

F16_7_1	GENERAZIONE TEMPLATE COREP C_34 02, C_34 03, C_34 04, C_34 06, C_34 08 E C_34 10
----------------	---

Tipo intermediario	Data pubblicazione	Data inizio validità	Data fine validità
B	2026 02 24	2026 03 31	9999 99 99

Generalità

La fase ha lo scopo di calcolare le informazioni necessarie per la generazione dei seguenti template COREP: C_34.02, C_34 03, C_34 04, C_34.06, C_34 08 e C_34 10.

La fase deve essere eseguita post ACA, post funzioni F27.XX necessarie al calcolo delle esposizioni in stato di default, post funzioni F16_XX, post Credit Risk Mitigation ordinaria del rischio di credito e prima del compattamento.

La fase si compone delle seguenti parti:

- **PARTE A: TEMPLATE C_34 03 - SA-CCR E SA-CCR SIMPLIFIED**
- **PARTE B: TEMPLATE C_34.04 - METODOLOGIA DELL'OEM**
- **PARTE C: TEMPLATE C_34 02 - CCR EXPOSURES BY APPROACH**
- **PARTE D: TEMPLATE C_34 06 - TOP TWENTY CONTERPARTY**
- **PARTE E: TEMPLATE C_34 08 - COMPOSITION OF COLLATERAL FOR CCR EXPOSURES**
- **PARTE F: TEMPLATE C_34 09 - CREDIT DERIVATIVES EXPOSURES**

PARTE A: TEMPLATE C_34 03 - SA-CCR E SA-CCR SIMPLIFIED

Processo di calcolo

Se il digit di TCOR050 'MET_CALC_EAD_RCTP' uguale a 0,1 eseguire le fasi successive.

FASE A: STEP1: MAPPED TO N RISK CATEGORIES

STEP 1a: determinazione della “risk categories” e della “categoria”

- 1) Selezionare tutti i record della tabella CTP01, creata nelle funzioni F16_1 e F16_4 e arricchita nelle F16_2, F16_5 e F16_3, e per ogni record mappare la nuova colonna “CATEGORIA” della CTP01 nel seguente modo:
 - i. rischio di tasso di interesse: se 01535.XX e 01543.XX con colonna “ASSET CLASS” pari a “INT” e 01593.01/05 con campo 05667≠0 e 05881=1 oppure con campo 05370=0 e 05667=0 e le 01593.98/99 con campo 05667=0 e 01599.01 impostare CATEGORIA= INT;
 - ii. rischio azionario: se FTO 01535.XX e 01543.XX con colonna “ASSET CLASS” pari a “AZ” e 01595.XX e 01599.03 impostare CATEGORIA= AZ;
 - iii. rischio di cambio: se FTO 01568.XX e 01597.01/05/09 e 01599.02 impostare CATEGORIA= FX;
 - iv. rischio di credito: se FTO 01594.98/99 e FTO 01064.02 impostare CATEGORIA= CR;
 - v. rischio di posizione in merci: se FTO 01597.13/17 e colonna “TYPE” diverso da 7 e 01599.04 impostare CATEGORIA= MERCI.
- 2) Selezionare tutti i record della tabella CTP01 e a parità di 00030 e 00204 verificare se esiste più di una ricorrenza:
 - se presente più di un record contarne il numero e memorizzare il risultato nel COMODO-RISK-CATEGORIES e successivamente:
 - scriverlo nella colonna “RISK-CATEGORIES” della CTP01 del record che ha 00348≠01599.XX
 - sul record che ha 00348=01599.XX impostare sempre colonna “RISK-CATEGORIES” pari al valore 0.
 - se presente solo un record impostare colonna “RISK-CATEGORIES” pari al valore 1.

3) Selezionare tutti i record della tabella CTP01 con la colonna RISK-CATEGORIES maggiore di 1 e calcolare per ogni valore della colonna RISK-CATEGORIES:

- ✓ $COMODOCMV = \sum(06697-06696)$. Il comodo deve essere segnato.
- ✓ $COMODO609 = \sum(00609)$
- ✓ contare il numero di record presi in considerazione e scriverli nel COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI;

A valle scrivere la nuova tabella **CTP19 – C_34 03 - 1° PARTE** con le seguenti informazioni in colonna:

- RISK CATEGORIES
- COMODOCMV
- COMODO609
- COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI

4) Selezionare tutti i record della tabella CTP01 con la colonna RISK-CATEGORIES pari a 1 e, successivamente, selezionare tutti i record che presentano lo stesso valore della colonna CATEGORIA e calcolare per ogni valore di tale colonna:

- ✓ $COMODOCMV = (06697-06696)$; Il comodo deve essere segnato.
- ✓ $COMODO609 = 00609$
- ✓ contare il numero di record presi in considerazione e scriverli nel COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI;

A valle scrivere la nuova tabella **CTP20 – C_34 03 - 2° PARTE** con le seguenti informazioni in colonna:

- CATEGORIA
- COMODOCMV
- COMODO609
- COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI

STEP 1b: GENERAZIONE DERIVATE 71520.20, 71520.30 E 71520.40 (colonne da 30 a 60)

Accedere a CTP19 e selezionare tutti i record e per ogni record generare le derivate del template utilizzando il seguente schema di generazione:

- schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_34.03', 08920RO¹, 08930RB, 08909RA²,
08960= 'C_34.03', 08998='M'

- schema variabile³:

FTD	Routine di condizionamento	Colonna 30	Colonna 40	Colonna 50	Colonna 60
71520.20	RISK-CATEGORIES=2	COMODO- NUMERO- TRANSAZIONI	COMODO609	Se COMODOCMV è positivo genera con COMODOCMV	Se COMODOCMV è negativo genera con COMODOCMV segnato
71520.30	RISK-CATEGORIES=3	COMODO- NUMERO- TRANSAZIONI	COMODO609	Se COMODOCMV è positivo genera con COMODOCMV	Se COMODOCMV è negativo genera con COMODOCMV segnato
71520.40	RISK-CATEGORIES>3	COMODO- NUMERO- TRANSAZIONI	COMODO609	Se COMODOCMV è positivo genera con COMODOCMV	Se COMODOCMV è negativo genera con COMODOCMV segnato

STEP 1c: GENERAZIONE DERIVATE 71520.60, 71521.30, 71522.00, 71522.40 e 71522.80 (colonne da 30 a 60)

Accedere a CTP20 e selezionare tutti i record e per ogni record generare le derivate del template utilizzando il seguente schema di generazione:

- schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_34.03', 08920RO, 08930RB, 08909RA,
08960= 'C_34.03', 08998='M'

¹ 08920RO Se attributo di TCOR050 'MET_CALC_EAD_RCTP' uguale a 0 impostare 8920=0001, altrimenti 08920=0002.

² 08909RA imposta il campo 08909 con il valore contenuto nella colonna 'REPORTING FRAMEWORK VERSION DPM 2.0' di TCOR070.

³ Lo schema variabile contiene le regole di condizionamento e i campi importati da utilizzare.

- schema variabile:

FTD	Routine di condizionamento	Colonna 30	Colonna 40	Colonna 50	Colonna 60
71520.60	RISK-CATEGORIES=1 E CATEGORIA = INT	COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI	COMODO609	Se COMODOCMV è positivo genera con COMODOCMV	Se COMODOCMV è negativo genera con COMODOCMV segnato
71521.30	RISK-CATEGORIES=1 E CATEGORIA = FX	COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI	COMODO609	Se COMODOCMV è positivo genera con COMODOCMV	Se COMODOCMV è negativo genera con COMODOCMV segnato
71522.00	RISK-CATEGORIES=1 E CATEGORIA = CR	COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI	COMODO609	Se COMODOCMV è positivo genera con COMODOCMV	Se COMODOCMV è negativo genera con COMODOCMV segnato
71522.40	RISK-CATEGORIES=1 E CATEGORIA = AZ	COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI	COMODO609	Se COMODOCMV è positivo genera con COMODOCMV	Se COMODOCMV è negativo genera con COMODOCMV segnato
71522.80	RISK-CATEGORIES=1 E CATEGORIA = MERCI	COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI	COMODO609	Se COMODOCMV è positivo genera con COMODOCMV	Se COMODOCMV è negativo genera con COMODOCMV segnato

FASE B: RISCHIO DI TASSO DI INTERESSE

STEP 1: GENERAZIONE DERIVATE DA 71520.70 A 71521.10 (colonne 10, 30, 40, 50 e 60)

STEP 1a: CALCOLO DELLE LARGEST CURRENCY

- Selezionare tutti i record della tabella CTP03 creata nelle funzioni F16_2 e F16_4 e per ogni valore del campo 00007:
 - sommare il campo CMV e riportare il valore calcolato nel COMODOCMV; il comodo deve essere segnato.
 - sommare il campo 00609 e riportare il valore calcolato nel COMODO609;
 - sommare il campo NUMERO-TRANSAZIONI e riportare il valore calcolato nel COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI;

- scrivere la nuova **CTP21 – C_34 03 - 3° PARTE** con le seguenti informazioni in colonna:
 - Forzare CATEGORIA=INT
 - 00007
 - COMODOCMV
 - COMODO609
 - COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI
- Ordinare i record della CTP21 in ordine decrescente sulla base del campo COMODOCMV da considerare in valore assoluto. Considerare i primi cinque record (partendo da quello che presenta l'ammontare più elevato) e scrivere per tale record, sulla CTP21, le seguenti ulteriori colonne pari al valore della colonna 00007 del record corrispondente:
 - Per il primo record scrivere la colonna LARGEST CURRENCY
 - Per il secondo record scrivere la colonna 2ND LARGEST CURRENCY
 - Per il terzo record scrivere la colonna 3ND LARGEST CURRENCY
 - Per il quarto record scrivere la colonna 4ND LARGEST CURRENCY
 - Per il quinto record scrivere la colonna 5ND LARGEST CURRENCY

STEP 1b: ADD-ON RISCHIO INTERESSE (colonna 70)

Accedere a CTP04 e selezionare tutti i record e per ogni record calcolare:

$$\text{ADD-ON-00007} = \text{NozEFF}(\text{IR},j) * 0,5\%$$

e scrivere il risultato nella corrispondente nuova colonna "ADD-ON-00007" sulla CTP21 a parità di campo 00007.

STEP 1c: GENERAZIONE

Per ogni record della CTP21 generare le derivate del template utilizzando il seguente schema di generazione:

- schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_34.03', 08920RO, 08930RB, 08909RA,
08960= 'C_34.03', 08998RB⁴

- schema variabile:

FTD	Routine di condizionale	Colonna 10	Colonna 30	Colonna 40	Colonna 50	Colonna 60	Colonna 70
71520.70	LARGEST CURRENCY≠0	00007	COMODO - NUMERO-TRANSAZIONI	COMODO609	Se COMODOCMV è positivo genera con COMODOCMV	Se COMODOCMV è negativo genera con COMODOCMV segnato	ADD-ON-00007
71520.80	2ND LARGEST CURRENCY≠0	00007	COMODO - NUMERO-TRANSAZIONI	COMODO609	Se COMODOCMV è positivo genera con COMODOCMV	Se COMODOCMV è negativo genera con COMODOCMV segnato	ADD-ON-00007
71520.90	3ND LARGEST CURRENCY≠0	00007	COMODO - NUMERO-TRANSAZIONI	COMODO609	Se COMODOCMV è positivo genera con COMODOCMV	Se COMODOCMV è negativo genera con COMODOCMV segnato	ADD-ON-00007
71521.00	4ND LARGEST CURRENCY≠0	00007	COMODO - NUMERO-TRANSAZIONI	COMODO609	Se COMODOCMV è positivo genera con COMODOCMV	Se COMODOCMV è negativo genera con COMODOCMV segnato	ADD-ON-00007
71521.10	5ND LARGEST CURRENCY≠0	00007	COMODO - NUMERO-TRANSAZIONI	COMODO609	Se COMODOCMV è positivo genera con COMODOCMV	Se COMODOCMV è negativo genera con COMODOCMV segnato	ADD-ON-00007

STEP 2: GENERAZIONE DERIVATA 71520.50

a) Considerare tutti i record della CTP21 con CATEGORIA = INT e:

- sommare il COMODOCMV > 0 e scrivere il risultato nella colonna CMVPOSITIVO;
- sommare il COMODOCMV < 0 e scrivere il risultato in valore assoluto nella colonna CMVNEGATIVO;
- sommare il COMODO609 e riportare il valore calcolato nel nuovo COMODO609;

⁴ Se campo 08940=010 impostare 08998=E altrimenti impostare 08998=M.

- sommare il COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI e riportare il valore calcolato nel nuovo COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI;
- calcolare la nuova colonna ADD-ON = \sum ADD-ON-00007
- scrivere la nuova **CTP22 – C_34 03 - 4° PARTE** con le seguenti informazioni in colonna:
 - Forzare la colonna CATEGORIA= INT
 - CMVPOSITIVO
 - CMVNEGATIVO
 - COMODO609
 - COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI
 - ADD-ON

b) Per ogni record della CTP22 generare la derivata del template utilizzando il seguente schema di generazione:

- schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_34.03', 08920RO, 08930RB, 08909RA, 08960= 'C_34.03', 08998='M'

- schema variabile:

FTD	Routine di Condizionamento	colonna 30	colonna 40	colonna 50	colonna 60	colonna 70
71520.50	CATEGORIA=INT	COMODO - NUMERO-TRANSAZIONI	COMODO609	Se CMVPOSITIVO > 0 genera con CMVPOSITIVO	Se CMVNEGATIVO > 0 genera con CMVNEGATIVO segnato	ADD-ON

FASE C: RISCHIO DI CAMBIO

STEP1: GENERAZIONE DERIVATE DA 71521.40 A 71521.80 (colonne da 10 a 70)

STEP 1a: CALCOLO DELLE LARGEST CURRENCY PAIR

a) Selezionare tutti i record della tabella CTP11 creata nelle funzioni F16_2 e F16_5 e, per ciascun record, ordinare secondo un ordine alfabetico le

colonne 1° VALUTA e 2° VALUTA e scrivere le rispettive colonne nella CTP11:

- 1° VAL IN PAIR con la valuta che viene prima in ordine alfabetico;
- 2° VAL IN PAIR con la valuta che viene dopo in ordine alfabetico⁵.

b) considerare tutti i record della CTP11 che presentano gli stessi valori del campo 1° VAL IN PAIR e 2° VAL IN PAIR e:

- sommare il campo CMV e riportare il valore calcolato nel COMODOCMV; il comodo deve essere segnato;
- sommare il campo 00609 e riportare il valore calcolato nel COMODO609;
- sommare il campo NUMERO-TRANSAZIONI e riportare il valore calcolato nel COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI;
- sommare il campo ADD-ON-FX(j) e riportare il valore calcolato nella colonna AddON-FX
- scrivere la nuova **CTP21 – C_34 03 - 3° PARTE** con le seguenti informazioni in colonna:
 - Forzare CATEGORIA=FX
 - 1° VAL IN PAIR
 - 2° VAL IN PAIR
 - COMODOCMV
 - COMODO609
 - COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI
 - ADD-ON-FX

c) Ordinare i record della CTP21 in ordine decrescente sulla base del campo COMODOCMV preso in valore assoluto e considerare i primi cinque record (partendo da quello che presenta l'ammontare più elevato) e per ogni record selezionato rispettando l'ordinamento scrivere le seguenti ulteriori colonne:

⁵ Se ad esempio 1° VALUTA= USD e 2° VALUTA=EUR l'ordine è EUR/USD. Quindi la 1° VAL IN PAIR sarà EUR e la 2° VAL IN PAIR sarà USD.

- i. Per il primo record:
 - scrivere la colonna LARGEST CURRENCY PAIR – 1° VALUTA pari al valore della 1° VAL IN PAIR della tabella CTP21.
 - scrivere la colonna LARGEST CURRENCY PAIR – 2° VALUTA pari al valore della 2° VAL IN PAIR della tabella CTP21.
- ii. Per il secondo record:
 - scrivere la colonna 2nd LARGEST CURRENCY PAIR – 1° VALUTA pari al valore della 1° VAL IN PAIR della tabella CTP21.
 - scrivere la colonna 2nd LARGEST CURRENCY PAIR – 2° VALUTA pari al valore della 2° VAL IN PAIR della tabella CTP21.
- iii. Per il terzo record:
 - scrivere la colonna 3rd LARGEST CURRENCY PAIR – 1° VALUTA pari al valore della 1° VAL IN PAIR della tabella CTP21.
 - scrivere la colonna 3rd LARGEST CURRENCY PAIR – 2° VALUTA pari al valore della 2° VAL IN PAIR della tabella CTP21.
- iv. Per il quarto record
 - scrivere la colonna 4nd LARGEST CURRENCY PAIR – 1° VALUTA pari al valore della 1° VAL IN PAIR della tabella CTP21.
 - scrivere la colonna 4nd LARGEST CURRENCY PAIR – 2° VALUTA pari al valore della 2° VAL IN PAIR della tabella CTP21.
- v. Per il quinto record:
 - scrivere la colonna 5nd LARGEST CURRENCY PAIR – 1° VALUTA pari al valore della 1° VAL IN PAIR della tabella CTP21.
 - scrivere la colonna 5nd LARGEST CURRENCY PAIR – 2° VALUTA pari al valore della 2° VAL IN PAIR della tabella CTP21.

STEP 1b: GENERAZIONE

Per ogni record della CTP21 generare le derivate del template utilizzando le seguenti il seguente schema di generazione:

- schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_34.03', 08920RO, 08930RB, 08909RA, 08960= 'C_34.03', 08998RC⁶

- schema variabile:

FTD	Routine di condizionamento	Colonna 10	Colonna 20	Colonna 30	Colonna 40	Colonna 50	Colonna 60	Colonna 70
71521.40	LARGEST CURRENCY PAIR - 1° VALUTA ≠0	1° VAL IN PAIR	2° VAL IN PAIR	COMODO - NUMERO-TRANSAZION 	COMODO60 9	Se COMODOCMV è positivo genera con COMODOCMV	Se COMODOCMV è negativo genera con COMODOCMV segnato	ADD-ON-FX
71521.50	2nd LARGEST CURRENCY PAIR - 1° VALUTA ≠0	1° VAL IN PAIR	2° VAL IN PAIR	COMODO - NUMERO-TRANSAZION 	COMODO60 9	Se COMODOCMV è positivo genera con COMODOCMV	Se COMODOCMV è negativo genera con COMODOCMV segnato	ADD-ON-FX
71521.60	3nd LARGEST CURRENCY PAIR - 1° VALUTA ≠0	1° VAL IN PAIR	2° VAL IN PAIR	COMODO - NUMERO-TRANSAZION 	COMODO60 9	Se COMODOCMV è positivo genera con COMODOCMV	Se COMODOCMV è negativo genera con COMODOCMV segnato	ADD-ON-FX
71521.70	4nd LARGEST CURRENCY PAIR - 1° VALUTA ≠0	1° VAL IN PAIR	2° VAL IN PAIR	COMODO - NUMERO-TRANSAZION 	COMODO60 9	Se COMODOCMV è positivo genera con COMODOCMV	Se COMODOCMV è negativo genera con COMODOCMV segnato	ADD-ON-FX
71521.80	5nd LARGEST CURRENCY PAIR - 1° VALUTA ≠0	1° VAL IN PAIR	2° VAL IN PAIR	COMODO - NUMERO-TRANSAZION 	COMODO60 9	Se COMODOCMV è positivo genera con COMODOCMV	Se COMODOCMV è negativo genera con COMODOCMV segnato	ADD-ON-FX

STEP 2: GENERAZIONE DERIVATA 71521.20

a) Considerare tutti i record della CTP21 con CATEGORIA = FX e:

- sommare il COMODOCMV > 0 e scrivere il risultato nella colonna CMVPOSITIVO;

⁶ Se campo 08940=010 e 020 impostare 08998=E altrimenti impostare 08998=M

- sommare il COMODOCMV < 0 e scrivere il risultato in valore assoluto nella colonna CMVNEGATIVO;
- sommare il COMODO609 e riportare il valore calcolato nel nuovo COMODO609;
- sommare il COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI e riportare il valore calcolato nel nuovo COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI;
- calcolare la nuova colonna ADD-ON = \sum ADD-ON- FX
- scrivere la nuova **CTP22 – C_34 03 - 4° PARTE** con le seguenti informazioni in colonna:
 - Forzare la colonna CATEGORIA= FX
 - CMVPOSITIVO
 - CMVNEGATIVO
 - COMODO609
 - COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI
 - ADD-ON

b) Per ogni record della CTP22 generare la derivata del template utilizzando il seguente schema di generazione:

- schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_34.03', 08920RO, 08930RB, 08909RA, 08960= 'C_34.03', 08998='M'

- schema variabile:

FTD	Routine di condizionamento	Colonna 30	Colonna 40	Colonna 50	Colonna 60	Colonna 70
71521.20	CATEGORIA=FX	COMODO - NUMERO- TRANSAZIO NI	COMODO609	Se CMVPOSITIVO > 0 genera con CMVPOSITIVO	Se CMVNEGATIVO > 0 genera con CMVNEGATIVO segnato	ADD-ON

FASE D: RISCHIO DI CREDITO

Selezionare i record della tabella CTP06 e per ogni valore del campo “p”:

- sommare il campo CMV e riportare il valore calcolato nel COMODOCMV; il comodo deve essere segnato.
- sommare il campo 00609 e riportare il valore calcolato nel COMODO609;
- sommare il campo NUMERO-TRANSAZIONI e riportare il valore calcolato nel COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI;
- scrivere la nuova **CTP21 – C_34 03 - 3° PARTE** con le seguenti informazioni in colonna:
 - Forzare CATEGORIA=CR
 - p
 - COMODOCMV
 - COMODO609
 - COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI

STEP 1: GENERAZIONE DERIVATE 71522.10 e 71522.20 (colonne da 30 a 60)

Selezionare i record della tabella CTP21 e per ogni record generare le derivate del template utilizzando il seguente schema di generazione:

- schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_34.03', 08920RO, 08930RB, 08909RA, 08960= 'C_34.03', 08998='M'

- schema variabile:

FTD	Routine di condizionamento	Colonna 30	Colonna 40	Colonna 50	Colonna 60
71522.10	Se colonna p =0,50%	COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI	COMODO609	Se COMODOCMV è positivo genera con COMODOCMV	Se COMODOCMV è negativo genera con COMODOCMV segnato
71522.20	Se colonna p=0,80%	COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI	COMODO609	Se COMODOCMV è positivo genera con COMODOCMV	Se COMODOCMV è negativo genera con COMODOCMV segnato

STEP 2: GENERAZIONE DERIVATA 71521.90

a) Selezionare i record della tabella CTP21 con CATEGORIA = CR e:

- sommare il COMODOCMV > 0 e scrivere il risultato nella colonna CMVPOSITIVO;
- sommare il COMODOCMV < 0 e scrivere il risultato in valore assoluto nella colonna CMVNEGATIVO;
- sommare il COMODO609 e riportare il valore calcolato nel nuovo COMODO609;
- sommare il COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI e riportare il valore calcolato nel nuovo COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI;
- scrivere la nuova **CTP22 – C_34 03 - 4° PARTE** con le seguenti informazioni in colonna:
 - Forzare la colonna CATEGORIA= CR
 - CMVPOSITIVO
 - CMVNEGATIVO
 - COMODO609
 - COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI

b) Selezionare i record della tabella CTP05 con campo 05847=1 e calcolare ADD-ON pari alla somma della colonna AddON-CR della CTP05; scrivere il risultato nella nuova colonna "ADD-ON" nella **CTP22 - C_34 03 - 4° PARTE**.

c) Per ogni record della CTP22 generare la derivata del template utilizzando il seguente schema di generazione:

- schema variabile:

FTD	Routine di condizionamento	Colonna 30	Colonna 40	Colonna 50	Colonna 60	Colonna 70
71421.90	CATEGORIA=CR	COMODO - NUMERO-TRANSAZIONI	COMODO609	Se CMVPOSITIVO > 0 genera con CMVPOSITIVO	Se CMVNEGATIVO > 0 genera con CMVNEGATIVO segnato	ADD-ON

- schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_34.03', 08920RO, 08930RB, 08909RA,
08960= 'C_34.03', 08998='M'

FASE E: RISCHIO DI POSIZIONE IN MERCI

STEP1: GENERAZIONE DERIVATE DA 71522.90 A 71523.30 (colonne da 30 a 70)

a) Selezionare tutti i record della tabella CTP08 creata nelle funzioni F16_2 e F16_4 e per ogni valore del campo HEDGING-SET-COM:

- sommare il campo CMV e riportare il valore calcolato nel COMODOCMV; il comodo deve essere segnato;
- sommare il campo 00609 e riportare il valore calcolato nel COMODO609;
- sommare il campo NUMERO-TRANSAZIONI e riportare il valore calcolato nel COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI;
- sommare il campo il campo AddOn-COM-HEDSET(j) nella colonna "ADD-ON-HED"
- scrivere la nuova **CTP21 – C_34 03 - 3° PARTE** con le seguenti informazioni in colonna:
 - Forzare CATEGORIA=MERCI
 - HEDGING-SET-COM
 - COMODOCMV
 - COMODO609
 - COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI
 - ADD-ON-HED

HEDGING-SET-COM	COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI	COMODO609	COMODOCMV	ADD-ON-HED
-----------------	---------------------------	-----------	-----------	------------

b) Per ogni record della CTP21 generare le derivate del template utilizzando le seguenti il seguente schema di generazione:

- schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_34.03', 08920RO, 08930RB, 08909RA,
08960= 'C_34.03', 08998='M'

- schema variabile:

FTD	Routine di condizionamento	Colonna 30	Colonna 40	Colonna 50	Colonna 60	Colonna 70
71522.90	HEDGING-SET-COM=ENERGIA	COMODO - NUMERO- TRANSAZIONI	COMODO609	Se COMODOCMV è positivo genera con COMODOCMV	Se COMODOCMV è negativo genera con COMODOCMV segnato	ADD-ON-HED
71523.00	HEDGING-SET-COM=METALLI	COMODO - NUMERO- TRANSAZIONI	COMODO609	Se COMODOCMV è positivo genera con COMODOCMV	Se COMODOCMV è negativo genera con COMODOCMV segnato	ADD-ON-HED
71523.10	HEDGING-SET-COM=AGRICOLTURA	COMODO - NUMERO- TRANSAZIONI	COMODO609	Se COMODOCMV è positivo genera con COMODOCMV	Se COMODOCMV è negativo genera con COMODOCMV segnato	ADD-ON-HED
71523.20	HEDGING-SET-COM=CLIMA	COMODO - NUMERO- TRANSAZIONI	COMODO609	Se COMODOCMV è positivo genera con COMODOCMV	Se COMODOCMV è negativo genera con COMODOCMV segnato	ADD-ON-HED
71523.30	HEDGING-SET-COM= ALTRE MERCI	COMODO - NUMERO- TRANSAZIONI	COMODO609	Se COMODOCMV è positivo genera con COMODOCMV	Se COMODOCMV è negativo genera con COMODOCMV segnato	ADD-ON-HED

STEP2: GENERAZIONE DERIVATA 71522.70

a) Selezionare i record della tabella CTP21 con CATEGORIA = MERCI e:

- sommare il COMODOCMV > 0 e scrivere il risultato nella colonna CMVPOSITIVO;
- sommare il COMODOCMV < 0 e scrivere il risultato in valore assoluto nella colonna CMVNEGATIVO;

- sommare il COMODO609 e riportare il valore calcolato nel nuovo COMODO609;
- sommare il COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI e riportare il valore calcolato nel nuovo COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI;
- calcolare la nuova colonna ADD-ON = \sum ADD-ON-HED
- scrivere la nuova **CTP22 – C_34 03 - 4° PARTE** con le seguenti informazioni in colonna:
 - Forzare la colonna CATEGORIA= MERCI
 - CMVPOSITIVO
 - CMVNEGATIVO
 - COMODO609
 - COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI
 - ADD-ON

b) Per ogni record della CTP22 generare la derivata del template utilizzando il seguente schema di generazione:

- schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_34.03', 08920RO, 08930RB, 08909RA, 08960= 'C_34.03', 08998='M'

- schema variabile:

FTD	Routine di condizionamento	Colonna 30	Colonna 40	Colonna 50	Colonna 60	Colonna 70
71522.70	CATEGORIA=MERCI	COMODO - NUMERO-TRANSAZIONI	COMODO609	Se CMVPOSITIVO > 0 genera con CMVPOSITIVO	Se CMVNEGATIVO > 0 genera con CMVNEGATIVO segnato	ADD-ON

FASE F: RISCHIO AZIONARIO

STEP1: GENERAZIONE DERIVATE 71522.50 E 71522.60 (colonne da 30 a 60)

a) Selezionare i record della tabella CTP12 e per ogni valore del campo “ρ”:

- sommare il campo CMV e riportare il valore calcolato nel COMODOCMV; il comodo deve essere segnato;
- sommare il campo 00609 e riportare il valore calcolato nel COMODO609;
- sommare il campo NUMERO-TRANSAZIONI e riportare il valore calcolato nel COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI;
- scrivere la nuova **CTP21 – C_34 03 - 3° PARTE** con le seguenti informazioni in colonna:
 - Forzare CATEGORIA=AZ
 - ρ
 - COMODOCMV
 - COMODO609
 - COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI

b) Selezionare i record della tabella CTP21 e per ogni record generare le derivate del template utilizzando il seguente schema di generazione:

- schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_34.03', 08920RO, 08930RB, 08909RA, 08960= 'C_34.03', 08998='M'

- schema variabile:

FTD	Routine di condizionamento	Colonna 30	Colonna 40	Colonna 50	Colonna 60
71522.50	Se colonna ρ =0,50%	NUMERO TRANSAZIONI	Colonna 00609	Se CMV è positivo genera con CMV	Se CMV è negativo genera con CMV segnato
71522.60	Se colonna ρ=0,80%	NUMERO TRANSAZIONI	Colonna 00609	Se CMV è positivo genera con CMV	Se CMV è negativo genera con CMV segnato

STEP 2: GENERAZIONE DERIVATA 71522.30

- a) Selezionare i record della tabella CTP21 con CATEGORIA = AZ e:
- sommare il COMODOCMV > 0 e scrivere il risultato nella colonna CMVPOSITIVO;
 - sommare il COMODOCMV < 0 e scrivere il risultato in valore assoluto nella colonna CMVNEGATIVO;
 - sommare il COMODO609 e riportare il valore calcolato nel nuovo COMODO609;
 - sommare il COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI e riportare il valore calcolato nel nuovo COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI;
 - scrivere la nuova **CTP22 – C_34 03 - 4° PARTE** con le seguenti informazioni in colonna:
 - Forzare la colonna CATEGORIA= AZ
 - CMVPOSITIVO
 - CMVNEGATIVO
 - COMODO609
 - COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI
- b) Selezionare i record della tabella CTP05 con campo 05847=1 e calcolare ADD-ON pari alla somma della colonna AddON-AZ della CTP05; scrivere il risultato nella nuova colonna "ADD-ON" nella **CTP22 - C_34 03 - 4° PARTE**.
- c) Per ogni record della CTP22 generare la derivata del template utilizzando il seguente schema di generazione:
- schema fisso:
- 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_34.03', 08920RO, 08930RB, 08909RA, 08960= 'C_34.03', 08998='M'

- schema variabile:

FTD	Routine di condizionamento	Colonna 30	Colonna 40	Colonna 50	Colonna 60	Colonna 70
71522.30	CATEGORIA=AZ	COMODO - NUMERO- TRANSAZIONI	COMODO609	Se CMVPOSITIVO > 0 genera con CMVPOSITIVO	Se CMVNEGATIVO > 0 genera con CMVNEGATIVO segnato	ADD-ON

FASE G: ALTRI RISCHI

STEP 1: PREPARAZIONE TABELLE

a) Selezionare dalla tabella CTP01 tutte le FTO 01597.13/17 con colonna "TYPE" pari a "7 e per ogni record calcolare:

- COMODOCMV= 06697-06696; il comodo deve essere segnato;
- COMODO609=00609;
- COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI=1;
- Scrivere la nuova **CTP21 – C_34 03 - 3° PARTE** con le seguenti informazioni in colonna:
 - Forzare CATEGORIA=OTHER
 - COMODOCMV
 - COMODO609
 - COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI

b) Selezionare i record della tabella CTP21 con CATEGORIA = OTHER e:

- sommare il COMODOCMV > 0 e scrivere il risultato nella colonna CMVPOSITIVO;
- sommare il COMODOCMV < 0 e scrivere il risultato in valore assoluto nella colonna CMVNEGATIVO;
- sommare il COMODO609 e riportare il valore calcolato nel nuovo COMODO609;
- sommare il COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI e riportare il valore calcolato nel nuovo COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI;

- scrivere la nuova **CTP22 – C_34 03 - 4° PARTE** con le seguenti informazioni in colonna:
 - Forzare la colonna CATEGORIA= AZ
 - CMVPOSITIVO
 - CMVNEGATIVO
 - COMODO609
 - COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI
- c) Selezionare i record della tabella CTP05 con campo 05847=1 e calcolare ADD-ON pari alla somma della colonna AddON-OT della CTP05; scrivere il risultato nella nuova colonna “ADD-ON” nella **CTP22 - C_34 03 - 4° PARTE**.

STEP 1: GENERAZIONE DERIVATA 71523.40

- a)
- b) Accedere a CTP21 e per ogni record generare la derivata del template utilizzando il seguente schema di generazione:

- schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_34.03', 08920RO, 08930RB, 08909RA, 08960= 'C_34.03', 08998='M'

- schema variabile:

FTD	Routine di condizionamento	Colonna 30	Colonna 40	Colonna 50	Colonna 60
71523.40	CATEGORIA=OTHER	COMODO - NUMERO- TRANSAZIONI	COMODO609	Se COMODOCMV è positivo genera con COMODOCMV	Se COMODOCMV è negativo genera con COMODOCMV segnato

- c) Accedere a CTP22 e per ogni record generare la derivata del template utilizzando il seguente schema di generazione:

- schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_34.03', 08920RO, 08930RB, 08909RA, 08960= 'C_34.03', 08998='M'

- schema variabile:

FTD	Routine di condizionamento	Colonna 70
71523.40	CATEGORIA=OTHER	ADD-ON

FASE H: GENERAZIONE DELLA DERIVATA 71520.10

La riga 71520.10 è pari alla somma di tutte le colonne da 30 a 70 delle 71520.50, 71521.20, 71521.90, 71522.30, 71522.70 e 71523.40.

PARTE B: TEMPLATE C_34.04 – METODOLOGIA DELL'ESPOSIZIONE ORIGINARIA

Processo di calcolo

Se il digit di TCOR050 'MET_CALC_EAD_RCTP' uguale a 2 eseguire i seguenti step.

STEP1: Determinazione della "CATEGORIA"

Accedi a CTP13 e determina la nuova colonna "CATEGORIA", da memorizzare sulla stessa tabella, secondo le seguenti regole:

- i. rischio di tasso di interesse: se 01535.XX e 01543.XX con colonna "ASSET CLASS" pari a "INT" e 01593.01/05 con campo 05667≠0 oppure con campo 05370=0 e 05667=0 e le 01593.98/99 con campo 05667=0 e 01599.01 impostare CATEGORIA= INT;
- ii. rischio azionario: se FTO 01535.XX e 01543.XX con colonna "ASSET CLASS" pari a "AZ" e 01595.XX e 01599.03 impostare CATEGORIA= AZ;
- iii. rischio di cambio: se FTO 01568.XX e 01597.01/05/09 e 01599.02 impostare CATEGORIA= FX;
- iv. rischio di credito: se FTO 01594.98/99 e FTO 01064.02 impostare CATEGORIA= CR;
- v. rischio di posizione in merci: se FTO 01597.13/17 e colonna "TYPE" diverso da 7 e 01599.04 impostare CATEGORIA= MERCI.

STEP2: Generazione derivate 71530.20/30/40/50/60/70

Selezionare tutti i record della tabella CTP13 e per ogni record genera le derivate del template utilizzando il seguente schema di generazione:

- schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_34.04', 08920RE, 08930RB, 08909RA,
08960= 'C_34.04', 08998='M'

- schema variabile:

Ftd	Routine di condizionamento	Colonna 10	Colonna 20	Colonna 30	Colonna 40	Colonna 50
71530.20	CATEGORIA = INT	Forzare valore 1	Colonna 00609	Se CMV è positivo genera con CMV	Se CMV è negativo genera con CMV segnato	PFE-EX
71530.30	CATEGORIA = FX	Forzare valore 1	Colonna 00609	Se CMV è positivo genera con CMV	Se CMV è negativo genera con CMV segnato	PFE-EX
71530.40	CATEGORIA = CR	Forzare valore 1	Colonna 00609	Se CMV è positivo genera con CMV	Se CMV è negativo genera con CMV segnato	PFE-EX
71530.50	CATEGORIA = AZ	Forzare valore 1	Colonna 00609	Se CMV è positivo genera con CMV	Se CMV è negativo genera con CMV segnato	PFE-EX
71530.60	CATEGORIA = MERCI	Forzare valore 1	Colonna 00609	Se CMV è positivo genera con CMV	Se CMV è negativo genera con CMV segnato	PFE-EX
71530.70	CATEGORIA = MERCI e TYPE=ENERGIA ELETTRICA	Forzare valore 1	Colonna 00609	Se CMV è positivo genera con CMV	Se CMV è negativo genera con CMV segnato	PFE-EX

STEP3: Generazione derivata 71530.10

La riga 71530.10 è pari alla somma di tutte le colonne delle 71530.20, 71530.30, 71530.40, 71530.50, 71530.60 e 71530.70.

PARTE C: TEMPLATE C_34 02 – CCR EXPOSURES BY APPROACH

FASE A: SHEET 0001 “All CCR exposures”

STEP 1a: GENERAZIONE DERIVATE 71510.10, 71510.20 e 71510.30 (colonne 20 e 30)

1. Accedere a CTP01 e selezionare tutti i record e per ogni record generare le derivate del template utilizzando il seguente schema di generazione:

- schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_34.02', 08920=0001, 08930RB, 08909RA, 08960= 'C_34.02', 08998RC⁷

- schema variabile:

FTD	ROUTINE DI CONDIZIONAMENTO	COLONNA 20	COLONNA 30
71510.10	se attributo di TCOR050 'MET_CALC_EAD_RCTP' uguale a 2	Forzare valore1	Colonna 00609
71510.20	se attributo di TCOR050 'MET_CALC_EAD_RCTP' uguale a 1	Forzare valore1	Colonna 00609
71510.30	se attributo di TCOR050 'MET_CALC_EAD_RCTP' uguale a 0	Forzare valore1	Colonna 00609

STEP 1b: GENERAZIONE DERIVATE 71510.10, 71510.20 e 71510.30 (colonne da 40 a 150)

1. Accedere alla CTP01 e alla CTP02 e selezionare tutti i record con campo 05847 uguale a 1 e per ogni record generare le derivate del template utilizzando il seguente schema di generazione.

- schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_34.02', 08920=0001, 08930RB, 08909RA, 08960= 'C_34.02', 08998='M'

- schema variabile per le colonne da 40 a 70:

FTD	Routine di condizionamento	Colonna 40	Colonna 50	Colonna 60	Colonna 70
71510.10	se attributo di TCOR050 'MET_CALC_EAD_RCTP' uguale a 2	Se CMVPOSITIVO>0 genera con CMVPOSITIVO	Se CMVNEGATIVO>0 genera con		

⁷ SE CAMPO 08940=020 IMPOSTARE 08998=I ALTRIMENTI IMPOSTARE 08998=M

			CMVNEGATIVO segnato		
71510.20	se attributo di TCOR050 'MET_CALC_EAD_RCTP' uguale a 1	Se CMVPOSITIVO>0 genera con CMVPOSITIVO	Se CMVNEGATIVO>0 genera con CMVNEGATIVO segnato	Colonna VM RICEVUTI	Colonna VM FORNITI
71510.30	se attributo di TCOR050 'MET_CALC_EAD_RCTP' uguale a 0	Se CMVPOSITIVO>0 genera con CMVPOSITIVO	Se CMVNEGATIVO>0 genera con CMVNEGATIVO segnato	Colonna VM RICEVUTI	Colonna VM FORNITI

- schema variabile per le colonne da 80 a 10:

FTD	Routine di condizionamento	Colonna 80	Colonna 90	Colonna 100	Colonna 110	Colonna 140	Colonna 150
71510.10	se attributo di TCOR050 'MET_CALC_EAD_RCTP' uguale a 2			Colonna RC	Colonna PFE	1,4	Colonna 07300 * (-1)
71510.20	se attributo di TCOR050 'MET_CALC_EAD_RCTP' uguale a 1	Colonna NICA RICEVUTI	Colonna NICA FORNITI	Colonna RC	Colonna PFE	1,4	Colonna 07300 * (-1)
71510.30	se attributo di TCOR050 'MET_CALC_EAD_RCTP' uguale a 0	Colonna NICA RICEVUTI	Colonna NICA FORNITI	Colonna RC	Colonna PFE	1,4	Colonna 07300 * (-1)

N.B la colonna 140 non va generata per le derivate 71510.10/20/30.

STEP 1c: GENERAZIONE DERIVATE 71511.30 e 71511.40

Colonne 20 e 30

Accedere a CTP01 e selezionare tutti i record e per ogni record generare le derivate del template utilizzando il seguente schema di generazione:

- schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_34.02', 08920=0001, 08930RB, 08909RA,
08960= 'C_34.02', 08998RC

- schema variabile:

FTD	ROUTINE DI CONDIZIONAMENTO	COLONNA 20	COLONNA 30
71511.30	Se campo 05665≠0	Forzare valore1	Colonna 00609
71511.40	Se campo 05665=0 o assente	Forzare valore1	Colonna 00609

Colonne 40 e 50

Accedere alla CTP01 e alla CTP02 e selezionare tutti i record con campo 05847 uguale a 1 e per ogni record generare le derivate del template utilizzando il seguente schema di generazione.

- schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_34.02', 08920=0001, 08930RB, 08909RA, 08960='C_34.02', 08998='M'

- schema variabile:

FTD	Routine di condizionamento	Colonna 40	Colonna 50
71511.30	Se campo 05665≠0	Se CMVPOSITIVO>0 genera con CMVPOSITIVO	Se CMVNEGATIVO>0 genera con CMVNEGATIVO segnato
71511.40	Se campo 05665=0 o assente	Se CMVPOSITIVO>0 genera con CMVPOSITIVO	Se CMVNEGATIVO>0 genera con CMVNEGATIVO segnato

STEP 1d: GENERAZIONE DERIVATE 71511.10

Colonne da 20 a 50, da 150 a 220

La riga 71511.10 è pari alla somma delle colonne da 20 a 50 e da 150 a 220 delle 71510.10, 71510.20, 71510.30, 71510.80 e 71510.90.

Colonna 10

Accedere alla CTP01 e alla CTP02 e selezionare tutti i record con campo 05847 uguale a 1.

Inoltre, selezionare le FTD 71510.80 e 71510.90⁸ con il campo 00030 di zona controparte significativo.

Memorizzare il numero di controparti in base ai diversi valore del campo 00030 nel COMODO-NUMERO-CONTROPARTI.

Genera la colonna 10⁹ con il contenuto del COMODO-NUMERO-CONTROPARTI.

Inoltre impostare il seguente schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_34.02', 08920=0001, 08930RB, 08909RA, 08960= 'C_34.02', 08998='M'

FASE B: SHEET 0002 “All CCR exposures excluding exposures to central counterparties (CCPs)”

Eseguire tutti gli STEP della FASE A selezionando solo i record che presentano il campo 05080=0; per ogni record generare le derivate del template utilizzando lo schema della FASE A e forzando il campo 08920=0002.

⁸ Le FTD 71510.80 e 71510.90 sono prodotte secondo le regole del DB.

⁹ Successivamente alla generazione della colonna 10 rieseguire il compattamento delle FTD 71510.80 e 71510.90 eliminando il campo 00030 dalla zonacontroparte utile alla produzione del formato XBRL.

PARTE D: TEMPLATE C_34 06 – TOP TWENTY COUNTERPARTY

STEP 1: Selezione delle 20 maggiori controparti

Selezionare prima del compattamento tutte le 71559.99 con campo 08940=120; a parità di campo 00030 sommare l'importo della colonna 120 e scriverlo nel COMODO-IMPORTO; ordinare le controparti in modo decrescente in base a COMODO-IMPORTO. Selezionare le prime 20 controparti (campo 00030) ed eseguire i successivi step.

STEP2: generazione derivata 71559.99 (colonne 70 e 80)

a) Per ogni campo 00030 delle derivate selezionate allo step 1) accedere a CTP01 e selezionare i record in base alle seguenti condizioni:

- se 00348≠01593.98/99 con campo 05667=0 e 01594.98/99 selezionare quelli che hanno lo stesso campo 00030;
- se 00348=01593.98/99 con campo 05667=0 e 01594.98/99 selezionare quelli che hanno lo stesso valore della colonna 1° chiave di abbinamento.

b) Per ogni record individuato al punto a) genera la derivata del template utilizzando il seguente schema di generazione:

- schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_34.06', 08920RE, 08930RB, 08909RA, 08960= 'C_34.06', 08998RD¹⁰, 00030

- schema variabile:

FTD	Colonna 70	Colonna 80
71559.99	Forzare valore 1	Colonna 00609

STEP3: generazione derivata 71559.99 (colonne 90 e 100) in assenza di accordi di compensazione

Accedere a CTP01 e selezionare tutti i record con campo 05847=1 che presentano lo stesso campo 00030 selezionato allo step 1) e generare la derivata del template utilizzando il seguente schema di generazione:

¹⁰ SE CAMPO 08940=070 IMPOSTARE 08998=I ALTRIMENTI IMPOSTARE 08998=M.

- schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_34.03', 08920RE, 08930RB, 08909RA,
08960= 'C_34.03', 08998='M', 00030

- schema variabile:

FTD	Colonna 90	Colonna 100
71559.99	Se CMVPOSITIVO>0 genera con CMVPOSITIVO	Se CMVNEGATIVO>0 genera con CMVNEGATIVO segnato

STEP4: generazione derivata 71559.99 (colonne 90 e 100) in presenza di accordi di compensazione

Accedere a CTP02 e selezionare tutti i record con campo 05847=1.

Per ogni campo 00030 selezionato allo step 1) selezionare il record della CTP01 che ha lo stesso campo 00030 e generare la derivata del template utilizzando il seguente schema di generazione:

- schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_34.06', 08920RE, 08930RB, 08909RA,
08960= 'C_34.06', 08998='M', 00030

- schema variabile:

FTD	Colonna 90	Colonna 100
71559.99	Se CMVPOSITIVO>0 genera con CMVPOSITIVO	Se CMVNEGATIVO>0 genera con CMVNEGATIVO segnato

STEP5: eliminazione delle derivate

A valle del processo eliminare tutte le 71559.99 che non si riferiscono alle 20 controparti maggiori individuate nello step 1).

PARTE E: TEMPLATE C_34 08 – COMPOSITION OF COLLATERAL FOR CCR EXPOSURES

STEP1: Generazione derivate da 71570.10 a 71570.70

A. Accedere alla CTP10 – GARANZIE REALI PER CALCOLO RC e selezionare tutti i record e:

1. calcolare la nuova colonna “TIPO COLLATERAL RIGA” secondo le seguenti regole:

- ✓ se campo 00348=09701.08 e campo 00007=EUR e campo 05756=2,3,4,5 impostare la colonna “TIPO COLLATERAL RIGA” uguale a 1 (cash domestic currency);
- ✓ se campo 00348=09701.08 e campo 00007≠EUR e campo 05756=2,3,4,5 impostare la colonna “TIPO COLLATERAL RIGA” uguale a 2 (cash other currency);
- ✓ se campo 00348=01115.18/32 e 01226.66/74/79¹¹ e 00007=EUR impostare la colonna “TIPO COLLATERAL RIGA” uguale a 1 (cash domestic currency);
- ✓ se campo 00348=01115.18/32 e 01226.66/74/79 e campo 00007≠EUR impostare la colonna “TIPO COLLATERAL RIGA” uguale a 2 (cash other currency);
- ✓ se campo 00348=09701.04 e 01063.11 e campo 00011=100,102 impostare la colonna “TIPO COLLATERAL RIGA” uguale a 3 (Domestic sovereign debt);
- ✓ se campo 00348=09701.04 e 01063.11 e campo 00011=705 oppure se campo (00011=704 e codice identificativo emittente non contiene (004730002w0, 005760002w0) dell’elemento della TCOR028 ricercato in base al campo 00032) impostare la colonna “TIPO COLLATERAL RIGA” uguale a 4 (other sovereign debt);

¹¹ La FTO 01226.79 è valida solo per le finanziarie.

- ✓ se campo 00348=09701.04 e 01063.11 e campo 05720=53 impostare la colonna “TIPO COLLATERAL RIGA” uguale a 5 (government agency debt);
 - ✓ se campo 00348=09701.04 e 01063.11 e campo 05720=58 e con ‘TIPOCOL_TITOLO’ di TCOR014 diversa da 21,22,24 impostare la colonna “TIPO COLLATERAL RIGA” uguale a 6 (Corporate bonds);
 - ✓ se campo 00348=09701.04 e 01063.11 e ‘TIPOCOL_TITOLO’ di TCOR014 uguale 21,22,24 impostare la colonna “TIPO COLLATERAL RIGA” uguale a 7 (Equity securities);
 - ✓ in tutti gli altri casi impostare la colonna “TIPO COLLATERAL RIGA” uguale a 8 (other collateral);
2. calcolare la nuova colonna “TIPO COLLATERAL COLONNA” secondo le seguenti regole:
- ✓ se campo 00348=09701.04/08 e campo 05807=1 e 00192=1 imposta “TIPO COLLATERAL COLONNA” uguale a 1
 - ✓ se campo 00348=09701.04/08 e campo 05807=1 e 00192=2 imposta “TIPO COLLATERAL COLONNA” uguale a 2
 - ✓ se campo 00348=09701.04/08 e campo 05807=2 e 00192=1 imposta “TIPO COLLATERAL COLONNA” uguale a 3
 - ✓ se campo 00348=09701.04/08 e campo 05807=2 e 00192=2 imposta “TIPO COLLATERAL COLONNA” uguale a 4
 - ✓ se campo 00348=01115.18/32 e 1226.66/74/79 e campo 05807=1 e 00192=1 oppure se 00348=01063.11 e 05807=1 e 00107=61,62 imposta “TIPO COLLATERAL COLONNA” uguale a 5
 - ✓ se campo 00348=01115.18/32 e 1226.66/74/79 e campo 05807=1 e 00192=2 imposta “TIPO COLLATERAL COLONNA” uguale a 6
 - ✓ se campo 00348=01115.18/32 e 1226.66/74/79 e campo 05807=2 e 00192=1 oppure se 00348=01063.11 e 05807=2 e 00107=61,62 imposta “TIPO COLLATERAL COLONNA” uguale a 7

- ✓ se campo 00348=01115.18/32 e 1226.66/74/79 e campo 05807=2 e 00192=2 imposta "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 8

B) Accedere alla CTP10, selezionare tutti i record e per ogni record generare la derivata del template utilizzando il seguente schema di generazione:

- schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_34.08', 08920RE, 08930RB, 08909RA, 08960= 'C_34.08 ', 08998='M', 06325..

- schema variabile per righe da 10 a 40:

FTD	Routine di condizionamento	Colonna 10	Colonna 20	Colonna 30	Colonna 40
71570.10	Se colonna "TIPO COLLATERAL RIGA" uguale a 1	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 1	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 2	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 3	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 4
71570.20	colonna "TIPO COLLATERAL RIGA" uguale a 2	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 1	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 2	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 3	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 4
71570.30	colonna "TIPO COLLATERAL RIGA" uguale a 3	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 1	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 2	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 3	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 4
71570.40	colonna "TIPO COLLATERAL RIGA" uguale a 4	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 1	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 2	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 3	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 4
71570.50	colonna "TIPO COLLATERAL RIGA" uguale a 5	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 1	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 2	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 3	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 4
71570.60	colonna "TIPO COLLATERAL RIGA" uguale a 6	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 1	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 2	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 3	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 4
71570.70	colonna "TIPO COLLATERAL RIGA" uguale a 7	colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 6	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 1	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 2	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 3

- schema variabile per righe da 50 a 80:

FTD	Routine di condizionamento	Colonna 50	Colonna 60	Colonna 70	Colonna 80
71570.10	Se colonna "TIPO COLLATERAL RIGA" uguale a 1	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 1	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 1	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 7	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 8

		COLONNA" uguale a 5	COLONNA" uguale a 6		
71570.20	colonna "TIPO COLLATERAL RIGA" uguale a 2	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 5	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 6	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 7	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 8
71570.30	colonna "TIPO COLLATERAL RIGA" uguale a 3	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 5	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 6	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 7	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 8
71570.40	colonna "TIPO COLLATERAL RIGA" uguale a 4	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 5	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 6	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 7	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 8
71570.50	colonna "TIPO COLLATERAL RIGA" uguale a 5	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 5	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 6	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 7	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 8
71570.60	colonna "TIPO COLLATERAL RIGA" uguale a 6	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 5	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 6	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 7	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 8
71570.70	colonna "TIPO COLLATERAL RIGA" uguale a 7	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 5	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 6	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 7	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 8

STEP2: Generazione derivata 71570.80

La riga 71570.80 è pari alla somma di tutte le colonne delle 71570.10, 71570.20, 71570.30, 71570.40, 71570.50, 71570.60, 71570.70 e 71570.80.

PARTE F: TEMPLATE C_34 09 – CREDIT DERIVATIVES EXPOSURES

STEP1: generazione derivate 71580.XX in assenza di accordi di compensazione

Accedere alla CTP01 e selezionare tutti i record delle FTO 01594.01/05 e FTO 01064.02 e per ogni record generare le derivate del template utilizzando il seguente schema di generazione:

- schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_34.09', 08920RE, 08930RB, 08909RA, 08960= 'C_34.09 ', 08998='M'

- schema variabile:

FTD	Routine di Condizionamento	Colonna 10	Colonna 20	Colonna 30	Colonna 40
71580.10	Se colonna 00507=01/21 e colonna 05508=0,4	Se 00348=01594.01 genera con colonna 00609	Se 00348=01594.05 e 01064.02 genera con colonna 00609	Se 00348=01594.01 genera con colonna 06696 oppure 06697 in base al campo che è >0	Se 00348=01594.05 e 01064.02 genera con colonna 06696 oppure 06697 in base al campo che è >0
71580.20	Se colonna 00507=01/21 e colonna 05508=5,6	Se 00348=01594.01 genera con colonna 00609	Se 00348=01594.05 e 01064.02 genera con colonna 00609	Se 00348=01594.01 genera con colonna 06696 oppure 06697 in base al campo che è >0	Se 00348=01594.05 e 01064.02 genera con colonna 06696 oppure 06697 in base al campo che è >0
71580.30	Se colonna 00507=32	Se 00348=01594.01 genera con colonna 00609	Se 00348=01594.05 e 01064.02 genera con colonna 00609	Se 00348=01594.01 genera con colonna 06696 oppure 06697 in base al campo che è >0	Se 00348=01594.05 e 01064.02 genera con colonna 06696 oppure 06697 in base al campo che è >0
71580.40	Se colonna 00507=02/22	Se 00348=01594.01 genera con colonna 00609	Se 00348=01594.05 e 01064.02 genera con colonna 00609	Se 00348=01594.01 genera con colonna 06696 oppure 06697 in base al campo che è >0	Se 00348=01594.05 e 01064.02 genera con colonna 06696 oppure 06697 in base al campo che è >0
71580.50	Se colonna 00507=00/68	Se 00348=01594.01 genera con colonna 00609	Se 00348=01594.05 e 01064.02 genera con colonna 00609	Se 00348=01594.01 genera con colonna 06696 oppure	00348=01594.05 e 01064.02 genera con colonna 06696 oppure 06697 in

				06697 in base al campo che è >0	base al campo che è >0
71580.60		Se 00348=01594.01 genera con colonna 00609	Se 00348=01594.05 e 01064.02 genera con colonna 00609	Se 00348=01594.01 genera con colonna 06696 oppure 06697 in base al campo che è >0	Se 00348=01594.05 e 01064.02 genera con colonna 06696 oppure 06697 in base al campo che è >0
71580.70	Se colonna 06697>0			Se 00348=01594.01 genera con colonna 06697	Se 00348=01594.05 e 01064.02 genera con colonna 06697
71580.80	Se colonna 06696>0			Se 00348=01594.01 genera con colonna (06696* -1)	Se 00348=01594.05 e 01064.02 genera con colonna 06696*-1)