

F87_4	GENERAZIONE TEMPLATE DA C 91.01 A C 92.01 (FRTB-A-SA – METODO BASATO SULLE SENSIBILITA')
--------------	---

Tipo intermediario	Data pubblicazione	Data inizio validità	Data fine validità
B	2026 09 24	2027 01 01	9999 99 99

Generalità

La fase ha lo scopo di generare i template da C 91.01 a C 92.7.2 relativi al metodo standardizzato alternativo (o A-SA A) nell'ambito dei requisiti per i rischi di mercato. Per le date contabili di marzo e giugno 2027, la fase documenta anche la produzione del template C 91.00.

La fase deve essere eseguita post fase F87_2 e se 'FRTB_MET_ASA' di TCOR075 uguale a 1 o 2.

FASE A: TEMPLATE C 91.01¹

Processo di calcolo

Di seguito è descritto il processo di generazione delle derivate previste dal template C 91.01 (C 91.00 fino al 30/06/2027).

Il processo di generazione si articola, salvo ove diversamente specificato, nelle seguenti fasi:

1. **Selezione dei record di origine**, dalle tabelle prodotte dalla fase F87_2, secondo le regole specifiche di ciascuno step;
2. **Determinazione della derivata da generare**, in funzione del valore della variabile **ASSET_CLASS**, secondo le regole generali riportate di seguito (fa eccezione lo step 5 che ha regole specifiche);

¹ Si precisa che le righe 90, 100, 120 e 130 del template C 91.1 sono generate nel database mentre la riga 110 non viene gestita nella documentazione PUMA.

3. **Determinazione dell'importo da utilizzare e valorizzazione del campo 08940**, secondo le regole specifiche di ciascuno step;
4. **Arricchimento della derivata**, mediante le valorizzazioni comuni riportate di seguito.

Per gli step da 2 a 5, la derivata da generare è determinata in funzione del valore della variabile ASSET_CLASS presente su ciascun record selezionato in ciascuno step, secondo le regole riportate nella tabella seguente.

se ASSET_CLASS=	GENERA DERIVATA=	
	C 91.00 (fino al 30/06/2027)	C 91.01 (dal 30/09/2027)
1	7181020	7050020
2	7181030	7050030
3	7181040	7050040
4	7181050	7050050
5	7181060	7050060
6	7181070	7050070
7	7181080	7050080

Per la determinazione delle derivate per lo step 1, fare riferimento direttamente al relativo paragrafo.

Ciascuna derivata deve essere arricchita mediante le seguenti valorizzazioni:

00003=1 00004=1 00005=3 08909RA, 08910RB, 08920RE, 08930RB, 08940RA, 08950RA, 08960RA, 08998='M'

Le regole specifiche di selezione dei record di origine e di valorizzazione dell'importo e del campo 08940 sono riportate nei singoli step.

Step 1 – generazione colonne 10, 20 e 30

- 1) Selezionare i record delle seguenti tabelle prodotte dalla fase F87_2 e utilizzarli per generare le derivate del template seguendo il seguente schema:

TABELLA DI ORIGINE	DERIVATA	
	C 91.00 (fino al 30/06/2027)	C 91.01 (dal 30/09/2027)
FRTB11 - POSIZIONE DI RISCHIO GIRR - DELTA	7181020	7050020
FRTB21 - POSIZIONE DI RISCHIO CSRNonSec - DELTA	7181030	7050030
FRTB31 - POSIZIONE DI RISCHIO CSR SecNonACTP - DELTA	7181040	7050040
FRTB41 - POSIZIONE DI RISCHIO CSR SecACTP - DELTA	7181050	7050050
FRTB51 - POSIZIONE DI RISCHIO EQUITY - DELTA	7181060	7050060
FRTB61 - POSIZIONE DI RISCHIO COMMODITY - DELTA	7181070	7050070
FRTB71 - POSIZIONE DI RISCHIO FX - DELTA	7181080	7050080

- 2) Per l'individuazione dell'importo e del valore da attribuire al campo 08940 fare riferimento alla seguente tabella:

IMPORTO=	SD+	SD-	S _K
-----------------	-----	-----	----------------

IMPOSTARE 08940=	10	20	30
-------------------------	----	----	----

Step 2 – generazione colonne 40, 80 e 120

- 1) Selezionare i record della tabella **FRTB03 – REQUISITO RISCHIO DELTA** creata nella fase F87_2;
- 2) Generare, a partire da ciascun record selezionato, la derivata corrispondente al valore della variabile **ASSET_CLASS** utilizzando l'importo REQ_DELTA. Per l'individuazione del valore da attribuire al campo 08940 fare riferimento alla seguente tabella:

se TIPO SCENARIO=	Basso	Medio	Alto
IMPOSTARE 08940=	40	80	120

Step 3 – generazione colonne 50, 90 e 130

- 1) Selezionare tutti i record della tabella **FRTB04 – REQUISITO RISCHIO VEGA** creata nella fase F87_2;
- 2) Generare, a partire da ciascun record selezionato, la derivata corrispondente al valore della variabile **ASSET_CLASS** utilizzando l'importo REQ_VEGA. Per l'individuazione del valore da attribuire al campo 08940 fare riferimento alla seguente tabella:

se TIPO SCENARIO=	Basso	Medio	Alto
IMPOSTARE 08940=	50	90	130

Step 4 – generazione colonne 60, 100 e 140

- 1) Selezionare tutti i record della tabella **FRTB04 – REQUISITO RISCHIO CURVATURA** creata nella fase F87_2;
- 2) Generare, a partire da ciascun record selezionato, la derivata corrispondente al valore della variabile **ASSET_CLASS** utilizzando l'importo REQ_CURVATURA. Per l'individuazione del valore da attribuire al campo 08940 fare riferimento alla seguente tabella:

se TIPO SCENARIO=	Basso	Medio	Alto
IMPOSTARE 08940=	60	100	140

Step 5 – generazione colonne da 155 a 157 e colonna 190

- 1) Selezionare tutti i record della tabella **FRTB77 – REQUISITO FONDI PROPRI** creata nella fase F87_2;
- 2) Generare, a partire da ciascun record selezionato, le colonne da 155 a 157 della derivata corrispondente al valore della variabile **ASSET_CLASS**. Per l'individuazione dell'importo e del valore da attribuire al campo 08940 fare riferimento alla seguente tabella:

se IMPORTO=	REQ_DELTA	REQ_VEGA	REQ_CURVATURA
IMPOSTARE 08940=	155	156	157

- 3) Generare la colonna 190 di ciascuna derivata come somma delle colonne 155, 156 e 157. Fino al 31 dicembre 2029, ai sensi dell'articolo 495 *vicies*, moltiplicare il risultato ottenuto per 0,9.

Eeguire le fasi successive se data di riferimento maggiore o uguale al 30/09/2027.

FASE B: TEMPLATE C 92.01

Processo di calcolo

Di seguito è descritto il processo di generazione della derivata 7051010 del template C 92.01.

Il processo di generazione si articola, salvo ove diversamente specificato, nelle seguenti fasi:

1. **Selezione dei record di origine**, dalle tabelle prodotte dalla fase F87_2, secondo le regole specifiche di ciascuno step;
2. **Determinazione dell'importo da utilizzare e valorizzazione del campo 08940**, secondo le regole specifiche di ciascuno step;
3. **Arricchimento della derivata**, mediante le valorizzazioni comuni riportate di seguito.

L'arricchimento della derivata deve avvenire mediante le seguenti valorizzazioni:

00003=1 00004=1 00005=3 08909RA, 08910RB, 08920RE, 08930RB, 08940RA, 08950RA, 08960RA, 08998='M'

Ciascun record prodotto dovrà essere corredato dall'informazione sulla valuta presente nella colonna COD_VALUTA di ciascuna tabella selezionata. Essa dovrà essere utilizzata per valorizzare la colonna 0010 del template.

Le regole specifiche di selezione dei record di origine e di valorizzazione dell'importo e del campo 08940 sono riportate nei singoli step.

Step 1 – generazione colonne da 100 a 220

- 1) Selezionare tutti i record della tabella **FRTB11 - POSIZIONE DI RISCHIO GIRR - DELTA** creata nella fase F87_2;

- 2) Generare, a partire da ciascun record selezionato, la derivata **7051010** utilizzando l'importo S_k . Per l'individuazione del valore da attribuire al campo 08940 fare riferimento alla seguente tabella:

se TENOR_DELTA =	Se ADD_ON_GIRR=	Impostare 08940=
1	0	100
2	0	110
3	0	120
4	0	130
5	0	140
6	0	150
7	0	160
8	0	170
9	0	180
10	0	190
N.A.	1	200
N.A.	2	210
N.A.	3	220

Step 2 – generazione colonne da 250 a 520

- 1) Selezionare tutti i record della tabella **FRTB13 - POSIZIONE DI RISCHIO GIRR - VEGA** creata nella fase F87_2;

2) Generare, a partire da ciascun record selezionato, la derivata **7051010** utilizzando l'importo S_k . Per l'individuazione del valore da attribuire al campo 08940 fare riferimento alla seguente tabella:

se TENOR_VEGA _OPZIONE=	se TENOR_VEGA_S OTT_OPZIONE=	se ADD_ON_GIRR=	impostare 08940=
1	1	0	250
1	2	0	260
1	3	0	270
1	4	0	280
1	5	0	290
2	1	0	300
2	2	0	310
2	3	0	320
2	4	0	330
2	5	0	340
3	1	0	350
3	2	0	360
3	3	0	370
3	4	0	380
3	5	0	390
4	1	0	400
4	2	0	410
4	3	0	420

4	4	0	430
4	5	0	440
5	1	0	450
5	2	0	460
5	3	0	470
5	4	0	480
5	5	0	490
N.A.	N.A.	1	500
N.A.	N.A.	2	510
N.A.	N.A.	3	520

Step 3 – generazione colonne 600 e 610

- 1) Selezionare tutti i record della tabella **FRTB15 - POSIZIONE DI RISCHIO GIRR - CURVATURA** creata nella fase F87_2;
- 2) Generare, a partire da ciascun record selezionato, la derivata **7051010**.
Per l'individuazione dell'importo e del valore da attribuire al campo 08940 fare riferimento alla seguente tabella:

IMPORTO=	CVR+TOT	CVR-TOT
Impostare 08940=	600	610

Step 4 – generazione colonne 700, 1000, 1030 e 1060

- 1) Selezionare tutti i record della tabella **FRTB12 - POSIZIONE DI RISCHIO GIRR – DELTA - K_b** creata nella fase F87_2;
- 2) Generare, a partire da ciascun record selezionato, la derivata **7051010**.
Per l'individuazione dell'importo e del valore da attribuire al campo 08940 fare riferimento alla seguente tabella:

se TIPO_SCENARIO	Impostare 08940=	IMPORTO=
medio ²	700	$\sum_k WS_k$
basso	1000	K _b
medio	1030	K _b
alto	1060	K _b

Step 5 – generazione colonne 710, 1010, 1040 e 1070

- 1) Selezionare tutti i record della tabella **FRTB14 - POSIZIONE DI RISCHIO GIRR – VEGA - K_b** creata nella fase F87_2;

Generare, a partire da ciascun record selezionato, la derivata **7051010**.
Per l'individuazione dell'importo e del valore da attribuire al campo 08940 fare riferimento alla seguente tabella:

se TIPO_SCENARIO	Impostare 08940=	IMPORTO=
---------------------	---------------------	----------

² Scegliere convenzionalmente lo scenario medio in quanto il dato, che deve coincidere su tutti i record della tabella, va selezionato una sola volta.

medio ³	710	$\sum_k WS_k$
basso	1010	K _b
medio	1040	K _b
alto	1070	K _b

Step 6 – generazione colonne 800, 1020, 1050 e 1080

- 1) Selezionare tutti i record della tabella **FRTB16 - POSIZIONE DI RISCHIO GIRR – CURVATURA - K_b** creata nella fase F87_2;
- 2) Generare, a partire da ciascun record selezionato, la derivata **7051010**.
Per l'individuazione dell'importo e del valore da attribuire al campo 08940 fare riferimento alla seguente tabella:

se TIPO_SCENARIO	Impostare 08940=	IMPORTO=
medio ⁴	800	S _b
basso	1020	K _b
medio	1050	K _b
alto	1080	K _b

FASE C: TEMPLATE DA C 92.02 A C 92.06

³ Cfr nota 2.

⁴ Cfr nota 2.

Processo di calcolo

Di seguito è descritto il processo di generazione delle derivate previste dai template da C 92.02 a C 92.06.

Il processo di generazione si articola, salvo ove diversamente specificato, nelle seguenti fasi:

5. **Selezione dei record di origine**, dalle tabelle prodotte dalla fase F87_2, secondo le regole specifiche di ciascuno step;
6. **Determinazione della derivata da generare**, in funzione del valore della variabile **CATEGORIA** e, per il template C 92.02, della variabile **CLASSE_MER_CRED**, secondo le regole generali riportate di seguito;
7. **Determinazione dell'importo da utilizzare e valorizzazione del campo 08940**, secondo le regole specifiche di ciascuno step;
8. **Arricchimento della derivata**, mediante le valorizzazioni comuni riportate di seguito.

La derivata da generare è determinata, per ciascun template, in funzione del valore della variabile **CATEGORIA** e, per il template C 92.02, della variabile **CLASSE_MER_CRED**, presenti su ciascun record selezionato, sulla base delle regole riportate nella tabella seguente.

CATEGORIA	C 92.02	C 92.03	C 92.04	C 92.05	C 92.06
1	7052010	7053010	7054010	7055010	7056010
2	7052020	7053020	7054020	7055020	7056020
3	7052030	7053030	7054030	7055030	7056030
4	7052040	7053040	7054040	7055040	7056060
5	7052050	7053050	7054050	7055050	7056070
6	7052060	7053060	7054060	7055060	7056080
7	7052070	7053070	7054070	7055070	7056090
8	7052080	7053080	7054080	7055080	7056100
9	7052090	7053090	7054090	7055090	7056110
10	7052100 7052110 ⁵	7053100	7054100	7055100	7056120
11	7052120	7053110	7054110	7055110	7056130
12	7052130	7053120	7054120	7055120	7056040

⁵ Se CLASSE_MER_CRED=2,3

13	7052140	7053130	7054130	7055130	7056050
14	7052150	7053140	7054140	/	/
15	7052160	7053150	7054150	/	/
16	7052170	7053160	7054160	/	/
17	7052180	7053170	7054170	/	/
18	7052190	7053180	7054180	/	/
19	7052200	7053190	/	/	/
20	7052210	7053200	/	/	/
21	/	7053210	/	/	/
22	/	7053220	/	/	/
23	/	7053230	/	/	/
24	/	7053240	/	/	/
25	/	7053250	/	/	/

Ciascuna derivata deve essere arricchita mediante le seguenti valorizzazioni:

00003=1 00004=1 00005=3 08909RA, 08910RB, 08920RE, 08930RB, 08940RA, 08950RA, 08960RA, 08998='M'

Le regole specifiche di selezione dei record di origine e di valorizzazione dell'importo e del campo 08940 sono riportate nei singoli step.

Step 1 – generazione colonne da 100 a 140

Step 1.1 – template C 92.02-C 92.04 e C 92.06: valorizzazione in funzione di TENOR_DELTA

- 1) Per ciascuno dei template da generare, selezionare i record delle seguenti tabelle prodotte dalla fase F87_2 sulla base dello schema che segue:

TEMPLATE	TABELLA
----------	---------

C 92.02	FRTB21 - POSIZIONE DI RISCHIO CSRNonSec - DELTA
C 92.03	FRTB31 - POSIZIONE DI RISCHIO CSRSecNonACTP - DELTA
C 92.04	FRTB41 - POSIZIONE DI RISCHIO CSRSecACTP - DELTA
C 92.06	FRTB61 - POSIZIONE DI RISCHIO COMMODITY - DELTA

2) Generare, a partire da ciascun record selezionato, la derivata corrispondente al valore della variabile **CATEGORIA** (nonché della variabile **CLASSE_MER_CRED** per il template C 92.02) utilizzando l'importo S_k . Per l'individuazione del valore da attribuire al campo 08940 fare riferimento alla seguente tabella:

se TENOR_DELTA=	Impostare 08940=	
	C 92.02-C 92.04	C 92.06
0	n.a.	100
1	100	110
2	n.a.	120
3	110	130
4	n.a.	140
5	120	150
6	130	160
7	140	170

8	n.a.	180
9	n.a.	190
10	n.a.	200

Step 1.2 – template C 92.05: valorizzazione in funzione di FATT_RISC_EQUITY

- 1) Per generare il template, selezionare i record della tabella FRTB51 - POSIZIONE DI RISCHIO EQUITY - DELTA prodotta dalla fase F87_2;
- 2) Generare, a partire da ciascun record selezionato, la derivata corrispondente al valore della variabile **CATEGORIA** utilizzando l'importo S_k . Per l'individuazione del valore da attribuire al campo 08940 fare riferimento alla seguente tabella:

se FATT_RISC_EQUITY=	1	2
Impostare 08940=	100	110

Step 2 – generazione colonne da 250 a 290

- 1) Per ciascuno dei template da generare, selezionare i record delle tabelle prodotte dalla fase F87_2 sulla base del seguente schema:

TEMPLATE	TABELLA
C 92.02	FRTB23 - POSIZIONE DI RISCHIO CSRNonSec - VEGA

C 92.03	FRTB33 - POSIZIONE DI RISCHIO CSRSecNonACTP - VEGA
C 92.04	FRTB43 - POSIZIONE DI RISCHIO CSRSecACTP - VEGA
C 92.05	FRTB53 - POSIZIONE DI RISCHIO EQUITY – VEGA
C 92.06	FRTB63 - POSIZIONE DI RISCHIO COMMODITIES - VEGA

- 2) Generare, a partire da ciascun record selezionato, la derivata corrispondente al valore della variabile **CATEGORIA** (nonché della variabile **CLASSE_MER_CRED** per il template C 92.02) utilizzando l'importo S_k . Per l'individuazione del valore da attribuire al campo 08940 fare riferimento alla seguente tabella:

se TENOR_VEGA_OPZIONE=	1	2	3	4	5
Impostare 08940=	250	260	270	280	290

Step 3 – generazione colonne 600 e 610

- 1) Per ciascuno dei template da generare, selezionare i record delle tabelle prodotte dalla fase F87_2 sulla base del seguente schema:

TEMPLATE	TABELLA
C 92.02	FRTB25 - POSIZIONE DI RISCHIO CSRNonSec - CURVATURA
C 92.03	FRTB35 - POSIZIONE DI RISCHIO CSRSecNonACTP - CURVATURA

C 92.04	FRTB45 - POSIZIONE DI RISCHIO CSRSecACTP - CURVATURA
C 92.05	FRTB55 - POSIZIONE DI RISCHIO EQUITY - CURVATURA
C 92.06	FRTB65 - POSIZIONE DI RISCHIO COMMODITIES - CURVATURA

- 2) Generare, a partire da ciascun record selezionato, la derivata corrispondente al valore della variabile **CATEGORIA** (nonché della variabile **CLASSE_MER_CRED** per il template C 92.02). Per l'individuazione dell'importo e del valore da attribuire al campo 08940 fare riferimento alla seguente tabella:

IMPORTO=	CVR+TOT	CVR-TOT
Impostare 08940=	600	610

Step 4 – generazione colonne 700, 1000, 1030 e 1060

- 1) Per ciascuno dei template da generare, selezionare i record delle tabelle prodotte dalla fase F87_2 sulla base del seguente schema:

TEMPLATE	TABELLA
C 92.02	FRTB22 - POSIZIONE DI RISCHIO CSRNonSec - DELTA - K _b
C 92.03	FRTB32 - POSIZIONE DI RISCHIO CSRSecNonACTP - DELTA - K _b

C 92.04	FRTB42 - POSIZIONE DI RISCHIO CSRSecACTP - DELTA - K_b
C 92.05	FRTB52 - POSIZIONE DI RISCHIO EQUITY - DELTA - K_b
C 92.06	FRTB62 - POSIZIONE DI RISCHIO COMMODITY - DELTA - K_b

2) Generare, a partire da ciascun record selezionato, la derivata corrispondente al valore della variabile **CATEGORIA** (nonché della variabile **CLASSE_MER_CRED** per il template C 92.02). Per l'individuazione dell'importo e del valore da attribuire al campo 08940 fare riferimento alla seguente tabella:

se TIPO_SCENARIO	Impostare 08940=	IMPORTO=
medio ⁶	700	$\sum_k WS_k$
basso	1000	K_b
medio	1030	K_b
alto	1060	K_b

Step 5 – generazione colonne 710, 1010, 1040 e 1070

1) Per ciascuno dei template da generare, selezionare i record delle tabelle prodotte dalla fase F87_2 sulla base del seguente schema:

⁶ Cfr nota 2.

TEMPLATE	TABELLA
C 92.02	FRTB24 - POSIZIONE DI RISCHIO CSRNonSec – VEGA - K _b
C 92.03	FRTB34 - POSIZIONE DI RISCHIO CSRSecNonACTP - VEGA - K _b
C 92.04	FRTB44 - POSIZIONE DI RISCHIO CSRSecACTP - VEGA - K _b
C 92.05	FRTB54 - POSIZIONE DI RISCHIO EQUITY - VEGA - K _b
C 92.06	FRTB64 - POSIZIONE DI RISCHIO COMMODITIES – VEGA – K _b

2) Generare, a partire da ciascun record selezionato, la derivata corrispondente al valore della variabile **CATEGORIA** (nonché della variabile **CLASSE_MER_CRED** per il template C 92.02). Per l'individuazione dell'importo e del valore da attribuire al campo 08940 fare riferimento alla seguente tabella:

se TIPO_SCENARIO	Impostare 08940=	IMPORTO=
medio ⁷	710	$\sum_k WS_k$
basso	1010	K _b
medio	1040	K _b
alto	1070	K _b

⁷ Cfr nota 2.

Step 6 – generazione colonne 800, 1020, 1050 e 1080

- 1) Per ciascuno dei template da generare, selezionare i record delle tabelle prodotte dalla fase F87_2 sulla base del seguente schema:

TEMPLATE	TABELLA
C 92.02	FRTB26 - POSIZIONE DI RISCHIO CSRNonSec – CURVATURA - K _b
C 92.03	FRTB36 - POSIZIONE DI RISCHIO CSRSecNonACTP - CURVATURA - K _b
C 92.04	FRTB46 - POSIZIONE DI RISCHIO CSRSecACTP - CURVATURA - K _b
C 92.05	FRTB56 - POSIZIONE DI RISCHIO EQUITY - CURVATURA - K _b
C 92.06	FRTB66 - POSIZIONE DI RISCHIO COMMODITIES – CURVATURA - K _b

- 2) Generare, a partire da ciascun record selezionato, la derivata corrispondente al valore della variabile **CATEGORIA** (nonché della variabile **CLASSE_MER_CRED** per il template C 92.02). Per l'individuazione dell'importo e del valore da attribuire al campo 08940 fare riferimento alla seguente tabella:

se TIPO_SCENARIO	Impostare 08940=	IMPORTO=
medio ⁸	800	S _b
basso	1020	K _b

⁸ Cfr nota 2.

medio	1050	K _b
alto	1080	K _b

FASE D: TEMPLATE C 92.07.1 e C 92.07.2.

Processo di calcolo

Di seguito è descritto il processo di generazione della derivata 7057099 del template C 92.07.1 e della derivata 7058099 del template C 92.07.2.

Il processo di generazione si articola, salvo ove diversamente specificato, nelle seguenti fasi:

4. **Selezione dei record di origine**, dalle tabelle prodotte dalla fase F87_2, secondo le regole specifiche di ciascuno step;
5. **Determinazione dell'importo da utilizzare e valorizzazione del campo 08940**, secondo le regole specifiche di ciascuno step;
6. **Arricchimento della derivata**, mediante le valorizzazioni comuni riportate di seguito.

L'arricchimento della derivata deve avvenire mediante le seguenti valorizzazioni:

00003=1 00004=1 00005=3 08909RA, 08910RB, 08920RE, 08930RB, 08940RA, 08950RA, 08960RA, 08998='M'

Ciascun record prodotto dovrà essere corredato dalle informazioni relative alla valuta di denominazione e alla valuta di segnalazione presenti, rispettivamente, nelle colonne 1_VALUTA_CAMBIO e 2_VALUTA_CAMBIO di ciascuna tabella selezionata. Esse dovranno essere utilizzate per valorizzare le colonne 010 e 020 del template.

Le regole specifiche di selezione dei record di origine e di valorizzazione dell'importo e del campo 08940 sono riportate nei singoli step.

Step 1 – generazione colonna 100 del template C 92.07.1

- 1) Selezionare tutti i record della tabella **FRTB71 - POSIZIONE DI RISCHIO FX - DELTA** creata nella fase F87_2;
- 2) Generare, a partire da ciascun record selezionato, la derivata **7057099** utilizzando l'importo S_k e impostando il campo 08940 con il valore 100.

Step 2 – generazione colonne da 250 a 290 del template C 92.07.2

- 1) Selezionare tutti i record della tabella **FRTB73 - POSIZIONE DI RISCHIO FX - VEGA** creata nella fase F87_2;
- 2) Generare, a partire da ciascun record selezionato, la derivata **7058099** utilizzando l'importo S_k . Per l'individuazione del valore da attribuire al campo 08940 fare riferimento alla seguente tabella:

se TENOR_VEGA_OPZIONE=	1	2	3	4	5
Impostare 08940=	250	260	270	280	290

Step 3 – generazione colonne 600 e 610 del template C 92.07.1

- 1) Selezionare tutti i record della tabella **FRTB75 - POSIZIONE DI RISCHIO FX - CURVATURA** creata nella fase F87_2;
- 2) Generare, a partire da ciascun record selezionato, la derivata **7057099**. Per l'individuazione dell'importo e del valore da attribuire al campo 08940 fare riferimento alla seguente tabella:

IMPORTO=	CVR+TOT	CVR-TOT
Impostare 08940=	600	610

Step 4 – generazione colonne 700, 1000, 1030 e 1060 del template C 92.07.1

- 1) Selezionare tutti i record della tabella **FRTB72 - POSIZIONE DI RISCHIO FX – DELTA - K_b** creata nella fase F87_2;
- 2) Generare, a partire da ciascun record selezionato, la derivata **7057099**.
Per l'individuazione dell'importo e del valore da attribuire al campo 08940 fare riferimento alla seguente tabella:

se TIPO_SCENARIO	Impostare 08940=	IMPORTO=
medio ⁹	700	$\sum_k WS_k$
basso	1000	K _b
medio	1030	K _b
alto	1060	K _b

Step 5 – generazione colonne 710, 1010, 1040 e 1070 del template C 92.07.2

- 1) Selezionare tutti i record della tabella **FRTB74 - POSIZIONE DI RISCHIO FX – VEGA - K_b** creata nella fase F87_2;

⁹ Cfr nota 2.

- 2) Generare, a partire da ciascun record selezionato, la derivata **7058099**.
Per l'individuazione dell'importo e del valore da attribuire al campo 08940 fare riferimento alla seguente tabella:

se TIPO_SCENARIO	Impostare 08940=	IMPORTO=
medio ¹⁰	710	$\sum_k WS_k$
basso	1010	K _b
medio	1040	K _b
alto	1070	K _b

Step 6 – generazione colonne 800, 1020, 1050 e 1080 del template C 92.07.1

- 3) Selezionare tutti i record della tabella **FRTB76 - POSIZIONE DI RISCHIO GIRR – CURVATURA - K_b** creata nella fase F87_2;
- 4) Generare, a partire da ciascun record selezionato, la derivata **7057099**.
Per l'individuazione dell'importo e del valore da attribuire al campo 08940 fare riferimento alla seguente tabella:

se TIPO_SCENARIO	Impostare 08940=	IMPORTO=
medio ¹¹	800	S _b
basso	1020	K _b
medio	1050	K _b

¹⁰ Cfr nota 2.

¹¹ Cfr nota 2.

alto	1080	K_b
------	------	-------