

	Fattispecie A: contratto derivato scaduto ed estinto	Fattispecie B: contratto derivato scaduto non estinto	Fattispecie C: contratto derivato in essere con differenziali scaduti	
			Parte non scaduta	Parte scaduta
Bilancio - Stato patrimoniale	Crediti	Derivati (negoziiazione)	Derivati (negoziiazione o copertura)	Derivati (negoziiazione o copertura)
Bilancio - Nota Integrativa parte B (e voci connesse di base W e M)	Altri finanziamenti	Derivati di negoziazione	Derivati	Derivati
Bilancio - Nota Integrativa parte E - Rischio di credito (e voci connesse di base W e M)	Attività per cassa	Fuori bilancio / Derivati	Fuori bilancio / Derivati	Fuori bilancio / Derivati
Bilancio - Nota Integrativa parte E - Rischi di mercato (tasso e cambio) e di liquidità (e voci connesse di base M)	Attività per cassa	Attività per cassa	Derivati	Attività per cassa
Bilancio - Nota Integrativa parte E - Strumenti derivati (e voci connesse di base M)	No	No	Sì	No
Segnalazione consolidata - voce 36277 (Contratti derivati finanziari scaduti)	No	Sì	No	Sì
Matrice dei conti - Sez. I	Altri finanziamenti	Derivati	Derivati	Derivati
Matrice dei conti - Sez. II - Traslazione del rischio (e Sez.III.9 della segnalaz. consolidata)	Sì (finanziamenti)	Sì (derivati)	Sì (derivati)	Sì (derivati)
Matrice dei conti - Sez. II - Vita residua	Attività per cassa	Attività per cassa	Derivati	Attività per cassa
Matrice dei conti - Sez. II - Derivati	No	No	Sì	No
Matrice dei conti - Sez. II - Servizi di investimento	No	Sì	Sì	Sì
Segnalazione prudenziale - rischio di credito/controparte	Rischio di credito - attività per cassa	Rischio di controparte - derivati N.B. Il tipo importo 89 (equivalente creditizio) viene valorizzato sulla base del valore esigibile dalla controparte.	Rischio di controparte - derivati N.B. Il tipo importo 89 (equivalente creditizio) viene valorizzato sulla base del costo di sostituzione e dell'esposizione creditizia futura.	Rischio di controparte - derivati N.B. Il tipo importo 89 (equivalente creditizio) viene valorizzato sulla base del valore esigibile dalla controparte.
Segnalazione prudenziale - rischio di posizione	No	No	Sì	No
Segnalazione prudenziale - rischio di regolamento	No	Sì, se portafoglio di negoziazione di vigilanza e operazione con scambio di capitale (in tal caso l'esposizione non è trattata nel rischio di controparte)	No	Sì, se portafoglio di negoziazione di vigilanza e operazione con scambio di capitale (in tal caso la parte scaduta non è trattata nel rischio di controparte)
Segnalazione prudenziale - rischio di concentrazione	No	Sì	Sì	Sì
Segnalazione prudenziale - rischio di cambio	Sì	Sì	Sì	Sì
Segnalazione prudenziale - grandi rischi	Sì (attività per cassa)	Sì (derivati)	Sì (derivati)	Sì (derivati)
Centrale dei Rischi	Crediti per cassa	Crediti per cassa	Derivati	Derivati