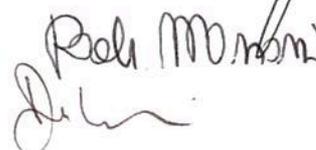


ALLEGATO A: PERIMETRO MORO FUNZIONI REGISTRATE

- **Group Treasury** - rappresenta la tesoreria di Gruppo e opera al fine di garantire la stabilità finanziaria e la solvibilità del Gruppo assicurando al contempo, la necessaria efficienza operativa e la massimizzazione dei risultati della gestione dei rischi di mercato.
 - **Intra – Group Cash Pooling**: agisce come unica controparte nel processo di gestione dei flussi finanziari infragruppo rivenienti dai fabbisogni / surplus di liquidità netti dei vari RLC e, per il RLC Italy, delle varie Entità; applica alle varie transazioni infragruppo i relativi tassi di riferimento
 - **Liquid. Risk & Settl. Risk Management** – responsabile, per il perimetro di propria competenza, di:
 - gestire i rischi di liquidità, regolamento, tasso di interesse e cambio derivanti dagli sbilanci a livello di gruppo; tale attività comporta;
 1. la partecipazione esclusiva ai mercati della liquidità a breve termine (operazioni collateralizzate e no),
 2. il coordinamento centralizzato delle operazioni di rifinanziamento con la Banca Centrale Europea,
 3. per le Entità comprese nel perimetro del Regional Center Italy, la gestione accentrata delle riserve obbligatorie, dei collateralizzati e l'accesso ai sistemi di regolamento interbancari.
 - coordinare le attività della Filiale di Londra, delle funzioni di tesoreria e di finanza delle altre Filiali Estere e di Unicredit Bank (Ireland) Plc, nonché, sulla base delle linee guida e dei processi di Gruppo in essere, delle altre Società Controllate.
 - definire la contribuzione dei tassi di riferimento del mercato monetario governati da Euribor – EBF
 - **Short Term Funding & IR Mgmt** - responsabile, per il perimetro di propria competenza, di:
 - gestire i rischi di liquidità, regolamento, tasso di interesse e cambio derivanti dagli sbilanci a livello di gruppo; tale attività comporta;
 1. la partecipazione esclusiva ai mercati della liquidità a breve termine (operazioni collateralizzate e no),
 2. il coordinamento centralizzato delle operazioni di rifinanziamento con la Banca Centrale Europea,
 3. per le Entità comprese nel perimetro del Regional Center Italy, la gestione accentrata delle riserve obbligatorie, dei collateralizzati e l'accesso ai sistemi di regolamento interbancari.
 - coordinare le attività della Filiale di Londra, delle funzioni di tesoreria e di finanza delle altre Filiali Estere e di Unicredit Bank (Ireland) Plc, nonché, sulla base delle linee guida e dei processi di Gruppo in essere, delle altre Società Controllate.
 - definire la contribuzione dei tassi di riferimento del mercato monetario governati da Euribor – EBF
 - **M / L Term Int. Rate Mgmt** - responsabile, per il perimetro di propria competenza, di:
 - gestire i rischi di liquidità, regolamento, tasso di interesse e cambio derivanti dagli sbilanci a livello di gruppo; tale attività comporta;
 1. la partecipazione esclusiva ai mercati della liquidità a breve termine (operazioni collateralizzate e no),
 2. il coordinamento centralizzato delle operazioni di rifinanziamento con la Banca Centrale Europea,
 3. per le Entità comprese nel perimetro del Regional Center Italy, la gestione accentrata delle riserve obbligatorie, dei collateralizzati e l'accesso ai sistemi di regolamento interbancari.
 - gestire le fonti finanziamento a medio lungo termine per tutte le Banche del Gruppo in coordinamento con la unit "Group Strategic Funding and Portfolio"

- **Group Finance** per quanto riguarda le attività svolte dai team sotto elencati:



- **Term Funding** presta il servizio di offerta e distribuzione e svolge principalmente le seguenti attività:
 - coordina l'accesso ai mercati dei capitali nazionali ed internazionali per scadenze superiori ad un anno per tutte le Banche del Gruppo.
 - esecuzione di operazioni di raccolta sui mercati domestici e internazionali, tramite l'emissione di titoli a medio/lungo termine, senior e subordinati;
 - gestione, in coordinamento con Group ALM and Financial Planning unit, della realizzazione del piano di *funding* del Gruppo;
 - può inoltre svolgere il ruolo di Responsabile del collocamento nell'ambito dell'emissione e distribuzione dei propri titoli di debito sia sulla rete del Gruppo UniCredit¹ sia sulla rete distributiva di reti terze
 - riacquisto di titoli di debito (incluse passività subordinate, strumenti ibridi e strumenti innovativi emessi dal Gruppo, finalizzata ad un efficiente *liability management*. Tale attività viene svolta in maniera selettiva e solo con Controparti Qualificate

- **Strategic Portfolio** presta il servizio di negoziazione per conto proprio e svolge principalmente le seguenti attività:
 - riacquisto di titoli di debito emessi dalle Special Purpose Vehicle (Asset Backed Securities) al fine di un'efficiente attività di *liability management*. Tale attività viene svolta in maniera selettiva e solo con Controparti Qualificate;
 - acquisto e gestione di strumenti finanziari (per es. bonds, covered bonds, subordinati) di terze parti con finalità di generazione di redditività e di ottimizzazione della counterbalancing capacity;
 - strutturazione di strumenti ibridi e passività subordinate.

- **Balance Sheet Management** svolge principalmente le seguenti attività:
 - analisi e proposta agli organi competenti delle operazioni di balance sheet management (e.g. operazioni finanziarie finalizzate (i) alla gestione strategica² dei rischi di mercato - di tasso d'interesse, di cambio, di prezzo di mercato, etc. - relativi al banking book e alle partecipazioni ii) alla gestione di altri rischi di bilancio - quali i rischi paese o derivanti da obbligazioni di natura previdenziale o, in via straordinaria, connessi a esposizioni creditizie iii) al miglioramento del risultato economico e/o alla generazione di capitale, inclusa l'emissione di strumenti di capitale di tipo equity) in linea con il risk appetite definito dagli Organi competenti, curandone la relativa implementazione e gestendo i portafogli di strumenti finanziari di pertinenza, anche effettuando direttamente l'execution delle relative operazioni su esplicita autorizzazione degli Organi/ Funzioni Competenti e secondo lo schema dei poteri delegati in essere.

- **Rates Italy** (10 risorse) – responsabile delle attività di trading / market making dei prodotti finanziari (cash e derivati) per le asset class dei tassi di interesse.
 - **Position Management** – responsabile dell'esecuzione delle operazioni di tassi di interesse e commodities per la clientela Commercial banking, gestita dagli specialist CTS Italy di competenza
 - **Bonds** – responsabile di operare su titoli di stato o titoli garantiti dallo stato, nel mercato primario e secondario. Gestisce tutti i rischi associati alle proprie attività usando strumenti derivati e tutti gli altri prodotti associati al proprio business mandate.

- **CTS Italy** - sviluppa il business relativamente ai prodotti di tesoreria e di copertura del rischio (Cambi, derivati) e ai prodotti di investimento, ivi compresi i prodotti per la gestione della liquidità aziendale.

¹ Le strutture a riporto del Country Chairman Italy coordinano l'attività distributiva nei confronti della clientela al dettaglio

² Operatività non riveniente dall'attività commerciale

De Pauli Massimo
Dulcin

- **CTS Commercial Banking** : unit dedicate alla clientele commercial banking, assicura il coordinamento operative dell'attività svolta dagli specialist CTS in collaborazione con Network Italy.
- **Corporate Solutions Group** : ha la principale finalità di assicurare lo svolgimento diretto di operazioni di tesoreria e in derivati per l'Investment Banking.

16 Aprile 2014

1/5

[Handwritten signature]

[Handwritten signature]

[Handwritten signature]
Markus

[Handwritten signature]

Paolo Manoni

[Handwritten signature]

[Handwritten signature]

Oggetto: Report del riascolto

Il report del riascolto delle telefonate /accesso alle comunicazioni elettroniche deve contenere, limitatamente alle verifiche poste in essere su iniziativa della banca, oltre alle informazioni di carattere generale (quali ad esempio: data e ora di accesso, motivo dell'accesso, numero di persone presenti all'accesso, tempo dell'accesso ed esito dell'accesso):

- L'ammontare complessivo del campione analizzato;
- I parametri utilizzati (es. tempo, tipo di operazione, parole chiavi ricercate, ecc.) con l'indicazione degli stessi in modo analitico;
- Se i parametri vengono utilizzati in "and" o "or";
- L'ammontare del campione ottenuto;
- Il numero dei casi selezionati;
- La percentuale di questi sul campione ottenuto.

Per quanto riguarda gli incontri, sono cadenziati nel numero di due all'anno il primo entro il 30 settembre e il secondo entro il 31 marzo successivi al semestre di riferimento.

Milano, 16 Aprile 2014

The bottom of the page contains several handwritten signatures and initials. From left to right: a signature with '10/5' written above it; a signature with 'Mendern' written below it; a signature with a circled '3' below it; a signature with 'Doh! Mo mom' written above it; and a signature with 'D. D. D. D.' written below it. There are also some blue ink marks and initials scattered around the signatures.

REPORT DI ACCESSO – DATI PER OOSS (Condivisi con Compliance ed Organizzazione)

1. data e ora di accesso: informazioni già previste sia nella "richiesta di accesso"/"comunicazione al dipendente", sia nel "verbale"
2. motivo dell'accesso: informazioni già previste nella "richiesta di accesso"/"comunicazione al dipendente", sia nel "verbale"
3. persone presenti all'accesso: informazioni già previste nel "verbale"
4. durata dell'accesso: sostituire con "inizio e fine della sessione di accesso".
Tale informazione è da inserire nel "verbale" (*).

I dati relativi al tempo impiegato per accedere alle singole registrazioni potrebbero essere forniti, in caso di successiva richiesta da parte delle RSA. Chiedo ad Orga, qui in copia, di avere conferma da parte di Bloomberg e UBIS che è possibile fornire tali dati relativi al tempo effettivamente impiegato per ciascun singolo accesso.

5. esito dell'accesso: "numero e tipologia degli elementi/operazioni estratte".
Tale informazione è da inserire nel verbale (*)

L'insieme delle informazioni sopracitate è inserita negli appositi campi previsti sulla modulistica di richiesta di accesso, comunicazione al dipendente, verbale di accesso.

Inoltre il report prevede:

- una chiara indicazione del motivo per cui si effettua il **controllo a campione**;
- l'espressa menzione dei parametri utilizzati per la campionatura (es. arco temporale di riferimento, numero delle operazioni, tipologia delle operazioni...)

In base alle richieste delle RSA occorre anche fornire i dati relativi alla percentuale delle operazioni estratte rispetto al totale delle operazioni.
Tali dati potrebbero essere forniti alle RSA in occasione della rendicontazione semestrale (e non nel verbale di accesso).

6/5

Handwritten signatures and initials:

- Handwritten signature on the left.
- Handwritten signature in the center, with the word "Mentem" written below it.
- A circled handwritten number "2" below the center signature.
- Handwritten initials "JF" on the right.
- Handwritten initials "B" above "JF".
- Handwritten initials "D" below "JF".
- Handwritten initials "D" below "B".
- Handwritten initials "D" below "D".
- Handwritten initials "D" below "D".
- Handwritten initials "D" below "D".
- Handwritten initials "D" below "D".