

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

Key metrics - Casa Madre		30.09.2021				30.09.2020
Fondi propri regolamentari						
Fondi propri computabili						
1	Fondi propri di base di qualità primaria (CET1)	114'423				137'821
2	Fondi propri di base (T1)	114'423				137'821
3	Fondi propri totali	138'344				166'633
4a	Fondi propri minimi (8%)	66'206				64'336
13a	Attivi (somma di bilancio - goodwill - partecipazioni + operazioni fuori bilancio)	827'569				804'201
14b	Leverage ratio semplificato (fondi propri di base in % degli attivi)	13.8%				17.1%
		01.07.21-30.09.21	01.04.21-30.06.21	01.01.21-31.03.21	01.10.20-31.12.20	01.07.20-30.09.20
Liquidity Coverage Ratio (1)						
15	Numeratore del LCR: totale delle attività liquide di elevata qualità	460'249	473'349	506'056	556'568	531'730
16	Denominatore del LCR: totale del deflusso netto di fondi	134'963	139'067	158'190	164'403	159'650
17	Quota di liquidità a breve termine, LCR (in %), minimo richiesto 110% (2)	341.0%	340.4%	319.9%	338.5%	333.1%
Key metrics - Gruppo		30.09.2021				30.09.2020
Fondi propri regolamentari						
Fondi propri computabili						
1	Fondi propri di base di qualità primaria (CET1)	173'828				189'891
2	Fondi propri di base (T1)	173'828				189'891
3	Fondi propri totali	173'828				189'891
4a	Fondi propri minimi (8%)	70'305				67'210
13a	Attivi (somma di bilancio - goodwill - partecipazioni + operazioni fuori bilancio)	878'813				840'127
14b	Leverage ratio semplificato (fondi propri di base in % degli attivi)	19.8%				22.6%
		01.07.21-30.09.21	01.04.21-30.06.21	01.01.21-31.03.21	01.10.20-31.12.20	01.07.20-30.09.20
Liquidity Coverage Ratio (1)						
15	Numeratore del LCR: totale delle attività liquide di elevata qualità	466'551	479'716	512'360	562'571	534'925
16	Denominatore del LCR: totale del deflusso netto di fondi	122'698	125'827	145'887	153'058	148'238
17	Quota di liquidità a breve termine, LCR (in %), minimo richiesto 110% (2)	380.2%	381.3%	351.2%	367.6%	360.9%

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

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