

NOME CAMPO			LUNG HEZZ A	TI PO	NOTE
METODOLOGIA ADOTTATA PER RISCHIO DI CREDITO			1	N	1 = STANDARD 2 = FIRB 3 = AIRB 9 = METODOLOGIA IRB ADOTTATA SOLTANTO PER ALCUNI PORTAFOGLI (in questo caso l'azienda deve impostare il campo 05888=1 sui rapporti trattati con metodologia IRB)
METODOLOGIA ADOTTATA PER RISCHIO DI CONTROPARTE – CONTRATTI DERIVATI			1	N	1 = VALORE CORRENTE 2 = STANDARDIZZATO 3 = MODELLI INTERNI DI TIPO EPE
METODOLOGIA ADOTTATA PER RISCHIO DI CONTROPARTE – OPERAZIONI A LUNGO TERMINE			1	N	1 = VALORE CORRENTE 2 = STANDARDIZZATO 3 = MODELLI INTERNI DI TIPO EPE
METODOLOGIA ADOTTATA PER RISCHIO DI CONTROPARTE – OPERAZIONI SFT (PRONTI CONTRO TERMINE) ED EVENTUALI ACCORDI- QUADRO DI COMPENSAZIONE			1	N	1 = CRM - METODO SEMPLIFICATO 2 = CRM - METODO INTEGRALE / RETTIFICHE STANDARD 3 = CRM - METODO INTEGRALE / RETTIFICHE STIMATE 4 = CRM - METODO MODELLI INTERNI DI TIPO VAR 5 = CRM - MODELLI INTERNI DI TIPO EPE
METODOLOGIA ADOTTATA PER RISCHIO OPERATIVO			1	N	1 = BASE (BIA) 2 = STANDARDIZZATO 3 = AVANZATO (AMA)
ASSOGGETTAMENTO ALLA DISCIPLINA DEI RISCHI DI MERCATO			1	N	0 = SI 1 = NO
METODOLOGIA ADOTTATA PER I RISCHI DI MERCATO – RISCHIO DI POSIZ. GENERICO SU TITOLI DEBITO			1	N	1 = STANDARD – PER SCADENZA 2 = STANDARD - PER DURATION 3 = MODELLI INTERNI
METODOLOGIA ADOTTATA PER I RISCHI DI MERCATO – RISCHIO DI			1	N	1 = STANDARD

NOME CAMPO	LUNG HEZZ A	TI PO	NOTE
CAMBIO			2 = MODELLI INTERNI
METODOLOGIA ADOTTATA PER I RISCHI DI MERCATO – RISCHIO DI POSIZIONE SU MERCI	1	N	1 = STANDARD - SEMPLIFICATO 2 = STANDARD - FASCE DI SCADENZA 3 = STANDARD - FASCE DI SCADENZA AMPLIATO 4 = MODELLI INTERNI
METODOLOGIA ADOTTATA PER I RISCHI DI MERCATO - TRATTAMENTO DELLE OPZIONI	1	N	1 = STANDARD - SEMPLIFICATA 2 = STANDARD - DELTA-PLUS 3 = STANDARD - SCENARIO 4 = MODELLI INTERNI
METODOLOGIA ADOTTATA PER I DERIVATI NEL RISCHIO GENERICO SU TITOLI DI DEBITO	1	N	1 = STANDARD – METODO DELLA DOPPIA ENTRATA 2 = MODELLO FINANZIARIO O DI SENSITIVITA'
METODOLOGIA ADOTTATA PER STRUMENTI SENSIBILI A PIU' FATTORI DI RISCHIO	1	N	1 = SCOMPOSIZIONE IN COMPONENTI ELEMENTARI PER TIPOLOGIA RISCHIO 2 = TRASFORMAZIONE IN POSIZIONI DI SENSIBILITA' SU FATTORI RISCHIO RILEVANTI
CARTOLARIZZAZIONI – POSIZIONI PONDERATE AL 1250%	1	N	0 = CALCOLO DEL REQUISITO 1 = DEDUZIONE DAL PATRIMONIO DI VIGILANZA
TRATTAMENTO DELLE ESPOSIZIONI AL DETTAGLIO	1	N	1 = NESSUN CONTROLLO 2 = EFFETTUA CONTROLLI / ATTIVA WARNING 3 = EFFETTUA CONTROLLI / MODIFICA SEGMENTO
TRATTAMENTO ESPOSIZIONI SCADUTE/SCONFINANTI – APPROCCIO PER TRANSAZIONE	1	N	0 = NO 1 = SI
APPROCCIO PER TRANSAZIONE: INDICAZIONE DEI PORTAFOGLI	2 x 10	N	se “approccio per transazione” = SI, vanno indicati i codici dei portafogli scelti (per il dominio cfr. quello del campo 05706) (*)
SCELTA VALUTAZIONI ECA/ECAI	2 x 10	N	vanno indicati i codici dei portafogli scelti

NOME CAMPO			LUNG HEZZ A	TI PO	NOTE
(per il dominio cfr. quello del campo 05720) (**)					
SUPERAMENTO VIAGGIANTI	SOGLIA	PARTITE	1	N	0 = NO 1 = SI
CRM – METODOLOGIA GARANZIE REALI FINANZIARIE		CALCOLO	1	N	1 = SEMPLIFICATO 2 = INTEGRALE - RETTIFICHE STANDARD 3 = INTEGRALE - RETTIFICHE STIMATE
CRM – METODOLOGIA GARANZIE PERSONALI		CALCOLO	1	N	1 = RETTIFICHE STANDARD 2 = RETTIFICHE STIMATE
PONDERAZ. PER CONCENTRAZIONE DEI RISCHI (riguarda solo aziende ex art. 107 TUB)			1	N	1 = coerentemente con la disciplina sul rischio di credito 2 = secondo quanto indicato nella Circ. 216, Cap. V, allegato J
RACCOLTA PUBBLICO (riguarda solo aziende ex art. 107 TUB)	RISPARMIO	TRA IL	1	N	0 = NO 1 = SI

(\*)I portafogli per i quali può essere effettuata la scelta dell'approccio per transazione sono: Amministrazioni centrali e banche centrali (51); Intermediari vigilati (52); Enti territoriali (53); Enti senza scopo di lucro e del settore pubblico (55); Banche multilaterali di sviluppo (56); Organizzazioni internazionali (57); Imprese e altri soggetti (58); Esposizioni al dettaglio (59); Esposizioni verso OICR (61); Esposizioni ad alto rischio (65).

(\*\*)I portafogli per i quali può essere effettuata la scelta delle valutazioni ECA/ECAI sono: Amministrazioni centrali e banche centrali (51); Banche multilaterali di sviluppo (56); Imprese e altri soggetti (58); Esposizioni a breve termine verso imprese (60); Esposizioni verso OICR (61); Posizioni v/cartolarizzazione diverse da quelle con rating a breve (90); Posizioni v/cartolarizzazione con rating a breve (91).