

TCOR062		OIC METODO MBA PER FRTB - METODO DELLA SENSIBILITA'		
data pubblicazione 2025-06-30				
VARIABLEID	DESCRIPTION	LUNGHEZZA	TIPO	NOTE
ID_ITEM	ID_ITEM	16	A	Variabile chiave a codifica aziendale che rappresenta il codice identificativo unico dello strumento
PROGR	PROGRESSIVO	15	N	Variabile chiave a codifica aziendale. La variabile deve permettere l'alimentazione di più record che si riferiscono allo stesso strumento identificato dal campo chiave "ID_ITEM"
COD_TITOLO	CODICE TITOLO	12	A	Codice identificativo del titolo  L'attributo va alimentato "ASSET_CLASS"=2,3,4,5
ASSET_CLASS	CLASSE DI RISCHIO	1	N	1= GIRR 2= CSR NonSEC 3= CSR SecNonACTP 4= CSR SecACTP 5= EQUITY 6= COMMODITY 7= FX
TIPO_REQ	TIPOLOGIA REQUISITO	1	N	L'attributo presenta il seguente dominio: 1= Delta; 2= Vega; 3= Curvatura;

TCOR062		OIC METODO MBA PER FRTB - METODO DELLA SENSIBILITA'		
data pubblicazione 2025-06-30				
VARIABLEID	DESCRIPTION	LUNGHEZZA	TIPO	NOTE

				In caso di "ASSET_CLASS" pari a 1 (GIRR) e 7 (FX) l'informazione non deve mai essere alimentata in quanto verranno utilizzati variabili già richieste.
CATEGORIA	CATEGORIA (BUCKET)	2	N	Se "ASSET_CLASS" pari a 2 (CSR NonSEC) l'attributo può assumere i valori da 01 a 21 Se "ASSET_CLASS" pari a 3 (CSR SecNonACTP ) l'attributo può assumere i valori da 01 a 25 Se "ASSET_CLASS" pari a 4 (CSR SecACTP) l'attributo può assumere i valori da 01 a 18 Se "ASSET_CLASS" pari a 5 (EQUITY:) l'attributo può assumere i valori da 01 a 13 Se "ASSET_CLASS" pari a 6 (COMMODITY:) l'attributo può assumere i valori da 01 a 11.
VALUTA	VALUTA (per tasso di interesse)	3	A	Da alimentare se il digit "ASSET_CLASS" è pari a 1. L'attributo deve essere espressa utilizzando i codici ISO.
PRIMA_VALUTA	PRIMA VALUTA (per tasso di cambio)	3	A	Da alimentare se il digit "ASSET_CLASS" è pari a 7. l'attributo deve essere espresso utilizzando i codici ISO.
SECONDA_VALUTA	SECONDA VALUTA (per tasso di cambio)	3	A	Da alimentare se il digit "ASSET_CLASS" è pari a 7. Il campo deve essere espresso utilizzando i codici ISO.

TCOR062		OIC METODO MBA PER FRTB - METODO DELLA SENSIBILITA'			
data pubblicazione 2025-06-30					
VARIABLEID	DESCRIPTION	LUNGHEZZA	TIPO	NOTE	
FATT_RISC_CURVA	FATTORE DI RISCHIO CURVA	30	A	Da alimentare se il digit "ASSET_CLASS" è pari a 1, 2,3,4.	
FATT_RISC_EQUITY	FATTORE DI RISCHIO PER EQUITY	1	N	L'attributo presenta il seguente dominio: 1= FATTORI DI RISCHIO COSTITUITI DAI PREZZI A PRONTI DEGLI STRUMENTI DI CAPITALE 2= FATTORI DI RISCHIO COSTITUITI DA TASSI DI PRONTI CONTRO TERMINE IN STRUMENTI DI CAPITALE  Da alimentare se il digit "ASSET_CLASS" è pari a 5 e se TIPO_REQ=1.	
TIPO_MERCE	TIPOLOGIA MERCE	30	A	L'attributo va alimentato se ASSET_CLASS=6	
LUOGO_CONS_MERCE	LUOGO DI CONSEGNA DELLA MERCE	30	A	Variabile a contenuto libero. resta a carico dell’ente segnalante la scelta del dominio da utilizzare (ad esempio utilizzo del codice NUTS per l’Europa e il codice ISO per il resto del mondo). Qualora la merce fosse in giacenza presso la banca indicare il valore generico “MAGAZZINO” L'attributo va alimentato se ASSET_CLASS=6	

TCOR062		OIC METODO MBA PER FRTB - METODO DELLA SENSIBILITA'		
data pubblicazione 2025-06-30				
VARIABLEID	DESCRIPTION	LUNGHEZZA	TIPO	NOTE

ADD-ON_GIRR	ADD-ON FATTORI DI RISCHIO PER ASSET CLASS GIRR	1	N	L'attributo presenta il seguente dominio: 0=NO; 1= INFLAZIONE 2= CROSS CURRENCY BASIS OVER EUR 3= CROSS CURRENCY BASIS OVER USD Da alimentare se il digit "TIPO_REQ" è pari a 1,2.
-------------	---	---	---	---

GRADO_SENIORITY	GRADO DI SENIORITY	3	N	L'attributo va alimentato se il valore dell'attributo ASSET_CLASS=3
-----------------	--------------------	---	---	---

TCOR062		OIC METODO MBA PER FRTB - METODO DELLA SENSIBILITA'		
data pubblicazione 2025-06-30				
VARIABLEID	DESCRIPTION	LUNGHEZZA	TIPO	NOTE

TENOR_DELTA	TENOR REGOLAMENTARE DELTA	5	N	L'attributo presenta il seguente dominio:  01= 0,25 anni; 02=0,5 anni; 03=1 anno; 04=2 anni; 05=3 anni; 06=5 anni; 07=10 anni; 08=15 anni; 09=20 anni; 10= 30 anni.
				Da alimentare se attributo "TIPO_REQ" è pari a 1 e se "ASSET_CLASS" pari a 1,2,3,4 e 6.  Se "ASSET_CLASS" pari a 1 (GIRR) l'attributo può assumere i valori da 01 a 10 Se "ASSET_CLASS" pari a 2 (CSR NonSEC) l'attributo può assumere i valori da 02, 03, 05, 06 e 07; Se "ASSET_CLASS" pari a 4 (CSR ACTP ) l'attributo può assumere i valori da 02, 03, 05, 06 e 07. Se "ASSET_CLASS" pari a 3 (CSR SecNonACTP) l'attributo può assumere i valori da 02, 03, 05, 06 e 07. Se "ASSET_CLASS" pari a 7 (COMMODITY:) l'attributo può assumere i valori da 01 a 10

SENS_DELTA	SENSIBILITA' DELTA	15	N	Da alimentare se il digit "TIPO_REQ" è pari a 1. L'attributo può assumere valore positivo o negativo.
------------	--------------------	----	---	---

TCOR062		OIC METODO MBA PER FRTB - METODO DELLA SENSIBILITA'		
data pubblicazione 2025-06-30				
VARIABLEID	DESCRIPTION	LUNGHEZZA	TIPO	NOTE
TENOR_VEGA_OPZIO NE	TENOR REGOLAMENTARE VEGA OPZIONE	2	N	L'attributo presenta il seguente dominio per ogni valore dell'attributo "ASSET_CLASS".  02=0,5 anni; 03=1 anno; 05=3 anni; 06=5 anni; 07=10 anni;  Da alimentare se il digit "TIPO_REQ" è pari a 2.
TENOR_VEGA_SOTT_ OPZIONE	TENOR REGOLAMENTARE VEGA DEL SOTTOSTANTE OPZIONE	2	N	L'attributo presenta il seguente dominio per ogni valore dell'attributo "ASSET_CLASS".  02=0,5 anni; 03=1 anno; 05=3 anni; 06=5 anni; 07=10 anni;  Da alimentare se il digit "TIPO_REQ" è pari a 2 e se "ASSET_CLASS" pari a 1 (GIRR)
SENS_VEGA	SENSIBILITA' VEGA	15	N	Da alimentare se attributo "TIPO_REQ" è pari a 2. L'attributo può assumere valore positivo o negativo.
CVRk+	POSIZIONE DI RISCHIO DI CURVATURA NETTA AL RIALZO	15	N	Posizione di rischio di curvatura netta al rialzo al rischio k. Da alimentare se il attributo "TIPO_REQ" è pari a 3.

TCOR062		OIC METODO MBA PER FRTB - METODO DELLA SENSIBILITA'		
data pubblicazione 2025-06-30				
VARIABLEID	DESCRIPTION	LUNGHEZZA	TIPO	NOTE
CVRk-	POSIZIONE DI RISCHIO DI CURVATURA NETTA AL RIBASSO	15	N	Posizione di rischio di curvatura netta a ribasso al rischio k. Da alimentare se il attributo "TIPO_REQ" è pari a 3.