

F27_3	DETERMINAZIONE DELLE ESPOSIZIONI SCADUTE PER BASILEA
--------------	---

Tipo intermediario	Data pubblicazione	Data inizio validità	Data fine validità
B/F	2021 07 06	2021 06 30	9999 99 99

Generalità

La fase consente di attribuire il portafoglio “esposizioni scadute” e le relative ponderazioni ante-CRM utilizzando le informazioni generate dalla funzione F27_9 (determinazione delle esposizioni scadute/sconfinanti).

Processo di calcolo

Essa opera come segue:

- selezionare tutti i record con campo 05707 <> 090, 091, 092, 093, 185 e (campo 00119 = 1 oppure 05206 = 1 oppure campo 05426 = 9 oppure campo 05189 = 2, 3 oppure campo 05589 = 1), escludendo i record con campo 05731 = 1;
- sui record così selezionati con campo 05707 <> 065, 159 impostare campi 05708, 05720, 05707 = 158 e campo 05727=100;
- sui record così selezionati con campo 05707 = 065, 159 impostare campi 05708 = 158 e campo 05727=100;
- sugli stessi record ad eccezione di quelli relativi alle FTO 01230.00 e 01232.00, impostare i campi 05721, 05723 e 05725 in funzione dell'incidenza delle rettifiche di valore seguendo la seguente modalità:

se $[(07540 + 07543) / (07500 + 07540 + 07543)] * 100 < 20\%$

allora la ponderazione da applicare, modificando i campi 05723 e 05725, impostati in fase ACA e riferiti alla controparte, è del 150% e il campo 05721 deve essere impostato a 88;

se $[(07540+07543) / (07500 + 07540+07543)] * 100 = > 20\%$

allora la ponderazione da applicare, modificando i campi 05723 e 05725, impostati in fase ACA e riferiti alla controparte, è del 100% e il campo 05721 deve essere impostato a 87.