

F87**FRTB
METODO STANDARDIZZATO ALTERNATIVO (A-SA)**

Tipo intermediario	Data pubblicazione	Data inizio validità	Data fine validità
B	2026 05 06	2027 01 01	9999 99 99

Generalità

Il requisito di fondi propri per i rischi di mercato nell'ambito del metodo standardizzato alternativo (FRTB) deve essere determinato come somma di tre componenti:

- Il requisito di fondi propri nell'ambito del metodo delle sensibilità;
- Il requisito di fondi propri per il rischio di default;
- Il requisito di fondi propri per i rischi residui.

La presente funzione documenta il calcolo dei primi due requisiti¹. A tal fine devono essere eseguite le seguenti fasi:

REQUISITO DI FONDI PROPRI NELL'AMBITO DEL METODO DELLE SENSIBILITA':**F87_1 – CREAZIONE TABELLE DA INPUT E DA TCOR075 (FRTB-A-SA – METODO BASATO SULLE SENSIBILITA')****F87_2 – CALCOLO REQUISITI DI FONDI PROPRI PER RISCHI DI MERCATO (FRTB-A-SA – METODO BASATO SULLE SENSIBILITA')****REQUISITO DI FONDI PROPRI PER IL RISCHIO DI DEFAULT:****F87_3 – CALCOLO REQUISITI DI FONDI PROPRI PER RISCHI DI MERCATO (FRTB-A-SA – RISCHIO DI DEFAULT)**

La generazione dei template relativi al rischio di default e ai rischi residui è documentata nel database. Per generare i template da C91.01 a C92.07 relativi

¹ Il calcolo del requisito per rischi residui viene documentato nella fase di generazione all'interno del database.

al metodo delle sensibilità deve essere eseguita la seguente funzione:

F87_4 – GENERAZIONE TEMPLATE DA C91.01 A C92.01 (FRTB-A-SA – METODO BASATO SULLE SENSIBILITA')²

² La fase F87_4 sarà resa disponibile nelle successive pubblicazioni.