

F16_7	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	2021 07 01	2021 06 30	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 COUNTERPARTY**
- **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 TCOR50 "METODOLOGIA DA UTILIZZARE PER CALCOLO EAD RISCHIO DI CTP" 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= EX;
 - iv. rischio di credito: se FTO 01594.98/99 e FTO 01064.02 impostare CATEGORIA= CR;
 - v. rischio di posizione in merci: se FTO 01597.11/13 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, 08950=
'tassonomia presente in TCOR70', 08960= 'C 34.03', 08998='M'
- schema variabile²:

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, 08950=
'tassonomia presente in TCOR70', 08960= 'C 34.03', 08998='M'

¹ 08920RO Se attributo di TCOR50 "METODOLOGIA DA UTILIZZARE PER CALCOLO EAD RISCHIO DI CTP" uguale a 0 impostare 8920=0001, altrimenti 08920=0002.

² Lo schema variabile contiene le regole di condizionamento e i campi importi 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 = EX	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, 08950='tassonomia presente in TCOR70', 08960= 'C 34.03', 08998RB³

- schema variabile:

FTD	Routine di condizionamento	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;

³ 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, 08950='tassonomia presente in TCOR70', 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 alfabetico⁴.

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:

⁴ 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, 08950='tassonomia presente in TCOR70', 08960='C 34.03', 08998RC⁵

- 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 I	COMODO609	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 I	COMODO609	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 I	COMODO609	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 I	COMODO609	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 I	COMODO609	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;

⁵ 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, 08950='tassonomia presente in TCOR70', 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- TRANSAZIONI	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, 08950=
'tassonomia presente in TCOR70', 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, 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 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, 08950='tassonomia presente in TCOR70', 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, 08950='tassonomia presente in TCOR70', 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 CMVPOSIVITO	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 "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=AZ
 - p
 - 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, 08950='tassonomia presente in TCOR70', 08960='C 34.03', 08998='M'

- schema variabile:

FTD	Routine di condizionamento	Colonna 30	Colonna 40	Colonna 50	Colonna 60
71522.50	Se colonna p =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 p=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, 08950='tassonomia presente in TCOR70', 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 01597.11/13 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, 08950='tassonomia presente in TCOR70', 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, 08950='tassonomia presente in TCOR70', 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 TCOR50 "METODOLOGIA DA UTILIZZARE PER CALCOLO EAD RISCHIO DI CTP" 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 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= EX;
- iv. rischio di credito: se FTO 01594.98/99 e FTO 01064.02 impostare CATEGORIA= CR;
- v. rischio di posizione in merci: se FTO 01597.11/13 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, 08950=
'tassonomia presente in TCOR70', 08960= 'C 34.04', 08998='M'

- schema variabile:

Ftd	Routine di condizionamento	Colonna 30	Colonna 40	Colonna 50	Colonna 60	Colonna 70
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 = EX	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, 08950='tassonomia presente in TCOR70', 08960='C 34.02', 08998='M'

- schema variabile:

FTD	ROUTINE DI CONDIZIONAMENTO	COLONNA 20	COLONNA 30
71510.10	se attributo di TCOR50 “METODOLOGIA DA UTILIZZARE PER CALCOLO EAD RISCHIO DI CTP” uguale a 2	Forzare valore1	Colonna 00609
71510.20	se attributo di TCOR50 “METODOLOGIA DA UTILIZZARE PER CALCOLO EAD RISCHIO DI CTP” uguale a 1	Forzare valore1	Colonna 00609
71510.30	se attributo di TCOR50 “METODOLOGIA DA UTILIZZARE PER CALCOLO EAD RISCHIO DI CTP” 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, 08950='tassonomia presente in TCOR70', 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 TCOR50 “METODOLOGIA DA UTILIZZARE PER CALCOLO EAD RISCHIO DI CTP” uguale a 2	Se CMVPOSITIVO>0 genera con CMVPOSITIVO	Se CMVNEGATIVO>0 genera con CMVNEGATIVO segnato		

71510.20	se attributo di TCOR50 "METODOLOGIA DA UTILIZZARE PER CALCOLO EAD RISCHIO DI CTP" 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 TCOR50 "METODOLOGIA DA UTILIZZARE PER CALCOLO EAD RISCHIO DI CTP" 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 TCOR50 "METODOLOGIA DA UTILIZZARE PER CALCOLO EAD RISCHIO DI CTP" uguale a 2			Colonna RC	Colonna PFE	1,4	Colonna 07300
71510.20	se attributo di TCOR50 "METODOLOGIA DA UTILIZZARE PER CALCOLO EAD RISCHIO DI CTP" uguale a 1	Colonna NICA RICEVUTI	Colonna NICA FORNITI	Colonna RC	Colonna PFE	1,4	Colonna 07300
71510.30	se attributo di TCOR50 "METODOLOGIA DA UTILIZZARE PER CALCOLO EAD RISCHIO DI CTP" uguale a 0	Colonna NICA RICEVUTI	Colonna NICA FORNITI	Colonna RC	Colonna PFE	1,4	Colonna 07300

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, 08950=
'tassonomia presente in TCOR70', 08960= 'C 34.02', 08998='M'
- 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, 08950='tassonomia presente in TCOR70', 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.

Memorizzare il numero di controparti in base ai diversi valore 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'

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.

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 34.03', 08920RE, 08930RB, 08950='tassonomia presente in TCOR70', 08960='C 34.03', 08998='M', 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:

- schema fisso:

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

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 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 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 TCOR28 ricercato in base al campo 00032) impostare la colonna “TIPO COLLATERAL RIGA” uguale a 4 (other sovereign debt);

- ✓ 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 tipologia titolo di TCOR14 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 tipologia titolo di TCOR14 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=0 e 00192=1 imposta "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 3
 - ✓ se campo 00348=09701.04/08 e campo 05807=0 e 00192=2 imposta "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 4
 - ✓ se campo 00348=01115.18/32 e 1226.66/74 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 e campo 05807=1 e 00192=2 imposta "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 6
 - ✓ se campo 00348=01115.18/32 e 1226.66/74 e campo 05807=0 e 00192=1 oppure se 00348=01063.11 e 05807=1 e 00107=61,62 imposta "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 7

✓ se campo 00348=01115.18/32 e 1226.66/74 e campo 05807=0 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 34.09', 08920RE, 08930RB, 08950='tassonomia presente in TCOR70', 08960='C 34.09 ', 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	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 7	Se colonna "TIPO COLLATERAL COLONNA" uguale a 8

		5	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 71530.80 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, 08950='tassonomia presente in TCOR70', 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 06697 in base al	00348=01594.05 e 01064.02 genera con colonna 06696 oppure 06697 in

				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)