

F87_1

CREAZIONE TABELLE DA INPUT E DA TCOR075 (FRTB-A-SA)

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

Generalità

La fase ha lo scopo di creare, a partire dai dati di input e da quelli presenti nella tabella di corredo TCOR075 le tabelle utili per calcolare, nella successiva fase F87_2, il requisito di fondi propri per il rischio di mercato derivante dall'applicazione del metodo standardizzato alternativo o A-SA secondo le disposizioni del CRR3.

La fase deve essere eseguita post ACA e post funzioni F27.XX necessarie al calcolo delle esposizioni in stato di default.

Processo di calcolo

Accedere a TCOR050 – PANNELLO GUIDA DELLE SCELTE AZIENDALI e se ASSOGG_RMERCATO uguale a 0 (SI) e se FRTB_MET_ASA uguale a 1, eseguire in sequenza le seguenti fasi elaborative:

- **FASE A: CREAZIONE TABELLE FRTB01 - DATI DA TCOR075**
- **FASE B: CREAZIONE TABELLA FRTB02 – DATI DA INPUT**
- **FASE C: CALCOLO PARAMETRI NELLA FRTB02**
- **FASE D: ARRICCHIMENTO TABELLA FRTB01 da FRTB02**

A) FASE A: CREAZIONE TABELLE FRTB01 - DATI DA TCOR075

Dai record della TCOR075 creare la tabella FRTB01 - DATI PER FRTB secondo le seguenti regole:

- a) Se l'attributo di TCOR050 "FRTB - METODO STANDARDIZZATO ALTERNATIVO o A-SA" è pari a 1,2 impostare le colonne della tabella FRTB01 a partire dalle informazioni presenti nella TCOR075 come di seguito indicato:

FRTB01	TCOR075
ID_ITEM	ID_ITEM
PROGR	PROGR
ASSET_CLASS	ASSET_CLASS
TIPO_REQ	TIPO_REQ
CATEGORIA ¹	CATEGORIA
FATT_RISC_CURVA	FATT_RISC_CURVA
FATT_RISC_EQUITY	FATT_RISC_EQUITY
ADD-ON_GIRR	ADD-ON_GIRR
TENOR_DELTA	TENOR_DELTA
SENS_DELTA	SENS_DELTA
TENOR_VEGA_OPZIONE	TENOR_VEGA_OPZIONE
TENOR_VEGA_SOTT_OPZIONE	TENOR_VEGA_SOTT_OPZIONE
SENS_VEGA	SENS_VEGA
CVRk+	CVRk+
CVRk-	CVRk-

- b) Se l'attributo di TCOR050 "FRTB - METODO STANDARDIZZATO ALTERNATIVO o A-SA" è pari a 2 impostare, in aggiunta alle colonne del punto a), anche le seguenti colonne della tabella FRTB01:

¹ Solo nel caso in cui ASSET_CLASS=4

FRTB01	TCOR075
COD_TITOLO	COD_TITOLO
CATEGORIA ²	CATEGORIA
CLASSE_MER_CRED	CLASSE_MER_CRED
COD_VALUTA	COD_VALUTA
1_VALUTA_CAMBIO	1_VALUTA_CAMBIO
2_VALUTA_CAMBIO	2_VALUTA_CAMBIO
TIPO_MERCE	TIPO_MERCE
LUOGO_CONS_MERCE	LUOGO_CONS_MERCE
GRADO_SENIORITY	GRADO_SENIORITY

² Per tutte le ASSET_CLASS (ad eccezione dei valori 1-GIRR e 7 FX).

FASE B: CREAZIONE TABELLA FRTB02 – DATI DA INPUT

Se l'attributo di TCOR050 "FRTB - METODO STANDARDIZZATO ALTERNATIVO o A-SA" è pari a 1 creare la tabella FRTB02 con le seguenti variabili in colonna: ID_ITEM⁴, 00007, 00016, 00032, 00138, 00143, 00154, 00163, 00338, 00348, 00370, 00525, 05508, 05667, 05370, 02168, 05315, 05567, 05713, 05706, 05720, 05721, 05781, 05576, 05839, 05873, 05278, 05760, 05579, 05588

selezionando le seguenti FTO che hanno il campo 00335=0 oppure 00377=0,2 (per le FTO dei derivati):

- 01063.02/11/77/78/79/80/81/84/85/86/98/99, 01079.02, 01064.02, 01535.40/51/61 (con 05766=0), 01543.61/81 (con 05766=0), 01555.12/22
- 01568.02/06
- 01593.01/05 e le 01593.98/99 ad esse collegate
- 01594.01 e la 01594.05 con la 01594.99 ad essa collegata
- 01595.01/05 e le 01595.98/99 ad esse collegate
- 01597.01/05/09/13/17
- 03904.02/04/06/08
- 03941.01/03/05/07/11.

FASE C: CALCOLO PARAMETRI NELLA FRTB02

Accedere alla tabella FRTB02 selezionare tutti record ed eseguire i seguenti step.

⁴ Tale campo deve essere definito a cura aziendale e deve garantire il collegamento con le informazioni rappresentate nelle tabelle di corredo TCOR062 e TCOR075.

STEP A: Calcolo della colonna “COD_VALUTA”

Nella tabella FRTB02 creare la colonna “**COD_VALUTA**”. Selezionare tutti i record della tabella e per ogni record compilare la nuova colonna con i dati presenti nella colonna 00007.

STEP B: Calcolo delle colonne “1_VALUTA_CAMBIO”, “2_VALUTA_CAMBIO”

Nella tabella FRTB02 creare le nuove colonne “**1_VALUTA_CAMBIO**”, “**2_VALUTA_CAMBIO**”.

Selezionare tutti i record della tabella FRTB02 e per ogni record impostare le colonne “1_VALUTA_CAMBIO” e “2_VALUTA_CAMBIO” nel seguente modo:

a) se FTO 01597.01:

- impostare la colonna “1_VALUTA_CAMBIO” pari a 00154;
- impostare la colonna “2_VALUTA_CAMBIO” pari a 00163.

b) altrimenti:

- impostare la colonna “1_VALUTA_CAMBIO” pari a EUR;
- impostare la colonna “2_VALUTA_CAMBIO” pari a 00007.

STEP C: Calcolo della “TIPO_SCOMP”

Selezionare dalla tabella FRTB02 tutti i record e impostare la colonna "TIPO_SCOMP" con le seguenti regole⁵:

- a) 01595.01/05 con colonna 00370 = 1 (indici scomposti) e 05579=1 imposta "TIPO_SCOMP" uguale a 13.
- b) 01595.01/05 con colonna 00370 = 1 (indici scomposti) e 05579=0 imposta "TIPO_SCOMP" uguale a 11
- c) 01595.01/05 con colonna 00370 <> 0,1 (indici non scomposti) imposta "TIPO_SCOMP" uguale a 11.
- d) 01595.98/99 con colonna 00370 > 9 e 05579=1 imposta "TIPO_SCOMP" uguale a 1.
- e) 01595.98/99 con colonna 00370 > 9 e 05579=0 imposta "TIPO_SCOMP" uguale a 2.
- f) 01593.01/05 e 05370=1 (cap e floor) imposta "TIPO_SCOMP" uguale a 13
- g) 01593.98/99 e 05370=1 imposta "TIPO_SCOMP" uguale a 5 (cap e floor)
- h) 01535.40/51/61 e 01543.61/81/83 e (01593.01/05 con 05370<>1) con 05315 diverso da 30 e 31 e variabile 00143=03,04,05,06 (contratti con scambio di capitale) e campo 00032 presente e significativo e "TIPOLOGIA

⁵ Il dominio del campo è il seguente:

0 = NESSUNA PARTICOLARITA';

1 = SINGOLO ELEMENTI DEGLI INDICI;

2 =SINGOLO ELEMENTO DEGLI INDICI SOLO PER DELTA E CURVATURA;

3 = QUOTE DI OICR - METODO LTA – SINGOLO ELEMENTO SOTTOSTANTE

4 = QUOTE DI OICR - UNICA POSIZIONE IN STRUMENTI DI CAPITALE.

5 = CAP E FLOOR

6 = DERIVATI SU CREDITO – INDICI

7 = DERIVATI SU CREDITO – SINGLE NAME

10 = ATTIVITA' SOTTOSTANTI IN TITOLI DEBITO

11 = INDICI NON SCOMPOSTI

12 = INDICI NON SCOMPOSTI SOLO VEGA

13 = DA NON PROCESSARE

TITOLO <> 07, 21, 22 e 25 e campo 00138 uguale a zero imposta "TIPO_SCOMP" uguale a 13;

- i) 01063.98/99: imposta "TIPO_SCOMP" uguale a 10.
- j) 01063.02/11 campo 05873 <> 0, 01535.40/51/61, 01543.61/81/83 e 01595.01/05 con campo 05278 <> 0:
 - con campo 05873 = 2 imposta "TIPO_SCOMP" uguale a 13 (LTA da sottostanti);
 - con campo 05873 = 1 imposta "TIPO_SCOMP" uguale a 13 (MBA);
 - con campo 05873 = 11 imposta "TIPO_SCOMP" uguale a 4 (unica posizione)
- k) Se 01063.77/78/79/80/81/84/85/86 e 03941.01/03/05/07/11:
 - se colonna 00032 presente e significativa accedi a TCOR28 e se attributo "INDICE AZIONARIO" pari a 1,2 imposta "TIPO_SCOMP" uguale a 11
 - altrimenti imposta "TIPO_SCOMP" uguale a 3
- l) 01594.01/05/98/99:
 - se campo 05508 = 0,4 imposta "TIPO_SCOMP" uguale a 7 (derivati su credito – single name)
 - se campo 05508 = 5,6 imposta "TIPO_SCOMP" uguale a 6 (derivati su credito - indici)
- m) per tutte le condizioni diverse dai i punti precedenti:
 - se con colonna 00032 presente e significativo accedi a TCOR28 e se attributo "INDICE AZIONARIO" pari a 1,2 imposta "TIPO_SCOMP" uguale a 11
 - altrimenti imposta "TIPO_SCOMP" uguale a 0.

A valle scrivere nella tabella FRTB02 del record in lavorazione la seguente nuova colonna contenenti i risultati dei calcoli precedenti: **“TIPO_SCOMP”**.

Non sottoporre ai trattamenti successivi i record con TIPO_SCOMP=13.

STEP D: Calcolo della colonna “STATO_MEMBRO”

Selezionare dalla tabella FRTB02 tutti i record e per ogni record con colonna 00016 accedi a TCOR06 e impostare la nuova colonna **“STATO_MEMBRO”** con le seguenti regole:

- a) se attributo “APPARTENENZA_UME” = 1 imposta “STATO_MEMBRO” pari a 1 (PAESI UME);
- b) se attributo “APPARTENENZA_UME” = 0 e attributo “COD_ZONA_BIL_GR” = 2 imposta “STATO_MEMBRO” pari a 2 (PAESI UE NON UME);
- c) se condizioni diverse dalle precedenti, imposta “STATO_MEMBRO” pari a 0.

STEP E: Calcolo delle colonne “SEZIONE_ATECO” e “DIVISIONE_ATECO”

Selezionare dalla tabella FRTB02 tutti i record e per ogni record con il contenuto della colonna 02168 accedere a TCOR133 e impostare le nuove colonne **“DIVISIONE_ATECO”** e **“SEZIONE_ATECO”** in base ai valori contenuti nelle variabili **“DIVISIONE_ATECO2025”** e **“SEZIONE_ATECO2025”** di TCOR133.

STEP F della colonna “MAX_INV_GRADE”

A parità di colonne “1°chiave_abbinamento” e “2°chiave_abbinamento”, selezionare dalla tabella FRTB02 tutti i record di 01594.98/99 e impostare la nuova colonna **“MAX_INV_GRADE”** in base alle seguenti regole:

- a) contare il n° di record che presentano il campo 05839=1 e memorizzarlo nel COMODO_GRADE_SI;

- b) contare il n° di record che presentano il campo 05839=0 oppure il campo 05721=98 e memorizzarlo nel COMODO COMODO_GRADE_NO;
- c) confrontare i due COMODI calcolati ai punti precedenti e se quello del punto a) risulta maggiore del punto b) impostare la colonna MAX_INV_GRADE pari a 1 (SI) altrimenti pari a 0 (NO).

STEP G: Calcolo delle colonne “TIPO_MERCE” e “LUOGO_CONS_MERCE”

Selezionare dalla tabella FRTB02 i record di 01597.13/17 e, per ogni record, con campo 00525 accedere a TCOR42 e impostare sulla base degli omonimi attributi, le seguenti nuove colonne:

- a) “TIPO_MERCE”;
- b) “LUOGO_CONS_MERCE”.

STEP H: Calcolo della colonna “COD_TITOLO”

Selezionare tutti i record della tabella FRTB02 e impostare la nuova colonna “COD_TITOLO” della FRTB02 con il valore della variabile 00032.

STEP I: Calcolo della colonna “GRADO_SENIORITY”

Selezionare tutti i record della tabella FRTB02 e impostare la nuova colonna “GRADO_SENIORITY” della FRTB02 con il valore della variabile 05713.

STEP L: Calcolo della colonna “CLASSE_MER_CRED”

Selezionare tutti i record della tabella FRTB02 con 05706=63 e impostare la nuova colonna “CLASSE_MER_CRED” della FRTB02 con il valore 1 se 05721=1,21, con il valore 2 se 05721=2,22 e con il valore se 05721=3,23.