

TCOR028	TABELLA TITOLI (ULTERIORI INFORMAZIONI DI COMPLEMENTO ALLA TCOR014)		
data pubblicazione 2024-06-10			
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 2024-06-10			
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'OBBLIGATO 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 2024-06-10				
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 2024-06-10				
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 2024-06-10			
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 2024-06-10				
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 2024-06-10				
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 2024-06-10			
NOME CAMPO	LUNGHEZZA	TIPO	NOTE

TIPOLOGIA TITOLO PER SHSG	1	N	<p>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".</p> <p>(informazione determinata dalla procedura attraverso il ragionamento R22)</p>
---------------------------	---	---	--

CLASSE DI ESPOSIZIONE IRB	5	N	<p>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</p>
---------------------------	---	---	---

TCOR028		TABELLA TITOLI (ULTERIORI INFORMAZIONI DI COMPLEMENTO ALLA TCOR014)		
data pubblicazione 2024-06-10				
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 2024-06-10			
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 EMESSE 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 2024-06-10			
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 2024-06-10			
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 COPEPTE 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 2024-06-10			
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 2024-06-10			
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 2024-06-10				
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 2024-06-10			
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