

<b>F11_2</b>	<b>RISCHIO DI REGOLAMENTO</b>
--------------	-------------------------------

<b>Tipo intermediario</b>	<b>B</b>
---------------------------	----------

## Generalità

Il requisito è determinato per le transazioni per le quali è previsto il regolamento del tipo “consegna contro pagamento” (Delivery versus Payment, DVP).

## Processo di calcolo

In fase di generazione si ottengono le seguenti FTD:

- **05836.01** (Esposizione per rischio di regolamento su portafoglio di negoziazione a fini di vigilanza - differenziale) che contiene anche le informazioni necessarie alle segnalazioni dei grandi rischi (campo **00359** - codice fiscale capogruppo e campo **00363** - tipologia posizione “xy”) per il requisito relativo al portafoglio di negoziazione;
- **05836.05** (Esposizione per rischio di regolamento su portafoglio bancario - differenziale).

La FTD **59576.00** deve essere generata secondo il seguente schema:

05836.01	59576.00	00294..	00777..
05836.05	59576.00	00294..	00777..

### **Requisito patrimoniale – FTD 59586.00**

Il requisito patrimoniale è costituito dalla somma dei valori ponderati calcolati secondo il seguente schema:

<b>FTD</b>	<b>CAMPO 294 (tempo di inadempimento)</b>	<b>Ponderazione</b>
05836.01/05	21	8%
05836.01/05	22	50%
05836.01/05	23	75%
05836.01/05	24	100%