

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

Il Gruppo partecipa al progetto pilota della FINMA concernente il regime per le banche particolarmente liquide e ben capitalizzate delle categorie 4 e 5. Allo stato attuale il Gruppo è esonerato dall'invio della statistica NSFR (Net Stable Funding Ratio) e la pubblicazione in materia di fondi propri e liquidità è circoscritta ai Key Metrics.

Importi in CHF 1'000

Key metrics - Casa Madre		30.09.2019				30.09.2018
Fondi propri regolamentari						
Fondi propri computabili						
1	Fondi propri di base di qualità primaria (CET1)	156'336				143'530
2	Fondi propri di base (T1)	156'336				143'530
3	Fondi propri totali	189'493				173'045
4a	Fondi propri minimi (8%)	63'494				59'538
13a	Attivi (somma di bilancio - goodwill - partecipazioni + operazioni fuori bilancio)	793'679				744'224
14b	Leverage ratio semplificato (fondi propri di base in % degli attivi)	19.7%				19.3%
		01.07.19-30.09.19	01.04.19-30.06.19	01.01.19-31.03.19	01.10.18-31.12.18	01.07.18-30.09.18
Liquidity Coverage Ratio (1)						
15	Numeratore del LCR: totale delle attività liquide di elevata qualità	528'670	546'804	570'138	548'305	458'097
16	Denominatore del LCR: totale del deflusso netto di fondi	162'131	172'618	187'642	172'288	149'531
17	Quota di liquidità a breve termine, LCR (in %), minimo richiesto 110% (2)	326.1%	316.8%	303.8%	318.2%	306.4%
Key metrics - Gruppo		30.09.2019				30.09.2018
Fondi propri regolamentari						
Fondi propri computabili						
1	Fondi propri di base di qualità primaria (CET1)	211'873				208'847
2	Fondi propri di base (T1)	211'873				208'847
3	Fondi propri totali	211'873				208'847
4a	Fondi propri minimi (8%)	66'303				62'773
13a	Attivi (somma di bilancio - goodwill - partecipazioni + operazioni fuori bilancio)	828'791				784'665
14b	Leverage ratio semplificato (fondi propri di base in % degli attivi)	25.6%				26.6%
		01.07.19-30.09.19	01.04.19-30.06.19	01.01.19-31.03.19	01.10.18-31.12.18	01.07.18-30.09.18
Liquidity Coverage Ratio (1)						
15	Numeratore del LCR: totale delle attività liquide di elevata qualità	536'360	554'874	576'688	553'396	463'214
16	Denominatore del LCR: totale del deflusso netto di fondi	152'626	163'379	176'981	160'726	133'095
17	Quota di liquidità a breve termine, LCR (in %), minimo richiesto 110% (2)	351.4%	339.6%	325.8%	344.3%	348.0%
(1) Gli importi indicati rappresentano una media dei dati mensili del trimestre.						
(2) Media degli ultimi 12 mesi.						
Lugano, 31 gennaio 2020						