruppi/entità soggetti a risoluzione) (KM2)

		Requisito minimo di fondi propri e passività ammissibili (MREL)	Requisito di fondi propri e passività ammissibili per i G-SII (TLAC)
		0010	0020
	Importo complessivo dell'esposizione al rischio e misura dell'esposizione complessiva		
0100	IMPORTO COMPLESSIVO DELL'ESPOSIZIONE AL RISCHIO (TREA)		
0110	MISURA DELL'ESPOSIZIONE COMPLESSIVA (TEM)		
	Fondi propri e passività ammissibili		
0200	FONDI PROPRI E PASSIVITÀ AMMISSIBILI		
0210	Di cui fondi propri e passività subordinate		
0220	Di cui disciplinati dal diritto di un paese terzo		
0230	Di cui contenenti una clausola di svalutazione e di conversione a norma dell'articolo 55 della direttiva 2014/59/UE		
	Altre passività sottoponibili al bail-in		
0250	ALTRE PASSIVITÀ SOTTOPONIBILI AL BAIL-IN		
0260	Di cui disciplinati dal diritto di un paese terzo		
0270	Di cui contenenti una clausola di svalutazione e di conversione a norma dell'articolo 55 della direttiva 2014/59/UE		
0280	Durata residua < 1 anno		
0285	Durata residua >= 1 anno e < 2 anni		
0290	Durata residua >= 2 anni		
	Rapporti e deroghe per subordinazione		
0300	FONDI PROPRI E PASSIVITÀ AMMISSIBILI IN PERCENTUALE DEL TREA		
0310	Di cui fondi propri e passività subordinate		
0320	FONDI PROPRI E PASSIVITÀ AMMISSIBILI IN PERCENTUALE DELLA TEM		
0330	Di cui fondi propri e passività subordinate		
0340	Si applica la deroga per subordinazione di cui all'articolo 72 ter, paragrafo 4, del regolamento (UE) n. 575/2013? (deroga 5 %)		
0350	Importo complessivo degli strumenti di passività ammissibili non subordinate consentiti se si applica la facoltà di subordinazione di cui all'articolo 72 ter, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 575/2013 (deroga 3,5 % massimo)		
0360	Quota delle passività non subordinate totali incluse nei fondi propri e nelle passività ammissibili		

IT
ALLEGATO I

M 02.00 – Capacità e composizione per il MREL e la TLAC (gruppi/entità soggetti a risoluzione) (TLAC1)				
		Requisito minimo di fondi propri e passività ammissibili (MREL)	Requisito di fondi propri e passività ammissibili per i G-SII (TLAC)	Voce per memoria: importi ammissibili ai fini del MREL ma non della TLAC
		0010	0020	0030
0010	FONDI PROPRI E PASSIVITÀ AMMISSIBILI			
0020	Fondi propri (ammissibili)			
0030	Capitale primario di classe 1			
0040	Capitale aggiuntivo di classe 1 (ammissibile)			
0050	Capitale di classe 2 (ammissibile)			
0060	Passività ammissibili			
0070	Elementi di passività ammissibili prima delle rettifiche			
0080	Di cui passività ammissibili considerate strutturalmente subordinate			
0090	Passività ammissibili subordinate a passività escluse			
0100	Strumenti di passività ammissibili emessi direttamente dall'entità soggetta a risoluzione (non soggetti alla clausola grandfathering)			
0110	Strumenti di passività ammissibili emessi da altri soggetti all'interno del gruppo soggetto a risoluzione (non soggetti alla clausola grandfathering)			
0120	Strumenti di passività ammissibili emessi prima del 27 giugno 2019			
0130	Strumenti di classe 2 con una durata residua di almeno un anno, nella misura in cui non sono considerati elementi di classe 2			
0132	(-) Strumenti propri di passività ammissibili subordinate a passività escluse			
0135	(-) Di cui importi non utilizzati nel quadro di un'autorizzazione preventiva			
0140	Passività ammissibili non subordinate a passività escluse			
0150	Passività ammissibili non subordinate a passività escluse (non soggette alla clausola grandfathering pre-massimale)			
0160	Passività ammissibili non subordinate a passività escluse emesse prima del 27 giugno 2019 (pre-massimale)			
0162	(-) Strumenti propri di passività ammissibili non subordinate a passività escluse			
0165	(-) Di cui importi non utilizzati nel quadro di un'autorizzazione preventiva			
0170	Importi ammissibili dopo l'applicazione del massimale di cui all'articolo 72 ter, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 575/2013 (non soggetti alla clausola grandfathering)			
0180	Importi ammissibili, dopo l'applicazione del massimale di cui all'articolo 72 ter, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 575/2013, di elementi emessi prima del 27 giugno 2019			
0190	(-) Deduzioni			
0200	(-) Esposizioni tra gruppi soggetti a risoluzione con punto di avvio multiplo (MPE)			
0211	(-) Investimenti in altri strumenti di passività ammissibili			
0220	Eccesso di deduzioni dalle passività ammissibili rispetto alle passività ammissibili (deduzioni dal capitale di classe 2)			
VOCI PER MEMORIA				
0400	CET1 (%) disponibile dopo aver soddisfatto i requisiti del soggetto			
0410	Requisito combinato di riserva di capitale (%)			
0420	Di cui requisito di riserva di conservazione del capitale			
0430	Di cui requisito anticiclico di riserva di capitale			
0440	Di cui requisito di riserva di capitale a fronte del rischio sistemico			
0450	Di cui riserva per gli enti a rilevanza sistemica a livello globale (G-SII) o per gli altri enti a rilevanza sistemica (O-SII)			
0460	Investimenti in passività subordinate ammissibili di altri enti			
0470	Investimenti in passività subordinate ammissibili di G-SII			
0480	Investimenti in passività subordinate ammissibili di O-SII			
0490	Investimenti in passività subordinate ammissibili di altri enti			
0500	Passività escluse			

IT
ALLEGATO I

M 03.00 – MREL interno e TLAC interna (ILAC)			
		MREL interno	TLAC interna
		0010	0020
0010	Livello di applicazione		
	Importo complessivo dell'esposizione al rischio e misura dell'esposizione complessiva		
0100	Importo complessivo dell'esposizione al rischio (TREA)		
0110	Misura dell'esposizione complessiva (TEM)		
	Fondi propri ammissibili e passività ammissibili		
0200	Fondi propri ammissibili e passività ammissibili		
0210	Fondi propri ammissibili		
0220	Capitale primario di classe 1 (CET1)		
0230	Capitale aggiuntivo di classe 1 ammissibile		
0240	Capitale di classe 2 ammissibile		
0250	Passività ammissibili e garanzie		
0260	Passività ammissibili (escluse le garanzie)		
0265	(-) Strumenti propri di passività ammissibili: importi non utilizzati nel quadro di un'autorizzazione preventiva		
0270	Garanzie fornite dall'entità soggetta a risoluzione e consentite dall'autorità di risoluzione		
0280	Voce per memoria: parte garantita della garanzia		
0290	(-) Strumenti di fondi propri e strumenti di passività ammissibili emessi da entità non soggette a risoluzione dello stesso gruppo soggetto a risoluzione		
0293	(-) Di cui strumenti di fondi propri emessi da entità soggette a liquidazione		
0295	Eccesso di deduzioni dalle passività ammissibili rispetto alle passività ammissibili		
	Rapporti dei fondi propri ammissibili e delle passività ammissibili		
0400	Fondi propri e passività ammissibili in percentuale del TREA		
0410	Di cui garanzie consentite		
0420	Fondi propri e passività ammissibili in percentuale della TEM		
0430	Di cui garanzie consentite		
0440	CET1 (%) disponibile dopo aver soddisfatto i requisiti del soggetto		
	Voci per memoria		
0500	Requisito combinato di riserva di capitale (%)		
0510	Di cui requisito di riserva di conservazione del capitale		
0520	Di cui requisito anticiclico di riserva di capitale		
0530	Di cui requisito di riserva di capitale a fronte del rischio sistemico		
0540	Di cui riserva per gli enti a rilevanza sistemica a livello globale (G-SII) o per gli altri enti a rilevanza sistemica (O-SII)		
0550	Altre passività sottoponibili al bail-in		
0560	Di cui disciplinati dal diritto di un paese terzo		
0570	Di cui contenenti una clausola di svalutazione e di conversione a norma dell'articolo 55 della direttiva 2014/59/UE		
0580	Durata residua < 1 anno		
0590	Durata residua >= 1 anno e < 2 anni		
0600	Durata residua >= 2 anni		
0610	Passività escluse		
0620	Strumenti di fondi propri emessi da entità soggette a liquidazione dello stesso gruppo soggetto a risoluzione		
0630	Rapporto tra strumenti di fondi propri detenuti emessi da entità soggette a liquidazione e fondi propri ammissibili e passività ammissibili		

IT
ALLEGATO I

M 04.00 – Struttura di finanziamento delle passività ammissibili (LIAB MREL)		
		Importo ammissibile per il MREL/per il MREL interno
		0010
0100	PASSIVITÀ AMMISSIBILI	
0200	Depositi, non protetti e non preferenziali >= 1 anno	
0210	Di cui durata residua >= 1 anno e < 2 anni	
0220	Di cui durata residua >= 2 anni	
0230	Di cui emesse da filiazioni	
0300	Passività garantite non coperte da garanzia reale > = 1 anno	
0310	Di cui durata residua >= 1 anno e < 2 anni	
0320	Di cui durata residua >= 2 anni	
0330	Di cui emesse da filiazioni	
0400	Obbligazioni strutturate > = 1 anno	
0410	Di cui durata residua >= 1 anno e < 2 anni	
0420	Di cui durata residua >= 2 anni	
0430	Di cui emesse da filiazioni	
0500	Passività di primo rango (senior) non garantite > = 1 anno	
0510	Di cui durata residua >= 1 anno e < 2 anni	
0520	Di cui durata residua >= 2 anni	
0530	Di cui emesse da filiazioni	
0600	Passività di primo rango (senior) non privilegiate > = 1 anno	
0610	Di cui durata residua >= 1 anno e < 2 anni	
0620	Di cui durata residua >= 2 anni	
0630	Di cui emesse da filiazioni	
0700	Passività subordinate (non riconosciute come fondi propri) > = 1 anno	
0710	Di cui durata residua >= 1 anno e < 2 anni	
0720	Di cui durata residua >= 2 anni	
0730	Di cui emesse da filiazioni	
0800	Altre passività ammissibili MREL >= 1 anno	
0810	Di cui durata residua >= 1 anno e < 2 anni	
0820	Di cui durata residua >= 2 anni	
0830	Di cui emesse da filiazioni	

IT
ALLEGATO I

M 05.00 – Rango nella graduatoria dei creditori (soggetto che non è un'entità soggetta a risoluzione) (TLAC2)

Rango in caso di insolvenza	Tipo di creditore	Descrizione del rango in caso di insolvenza	Passività e fondi propri		Passività e fondi propri meno passività escluse						
				Di cui passività escluse	Di cui fondi propri e passività ammissibili ai fini del MREL interno	Di cui con durata residua di				Di cui titoli perpetui	
						≥ 1 anno < 2 anni	≥ 2 anni < 5 anni	≥ 5 anni < 10 anni	≥ 10 anni		
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120

IT
ALLEGATO I

M 06.00 – Rango nella graduatoria dei creditori (entità soggette a risoluzione) (TLAC3)

Rango in caso di insolvenza	Descrizione del rango in caso di insolvenza	Passività e fondi propri		Passività e fondi propri meno passività escluse						
		Di cui passività escluse	Di cui fondi propri e passività ammissibili potenzialmente ammissibili ai fini del MREL	Di cui con durata residua di				Di cui titoli perpetui		
				≥ 1 anno < 2 anni	≥ 2 anni < 5 anni	≥ 5 anni < 10 anni	≥ 10 anni			
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110

M 07.00 – Strumenti disciplinati dal diritto di un paese terzo (MTCI)

Soggetto emittente			Identificativo del contratto	Diritto applicabile (paese terzo)	Riconoscimento contrattuale dei poteri di svalutazione e di conversione	Trattamento regolamentare		Importo	Rango nelle procedure ordinarie di insolvenza		Durata	(Prima) data di call	Regulatory call (Sì/No)
Nome	Codice	Tipo di codice				Tipo di fondi propri o passività ammissibili	Tipo di strumento		Diritto applicabile	Rango in caso di insolvenza			
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120	0130	0140