

ALLEGATO

Tavola 1

Categorie di scarto di garanzia per attività negoziabili idonee sulla base del tipo di emittente e/o del tipo di attività

Categoria I	Categoria II	Categoria III	Categoria IV	Categoria V
strumenti di debito emessi dalle amministrazioni centrali certificati di debito della BCE certificati di debito emessi da BCN prima della data di adozione dell'euro nel rispettivo Stato membro	strumenti di debito emessi dalle amministrazioni locali e regionali strumenti di debito emessi da soggetti classificati come agenzie da parte dell'Eurosistema strumenti di debito emessi da banche multilaterali di sviluppo e da organizzazioni internazionali obbligazioni garantite di tipo jumbo	obbligazioni garantite tradizionali e altre obbligazioni garantite strumenti di debito emessi da società non finanziarie	strumenti di debito non garantiti emessi da enti creditizi strumenti di debito non garantiti emessi da società finanziarie diverse da enti creditizi	titoli garantiti da attività

Tavola 2

Livelli degli scarti di garanzia applicati alle attività negoziabili idonee

		Categorie di scarti di garanzia									
Qualità del credito	Vita residua (in anni) (*)	Categoria I		Categoria II		Categoria III		Categoria IV		Categor- gia V	
		cedola fissa	zero coupon	cedola fissa	zero coupon	cedola fissa	zero coupon	cedola fissa	zero coupon		
Livelli 1 e 2	[0, -1)	0,5	0,5	1,0	1,0	1,0	1,0	6,5	6,5	10,0	
	[1, -3)	1,0	2,0	1,5	2,5	2,0	3,0	8,5	9,0		
	[3, -5)	1,5	2,5	2,5	3,5	3,0	4,5	11,0	11,5		
	[5, -7)	2,0	3,0	3,5	4,5	4,5	6,0	12,5	13,5		
	[7, -10)	3,0	4,0	4,5	6,5	6,0	8,0	14,0	15,5		
	[10, ∞)	5,0	7,0	8,0	10,5	9,0	13,0	17,0	22,5		
		Categorie di scarti di garanzia									
Qualità del credito	Vita residua (in anni) (*)	Categoria I		Categoria II		Categoria III		Categoria IV		Categor- ria V	
		cedola fissa	zero coupon	cedola fissa	zero coupon	cedola fissa	zero coupon	cedola fissa	zero coupon		
Livello 3	[0, -1)	6,0	6,0	7,0	7,0	8,0	8,0	13,0	13,0	non ido- neo	
	[1, -3)	7,0	8,0	10,0	14,5	15,0	16,5	24,5	26,5		
	[3, -5)	9,0	10,0	15,5	20,5	22,5	25,0	32,5	36,5		
	[5, -7)	10,0	11,5	16,0	22,0	26,0	30,0	36,0	40,0		
	[7, -10)	11,5	13,0	18,5	27,5	27,0	32,5	37,0	42,5		
	[10, ∞)	13,0	16,0	22,5	33,0	27,5	35,0	37,5	44,0		

(*) vale a dire, [0-1) vita residua inferiore ad un anno, [1-3) vita residua pari o superiore ad un anno ed inferiore a tre anni ecc.

