

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		30.09.2020				30.09.2019
Fondi propri regolamentari						
Fondi propri computabili						
1	Fondi propri di base di qualità primaria (CET1)	137'821				156'336
2	Fondi propri di base (T1)	137'821				156'336
3	Fondi propri totali	166'633				189'493
4a	Fondi propri minimi (8%)	64'336				63'494
13a	Attivi (somma di bilancio - goodwill - partecipazioni + operazioni fuori bilancio)	804'201				793'679
14b	Leverage ratio semplificato (fondi propri di base in % degli attivi)	17.1%				19.7%
		01.07.20-30.09.20	01.04.20-30.06.20	01.01.20-31.03.20	01.10.19-31.12.19	01.07.19-30.09.19
Liquidity Coverage Ratio (1)						
15	Numeratore del LCR: totale delle attività liquide di elevata qualità	531'730	452'425	479'976	492'369	528'670
16	Denominatore del LCR: totale del deflusso netto di fondi	159'650	137'306	149'454	144'091	162'131
17	Quota di liquidità a breve termine, LCR (in %), minimo richiesto 110% (2)	333.1%	329.5%	321.2%	341.7%	326.1%
Key metrics - Gruppo		30.09.2020				30.09.2019
Fondi propri regolamentari						
Fondi propri computabili						
1	Fondi propri di base di qualità primaria (CET1)	189'891				211'873
2	Fondi propri di base (T1)	189'891				211'873
3	Fondi propri totali	189'891				211'873
4a	Fondi propri minimi (8%)	67'210				66'303
13a	Attivi (somma di bilancio - goodwill - partecipazioni + operazioni fuori bilancio)	840'127				828'791
14b	Leverage ratio semplificato (fondi propri di base in % degli attivi)	22.6%				25.6%
		01.07.20-30.09.20	01.04.20-30.06.20	01.01.20-31.03.20	01.10.19-31.12.19	01.07.19-30.09.19
Liquidity Coverage Ratio (1)						
15	Numeratore del LCR: totale delle attività liquide di elevata qualità	534'925	458'238	486'160	497'937	536'360
16	Denominatore del LCR: totale del deflusso netto di fondi	148'238	126'569	139'634	132'863	152'626
17	Quota di liquidità a breve termine, LCR (in %), minimo richiesto 110% (2)	360.9%	362.0%	348.2%	374.8%	351.4%

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

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