

## OBBLIGHI DI PUBBLICAZIONE IN MATERIA DI FONDI PROPRI E LIQUIDITÀ SECONDO LA CIRCOLARE FINMA 2016/01

Il Gruppo partecipa al regime per le banche particolarmente liquide e ben capitalizzate delle categorie 4 e 5. Esoneri e facilitazioni concesse alla Banca e al Gruppo: esenzione dall'obbligo di osservare le disposizioni relative ai fondi propri necessari (Risk-weighted Assets), esonero dall'invio della statistica NSFR (Net Stable Funding Ratio), pianificazione semplificata del capitale, pubblicazione in materia di fondi propri e liquidità circoscritta ai Key Metrics.

Importi in CHF 1'000

<b>Key metrics - Casa Madre</b>		<b>30.09.2022</b>				<b>30.09.2021</b>
<b>Fondi propri regolamentari</b>						
<b>Fondi propri computabili</b>						
1	Fondi propri di base di qualità primaria (CET1)	119'297				114'423
2	Fondi propri di base (T1)	119'297				114'423
<b>3</b>	<b>Fondi propri totali</b>	<b>138'325</b>				<b>138'344</b>
<b>4a</b>	<b>Fondi propri minimi (8%)</b>	<b>66'037</b>				<b>66'206</b>
13a	Attivi (somma di bilancio - goodwill - partecipazioni + operazioni fuori bilancio)	825'466				827'569
<b>14b</b>	<b>Leverage ratio semplificato (fondi propri di base in % degli attivi)</b>	<b>14.5%</b>				<b>13.8%</b>
		<b>01.07.22-30.09.22</b>	<b>01.04.22-30.06.22</b>	<b>01.01.22-31.03.22</b>	<b>01.10.21-31.12.21</b>	<b>01.07.21-30.09.21</b>
<b>Liquidity Coverage Ratio (1)</b>						
15	Numeratore del LCR: totale delle attività liquide di elevata qualità	519'139	542'523	509'113	485'060	460'249
16	Denominatore del LCR: totale del deflusso netto di fondi	177'619	189'904	143'363	143'126	134'963
<b>17</b>	<b>Quota di liquidità a breve termine, LCR (in %), minimo richiesto 110% (2)</b>	<b>292.3%</b>	<b>285.7%</b>	<b>355.1%</b>	<b>338.9%</b>	<b>341.0%</b>
<b>Key metrics - Gruppo</b>		<b>30.09.2022</b>				<b>30.09.2021</b>
<b>Fondi propri regolamentari</b>						
<b>Fondi propri computabili</b>						
1	Fondi propri di base di qualità primaria (CET1)	170'196				173'828
2	Fondi propri di base (T1)	170'196				173'828
<b>3</b>	<b>Fondi propri totali</b>	<b>170'196</b>				<b>173'828</b>
<b>4a</b>	<b>Fondi propri minimi (8%)</b>	<b>69'100</b>				<b>70'305</b>
13a	Attivi (somma di bilancio - goodwill - partecipazioni + operazioni fuori bilancio)	863'756				878'813
<b>14b</b>	<b>Leverage ratio semplificato (fondi propri di base in % degli attivi)</b>	<b>19.7%</b>				<b>19.8%</b>
		<b>01.07.22-30.09.22</b>	<b>01.04.22-30.06.22</b>	<b>01.01.22-31.03.22</b>	<b>01.10.21-31.12.21</b>	<b>01.07.21-30.09.21</b>
<b>Liquidity Coverage Ratio (1)</b>						
15	Numeratore del LCR: totale delle attività liquide di elevata qualità	524'800	548'507	515'267	491'245	466'551
16	Denominatore del LCR: totale del deflusso netto di fondi	167'421	179'283	134'326	134'200	122'698
<b>17</b>	<b>Quota di liquidità a breve termine, LCR (in %), minimo richiesto 110% (2)</b>	<b>313.5%</b>	<b>305.9%</b>	<b>383.6%</b>	<b>366.1%</b>	<b>380.2%</b>

(1) Gli importi indicati rappresentano una media dei dati mensili del trimestre.

(2) Minimo richiesto: media degli ultimi 12 mesi.