

ESEMPIO 1: GENERAZIONE TEMPLATE CON IL METODO SA-CCR

PARTE A: TEMPLATE C 34 03 - SA-CCR E SA-CCR SIMPLIFIED

Si parte dalla tabella CTP01 creata nella F16_1 e arricchita nella F16_2:

CTP01 – SINGOLI CONTRATTI DERIVATI

00030	00204	00348	00007	TYPE	HEDGING- SET- COM	00609	Market Value Negativo 06696	Market Value Positivo 06697
1	R1	01593.05	USD			10.000		30
1	R2	01593.01	USD			10.000	-20	
1	R3	01593.01	EUR			5.000		50
FIRM A	R1	01594.99				10.000		20
FIRM B	R2	01594.98				10.000	-40	
CDX.IG 5Y	R3	01594.99				10.000		10
2	R1	01597.05	USD	2 (energia non elettrica)	ENERGIA	10.000	-50	
2	R2	01597.01	USD	2 (energia non elettrica)	ENERGIA	20.000	-30	
2	R3	01597.05	EUR	4 (metalli)	METALLI	10.000		100

Inoltre si tiene conto delle seguenti tabelle create nella F16_2 per le diverse classi di rischio considerate:

- CTP03 - POSIZIONE DI RISCHIO IR

00030	00204	05277	05666	00007	05843	TB	D(IR) _{j,k}	00609	CMV	NUMERO TRANSAZIONI
N.A	N.A	N.A	AAA	USD	0	3	78.693,87	10.000	30	1
N.A	N.A	N.A	AAA	USD	0	2	- 36.253,85	10.000	-20	1
N.A	N.A	N.A	AAA	EUR	0	3	- 11.303,82	5.000	50	1

- **CTP06 - Nozionale Effettivo CR**

00030	00204	05277	1° chiave di abbinamento	2° chiave di abbinamento	05666	p	NozEFF (Entity(k))	AddOn (Entity(k))	00609	CMV	NUMERO TRANSAZIONI
FIRM A	R1	N.A	N.A	N.A	BBB	0,5	106	106	10.000	20	1
FIRM B	R2	N.A	N.A	N.A	BBB	0,5	-280	-280	10.000	-40	1
CDX.I G 5Y	R3	N.A	N.A	N.A	BBB	0,8	168	168	10.000	10	1

- **CTP08 – COMMODITIES HEDGING SET**

00030	00204	05277	05666	HEDGING-SET- COM	05843	AddOn-COM-HEGING (j)	00609	CMV	NUMERO TRANSAZIONI
N.A	N.A	N.A	CCC	ENERGIA	0	2.041	30.000	-80	2
N.A	N.A	N.A	CCC	METALLI	0	1.800	10.000	100	1

FASE A1: STEP1: MAPPED TO N RISK CATEGORIES

a) Selezionare i record dalla CTP01 e per ogni record mappare le nuove colonne “CATEGORIA” e COMODO-RISK-CATEGORIES.

TABELLA CTP01 – SINGOLI CONTRATTI DERIVATI

00030	00204	00348	00007	TYPE	HEDGING-SET- COM	00609	Market Value Negativo 06696	Market Value Positivo 06697	Categoria	Comodo-risk-Categories
1	R1	01593.05	USD			10.000		30	INT	1
1	R2	01593.01	USD			10.000	-20		INT	1
1	R3	01593.01	EUR			5.000		50	INT	1
FIRM A	R1	01594.99				10.000		20	CR	1
FIRM B	R2	01594.98				10.000	-40		CR	1

CDX.I G 5Y	R3	01594.99				10.000		10	CR	1
2	R1	01597.05	USD	2 (energia non elettrica)	ENERGIA	10.000	-50		MERCI	1
2	R2	01597.01	USD	2 (energia non elettrica)	ENERGIA	20.000	-30		MERCI	1
2	R3	01597.05	EUR	4 (metalli)	METALLI	10.000		100	MERCI	1

1) 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:

CTP20 – C 34 03 - 1° PARTE

CATEGORIA	COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI	COMODO609	COMODOCMV
INT	3	25.000	60
CR	3	30.000	-10
MERCI	3	40.000	20

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

Accedere a CTP20 e seleziona tutti i record e in base alle regole di generazione, schema variabile, le derivate sono le seguenti:

FTD	COLONNA 30	COLONNA 40	COLONNA 50	COLONNA 60
71520.60	3	25.000	60	
71522.00	3	30.000		-10
71522.80	3	40.000	20	

Aggiungere poi il seguente schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C 34.03', 08920RO, 08930RB, 08950= 'tassonomia presente in TCOR70', 08960= 'C 34.03', 08998='M'

FASE B: RISCHIO 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

a) Selezionare tutti i record della tabella CTP03 creata nella funzione F16_2.

- **CTP03 - POSIZIONE DI RISCHIO IR**

00030	00204	05277	05666	00007	05843	TB	D(IR) _{j,k}	00609	CMV	NUMERO TRANSAZIONI
N.A	N.A	N.A	AAA	USD	0	3	78.693,87	10.000	30	1
N.A	N.A	N.A	AAA	USD	0	2	- 36.253,85	10.000	-20	1
N.A	N.A	N.A	AAA	EUR	0	3	- 11.303,82	5.000	50	1

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:

CTP21 – C 34 03 - 3° PARTE

CATEGORIA	00007	COMODO609	COMODOCMV	COMODO-NUMERO- TRANSAZIONI
INT	USD	20.000	10	2
INT	EUR	5.000	50	1

b) 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

CTP21 – C 34 03 - 3° PARTE

CATEGORIA	00007	COMODO609	COMODOCMV	COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI	LARGEST CURRENCY	2 nd LARGEST CURRENCY
INT	USD	20.000	10	2		USD
INT	EUR	5.000	50	1	EUR	

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

a) Accedere a CTP04:

CTP04 - NOZIONALE EFFETTIVO IR

00030	00204	05277	05666	00007	05843	NozEFF(IR,j)
N.A	N.A	N.A	AAA	USD	0	59.270,00
N.A	N.A	N.A	AAA	EUR	0	11.303,82

Per ogni record selezionato calcolare:

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

e scrivere il risultato nella corrispondente nuova colonna “ADD-ON-0007” sulla CTP21.

✓ ADD-ON-00007 (USD) = 59.270,00* 0,5% = 296,35

✓ ADD-ON-00007 (EUR) = 11.303,82* 0,5% = 56,52

CTP21 – C 34 03 - 3° PARTE

CATEGORIA	00007	COMODO609	COMODOCMV	COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI	LARGEST CURRENCY	2 nd LARGEST CURRENCY	ADD-ON-00007
INT	USD	20.000	10	2		USD	296,35
INT	EUR	5.000	50	1	EUR		56,52

STEP 1c: GENERAZIONE

Accedere a CTP21 e per ogni record in base alle regole di generazione, schema variabile, le derivate sono le seguenti:

FTD	COLONNA 10	COLONNA 30	COLONNA 40	COLONNA 50	COLONNA 60	COLONNA 70
71520.70	EUR	1	5.000	50		56,52
71520.80	USD	2	20.000	10		296,35

Aggiungere poi il seguente schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C 34.03', 08920RO, 08930RB, 08950= 'tassonomia presente in TCOR70', 08960= 'C 34.03', 08998RB

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;
- 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:

CTP22 – C 34 03 - 4° PARTE

CATEGORIA	COMODO609	CMVPOSITIVO	CMVNEGATIVO	COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI	ADD-ON
INT	25.000	60		3	352,86

- b) Accedere a CTP22, selezionare il record con CATEGORIA = INT e e in base alle regole di generazione, schema variabile, la derivata è la seguente:

FTD	COLONNA 30	COLONNA 40	COLONNA 50	COLONNA 60	COLONNA 70
71520.50	3	25.000	60		352,86

Aggiungere poi il seguente schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C 34.03', 08920RO, 08930RB, 08950= 'tassonomia presente in TCOR70', 08960= 'C 34.03', 08998='M'

FASE D: CREDIT RISK

Selezionare tutte le 01594.98/99 della tabella CTP06.

CTP06 - Nozionale Effettivo CR

00030	00204	05277	1° chiave di abbinamento	2° chiave di abbinamento	05666	p	NozEFF (Entity(k))	AddOn (Entity(k))	00609	CMV	NUMERO TRANSAZIONI
FIRM A	R1	N.A	N.A	N.A	BBB	0,5	106	106	10.000	20	1
FIRM B	R2	N.A	N.A	N.A	BBB	0,5	-280	-280	10.000	-40	1
CDX.I G 5Y	R3	N.A	N.A	N.A	BBB	0,8	168	168	10.000	10	1

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:

CTP21 – C 34 03 - 3° PARTE

CATEGORIA	p	COMODO609	COMODOCMV	COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI
CR	0,5	20.000	-20	2
CR	0,8	10.000	10	1

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

Selezionare tutti i record della CTP21 e in base alle regole di generazione, schema variabile, le derivate sono le seguenti:

FTD	COLONNA 30	COLONNA 40	COLONNA 50	COLONNA 60
71522.10	2	20.000		-20
71522.20	1	10.000	10	

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:

CTP22 – C 34 03 - 4° PARTE

CATEGORIA	COMODO609	CMVPOSITIVO	CMVNEGATIVO	COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI
CR	30.000	10	20	3

b) Selezionare i record della tabella CTP05 con campo 05847=1 e calcolare la nuova colonna ADD-ON pari alla somma della colonna AddON-CR della CTP05 e scrivere il risultato nella **CTP22 - C 34 03 - 4° PARTE**.

CTP22 – C 34 03 - 4° PARTE

CATEGORIA	COMODO609	CMVPOSITIVO	CMVNEGATIVO	COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI	ADD-ON
CR	30.000	10	20	3	282

c) Accedere a CTP22, selezionare il record con CATEGORIA = CR e in base alle regole di generazione, schema variabile, la derivata è la seguente:

FTD	COLONNA 30	COLONNA 40	COLONNA 50	COLONNA 60	COLONNA 70
71421.90	3	30.000	10	-20	282

Aggiungere poi il seguente schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C 34.03', 08920RO, 08930RB, 08950= 'tassonomia presente in TCOR70', 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 nella funzione F16_2.

CTP08 – COMMODITIES HEDGING SET

00030	00204	05277	05666	HEDGING- SET-COM	05843	AddOn- COM- HEDSET(j)	00609	CMV	NUMERO TRANSAZIONI
N.A	N.A	N.A	CCC	ENERGIA	0	2.041	30.000	-80	2
N.A	N.A	N.A	CCC	METALLI	0	1.800	10.000	100	1

Per ogni valore del campo HEDGING-SET-COM:

- sommare il campo CMV e riportare il valore calcolato nel COMODOCMV;
- 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:

CTP21 – C 34 03 - 3° PARTE

CATEGORIA	HEDGING- SET- COM	COMODO609	COMODOCMV	COMODO-NUMERO- TRANSAZIONI	ADD-ON-HED
MERCI	ENERGIA	30.000	-80	2	2.041
MERCI	METALLI	10.000	100	1	1.800

b) Selezionare tutti i record della CTP21 e in base alle regole di generazione, schema variabile, le derivate sono le seguenti:

FTD	COLONNA 30	COLONNA 40	COLONNA 50	COLONNA 60	COLONNA 70
71522.90	2	30.000		-80	2.041
71523.00	1	10.000	100		1.800

Aggiungere poi il seguente schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C 34.03', 08920RO, 08930RB, 08950= 'tassonomia presente in TCOR70', 08960= 'C 34.03', 08998='M'

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:

CTP22 – C 34 03 - 4° PARTE

CATEGORIA	COMODO609	CMVPOSITIVO	CMVNEGATIVO	COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI	ADD-ON
MERCI	40.000	100	80	3	3.841

b) Accedere a CTP22, selezionare il record con CATEGORIA = MERCI e in base alle regole di generazione, schema variabile, le derivate sono le seguenti:

FTD	COLONNA 30	COLONNA 40	COLONNA 50	COLONNA 60	COLONNA 70
71522.70	3	40.000	100	-80	3.841

Aggiungere poi il seguente schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C 34.03', 08920RO, 08930RB, 08950= 'tassonomia presente in TCOR70', 08960= 'C 34.03', 08998='M'

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. Scrivere pertanto la seguente derivata:

FTD	COLONNA 30	COLONNA 40	COLONNA 50	COLONNA 60	COLONNA 70
71520.10	9	95.000	170	-100	4.475,86

La generazione complessiva del template C34 03 è quindi la seguente:

	Colonna 10	Colonna 20	Colonna 30	Colonna 40	Colonna 50	Colonna 60	Colonna 70
71520.10			9	95.000	170	-100	4.475,86
71520.50			3	25.000	60		352,86
71520.60			3	25.000	60		
71520.70	EUR		1	5.000	50		56,52
71520.80	USD		2	20.000	10		296,35
71521.90			3	30.000	10	-20	282
71522.00			3	30.000		-10	
71522.10			2	20.000		-20	
71522.20			1	10.000	10		
71522.70			3	40.000	100	-80	3.841
71522.80			3	40.000	20		
71522.90			2	30.000		-80	2.041
71523.00			1	10.000	100		1.800

PARTE C: TEMPLATE C 34 02 – SA-CCR

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

TABELLA CTP01 – SINGOLI CONTRATTI DERIVATI

00030	00204	1 ° chiave di abbinamento	00348	00007	00609	CMVNEGATIVO	CMVPOSITIVO	05080
1	R1		01593.05	USD	10.000		30	0
1	R2		01593.01	USD	10.000	20		0
1	R3		01593.01	EUR	5.000		50	0
FIRM A	R1	3	01594.99		10.000		20	1
FIRM B	R2	3	01594.98		10.000	40		1
CDX.I G 5Y	R3	3	01594.99		10.000		10	1
2	R1		01597.05	USD	10.000	50		3
2	R2		01597.01	USD	20.000	30		3
2	R3		01597.05	EUR	10.000		100	3

2. selezionare tutti i record e in base alle regole di generazione, schema variabile, le derivate sono le seguenti:

FTD	COLONNA 20	COLONNA 30
71510.30	9	95.000

Aggiungere poi il seguente schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C 34.02', 08920=0001, 08930RB, 08950= 'tassonomia presente in TCOR70', 08960= 'C 34.02', 08998='M'

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

1. Accedere alla CTP01 e alla CTP02:

TABELLA CTP02 – ACCORDI DI COMPENSAZIONE

00348	00030	05080	05665	CMV +	CMV -	VM FORNITI	VM RICEVUTI	VM	NICA FORNITI	NICA RICEVUTI	NICA	RC	PFE	EAD	05847
01592.01	1	0	AAA	60		5	7	2	8,65	12,84	4,19	53,8	20	103,32	1
01592.01	3	1	BBB		-10	2	3	1		5	5	73	5	109,2	1
01592.01	3	3	CCC	20		1	4	3	3	8	4	25	6	43,4	1

2. selezionare tutti i record con campo 05847 uguale a 1 e in base alle regole di generazione, schema variabile, le derivate sono le seguenti:

FTD	COL 40	COL 50	COL 60	COL 70	COL 80	COL 90	COL 100	COL 110	COL 140	COL 150
71510.10	80	10	14	8	25,84	11,65	151,8	31	1,4	255,92

Aggiungere poi il seguente schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C 34.02', 08920=0001, 08930RB, 08950= 'tassonomia presente in TCOR70', 08960= 'C 34.02', 08998='M'

STEP 1c: GENERAZIONE DERIVATE 71511.30 e 71511.40

Colonne 20 e 30

Accedere a CTP01 e selezionare tutti i record e in base alle regole di generazione, schema variabile, le derivate sono le seguenti:

FTD	COLONNA 20	COLONNA 30
71511.30	9	95.000

Aggiungere poi il seguente schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C 34.02', 08920=0001, 08930RB, 08950= 'tassonomia presente in TCOR70', 08960= 'C 34.02', 08998='M'

Colonne 40 e 50

Accedere alla CTP01 e alla CTP02 e selezionare tutti i record con campo 05847 uguale a 1 e in base alle regole di generazione, schema variabile, le derivate sono le seguenti:

FTD	COL 40	COL 50
71511.30	80	10

Aggiungere poi il seguente schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C 34.02', 08920=0001, 08930RB, 08950= 'tassonomia presente in TCOR70', 08960= 'C 34.02', 08998='M'

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.

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

Genera la colonna 10 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, 08950= 'tassonomia presente in TCOR70', 08960= 'C 34.02', 08998='M'

FTD	COL 10	COL 20	COL 30	COL 40	COL 50	COL 150
71511.10	3	9	95.000	80	10	255,92

La generazione completa del template C 34 02 - SHEET 0001 “All CCR exposures”:

FTD	COL 10	COL 20	COL 30	COL 40	COL 50	COL 60	COL 70	COL 80	COL 90	COL 100	COL 110	COL 140	COL 150
71510.10		9	95.000	80	10	14	8	25,84	11,65	151,8	31	1,4	255,92
71511.10	3	9	95.000	80	10								255,92
71511.30		9	95.000	80	10								

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

Eseguire gli STEP 1a e 1b 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.

FTD	COL 10	COL 20	COL 30	COL 40	COL 50	COL 60	COL 70	COL 80	COL 90	COL 100	COL 110	COL 140	COL 150
71510.10		3	25.000	60	0	7	5	12,84	8,65	53,8	20	1,4	103,32
71511.10	1	3	25.000	60	0								103,32
71511.30		3	25.000	60	0								

PARTE D: TEMPLATE C 34 06

STEP 1: Selezione delle 20 maggiori controparti

a) Selezionare prima del compattamento tutte le derivate 71559.99 prodotte con le regole del DB:

FTD	COLONNA 10	Colonna 120	00030
71559.99	1		10.000	1
71559.99	2		7.500	2
71559.99	3		21.000	3

b) A parità di valore del campo 00030 sommare l'importo della colonna 120 e scriverlo nel COMODO-IMPORTO; ordinare le controparti in modo decrescente in base a COMODO-IMPORTO:

FTD	COLONNA 10	Colonna 120	00030
71559.99	3		21.000	3
71559.99	1		10.000	1
71559.99	2		7.500	2

c) Selezionare le prime 20 controparti (campo 00030) ed eseguire i seguenti step.

STEP2: generazione colonne 70/80

a) Per ogni campo 00030 delle derivate selezionate allo step 1) accedere a CTP01:

TABELLA CTP01 – SINGOLI CONTRATTI DERIVATI

00030	00204	00348	1°chiave di abbinamento	2°chiave di abbinamento	00609	Market Value Negativo 06696	Market Value Positivo 06697
1	R1	01593.05			10.000		30
1	R2	01593.01			10.000	-20	
1	R3	01593.01			5.000		50
FIRM A	R1	01594.99	3	R1	10.000		20
FIRM B	R2	01594.98	3	R1	10.000	-40	
CDX.IG 5Y	R3	01594.99	3	R1	10.000		10
2	R1	01597.05			10.000	-50	
2	R2	01597.01			20.000	-30	
2	R3	01597.05			10.000		100

b) Selezionare i record di in base alle seguenti condizioni:

- se 00348≠01594.98/99 selezionare quelli che hanno lo stesso campo 00030
- se 00348=01594.98/99 selezionare quelli che hanno lo stesso valore della colonna “1°chiave di abbinamento”

c) Considerare tutti i record selezionati al punto b) e in base alle regole di generazione, schema variabile, le derivate sono le seguenti:

FTD	COLONNA 10 ...	COLONNA 70	COLONNA 80	00030
71559.99	1	3	25.000	1
71559.99	2	3	40.000	2
71559.99	3	3	30.000	3

Aggiungere poi il seguente schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C 34.03', 08920=A, 08930RB, 08950= 'tassonomia presente in TCOR70', 08960= 'C 34.03', 08998='M', 00030

STEP3: generazione colonne 90/100 in presenza di accordi di compensazione

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

TABELLA CTP02 – ACCORDI DI COMPENSAZIONE

05666	00030	unico accordo di garanzi a	fto principale accordo	CMV Positivo	CMV negativo	05847
AAA	1	0	0	60		1
BBB	2	0	0	20		1
CCC	3	0	0		10	1

Per ogni campo 00030 selezionato allo step 1) selezionare il record che ha lo stesso campo 00030.

Considerare tutti i record e in base alle regole di generazione, schema variabile, le derivate sono le seguenti:

FTD	COLONNA 10 ...	COLONNA 90	COLONNA 100	00030
71559.99	1	60		1
71559.99	2	20		2
71559.99	3		-10	3

Aggiungere poi il seguente schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C 34.03', 08920=A, 08930RB, 08950= 'tassonomia presente in TCOR70', 08960= 'C 34.03', 08998='M', 00030

La generazione complessiva (colonne 70/80/90/100) del template C34 06 è la seguente:

FTD	COLONNA 10 ...	COLONNA 70	COLONNA 80	COLONNA 90	COLONNA 100	00030
71459.99	1	3	25.000	60		1
71459.99	2	3	40.000	20		2
71459.99	3	3	30.000		-10	3

ESEMPIO 2 GENERAZIONE TEMPLATE CON IL METODO SA-CCR

FASE A: STEP1: MAPPED TO N RISK CATEGORIES

Si parte dalla tabella CTP01 creata nella F16_1 e arricchita nella F16_2:

CTP01 – SINGOLI CONTRATTI DERIVATI

00030	00204	00348	00007	1° VALUTA	2° VALUTA	00609	Market Value Negativo 06696	Market Value Positivo 06697
1	R1	01593.05	USD			10.000		30
1	R2	01593.01	USD			10.000	-20	
1	R3	01593.01	EUR			5.000		50
1	R3	01599.02		USD	EUR	5.000		50

Inoltre si tiene conto delle seguenti tabelle create nella F16_2 per le diverse classi di rischio considerate:

- CTP03 - POSIZIONE DI RISCHIO IR**

00030	00204	05277	05666	00007	05843	TB	D(IR) _{j,k}	00609	CMV	NUMERO TRANSAZIONI
N.A	N.A	N.A	AAA	USD	0	3	78.693,87	10.000	30	1
N.A	N.A	N.A	AAA	USD	0	2	- 36.253,85	10.000	-20	1
N.A	N.A	N.A	AAA	EUR	0	3	- 11.303,82	5.000	50	1

- CTP11 - POSIZIONE DI RISCHIO FX**

00030	00204	05277	05666	1° valuta	2°valuta	05843	AddOn-FX	00609	CMV	NUMERO TRANSAZIONI
N.A	N.A	N.A	AAA	USD	EUR	0	103	5.000	50	1

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

a) Selezionare i record dalla CTP01:

TABELLA CTP01 – SINGOLI CONTRATTI DERIVATI

00030	00204	00348	00007	1° valuta	2°valuta	00609	Market Value Negativo 06696	Market Value Positivo 06697	Categoria	Comodo-risk-Categories
1	R1	01593.05	USD			10.000		30	INT	1
1	R2	01593.01	USD			10.000	-20		INT	1
1	R3	01593.01	EUR			5.000		50	INT	2
1	R3	01599.02		EUR	EUR	5.000		50	FX	0

b) 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.

2) 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:

CTP19 – C 34 03 - 1° PARTE

RISK CATEGORIES	COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI	COMODO609	COMODOCMV
2	1	5.000	50

3) 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:

CTP20 – C 34 03 - 2° PARTE

CATEGORIA	COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI	COMODO609	COMODOCMV
INT	2	20.000	10

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 in base alle regole di generazione, schema variabile, scrivere le seguenti derivate:

FTD	COLONNA 30	COLONNA 40	COLONNA 50	COLONNA 60
71520.20	1	5.000	50	

Aggiungere poi il seguente schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C 34.03', 08920RO, 08930RB, 08950= 'tassonomia presente in TCOR70', 08960= 'C 34.03', 08998='M'

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 in base alle regole di generazione, schema variabile, scrivere la seguente derivata:

FTD	COLONNA 30	COLONNA 40	COLONNA 50	COLONNA 60
71520.60	2	20.000	10	

Aggiungere poi il seguente schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C 34.03', 08920RO, 08930RB, 08950= 'tassonomia presente in TCOR70', 08960= 'C 34.03', 08998='M'

FASE B: RISCHIO 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

a) Selezionare tutti i record della tabella CTP03 creata nella funzione F16_2.

CTP03 - POSIZIONE DI RISCHIO IR

00030	00204	05277	05666	00007	05843	TB	D(IR) _{j,k}	00609	CMV	NUMERO TRANSAZIONI
N.A	N.A	N.A	AAA	USD	0	3	78.693,87	10.000	30	1
N.A	N.A	N.A	AAA	USD	0	2	- 36.253,85	10.000	-20	1
N.A	N.A	N.A	AAA	EUR	0	3	- 11.303,82	5.000	50	1

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:

CTP21 – C 34 03 - 3° PARTE

CATEGORIA	00007	COMODO609	COMODOCMV	COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI
INT	USD	20.000	10	2
INT	EUR	5.000	50	1

c) 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 tali 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

CTP21 – C 34 03 - 3° PARTE

CATEGORIA	00007	COMODO609	COMODOCMV	COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI	LARGEST CURRENCY	2 nd LARGEST CURRENCY
INT	USD	20.000	10	2	EUR	
INT	EUR	5.000	50	1		USD

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

a) Accedere a CTP04:

CTP04 - NOZIONALE EFFETTIVO IR

00030	00204	05277	05666	00007	05843	NozEFF(IR,j)
N.A	N.A	N.A	AAA	USD	0	59.270,00
N.A	N.A	N.A	AAA	EUR	0	11.303,82

b) Per ogni record selezionato calcolare:

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

e scrivere il risultato nella corrispondente nuova colonna “ADD-ON-0007” sulla CTP21.

$$\checkmark \text{ ADD-ON-00007 (USD)} = 59.270,00 * 0,5\% = 296,35$$

$$\checkmark \text{ ADD-ON-00007 (EUR)} = 11.303,82 * 0,5\% = 56,52$$

CTP21 – C 34 03 - 3° PARTE

CATEGORIA	00007	COMODO609	COMODOCMV	COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI	LARGEST CURRENCY	2 nd LARGEST CURRENCY	ADD-ON-00007
INT	USD	20.000	10	2		USD	296,35
INT	EUR	5.000	50	1	EUR		56,52

STEP 1c: GENERAZIONE

Accedere a CTP21 e per ogni record in base alle regole di generazione, schema variabile, scrivere le seguenti derivate:

FTD	COLONNA 10	COLONNA 30	COLONNA 40	COLONNA 50	COLONNA 60	COLONNA 70
71520.70	EUR	1	5.000	50		56,52
71520.80	USD	2	20.000	10		296,35

Aggiungere poi il seguente schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C 34.03', 08920RO, 08930RB, 08950= 'tassonomia presente in TCOR70', 08960= 'C 34.03', 08998RB

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;
- 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:

CTP22 – C 34 03 - 4° PARTE

CATEGORIA	COMODO609	CMVPOSITIVO	CMVNEGATIVO	COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI	ADD-ON
INT	25.000	60		3	352,86

b) Accedere a CTP22 e per ogni record in base alle regole di generazione, schema variabile, scrivere la seguente derivata:

FTD	Colonna 30	Colonna 40	Colonna 50	Colonna 60	Colonna 70
71520.50	3	25.000	60		352,86

Aggiungere poi il seguente schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C 34.03', 08920RO, 08930RB, 08950= 'tassonomia presente in TCOR70', 08960= 'C 34.03', 08998='M'

FASE C: RISCHIO DI CAMBIO

STEP1: GENERAZIONE DERIVATE DA 71521.40 A 71521.80 (colonne da 10 a 60)

STEP 1a: CALCOLO DELLE LARGEST CURRENCY PAIR

a) Selezionare tutti i record della tabella CTP11 creata nella funzione F16_2.

CTP11 - POSIZIONE DI RISCHIO FX

00030	00204	05277	05666	1° valuta	2°valuta	05843	AddON-FX	00609	CMV	NUMERO TRANSAZIONI
N.A	N.A	N.A	AAA	USD	EUR	0	103	5.000	50	1

b) Selezionare tutti i record della tabella CTP11 creata nella funzione F16_2 e ordinare secondo un ordine alfabetico le colonne 1° VALUTA e 2° VALUTA e scrivere le rispettive colonna 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 alfabetico

c) considerare ogni record che presenta gli stessi valori del campo 1° VALUTA e 2° VALUTA 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:

CTP21 – C 34 03 - 3° PARTE

CATEGORIA	1° VAL IN PAIR	2° VAL IN PAIR	COMODO609	COMODOCMV	COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI	AddON
FX	EUR	USD	5.000	50	1	103

d) 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 rispettando l'ordinamento scrivere le seguenti ulteriori colonne:

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.

CTP21 – C 34 03 - 3° PARTE

1°VAL IN PAIR	2° VAL IN PAIR	COMODO609	COMODOCMV	COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI	LARGEST CURRENCY PAIR – 1° VALUTA	LARGEST CURRENCY PAIR – 2° VALUTA
EUR	USD	5.000	50	1	EUR	USD

STEP 1b: GENERAZIONE

Accedere a CTP21 e per ogni record in base alle regole di generazione, schema variabile, le derivate sono le seguenti:

FTD	COLONNA 10	COLONNA 20	COLONNA 30	COLONNA 40	COLONNA 50	COLONNA 60	COLONNA 70
71521.40	EUR	USD	1	5.000	50		103

Aggiungere poi il seguente schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C 34.03', 08920RO, 08930RB, 08950= 'tassonomia presente in TCOR70', 08960= 'C 34.03', 08998RC'

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;
- 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:

CTP22 – C 34 03 - 4° PARTE

CATEGORIA	COMODO609	CMVPOSITIVO	CMVNEGATIVO	COMODO-NUMERO-TRANSAZIONI	ADD-ON
FX	5.000	50		1	103

b) Accedere a CTP22 e per ogni record in base alle regole di generazione, schema variabile, la derivata è la seguente:

FTD	COLONNA 30	COLONNA 40	COLONNA 50	COLONNA 60	COLONNA 70
71521.20	1	5.000	50		103

Aggiungere poi il seguente schema fisso:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C 34.03', 08920RO, 08930RB, 08950= 'tassonomia presente in TCOR70', 08960= 'C 34.03', 08998='M'

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. Scrivere pertanto la seguente derivata:

FTD	COLONNA 30	COLONNA 40	COLONNA 50	COLONNA 60	COLONNA 70
71520.10	4	30.000	110		455,86

La generazione totale del template C 34 03 è:

FTD	Colonna 10	Colonna 20	Colonna 30	Colonna 40	Colonna 50	Colonna 60	Colonna 70
71520.10			4	30.000	110		455,86
71520.20			1	5.000	50		
71520.50			3	25.000	60		352,86
71520.60			2	20.000	10		
71520.70	USD		2	20.000	10		296,35
71520.80	EUR		1	5.000	50		56,52
71521.20			1	5.000	50		103
71521.40	EUR	USD	1	5.000	50		103