

| TCOR028 | TABELLA TITOLI (ULTERIORI INFORMAZIONI DI COMPLEMENTO ALLA TCOR014) | | |
|---|---|------|---|
| data pubblicazione 2024-02-21 | | | |
| NOME CAMPO | LUNGHEZZA | TIPO | NOTE |
| CHIAVE | 12 | A | campo chiave (lo stesso campo chiave della tabella TCOR014) |
| CODICE ISIN | 12 | A | codice ISIN del titolo |
| COD IDENTIFICATIVO EMIT. | 16 | A | cod. identificativo del cliente (cod. fiscale/cod. corrispondente estero UIC) |
| PREZZO UNITARIO OPZIONE | 5 | N | 3 interi, 2 decimali (alimentazione aziendale) |
| COMPARTO TITOLO | 4 | A | Ved. 1.37 del T. Record UIC per le prime tre posizioni e 1.45 per la quarta posizione |
| NATURA TITOLO | 3 | A | Ved. 1.36 del T. Record UIC |
| SOGGETTO CHE ESERCITA L'OPZIONE | 1 | N | Ved. 1.67 del T. Record UIC (facoltà rimborso anticipato) |
| PERIODICITÀ CEDOLA O REVISIONE RENDIMENTO | 1 | N | Ved. 1.51 del T. Record UIC |
| TITOLO QUALIFICATO BASILEA1 | 1 | N | “0”=no, “1”=si (alimentazione aziendale) |

| TCOR028 | TABELLA TITOLI (ULTERIORI INFORMAZIONI DI COMPLEMENTO ALLA TCOR014) | | |
|---|---|------|---|
| data pubblicazione 2024-02-21 | | | |
| NOME CAMPO | LUNGHEZZA | TIPO | NOTE |
| FONDI COMUNI D'INVESTIMENTO (Tipologia titoli più rischiosa prevista dal regolamento del fondo) | 1 | N | "7"=Titoli di o garantiti da Stato e Banche Centrali Zona A e Comunità Europea "8"=Titoli di debito di emittenti qualificati "9"=Altri titoli (compresi i titoli di capitale indipendentemente dall'emittente) (alimentazione aziendale) |
| LOCALIZZAZIONE DELL'OBLIGATO DELLE ESPOSIZIONI SOTTOSTANTI OIC (se ricorrono le condizioni previste dal par. 5 a) dell'art. 2 del Reg. n. 1152/2014 UE alimentare con il valore '086') | 3 | N | cod. Stato |
| TIT. DI AMMINISTR. CENTR. ZONA B DENOMINATI E FI-NANZIATI IN VALUTA LOCA-LE etc. | 1 | N | "0"=no, "1"=si |
| TASSO DI EMISSIONE | 7 | N | 2 interi, 5 decimali (vedi punto 1.46 anagrafe UIC) |
| PAESE DI NEGOZIAZIONE DEL TITOLO/INDICE | 3 | N | cod. UIC paese di quotazione (alimentazione aziendale) |
| LOTTO MINIMO NEGOZIABILE | 15 | N | importo da fornire per l'esecuzione della funzione F42 (in sua assenza la funzione utilizza un importo prudenziale di 100.000 euro) |

| TCOR028 | TABELLA TITOLI (ULTERIORI INFORMAZIONI DI COMPLEMENTO ALLA TCOR014) | | |
|--------------------------------------|---|------|--|
| data pubblicazione 2024-02-21 | | | |
| NOME CAMPO | LUNGHEZZA | TIPO | NOTE |
| INDICE AZIONARIO | 1 | N | "0"=no; "1"=si - altri (alimentazione aziendale) "2"=si - negoziati in borsa ed adeguatamente diversificati (alimentazione aziendale). |
| INDICATORE DI QUOTAZIONE AI FINI IAS | 1 | N | "0"=non quotato IAS "1"=quotato IAS |
| RATING ESTERNO | 5 | A | rating univoco dell'emissione (in assenza, rating dell'emittente) per il dominio cfr. TCOR35 |
| ESPOSIZIONI AD ALTO RISCHIO | 1 | N | 0=no; 1=hedge funds; 2=private equity; 3=venture capital; 4=altre esposizioni ad alto rischio. Il valore 1 vale solo per gli intermediari finanziari (non per le banche) e solo per le esposizioni verso organismi di investimento collettivo già detenute al 24 dicembre 2020. |
| COVERED BONDS | 1 | N | "0"=no, "1"=Obbligazioni bancarie garantite ex art.129 (4 o 5) del CRR "2"=Altre obbligazioni bancarie garantite ex art. 3 (1) direttiva 2019/2162 e ex art.52(4) direttiva 2009/65 "3"=Altre obbligazioni bancarie garantite |

| TCOR028 | TABELLA TITOLI (ULTERIORI INFORMAZIONI DI COMPLEMENTO ALLA TCOR014) | | |
|---|---|------|--|
| data pubblicazione 2024-02-21 | | | |
| NOME CAMPO | LUNGHEZZA | TIPO | NOTE |
| TITOLI ABS | 1 | N | "0"=no, "1"=garantiti da crediti ipotecari commerciali (CMBS) "2"=garantiti da crediti ipotecari residenziali (art.13, P.2,lettera g), punti i) e ii) del RD 2015/61) "4"= garantiti da veicoli e leasing auto (art.13, P.2,lettera g), punto iv) del RD 2015/61, come modificato dal RD 2018/1620) "5"= garantiti da prestiti commerciali a imprese o da prestiti al consumo (art.13, P.2,lettera g), punti iii) e v) del RD 2015/61,come modificato dal RD 2018/1620) "6"= altri ABS. |
| CARTOLARIZZAZIONI LIVELLO 2B CON DISPOSIZIONE TRANSITORIA (da alimentare solo se TITOLI ABS=2) | 1 | N | "0"=no; "1"=sì (cfr. art 37, par. 1 e 2, del RD). |
| EMITTENTE NON BANCARIO VIGILATO PER BASILEA | 1 | N | "0"=no; "1"=sì (emittente ente finanziario autorizzato e sottoposto a vigilanza dalle autorità competenti e sottoposto a requisiti prudenziali comparabili a quelli applicati agli enti). |
| TITOLO QUALIFICATO BASILEA | 1 | N | "0"=no, "1"=sì |

| TCOR028 | TABELLA TITOLI (ULTERIORI INFORMAZIONI DI COMPLEMENTO ALLA TCOR014) | | |
|---|---|------|---|
| data pubblicazione 2024-02-21 | | | |
| NOME CAMPO | LUNGHEZZA | TIPO | NOTE |
| COMPOSIZIONE PREVALENTE DEL FONDO | 1 | N | "0"=no; "1"=titoli di debito; "2"=titoli di capitale. (da alimentare solo per OICR) |
| TITOLO CONTENUTO NEI PRINCIPALI INDICI DI BORSA | 1 | N | "0"=no, "1"=si |
| CENSITO CR | 13 | N | codice censito Centrale dei rischi dell'emittente (da alimentare per i certificati di deposito emessi da banche) |
| COEFFICIENTE DI CONCENTRAZIONE | 7 | N | (da fornire con 1 intero e 6 decimali soltanto per l'applicazione del metodo look-through di cui al CRR art. 253 e alla Circ. 288) |
| FATTORE DI PONDERAZIONE MINIMO | 4 | N | (da fornire soltanto per l'applicazione del metodo look-through di cui al CRR art.253-254 e alla Circ. 288; i valori devono essere compresi tra 0 e 1250 per le banche e le finanziarie che raccolgono risparmio tra il pubblico, mentre devono essere compresi tra 0 e 1666 per le finanziarie che non raccolgono risparmio tra il pubblico) |
| TITOLI STEPPED | 1 | N | "0"=no, "1"=si |

| TCOR028 | TABELLA TITOLI (ULTERIORI INFORMAZIONI DI COMPLEMENTO ALLA TCOR014) | | |
|--|---|------|---|
| data pubblicazione 2024-02-21 | | | |
| NOME CAMPO | LUNGHEZZA | TIPO | NOTE |
| TIPO TASSO INIZIALE | 1 | N | "0"=fisso "1"=indicizzato "2"=zero coupon |
| DATA VARIAZIONE TIPO TASSO | 8 | N | Data da fornire nella forma "AAAAMMGG" |
| TIPO AMMORTAMENTO | 1 | N | (vedi punto 1.53 dell' anagrafe UIC) 0 = rimborso in unica soluzione alla data di fine prestito; "1"=ammortamento costante (rata variabile con quota capitale costante); "2"=ammortamento "francese" (rata costante con capitale crescente); "3"=altre modalità; "4"=irredimibile. |
| TASSO DI RIFERIMENTO (da alimentare solo per certificati di deposito se 'SEGNALAZIONE ANACREDIT' DI FGL è <> 0 e 'TASSO INDICIZZATO' di TCOR14=1) | 3 | N | per i valori cfr. TCOR45. |

| TCOR028 | TABELLA TITOLI (ULTERIORI INFORMAZIONI DI COMPLEMENTO ALLA TCOR014) | | |
|---|---|------|--|
| data pubblicazione 2024-02-21 | | | |
| NOME CAMPO | LUNGHEZZA | TIPO | NOTE |
| DIFFERENZIALE (SPREAD)/MARGINE DEL TASSO DI INTERESSE (da alimentare solo per certificati di deposito se 'SEGNALAZIONE ANACREDIT' DI FGL è <> 0 e 'TASSO INDICIZZATO' di TCOR14=1) | 10 | N | (da fornire in percentuale con 4 interi, 6 decimali) |
| TASSO DI INTERESSE MASSIMO (da alimentare solo per certificati di deposito se 'SEGNALAZIONE ANACREDIT' DI FGL è <> 0 e 'TASSO INDICIZZATO' di TCOR14=1) | 10 | N | (da fornire in percentuale con 4 interi, 6 decimali) |
| TASSO DI INTERESSE MINIMO (da alimentare solo per certificati di deposito se 'SEGNALAZIONE ANACREDIT' DI FGL è <> 0 e 'TASSO INDICIZZATO' di TCOR14=1) | 10 | N | (da fornire in percentuale con 4 interi, 6 decimali) |

| TCOR028 | TABELLA TITOLI (ULTERIORI INFORMAZIONI DI COMPLEMENTO ALLA TCOR014) | | |
|----------------------------------|---|------|--|
| data pubblicazione 2024-02-21 | | | |
| NOME CAMPO | LUNGHEZZA | TIPO | NOTE |
| TIPOLOGIA TITOLO PER SHSG | 1 | N | 1 = “Titoli provvisti di codice ISIN: azioni quotate”; 2 = “Titoli provvisti di codice ISIN: OICR”; 3 = “Titoli provvisti di codice ISIN: titoli di debito”; 4 = “Titoli privi di codice ISIN: azioni quotate”; 5 = “Titoli privi di codice ISIN: OICR”; 6 = “Titoli privi di codice ISIN: titoli di debito”. (informazione determinata dalla procedura attraverso il ragionamento R22) |
| CLASSE DI ESPOSIZIONE IRB | 5 | N | 0 = Non applicabile 51 = Equity exposures 52 = Exposure classes excluding equities, securitisations and other non credit-obligation assets 53 = Exposures to central governments or central banks 54 = Exposures to corporates - specialised lending 55 = Exposures to corporates other than specialised lending 56 = Exposures to institutions 57 = Items representing securitisation positions 58 = Other non credit-obligation assets 59 = Retail exposures - other 60 = Retail exposures - qualifying revolving 61 = Retail exposures secured by immovable property |

| TCOR028 | TABELLA TITOLI (ULTERIORI INFORMAZIONI DI COMPLEMENTO ALLA TCOR014) | | |
|---|---|------|---|
| data pubblicazione 2024-02-21 | | | |
| NOME CAMPO | LUNGHEZZA | TIPO | NOTE |
| PERDITA IN CASO DI DEFAULT IN TEMPI DI RECESSIONE (ai sensi dell'art. 181 del CRR) | 5 | N | E' rappresentata con un numero con range da 0 a 1 arrotondato alla quarta cifra decimale dopo la virgola (es. 48,73% deve essere alimentato come 04873). Nei casi di non applicabile va indicato il valore negativo -1. (Obbligatorio solo per i segnalanti delle SHSG e per le controparti trattate con metodo IRB) |
| PERDITA IN CASO DI DEFAULT IN TEMPI NORMALI (ai sensi dell'art. 181 del CRR) | 5 | N | E' rappresentata con un numero con range da 0 a 1 arrotondato alla quarta cifra decimale dopo la virgola (es. 41,80% deve essere alimentato come 04180). Nei casi di non applicabile va indicato il valore negativo -1. (Obbligatorio solo per i segnalanti delle SHSG e per le controparti trattate con metodo IRB) |
| PONDERAZIONE DA PARAMETRI IRB | 6 | N | E' rappresentata con un numero con range da 0 a 12,50 arrotondato alla quarta cifra decimale dopo la virgola (es. 12,50% deve essere alimentato come 125000). Nei casi di non applicabile va indicato il valore negativo -1. (Obbligatorio solo per i segnalanti delle SHSG e per le controparti trattate con metodo IRB) |
| OBBLIGAZIONI COPERTE DA GARANZIA DELLO STATO (ai sensi dell'art.8 del decreto legge 6.12.2011, n. 201) | 1 | N | "0"=no, "1"=si con garanzia concessa anteriormente al 30.06.2014 (cfr. art. 35 del RD 2015/61) "2"=si con garanzia concessa a partire dal 30.06.2014. |

| TCOR028 | TABELLA TITOLI (ULTERIORI INFORMAZIONI DI COMPLEMENTO ALLA TCOR014) | | |
|----------------------------------|--|------|------|
| data pubblicazione 2024-02-21 | | | |
| NOME CAMPO | LUNGHEZZA | TIPO | NOTE |

| | | | |
|---|---|---|--|
| CATEGORIA DI POSIZIONI PER RISCHIO SPECIFICO – BANCHE IRB (cfr. art. 336 punto 2 della CRR) | 2 | N | Per il dominio cfr. campo 05831 -Categoria di posizioni per rischio specifico |
| LIQUIDITA' E QUALITA' CREDITIZIA Articolo 416 par. 1 lettera b),d)) CRR | 1 | N | 0 = Altro; 1 = Elevata; 2 = Elevatissima. |
| LIVELLO DI LIQUIDITA' (RD UE 2015/61) (da alimentare solo per CB, ABS e corporate bonds) | 1 | N | 0 = Altro; 1 = Elevata - Level 2B (art. 12); 2 = Elevata - Level 2A (art. 11); 3 = Elevatissima - Level 1 (art. 10). N.B. Devono essere rispettati tutti i requisiti dagli articoli indicati a seconda della casistica considerata. |
| TITOLO EMESSO DA BANCA COSTITUITA DA AMMINISTRAZIONI CENTRALI O REGIONALI (Art. 416 paragrafo 2 lettera a punto iii) del CRR) | 1 | N | "0"=no, "1"=si |

| | | | |
|----------------------------------|---|------|------|
| TCOR028 | TABELLA TITOLI (ULTERIORI INFORMAZIONI DI COMPLEMENTO ALLA TCOR014) | | |
| data pubblicazione 2024-02-21 | | | |
| NOME CAMPO | LUNGHEZZA | TIPO | NOTE |

TITOLI DI LIVELLO 1 EMESSI DA
ENTI CREDITIZI (di cui all'art. 10,
par.1, lett. e) del RD UE 2015/61)

1

N

"0"=no,
"1"=enti creditizi costituiti da amministrazioni centrali/regionali/locali di stati UE,
"2"=enti creditizi finanziatori di prestiti agevolati (*promotional lenders*).

| | | | |
|----------------------------------|---|------|------|
| TCOR028 | TABELLA TITOLI (ULTERIORI INFORMAZIONI DI COMPLEMENTO ALLA TCOR014) | | |
| data pubblicazione 2024-02-21 | | | |
| NOME CAMPO | LUNGHEZZA | TIPO | NOTE |

GARANZIA

2

N

00 = no;
01 = amministrazioni centrali stati UE;
02 = amministrazioni centrali stati extra-UE con ponderazione 0%;
03 = amministrazioni centrali stati extra-UE con ponderazione 20%;
04 = altre amministrazioni centrali;
05 = amministrazioni regionali UE con ponderazione 0%;
06 = amministrazioni regionali extra-UE con ponderazione 0%;
07 = amministrazioni regionali UE con ponderazione 20%;
08 = amministrazioni regionali extra-UE con ponderazione 20%;
09 = altre amministrazioni regionali;
10 = organismi del settore pubblico UE con ponderazione 0%;
11 = organismi del settore pubblico extra-UE con ponderazione 0%;
12 = organismi del settore pubblico UE con ponderazione 20%;
13 = organismi del settore pubblico extra-UE con ponderazione 20%;
14 = altri organismi del settore pubblico;
15 = autorità locali UE con ponderazione 0%;
16 = autorità locali extra-UE con ponderazione 0%;
17 = autorità locali UE con ponderazione 20%;
18 = autorità locali extra-UE con ponderazione 20%;
19 = altre autorità locali;
20 = BMS con ponderazione 0%;
21 = BMS con ponderazione 20%;
22 = BRI, FMI, UE;
23 = EFSF, ESM.
Indica se lo strumento finanziario è coperto da garanzia e, in caso affermativo, la natura del garante. La ponderazione si intende ai sensi della parte tre, titolo II, capo 2 del CRR.
Per le OBBLIGAZIONI COPELTE DA GARANZIA DELLO STATO (ai sensi dell'art.8 del decreto legge 6.12.2011, n. 201) attribuire il valore 01.

| TCOR028 | TABELLA TITOLI (ULTERIORI INFORMAZIONI DI COMPLEMENTO ALLA TCOR014) | | |
|---|---|------|--|
| data pubblicazione 2024-02-21 | | | |
| NOME CAMPO | LUNGHEZZA | TIPO | NOTE |
| RISPETTO DELLA CONDIZIONE DI CUI ALL'ART. 12, PAR. 1, LETTERA c), punto iii), DEL RD 2015/61 | 1 | N | "0"=no, "1"=si |
| SCARTO DI GARANZIA (cfr. ART. 418 DEL CRR) | 5 | N | (da fornire in percentuale con 3 interi, 2 decimali) |
| AZIONI O QUOTE DI OIC: SCARTO PRUDENZIALE 0% (cfr. ART 418, par. 2 e 3 del CRR) | 5 | N | (da fornire in percentuale con 3 interi, 2 decimali) |
| AZIONI O QUOTE DI OIC: SCARTO PRUDENZIALE 5% (cfr. ART 418, par. 2 e 3 del CRR) | 5 | N | (da fornire in percentuale con 3 interi, 2 decimali) |
| AZIONI O QUOTE DI OIC: SCARTO PRUDENZIALE 20% (cfr. ART 418, par. 2 e 3 del CRR) | 5 | N | (da fornire in percentuale con 3 interi, 2 decimali) |
| AZIONI O QUOTE DI OIC: SCARTO PRUDENZIALE 0% (cfr. art. 15, par. 2, lett.a) del RD 2015/61) | 5 | N | (da fornire in percentuale con 3 interi, 2 decimali) |

| TCOR028 | TABELLA TITOLI (ULTERIORI INFORMAZIONI DI COMPLEMENTO ALLA TCOR014) | | |
|---|---|------|---|
| data pubblicazione 2024-02-21 | | | |
| NOME CAMPO | LUNGHEZZA | TIPO | NOTE |
| AZIONI O QUOTE DI OIC: SCARTO PRUDENZIALE 5% (cfr. art. 15, par. 2, lett.b) del RD 2015/61) | 5 | N | (da fornire in percentuale con 3 interi, 2 decimali solo se non si è optato per il metodo della scomposizione integrale) |
| AZIONI O QUOTE DI OIC: SCARTO PRUDENZIALE 12% (cfr. art. 15, par. 2, lett.c) del RD 2015/61) | 5 | N | (da fornire in percentuale con 3 interi, 2 decimali solo se non si è optato per il metodo della scomposizione integrale) |
| AZIONI O QUOTE DI OIC: SCARTO PRUDENZIALE 20% (cfr. art. 15, par. 2, lett.d) del RD 2015/61) | 5 | N | (da fornire in percentuale con 3 interi, 2 decimali solo se non si è optato per il metodo della scomposizione integrale) |
| AZIONI O QUOTE DI OIC: SCARTO PRUDENZIALE 30% (cfr. art. 15, par. 2, lett.e) del RD 2015/61) | 5 | N | (da fornire in percentuale con 3 interi, 2 decimali solo se non si è optato per il metodo della scomposizione integrale) |
| AZIONI O QUOTE DI OIC: SCARTO PRUDENZIALE 35% (cfr. art. 15, par. 2, lett.f) del RD 2015/61) | 5 | N | (da fornire in percentuale con 3 interi, 2 decimali solo se non si è optato per il metodo della scomposizione integrale) |
| AZIONI O QUOTE DI OIC: SCARTO PRUDENZIALE 40% (cfr. art. 15, par. 2, lett.g) del RD 2015/61) | 5 | N | (da fornire in percentuale con 3 interi, 2 decimali solo se non si è optato per il metodo della scomposizione integrale) |

| TCOR028 | TABELLA TITOLI (ULTERIORI INFORMAZIONI DI COMPLEMENTO ALLA TCOR014) | | |
|---|---|------|---|
| data pubblicazione 2024-02-21 | | | |
| NOME CAMPO | LUNGHEZZA | TIPO | NOTE |
| AZIONI O QUOTE DI OIC: SCARTO PRUDENZIALE 55% (cfr. art. 15, par. 2, lett.h) del RD 2015/61) | 5 | N | (da fornire in percentuale con 3 interi, 2 decimali solo se non si è optato per il metodo della scomposizione integrale) |
| AZIONI O QUOTE DI OIC DA SEGNALARE NELLE ATTIVITA' LIQUIDE AGGIUNTIVE (AVENTI AD OGGETTO ATTIVITA' RIPORTATE NELLE VOCI 59354.12/14/16/18/20) | 1 | N | "0"=no, "1"=si |
| RATING ESTERNO ORIGINARIO (Solo posizioni verso la cartolarizzazione) | 5 | A | rating univoco dell'emissione alla data di origine dell'operazione di cartolarizzazione (o il primo disponibile) per il dominio cfr. TCOR35 |
| AMMISSIBILITA' COME ATTIVITA' LIQUIDE DELLE AZIONI O QUOTE DI OIC (ART. 15, PARAGRAFO 1, DEL RD 2015/61) | 1 | N | "0"=no, "1"=si |
| QUOTE DI OIC IMMOBILIARI (VOCE 5837816 CIRCOLARE 217) | 1 | N | "0"=no, "1"=si |

| TCOR028 | TABELLA TITOLI (ULTERIORI INFORMAZIONI DI COMPLEMENTO ALLA TCOR014) | | |
|--|---|------|---|
| data pubblicazione 2024-02-21 | | | |
| NOME CAMPO | LUNGHEZZA | TIPO | NOTE |
| SE AMMISSIBILE A FINI MREL PER L'EMITTENTE (articolo 72 ter, par 2 CRR2) | 1 | N | "0"=no, "1"=si |
| PORTAFOGLIO PRUDENZIALE ORGANISMI DEL SETTORE PUBBLICO ART. 116(4) CRR | 1 | N | "0"=no, "1"=si |
| OBBLIGAZIONI 'SENIOR NON PRIVILEGIATE' (art. 108 BRRD; art 12 bis TUB) | 1 | N | "0"=no "1"=si |
| DATA SCADENZA ESTESA | 8 | N | Data da fornire nella forma "AAAAMMGG". Da alimentare per i programmi di emissione di obbligazioni bancarie garantite che prevedono l'estensione automatica della scadenza delle obbligazioni. |
| DATA DI SCADENZA ESPOSIZIONE PER ESG | 8 | N | Data da fornire nella forma "AAAAMMGG". Da alimentare solo sulle azioni per la segnalazione ESG |