



**REGOLAMENTO DI ESECUZIONE (UE) 2025/379 DELLA COMMISSIONE**

**del 26 febbraio 2025**

**che modifica le norme tecniche di attuazione stabilite nel regolamento di esecuzione (UE) 2016/2070 della Commissione per quanto riguarda i portafogli di riferimento, i modelli e le istruzioni per la presentazione delle informazioni da applicare nell'Unione per le comunicazioni di cui all'articolo 78, paragrafo 2, della direttiva 2013/36/UE del Parlamento europeo e del Consiglio**

(Testo rilevante ai fini del SEE)

LA COMMISSIONE EUROPEA,

visto il trattato sul funzionamento dell'Unione europea,

vista la direttiva 2013/36/UE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 26 giugno 2013, sull'accesso all'attività degli enti creditizi e sulla vigilanza prudenziale sugli enti creditizi, che modifica la direttiva 2002/87/CE e abroga le direttive 2006/48/CE e 2006/49/CE <sup>(1)</sup>, in particolare l'articolo 78, paragrafo 8, terzo comma,

considerando quanto segue:

- (1) A norma dell'articolo 78, paragrafo 1, della direttiva 2013/36/UE, gli enti autorizzati a utilizzare i metodi interni sono tenuti a presentare alla rispettiva autorità competente, con una frequenza adeguata e almeno una volta all'anno, i risultati dei calcoli degli importi delle esposizioni ponderati per il rischio o dei requisiti di fondi propri nell'ambito dei loro metodi interni per le esposizioni o le posizioni incluse nei portafogli di riferimento, al fine di consentire a tale autorità competente di valutare la qualità di tali metodi interni («esercizio di analisi comparativa»). A norma dell'articolo 78, paragrafo 3, secondo comma, della medesima direttiva, l'Autorità bancaria europea (ABE) deve elaborare una relazione per assistere le autorità competenti nella valutazione della qualità dei metodi interni degli enti, sulla base dei risultati dell'esercizio di analisi comparativa. Gli obblighi di segnalazione per l'esercizio di analisi comparativa sono specificati nel regolamento di esecuzione (UE) 2016/2070 della Commissione <sup>(2)</sup>, modificato più volte. Per tenere conto dei cambiamenti nell'orientamento delle valutazioni delle autorità competenti e delle relazioni dell'ABE, e alla luce delle modifiche legislative nel settore del rischio di mercato, è necessario aggiornare nuovamente i portafogli di riferimento, unitamente agli obblighi di segnalazione stabiliti in tale regolamento di esecuzione.
- (2) Per l'analisi comparativa del rischio di credito, le istruzioni dovrebbero essere modificate per specificare la natura obbligatoria della segnalazione dei parametri di rischio relativi alla probabilità di default (PD) e alla perdita in caso di default (LGD) per quanto riguarda le componenti del margine di cautela (MoC), della maggiorazione regolamentare e della recessione (DWT), che possono essere una fonte di variabilità nei modelli. È inoltre opportuno specificare che gli enti sono tenuti a segnalare l'identificativo dei modelli assegnato dall'autorità competente, semplificando da un punto di vista operativo l'assegnazione dei dati segnalati.
- (3) Il regolamento delegato (UE) 2024/2795 della Commissione <sup>(3)</sup> ha rinviato la data di applicazione dei nuovi requisiti di fondi propri per il rischio di mercato. I modelli per l'attuale metodo dei modelli interni non sono pertanto sostituiti per questo esercizio. I modelli per la convalida del metodo standardizzato dovrebbero essere invece ampliati per includere portafogli aggiuntivi rispetto all'esercizio 2024, nel quale rientravano solo gli strumenti correlati a tassi di interesse. L'obiettivo è garantire una vigilanza adeguata e un'agevole attuazione del nuovo metodo standardizzato, utilizzato per il calcolo dell'output floor.

<sup>(1)</sup> GU L 176 del 27.6.2013, pag. 338, ELI: <http://data.europa.eu/eli/dir/2013/36/oj>.

<sup>(2)</sup> Regolamento di esecuzione (UE) 2016/2070 della Commissione, del 14 settembre 2016, che stabilisce le norme tecniche di attuazione per i modelli, le definizioni e le soluzioni IT che gli enti sono tenuti ad applicare nella presentazione di informazioni all'Autorità bancaria europea e alle autorità competenti in conformità all'articolo 78, paragrafo 2, della direttiva 2013/36/UE del Parlamento europeo e del Consiglio (GU L 328 del 2.12.2016, pag. 1, ELI: [http://data.europa.eu/eli/reg\\_impl/2016/2070/oj](http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2016/2070/oj)).

<sup>(3)</sup> Regolamento delegato (UE) 2024/2795 della Commissione, del 24 luglio 2024, che modifica il regolamento (UE) n. 575/2013 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda la data di applicazione dei requisiti di fondi propri per il rischio di mercato (GU L, 2024/2795, 31.10.2024, ELI: [http://data.europa.eu/eli/reg\\_del/2024/2795/oj](http://data.europa.eu/eli/reg_del/2024/2795/oj)).

- (4) È pertanto opportuno modificare di conseguenza il regolamento di esecuzione (UE) 2016/2070.
- (5) Il presente regolamento si basa sui progetti di norme tecniche di attuazione che l'ABE ha presentato alla Commissione.
- (6) L'ABE ha condotto consultazioni pubbliche aperte sui progetti di norme tecniche di attuazione sui quali è basato il presente regolamento, ha analizzato i potenziali costi e benefici collegati e ha chiesto il parere del gruppo delle parti interessate nel settore bancario istituito ai sensi dell'articolo 37 del regolamento (UE) n. 1093/2010 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(4)</sup>,

HA ADOTTATO IL PRESENTE REGOLAMENTO:

#### *Articolo 1*

Il regolamento di esecuzione (UE) 2016/2070 è così modificato:

- 1) l'allegato IV è sostituito dal testo di cui all'allegato I del presente regolamento;
- 2) l'allegato V è sostituito dal testo di cui all'allegato II del presente regolamento;
- 3) l'allegato VI è sostituito dal testo di cui all'allegato III del presente regolamento;
- 4) l'allegato VII è sostituito dal testo di cui all'allegato IV del presente regolamento;
- 5) l'allegato X è sostituito dal testo di cui all'allegato V del presente regolamento.

#### *Articolo 2*

Il presente regolamento entra in vigore il ventesimo giorno successivo alla pubblicazione nella *Gazzetta ufficiale dell'Unione europea*.

Il presente regolamento è obbligatorio in tutti i suoi elementi e direttamente applicabile in ciascuno degli Stati membri.

Fatto a Bruxelles, il 26 febbraio 2025

*Per la Commissione*  
*La presidente*  
Ursula VON DER LEYEN

---

<sup>(4)</sup> Regolamento (UE) n. 1093/2010 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 24 novembre 2010, che istituisce l'Autorità europea di vigilanza (Autorità bancaria europea), modifica la decisione n. 716/2009/CE e abroga la decisione 2009/78/CE della Commissione (GU L 331 del 15.12.2010, pag. 12, ELI: <http://data.europa.eu/eli/reg/2010/1093/oj>).

*ALLEGATO I*

## «ALLEGATO IV

**RISULTATI DEI PORTAFOGLI DI RIFERIMENTO A FINI DI VIGILANZA****PARTE I: ISTRUZIONI DI CARATTERE GENERALE****PARTE II: ISTRUZIONI RELATIVE AI MODELLI**

C 101 - Dettagli sulle esposizioni nei Low default portfolios (LDP) per controparte

C 102 - Dettagli sulle esposizioni nei Low default portfolios (LDP)

C 103 - Dettagli sulle esposizioni negli High default portfolios (HDP)

C 105.01 – Definizione dei modelli interni

C 105.02 – Corrispondenza tra modelli interni e portafogli

C 105.03 – Corrispondenza tra modelli interni e paesi

**PARTE I: ISTRUZIONI DI CARATTERE GENERALE**

1. Le informazioni sono fornite solo per le controparti e i portafogli per i quali alla data di riferimento esiste un'esposizione effettiva sotto forma di esposizione originaria o di esposizione dopo CRM (attenuazione del rischio di credito). Le controparti e i portafogli per i quali alla data di riferimento non esiste esposizione non sono oggetto di segnalazione.
2. Le informazioni sono fornite solo per le esposizioni per le quali l'autorità competente ha approvato un modello interno per il calcolo degli importi delle esposizioni ponderati per il rischio (RWA). Nel modello C 101 non sono segnalati i codici di controparte che terminano con "STDA". Per i codici di controparte restanti del modello C 101 dell'allegato I e per i portafogli di riferimento di cui ai modelli C 102 e C 103 sono escluse le esposizioni trattate secondo il metodo standardizzato e le esposizioni per le quali l'autorità competente pertinente ha autorizzato in via temporanea o permanente l'utilizzo parziale del metodo standardizzato.
3. Le caselle riguardanti informazioni non applicabili o mal definite devono essere lasciate in bianco oppure è inserita la dicitura "NULL". Lo stesso vale per i quantitativi ponderati per l'EAD o i parametri che non possono essere calcolati. Analogamente, i campi di dati la cui segnalazione non è obbligatoria possono essere lasciati in bianco o presentati come "NULL". Indicare valori pari a zero solo se l'intenzione è di indicare effettivamente un quantitativo o parametro pari a zero. Non lasciare la casella in bianco né indicare "NULL" per comunicare quantitativi o parametri pari a zero.
4. Gli importi monetari sono indicati come per il calcolo dei requisiti di fondi propri a una specifica data di riferimento come previsto dal regolamento di esecuzione (UE) 2021/451 della Commissione <sup>(1)</sup>.

---

<sup>(1)</sup> Regolamento di esecuzione (UE) 2021/451 della Commissione, del 17 dicembre 2020, che stabilisce norme tecniche di attuazione per l'applicazione del regolamento (UE) n. 575/2013 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le segnalazioni degli enti a fini di vigilanza e che abroga il regolamento di esecuzione (UE) n. 680/2014 (GU L 97 del 19.3.2021, pag. 1, ELI: [http://data.europa.eu/eli/reg\\_impl/2021/451/oj](http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2021/451/oj)).

PARTE II: ISTRUZIONI RELATIVE AI MODELLI

**C 101 - Dettagli sulle esposizioni nei Low default portfolios (LDP) per controparte**

Sono escluse le esposizioni da finanziamenti specializzati.

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0010	Codice della controparte	Modello C 101, colonna 0010, dell'allegato I	È indicato il codice della controparte, di cui al modello C 101, colonna 0010, dell'allegato I, assegnato alla controparte compresa nel campione di Low default portfolios ("LDP"). Tale codice è un identificativo di riga ed è unico per ogni riga del modello.
0020	Classe di esposizione	Allegato II, punto 76, del regolamento di esecuzione (UE) 2021/451	Ogni controparte è classificata in una delle seguenti classi di esposizioni: a) banche centrali e amministrazioni centrali; b) enti; c) imprese - PMI (piccole e medie imprese); d) imprese - finanziamenti specializzati; e) imprese - altro; f) settore al dettaglio - garantite da beni immobili, PMI; g) settore al dettaglio - garantite da beni immobili, non PMI; h) settore al dettaglio - rotative qualificate; i) settore al dettaglio - altro, PMI; j) settore al dettaglio - altro, non PMI; k) non applicabile. Utilizzare la menzione "non applicabile" quando nessuna delle risposte indicate nell'elenco è corretta; è questo il caso in cui le esposizioni verso una controparte sono classificate in diverse classi di esposizioni, nessuna delle quali è chiaramente prevalente.
0040	Rating		È segnalato il grado del rating interno assegnato alla controparte all'interno della scala di rating interna applicabile dell'ente. Deve seguire l'ordine numerico 1, 2, 3 ecc., dal rischio più basso al rischio più elevato, esclusi i default con PD corrispondente al 100 %.  Se un ente utilizza una scala continua di rating conformemente all'articolo 169, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 575/2013 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(2)</sup> , si utilizzano le classi di rating indicate nella colonna 0005 del modello C 08.02 dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2021/451.  Se le esposizioni verso una controparte sono state assegnate a più classi di rating conformemente all'articolo 172, paragrafo 1, lettera e), punto i) o iii), del regolamento (UE) n. 575/2013, è segnalata la classe di rating zero (0).

<sup>(2)</sup> Regolamento (UE) n. 575/2013 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 26 giugno 2013, relativo ai requisiti prudenziali per gli enti creditizi e le imprese di investimento e che modifica il regolamento (UE) n. 648/2012 (GU L 176 del 27.6.2013, pag. 1, ELI: <http://data.europa.eu/eli/reg/2013/575/oj>).

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0050	Data del rating più recente della controparte		Indicare la data del rating più recente della controparte.
0060	PD	Modello C 08.01, colonna 0010, dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2021/451	È segnalata la PD assegnata alla controparte. La PD è quella utilizzata per il calcolo dell'RWA, escludendo gli effetti delle misure adottate a norma dell'articolo 458 del regolamento (UE) n. 575/2013. La PD è espressa da un valore compreso tra 0 e 1.
0070	Status in relazione al default		È segnalato lo stato in materia di default della controparte. Si tratta di uno dei seguenti a norma dell'articolo 178 del regolamento (UE) n. 575/2013: a) in stato di default; b) non in stato di default.
0080	Esposizione originaria prima dell'applicazione dei fattori di conversione	Modello C 08.01, colonna 0020, dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2021/451	Indicare il valore dell'esposizione originaria prima di tener conto delle rettifiche di valore, degli accantonamenti, degli effetti dovuti alle tecniche di attenuazione del rischio di credito o dei fattori di conversione.
0090	Esposizione dopo gli effetti di sostituzione dell'attenuazione del rischio di credito prima dell'applicazione dei fattori di conversione	Modello C 08.01, colonna 0090, dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2021/451	Si comunica l'importo al quale si applicano fattori di conversione del credito (CCF) al fine di determinare l'EAD (colonna 0110). A tal fine tenere conto delle tecniche di attenuazione del rischio di credito con effetti di sostituzione sull'esposizione.
0100	CCF	Articolo 166, paragrafo 8, del regolamento (UE) n. 575/2013	Indicare le media ponderata dei CCF. I fattori di ponderazione da utilizzare sono gli importi ai quali sono applicati i CCF per determinare l'EAD.  Per le controparti aventi unicamente linee (facility) per gli elementi di cui all'articolo 166, paragrafo 8, del regolamento (UE) n. 575/2013, la media ponderata segnalata dei CCF si basa su tutte le linee.  Per le controparti aventi unicamente linee (facility) che non rientrano tra gli elementi di cui all'articolo 166, paragrafo 8, del regolamento (UE) n. 575/2013, i CCF sono lasciati in bianco o è inserita la dicitura "NULL".

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
			<p>Per le controparti con linee (facility) corrispondenti agli elementi di cui all'articolo 166, paragrafo 8, del regolamento (UE) n. 575/2013 e linee che non rientrano tra gli elementi di cui all'articolo 166, paragrafo 8, del medesimo regolamento, la media ponderata segnalata del CCF si basa solo sulle linee corrispondenti agli elementi di cui all'articolo 166, paragrafo 8, del regolamento (UE) n. 575/2013. In particolare le linee corrispondenti ad elementi di cui all'articolo 166, paragrafo 10, del medesimo regolamento non sono considerate nel calcolo.</p> <p>Se l'ente applica stime interne dei CCF per gli elementi di cui all'articolo 166, paragrafo 8, del regolamento (UE) n. 575/2013, tali CCF sono utilizzati per calcolare la media ponderata dei CCF. Se l'ente non applica stime interne dei CCF per gli elementi di cui all'articolo 166, paragrafo 8, del regolamento (UE) n. 575/2013, si utilizzano i CCF regolamentari di cui all'articolo 166, paragrafo 8, del regolamento (UE) n. 575/2013.</p> <p>Il CCF è espresso da un valore compreso tra 0 e 1.</p>
0110	EAD	Modello C 08.01, colonna 0110, dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2021/451	Indicare il valore dell'esposizione.
0120	Valore delle garanzie	Modello C 08.01, colonne da 0150 a 0210, dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2021/451	Indicare il valore di mercato delle garanzie.
0130	LGD ipotetica di primo rango (senior) non garantita senza garanzia negativa	Articolo 161 del regolamento (UE) n. 575/2013	<p>Indicare le stime interne ipotetiche della perdita in caso di default (LGD) che l'ente applicherebbe alle esposizioni verso la controparte secondo quanto segue:</p> <p>(a) l'ambito di applicazione riguardo alle esposizioni è lo stesso del valore della LGD indicato nella colonna 0150;</p> <p>(b) le esposizioni sono di primo rango (senior) e non garantite;</p> <p>(c) non vigono clausole di garanzia negativa.</p> <p>Una clausola di garanzia negativa stipula che il debitore o l'emittente di debito non costituirà in pegno nessuna delle sue attività a favore di un terzo.</p>

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0140	LGD ipotetica di primo rango (senior) non garantita con garanzia negativa	Articolo 161 del regolamento (UE) n. 575/2013	<p>Indicare le stime interne ipotetiche della LGD che l'ente applicherebbe alle esposizioni verso la controparte secondo quanto segue:</p> <p>(a) l'ambito di applicazione riguardo alle esposizioni è lo stesso del valore della LGD indicato nella colonna 0150;</p> <p>(b) le esposizioni sono di primo rango (senior) e non garantite;</p> <p>(c) vige una clausola di garanzia negativa.</p> <p>Una clausola di garanzia negativa stipula che il debitore o l'emittente di debito non costituirà in pegno nessuna delle sue attività a favore di un terzo.</p>
0150	LGD	Modello C 08.01, colonne 0230 e 0240, dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2021/451	<p>È segnalata la media ponderata per l'EAD dei valori della LGD delle esposizioni verso la controparte.</p> <p>Le LGD sono quelle utilizzate per il calcolo degli RWA. Nello specifico, se l'ente ha ottenuto dall'autorità competente l'autorizzazione a utilizzare stime interne delle LGD, le LGD si basano sulle stime interne dell'ente, altrimenti le LGD si basano sui valori regolamentari della LGD tenendo conto dell'attenuazione del rischio applicabile.</p> <p>Sono incluse le LGD per i soggetti regolamentati di grandi dimensioni del settore finanziario e i soggetti finanziari non regolamentati.</p> <p>È escluso l'effetto delle misure adottate a norma dell'articolo 458 del regolamento (UE) n. 575/2013.</p> <p>La LGD è espressa da un valore compreso tra 0 e 1.</p>
0160	Durata	Modello C 08.01, colonna 0250, dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2021/451	Indicare la durata ponderata per l'EAD delle esposizioni verso la controparte. Il valore è espresso in numero di giorni.
0170	RWA	Modello C 08.01, colonna 0260, dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2021/451	È segnalato l'RWA dopo l'applicazione dei fattori di sostegno (fattori di sostegno alle PMI e alle infrastrutture). L'RWA non include l'effetto delle potenziali misure di cui all'articolo 458 del regolamento (UE) n. 575/2013.



### C 102 - Dettagli sulle esposizioni nei Low default portfolios (LDP)

Per i portafogli di cui all'allegato I con uno status in relazione alla garanzia diverso da "non applicabile", le seguenti informazioni possono essere omesse, se il modello approvato non consente di calcolare la LGD separatamente per la parte garantita e per quella non garantita dell'esposizione: LGD (colonna 0130), LGD senza misure di vigilanza (colonna 0131), LGD senza margine di cautela (MoC) e misure di vigilanza (colonna 0132), LGD senza MoC, misure di vigilanza e componente recessione (colonna 0133), importo della perdita attesa (colonna 0150) e RWA (colonna 0170).

Per portafogli con il metodo regolamentare "Criteri di assegnazione dei finanziamenti specializzati", le seguenti informazioni sono omesse: PD (colonna 0060), PD senza misure di vigilanza (colonna 0061), PD senza MoC e misure di vigilanza (colonna 0062), LGD (colonna 0130), LGD senza misure di vigilanza (colonna 0131), LGD senza MoC e misure di vigilanza (colonna 0132), LGD senza MoC, misure di vigilanza e componente recessione (colonna 0133).

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0010	ID del portafoglio	Modello C 102, colonna 0010, dell'allegato I	Indicare l'ID del portafoglio della colonna 0010 del modello C 102 dell'allegato I che definisce il portafoglio. Tale ID è un identificativo di riga ed è unico per ogni riga del modello. L'assegnazione delle esposizioni agli ID di portafoglio non è esclusiva: le esposizioni o parti di esposizioni sono segnalate nell'ambito di ciascun ID di portafoglio applicabile.
0040	Numero di debitori		Indicare il numero di debitori. Esso si basa sui debitori che hanno un valore strettamente positivo segnalato nella colonna 0080 o nella colonna 0090. Se si applica una piena sostituzione per effetto di una tecnica di attenuazione del rischio di credito, il debitore originario è aggiunto al "Numero di debitori" del suo portafoglio originario e il garante è aggiunto al "Numero di debitori" del portafoglio del garante.
0060	PD	Modello C 08.01, colonna 0010, dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2021/451	La PD è quella utilizzata per il calcolo dell'RWA, escludendo gli effetti delle eventuali misure adottate a norma dell'articolo 458 del regolamento (UE) n. 575/2013. Per i portafogli corrispondenti ad una singola classe o un singolo pool, indicare la PD assegnata alla specifica classe o allo specifico pool di debitori. Per i portafogli corrispondenti a un'aggregazione di classi o pool di debitori indicare la media ponderata per l'EAD delle PD assegnate alle esposizioni incluse nell'aggregazione. La PD è espressa da un valore compreso tra 0 e 1.
0061	PD senza misure di vigilanza		La PD senza misure di vigilanza è la PD basata sui requisiti degli articoli 179 e 180 del regolamento (UE) n. 575/2013, incluso il MoC aggiunto dall'ente ma escluse le misure imposte dalle autorità competenti (fattori moltiplicativi, maggiorazioni, soglie minime o misure simili che aumentano direttamente la PD).  Per i portafogli corrispondenti ad una singola classe o un singolo pool, occorre indicare la PD per tale classe che include il MoC ma non le misure di vigilanza. Per i portafogli corrispondenti a un'aggregazione di debitori di diverse classi o pool, indicare la media ponderata per l'EAD delle PD assegnate alle rispettive esposizioni che includono il MoC ma non le misure di vigilanza.  La PD senza misure di vigilanza è espressa da un valore compreso tra 0 e 1.  Qualora l'ente non sia in grado di isolare i pertinenti adeguamenti prudenziali, si applica la parte I, punto 3.

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0062	PD senza MoC e misure di vigilanza		<p>La PD senza MoC e misure di vigilanza è la PD che non include né il MoC aggiunto dall'ente a norma dell'articolo 179, paragrafo 1, lettera f), e dell'articolo 180, paragrafo 1, lettera e), del regolamento (UE) n. 575/2013, né l'effetto delle misure imposte dalle autorità competenti (fattori moltiplicativi, maggiorazioni, soglie minime o misure simili che aumentano direttamente la PD).</p> <p>Per i portafogli corrispondenti ad una singola classe o un singolo pool, occorre indicare la PD per tale classe senza il MoC e le misure di vigilanza. Per i portafogli corrispondenti a un'aggregazione di debitori di diverse classi o pool, indicare la media ponderata per l'EAD delle PD delle rispettive esposizioni senza i MoC e senza le misure di vigilanza.</p> <p>La PD senza MoC e misure di vigilanza è espressa da un valore compreso tra 0 e 1. Qualora l'ente non sia in grado di isolare i pertinenti adeguamenti prudenziali, si applica la parte I, punto 3.</p>
0080	Esposizione originaria prima dell'applicazione dei fattori di conversione	Modello C 08.01, colonna 0020, dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2021/451	Indicare il valore dell'esposizione originaria prima di tener conto delle rettifiche di valore, degli accantonamenti, degli effetti dovuti alle tecniche di attenuazione del rischio di credito o dei fattori di conversione.
0090	Esposizione dopo gli effetti di sostituzione dell'attenuazione del rischio di credito prima dell'applicazione dei fattori di conversione	Modello C 08.01, colonna 0090, dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2021/451	Indicare l'importo al quale si applicano fattori di conversione del credito (CCF) al fine di determinare l'EAD (colonna 0110). A tal fine tenere conto delle tecniche di attenuazione del rischio di credito con effetti di sostituzione sull'esposizione.
0100	CCF	Articolo 166, paragrafo 8, del regolamento (UE) n. 575/2013	<p>Indicare la media ponderata dei CCF. I fattori di ponderazione da utilizzare sono gli importi ai quali sono applicati i CCF per determinare l'EAD.</p> <p>Per i portafogli aventi unicamente linee (facility) per gli elementi di cui all'articolo 166, paragrafo 8, del regolamento (UE) n. 575/2013, la media ponderata segnalata dei CCF si basa su tutte le linee.</p> <p>Per i portafogli per i quali nessuna delle linee (facility) incluse rientra tra gli elementi di cui all'articolo 166 del regolamento (UE) n. 575/2013, il CCF è lasciato in bianco o è inserita la dicitura "NULL".</p> <p>Per i portafogli che includono linee (facility) corrispondenti agli elementi di cui all'articolo 166, paragrafo 8, del regolamento (UE) n. 575/2013 e linee che non rientrano tra gli elementi di cui all'articolo 166, paragrafo 8, del medesimo regolamento, la media ponderata segnalata del CCF si basa solo sulle linee corrispondenti agli elementi di cui all'articolo 166, paragrafo 8, del</p>

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
			<p>regolamento (UE) n. 575/2013. In particolare le linee corrispondenti ad elementi di cui all'articolo 166, paragrafo 10, del medesimo regolamento non sono considerate nel calcolo.</p> <p>Se l'ente applica stime interne dei CCF per gli elementi di cui all'articolo 166, paragrafo 8, del regolamento (UE) n. 575/2013, tali CCF sono utilizzati per calcolare la media ponderata dei CCF. Se l'ente non applica stime interne dei CCF per gli elementi di cui all'articolo 166, paragrafo 8, del regolamento (UE) n. 575/2013, si utilizzano i CCF regolamentari di cui all'articolo 166, paragrafo 8, del regolamento (UE) n. 575/2013.</p> <p>Il CCF è espresso da un valore compreso tra 0 e 1.</p>
0110	EAD	Modello C 08.01, colonna 0110, dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2021/451	Indicare il valore dell'esposizione.
0120	Valore delle garanzie	Modello C 08.01, colonne da 0150 a 0210, dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2021/451	Indicare il valore di mercato delle garanzie.
0130	LGD	Modello C 08.01, colonne 0230 e 0240, dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2021/451	<p>È segnalata la media ponderata per l'EAD dei valori della LGD delle esposizioni nel rispettivo portafoglio.</p> <p>Le LGD sono quelle utilizzate per il calcolo degli RWA. Nello specifico, se l'ente ha ottenuto dall'autorità competente l'autorizzazione a utilizzare stime interne delle LGD, le LGD si basano sulle stime interne dell'ente, altrimenti le LGD si basano sui valori regolamentari della LGD tenendo conto dell'attenuazione del rischio applicabile.</p> <p>Sono incluse le esposizioni e le rispettive LGD per i soggetti regolamentati di grandi dimensioni del settore finanziario e i soggetti finanziari non regolamentati.</p> <p>È escluso l'effetto delle misure adottate a norma dell'articolo 458 del regolamento (UE) n. 575/2013.</p> <p>La LGD è espressa da un valore compreso tra 0 e 1.</p>

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0131	LGD senza misure di vigilanza		<p>La LGD senza misure di vigilanza è la LGD basata sui requisiti degli articoli 179 e 181 del regolamento (UE) n. 575/2013, incluso il MoC aggiunto dall'ente ma escluse le misure imposte dalle autorità competenti (fattori moltiplicativi, maggiorazioni, soglie minime o misure simili che aumentano direttamente la LGD).</p> <p>Per i portafogli corrispondenti ad una singola classe o un singolo pool, occorre indicare la LGD per tale classe che include il MoC ma non le misure di vigilanza.</p> <p>Per i portafogli corrispondenti a un'aggregazione di debitori di diverse classi o pool, indicare la media ponderata per l'EAD delle LGD assegnate alle rispettive esposizioni che includono il MoC ma non le misure di vigilanza.</p> <p>La LGD senza misure di vigilanza è espressa da un valore compreso tra 0 e 1.</p> <p>Qualora l'ente non sia in grado di isolare i pertinenti adeguamenti prudenziali, si applica la parte I, punto 3.</p>
0132	LGD senza MoC e misure di vigilanza		<p>La LGD senza MoC e misure di vigilanza è la LGD che non include né il MoC aggiunto dall'ente a norma dell'articolo 179, paragrafo 1, lettera f), e dell'articolo 181 del regolamento (UE) n. 575/2013, né l'effetto delle misure imposte dalle autorità competenti (fattori moltiplicativi, maggiorazioni, soglie minime o misure simili che aumentano direttamente la LGD).</p> <p>Per i portafogli corrispondenti ad una singola classe o un singolo pool, occorre indicare la LGD per tale classe senza il MoC e le misure di vigilanza. Per i portafogli corrispondenti a un'aggregazione di debitori di diverse classi o pool, indicare la media ponderata per l'EAD delle LGD delle rispettive esposizioni senza il MoC e senza le misure di vigilanza.</p> <p>La LGD senza MoC e misure di vigilanza è espressa da un valore compreso tra 0 e 1.</p> <p>Qualora l'ente non sia in grado di isolare i pertinenti adeguamenti prudenziali, si applica la parte I, punto 3.</p>
0133	LGD senza MoC, misure di vigilanza e componente recessione,		<p>La LGD senza MoC, misure di vigilanza e componente recessione è la LGD che non include né il MoC aggiunto dall'ente a norma dell'articolo 179, paragrafo 1, lettera f), e dell'articolo 181 del regolamento (UE) n. 575/2013, né l'effetto delle misure imposte dalle autorità competenti (fattori moltiplicativi, maggiorazioni, soglie minime o misure simili che aumentano direttamente la LGD), né la componente recessione richiesta all'articolo 181, paragrafo 1, lettera b), di tale regolamento.</p> <p>Per i portafogli corrispondenti ad una singola classe o un singolo pool, occorre indicare la LGD per tale classe senza il MoC, le misure di vigilanza e la componente recessione. Per i portafogli corrispondenti a un'aggregazione di debitori di diverse classi o pool, indicare la media ponderata per l'EAD delle LGD delle rispettive esposizioni senza il MoC, le misure di vigilanza e la componente recessione.</p>

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
			La LGD senza MoC, misure di vigilanza e componente recessione è espressa da un valore compreso tra 0 e 1. Qualora l'ente non sia in grado di isolare i pertinenti adeguamenti prudenziali, si applica la parte I, punto 3.
0140	Durata	Modello C 08.01, colonna 0250, dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2021/451	Indicare la durata ponderata per l'EAD. Il valore è espresso in numero di giorni.  Non occorre segnalare questa informazione per le esposizioni la cui durata non è un elemento compreso nel calcolo dell'RWA. In particolare, la scadenza non va segnalata per i portafogli che rappresentano esposizioni della classe di esposizioni "settore al dettaglio".
0150	Importo delle perdite attese	Modello C 08.01, colonna 0280, dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2021/451	Indicare l'importo delle perdite attese.
0160	Accantonamenti per esposizioni in stato di default	Modello C 09.02, colonne 0050, 0055 e 0060, dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2021/451	Indicare gli accantonamenti per le esposizioni in stato di default. Comprendono tutte le rettifiche di valore su crediti generali e specifiche sulle esposizioni in stato di default di cui all'articolo 110 del regolamento (UE) n. 575/2013. Le rettifiche di valore su crediti (una tantum) che un ente applica in relazione alle modifiche nell'attuazione della definizione di default (DoD) sono segnalate come registrate nella banca dati dell'ente.
0170	RWA	Modello C 08.01, colonna 0260, dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2021/451	È segnalato l'RWA dopo l'applicazione dei fattori di sostegno (fattori di sostegno alle PMI e alle infrastrutture). L'RWA non include l'effetto delle potenziali misure di cui all'articolo 458 del regolamento (UE) n. 575/2013.
0180	RWA secondo il metodo standardizzato	Parte tre, titolo II, capo 2, del regolamento (UE) n. 575/2013.	L'RWA secondo il metodo standardizzato è l'importo RWA ipotetico ottenuto applicando alle esposizioni il metodo standardizzato per il rischio di credito, anziché il metodo IRB.

**C 103 - Dettagli sulle esposizioni negli High default portfolios (HDP)**

Per i portafogli di cui all'allegato I con uno status in relazione alla garanzia diverso da "non applicabile", le seguenti informazioni possono essere omesse se il modello approvato non consente di calcolare la LGD separatamente per la parte garantita e per quella non garantita dell'esposizione: LGD (colonna 0130), LGD senza misure di vigilanza (colonna 0131), LGD senza MoC e misure di vigilanza (colonna 0132), LGD senza MoC, misure di vigilanza e componente recessione (colonna 0133), importo della perdita attesa (colonna 0150) e RWA (colonna 0170), tasso di perdita ultimo anno (colonna 0210) e tasso di perdita ultimi 5 anni (colonna 0220).

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0010	ID del portafoglio		Indicare l'ID del portafoglio della colonna 0010 del modello C 103 dell'allegato I che definisce il portafoglio. Tale ID è un identificativo di riga ed è unico per ogni riga del modello.  L'assegnazione delle esposizioni agli ID di portafoglio non è esclusiva: le esposizioni o parti di esposizioni sono segnalate nell'ambito di ciascun ID di portafoglio applicabile.
0040	Numero di debitori		Si applicano le istruzioni fornite per la colonna 0040 del modello C 102 dell'allegato I.
0060	PD		Si applicano le istruzioni fornite per la colonna 0060 del modello C 102 dell'allegato I.
0061	PD senza misure di vigilanza		Si applicano le istruzioni fornite per la colonna 0061 del modello C 102 dell'allegato I.
0062	PD senza MoC e misure di vigilanza		Si applicano le istruzioni fornite per la colonna 0062 del modello C 102 dell'allegato I.
0080	Esposizione originaria prima dell'applicazione dei fattori di conversione		Si applicano le istruzioni fornite per la colonna 0080 del modello C 102 dell'allegato I.
0090	Esposizione dopo gli effetti di sostituzione CRM prima dell'applicazione dei fattori di conversione		Si applicano le istruzioni fornite per la colonna 0090 del modello C 102 dell'allegato I.
0100	CCF		Si applicano le istruzioni fornite per la colonna 0100 del modello C 102 dell'allegato I.
0110	EAD		Si applicano le istruzioni fornite per la colonna 0110 del modello C 102 dell'allegato I.
0120	Valore delle garanzie		Si applicano le istruzioni fornite per la colonna 0120 del modello C 102 dell'allegato I.
0130	LGD		Si applicano le istruzioni fornite per la colonna 0130 del modello C 102 dell'allegato I.

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0131	LGD senza misure di vigilanza		Si applicano le istruzioni fornite per la colonna 0131 del modello C 102 dell'allegato I.
0132	LGD senza MoC e misure di vigilanza		Si applicano le istruzioni fornite per la colonna 0132 del modello C 102 dell'allegato I.
0133	LGD senza MoC, misure di vigilanza e componente recessione		Si applicano le istruzioni fornite per la colonna 0133 del modello C 102 dell'allegato I.
0140	Durata		Si applicano le istruzioni fornite per la colonna 0140 del modello C 102 dell'allegato I.
0150	Importo delle perdite attese		Si applicano le istruzioni fornite per la colonna 0150 del modello C 102 dell'allegato I.
0160	Accantonamenti per esposizioni in stato di default		Si applicano le istruzioni fornite per la colonna 0160 del modello C 102 dell'allegato I.
0170	RWA		Si applicano le istruzioni fornite per la colonna 0170 del modello C 102 dell'allegato I.
0180	RWA secondo il metodo standardizzato		Si applicano le istruzioni fornite per la colonna 0180 del modello C 102 dell'allegato I.
0190	Tasso di default dell'ultimo anno		<p>Indicare il tasso di default dell'anno più recente. A tal fine il tasso di default è rappresentato dal rapporto tra i valori seguenti:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>a) la somma delle esposizioni (esposizione originaria, colonna 0080, misurata alla data di riferimento meno un anno) che non erano in stato di default esattamente un anno prima della data di riferimento e entrate in stato di default tra la data di riferimento meno un anno e la data di riferimento;</li> <li>b) la somma delle esposizioni (esposizione originaria, colonna 0080, misurata alla data di riferimento meno un anno) che non erano in stato di default alla data di riferimento meno un anno.</li> </ul> <p>Non vanno incluse le nuove esposizioni generate nel corso dell'anno precedente la data di riferimento. Le esposizioni entrate in stato di default che sono tornate in bonis nel corso dell'anno precedente la data di riferimento vanno incluse sia al numeratore che al denominatore. I default multipli riferiti allo stesso debitore vanno inclusi soltanto una volta.</p>

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
			<p>Questa informazione va comunicata unicamente per gli ID di portafoglio relativi alle esposizioni non in stato di default; è espressa da un valore compreso tra 0 e 1.</p> <p>I default e le date di default sono utilizzati come registrati nell'ambito dell'attuazione della DoD applicabile al momento dell'evento, vale a dire che un ente considera che si sia verificato un default in relazione alla DoD che era stata applicata dall'ente al momento della registrazione dell'evento. Le modifiche della DoD sono considerate solo prospetticamente a partire dalla loro data di attuazione, mentre non deve essere utilizzata l'applicazione retroattiva delle modifiche della DoD dopo l'evento di default in esame (simulazione retrospettiva).</p>
0200	Tasso di default degli ultimi 5 anni		<p>Indicare la media ponderata dei tassi di default osservati negli ultimi 5 anni precedenti la data di riferimento. Si applica la definizione di tasso di default di cui alla colonna 0190. I fattori di ponderazione da utilizzare sono le esposizioni non in stato di default utilizzate per il calcolo del tasso di default secondo le indicazioni per la colonna 0190.</p> <p>Se non è in grado di calcolare il tasso di default degli ultimi 5 anni precedenti la data di riferimento a norma dell'articolo 180, paragrafo 1, lettera h), o dell'articolo 180, paragrafo 2, lettera e), del regolamento (UE) n. 575/2013, l'ente elabora una variabile proxy utilizzando la serie più lunga di dati storici fino a 5 anni precedenti la data di riferimento e fornisce alla propria autorità competente la documentazione che espone i calcoli in dettaglio.</p> <p>Questa informazione va comunicata unicamente per gli ID di portafoglio relativi alle esposizioni "non in stato di default"; è espressa da un valore compreso tra 0 e 1.</p> <p>I default e le date di default sono utilizzati come registrati nell'ambito dell'attuazione della DoD applicabile al momento dell'evento, vale a dire che un ente considera che si sia verificato un default in relazione alla DoD che era stata applicata dall'ente al momento della registrazione dell'evento. Le modifiche della DoD sono considerate solo prospetticamente a partire dalla loro data di attuazione, mentre non deve essere utilizzata l'applicazione retroattiva delle modifiche della DoD dopo l'evento di default in esame (simulazione retrospettiva).</p>
0210	Tasso di perdita dell'ultimo anno		<p>Il tasso di perdita osservato nell'anno più recente è segnalato unicamente per gli ID di portafoglio relativi alle esposizioni "non in stato di default" e "in stato di default".</p> <p>Per i portafogli non in stato di default il tasso di perdita è dato dalla somma delle rettifiche di valore su crediti e delle cancellazioni applicate, nell'anno precedente la data di riferimento, alle esposizioni che non erano in stato di default esattamente un anno prima della data di riferimento ma che sono entrate in stato di default durante l'anno precedente la data di riferimento, divisa per la somma dell'EAD, misurata esattamente un anno prima della data di riferimento, delle esposizioni che non erano in stato di default esattamente un anno prima della data di riferimento ma che sono entrate in stato di default durante l'anno precedente la data di riferimento.</p>



Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
			<p>Il numeratore del tasso di perdita include tutte le rettifiche di valore su crediti e le cancellazioni relative alle esposizioni entrate in stato di default nell'anno precedente il riferimento, comprese le rettifiche di valore su crediti applicate prima della data di default.</p> <p>Non vanno incluse le nuove esposizioni generate nel corso dell'anno precedente la data di riferimento. Le esposizioni entrate in stato di default che sono tornate in bonis durante l'anno precedente la data di riferimento vanno incluse nel denominatore del tasso di perdita; al numeratore del tasso di perdita vanno inserite le rettifiche di valore su crediti e le cancellazioni per tali esposizioni. I default multipli riferiti allo stesso debitore vanno inclusi una volta sola.</p> <p>Per i portafogli in stato di default, il tasso di perdita considera le esposizioni che erano in stato di default esattamente un anno prima della data di riferimento. È pari alla somma dei seguenti elementi:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>rettifiche di valore su crediti di tali esposizioni un anno prima della data di riferimento, e</li> <li>rettifiche di valore su crediti e cancellazioni applicate nell'anno precedente la data di riferimento,</li> </ol> <p>divisa per la somma dell'EAD, misurata esattamente un anno prima della data di riferimento delle esposizioni in esame.</p> <p>I nuovi default avvenuti nell'anno precedente la data di riferimento non vanno inclusi. Le esposizioni tornate nuovamente in bonis durante l'anno precedente la data di riferimento vanno incluse nel denominatore del tasso di perdita; al numeratore del tasso di perdita vanno inserite le rettifiche di valore su crediti e le cancellazioni per tali esposizioni. I default multipli riferiti allo stesso debitore vanno inclusi soltanto una volta.</p> <p>Il tasso di perdita è espresso da un valore compreso tra 0 e 1.</p> <p>I default e le date di default sono utilizzati come registrati nell'ambito dell'attuazione della DoD applicabile al momento dell'evento, vale a dire che un ente considera che si sia verificato un default in relazione alla DoD che era stata applicata dall'ente al momento della registrazione dell'evento. Le modifiche della DoD sono considerate solo prospetticamente a partire dalla loro data di attuazione, mentre non deve essere utilizzata l'applicazione retroattiva delle modifiche della DoD dopo l'evento di default in esame (simulazione retrospettiva).</p>
0220	Tasso di perdita degli ultimi 5 anni		<p>La media ponderata per l'EAD dei tassi di perdita osservati negli ultimi cinque anni precedenti la data di riferimento è segnalata unicamente per gli ID di portafoglio relativi alle esposizioni "non in stato di default" e "in stato di default". Si utilizza la definizione di tasso di perdita di cui alla colonna 0210.</p> <p>Il tasso di perdita degli ultimi cinque anni si basa sui tassi di perdita annuali degli ultimi cinque anni, laddove tali tassi di perdita annuali siano definiti in analogia con la definizione del tasso di perdita di cui alla colonna 0210; in particolare, i tassi di perdita annuali non includono ulteriori variazioni delle rettifiche di valore su crediti e delle cancellazioni intervenute dopo l'orizzonte di osservazione (anno civile) di ciascun tasso di perdita annuale.</p> <p>Se non è tenuto ad utilizzare dati degli ultimi 5 anni precedenti la data di riferimento a norma dell'articolo 181, paragrafo 2, ultimo comma, del regolamento (UE) n. 575/2013, l'ente elabora una variabile proxy utilizzando la serie più lunga di dati storici fino a 5 anni precedenti la data di riferimento e fornisce alla propria autorità competente la documentazione che espone i calcoli in dettaglio.</p> <p>Il tasso di perdita è espresso da un valore compreso tra 0 e 1.</p> <p>I default e le date di default sono utilizzati come registrati nell'ambito dell'attuazione della DoD applicabile al momento dell'evento, vale a dire che un ente considera che si sia verificato un default in relazione alla DoD che era stata applicata dall'ente al momento della registrazione dell'evento. Le modifiche della DoD sono considerate solo prospetticamente a partire dalla loro data di attuazione, mentre non deve essere utilizzata l'applicazione retroattiva delle modifiche della DoD dopo l'evento di default in esame (simulazione retrospettiva).</p>

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0250	RWA-		<p>Gli enti calcolano e segnalano l'RWA- per i portafogli di cui all'allegato I, modello 103, con i seguenti ID di portafoglio:</p> <p>CORP_ALL_0086_CT **** ** ** ALL  SMEC_ALL_0106_CT **** ** ** ALL  MORT_ALL_0094_CT **** ** ** ALL  SMOT_ALL_0106_CT **** ** ** ALL  RSMS_ALL_0106_CT **** ** ** ALL  RETO_ALL_0094_CT **** ** ** ALL  RQRR_ALL_0094_CT **** ** ** ALL</p> <p>RWA- è l'RWA ipotetico, dopo aver applicato i fattori di sostegno, ottenuto applicando i valori PD- invece dei valori PD dell'ente, per ogni esposizione. Gli altri parametri necessari per il calcolo non sono soggetti a modifiche.</p> <p>PD- si basa su un calcolo eseguito separatamente per ogni classe di debitore, ricorrendo alle classi di debitori indicate nella colonna 0005 del modello C 08.02 dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2021/451 della Commissione (per le istruzioni cfr. allegato II, modello C 08.01, colonna 0010, e modello C 08.02, di tale regolamento).</p> <p>Per ogni classe di debitore, <math>p^-</math> è il valore positivo minimo che soddisfa l'equazione</p> $p^- + \Phi^{-1}(q) \cdot \sqrt{\frac{p^- \cdot (1 - p^-)}{n}} \geq DR_{1y}$ <p>dove <math>DR_{1y} &gt; 0</math>, e <math>p^- = 0</math> dove <math>DR_{1y} = 0</math>.</p> <p>Qui,</p> <p><math>\Phi^{-1} =</math> funzione inversa della distribuzione normale standard (cumulativa);</p> <p><math>q =</math> il livello di confidenza del 90 %;</p> <p><math>DR_{1y} =</math> il tasso di default ponderato per i casi dell'anno precedente la data di riferimento, vale a dire il numero di debitori che non erano in stato di default e a cui era stata assegnata la classe di debitore in questione esattamente un anno prima della data di riferimento e che sono entrati in stato di default durante l'anno più recente, diviso per il numero di debitori che non erano in stato di default e a cui era stata assegnata la classe di debitore in questione esattamente un anno prima della data di riferimento;</p> <p><math>n =</math> il numero di debitori che non erano in stato di default e a cui era stata assegnata la classe di debitore in questione esattamente un anno prima della data di riferimento.</p> <p>Per ogni debitore, PD- è pari a <math>p^-</math>, dove <math>p^-</math> è calcolato secondo la formula di cui al quarto comma per la classe di debitore assegnata al debitore.</p>

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0260	RWA+		<p>Gli enti calcolano e segnalano l'RWA+ per i portafogli di cui all'allegato I, modello 103, con il seguente ID di portafoglio:</p> <p>CORP_ALL_0086_CT **** ** ** ALL            SMEC_ALL_0106_CT **** ** ** ALL            MORT_ALL_0094_CT **** ** ** ALL            SMOT_ALL_0106_CT **** ** ** ALL            RSMS_ALL_0106_CT **** ** ** ALL            RETO_ALL_0094_CT **** ** ** ALL            RQRR_ALL_0094_CT **** ** ** ALL</p> <p>RWA+ è l'RWA ipotetico, dopo aver applicato i fattori di sostegno, ottenuto applicando i valori PD+ invece dei valori PD dell'ente, per ogni esposizione. Gli altri parametri necessari per il calcolo non sono soggetti a modifiche.</p> <p>PD+ si basa su un calcolo eseguito separatamente per ogni classe di debitore, ricorrendo alle classi di debitori indicate nella colonna 0005 del modello C 08.02 dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2021/451 della Commissione (per le istruzioni cfr. allegato II, modello C 08.01, colonna 0010, e modello C 08.02, di tale regolamento).</p> <p>Per ogni classe di debitore, <math>p^+</math> è il valore positivo massimo che soddisfa l'equazione</p> $p^+ - \Phi^{-1}(q) \cdot \sqrt{\frac{p^+ \cdot (1 - p^+)}{n}} \leq DR_{1y}$ <p>In questa equazione,</p> <p><math>\Phi^{-1}</math> = funzione inversa della distribuzione normale standard (cumulativa);</p> <p>q = il livello di confidenza del 90 %;</p> <p><math>DR_{1y}</math> = il tasso di default ponderato per i casi dell'anno precedente la data di riferimento, vale a dire il numero di debitori che non erano in stato di default e a cui era stata assegnata la classe di debitore in questione esattamente un anno prima della data di riferimento e che sono entrati in stato di default durante l'anno più recente, diviso per il numero di debitori che non erano in stato di default e a cui era stata assegnata la classe di debitore in questione esattamente un anno prima della data di riferimento;</p> <p>n = il numero di debitori che non erano in stato di default e a cui era stata assegnata la classe di debitore in questione esattamente un anno prima della data di riferimento.</p> <p>Per ogni debitore, PD+ è pari a <math>p^+</math>, dove <math>p^+</math> è calcolato secondo la formula di cui al quarto comma per la classe di debitore assegnata al debitore.</p>

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0270	RWA-		<p>Gli enti calcolano e segnalano l'RWA- per i portafogli di cui all'allegato I, modello 103, con il seguente identificativo di portafoglio (ID):</p> <p>CORP_ALL_0086_CT_****_*_*_*_*_ALL  SMEC_ALL_0106_CT_****_*_*_*_*_ALL  MORT_ALL_0094_CT_****_*_*_*_*_ALL  SMOT_ALL_0106_CT_****_*_*_*_*_ALL  RSMS_ALL_0106_CT_****_*_*_*_*_ALL  RETO_ALL_0094_CT_****_*_*_*_*_ALL  RQRR_ALL_0094_CT_****_*_*_*_*_ALL</p> <p>RWA- è l'RWA ipotetico, dopo aver applicato i fattori di sostegno, ottenuto applicando i valori PD-- invece dei valori PD dell'ente, per ogni esposizione. Gli altri parametri necessari per il calcolo non sono soggetti a modifiche.</p> <p>PD-- si basa su un calcolo eseguito separatamente per ogni classe di debitore, ricorrendo alle classi di debitori indicate nella colonna 0005 del modello C 08.02 dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2021/451 della Commissione (per le istruzioni cfr. allegato II, modello C 08.01, colonna 0010, e modello C 08.02, di tale regolamento).</p> <p>Per ogni classe di debitore, <math>p^{--}</math> è il valore positivo minimo che soddisfa l'equazione</p> $p^{--} + \Phi^{-1}(q) \cdot \sqrt{\frac{p^{--} \cdot (1 - p^{--})}{n}} \geq DR_{5y}$ <p>dove <math>DR_{5y} &gt; 0</math>, e <math>p^{--} := 0</math> dove <math>DR_{5y} = 0</math></p> <p>Qui,</p> <p><math>\Phi^{-1}</math> = funzione inversa della distribuzione normale standard (cumulativa);</p> <p>q = il livello di confidenza del 90 %;</p> <p><math>DR_{5y}</math> = il tasso di default degli ultimi 5 anni per la classe di debitore, calcolato come media semplice di 5 tassi di default su 1 anno ponderati per i casi;</p> <p>n = il numero di debitori che non erano in stato di default e a cui era stata assegnata la classe di debitore in questione esattamente un anno prima della data di riferimento.</p> <p>Per ogni debitore, PD-- è pari a <math>p^{--}</math>, dove <math>p^{--}</math> è calcolato secondo la formula di cui al quarto comma per la classe di debitore assegnata al debitore.</p>

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0280	RWA++		<p>Gli enti calcolano e segnalano l'RWA++ per i portafogli di cui all'allegato I, modello 103, con il seguente ID di portafoglio:</p> <p>CORP_ALL_0086_CT **** ** ** ALL            SMEC_ALL_0106_CT **** ** ** ALL            MORT_ALL_0094_CT **** ** ** ALL            SMOT_ALL_0106_CT **** ** ** ALL            RSMS_ALL_0106_CT **** ** ** ALL            RETO_ALL_0094_CT **** ** ** ALL            RQRR_ALL_0094_CT **** ** ** ALL</p> <p>RWA++ è l'RWA ipotetico, dopo aver applicato i fattori di sostegno, ottenuto applicando i valori PD++ invece dei valori PD dell'ente, per ogni esposizione. Gli altri parametri necessari per il calcolo non sono soggetti a modifiche.</p> <p>PD++ si basa su un calcolo eseguito separatamente per ogni classe di debitore, ricorrendo alle classi di debitori indicate nella colonna 0005 del modello C 08.02 dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2021/451 della Commissione (per le istruzioni cfr. allegato II, modello C 08.01, colonna 0010, e modello C 08.02, di tale regolamento).</p> <p>Per ogni classe di debitore, <math>p^{++}</math> è il valore positivo massimo che soddisfa l'equazione</p> $p^{++} - \Phi^{-1}(q) \cdot \sqrt{\frac{p^{++} \cdot (1 - p^{++})}{n}} \leq DR_{5y}$ <p>dove</p> <p><math>\Phi^{-1}</math> = funzione inversa della distribuzione normale standard (cumulativa);            q = il livello di confidenza del 90 %;            DR<sub>5y</sub> = il tasso di default degli ultimi 5 anni per la classe di debitore, calcolato come media semplice di 5 tassi di default su 1 anno ponderati per i casi;            n = il numero di debitori che non erano in stato di default e a cui era stata assegnata la classe di debitore in questione esattamente un anno prima della data di riferimento.</p> <p>Per ogni debitore, PD++ è pari a <math>p^{++}</math>, dove <math>p^{++}</math> è calcolato secondo la formula di cui al quarto comma per la classe di debitore assegnata al debitore.</p>

**C 105.01 – Definizione dei modelli interni**

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0010	ID del modello interno		L'ente segnala l'ID del modello interno assegnato dall'autorità competente. In caso di indisponibilità, l'ente segnala l'ID del modello interno assegnato dall'ente stesso. L'ID del modello interno fa riferimento in modo univoco a un modello interno approvato dall'autorità competente e utilizzato per il calcolo dell'RWA. È un identificativo di riga ed è unico per ogni riga del modello.
0020	Nome del modello		Indicare il nome assegnato al modello interno dall'ente segnalante.
0030	Parametro di rischio del metodo IRB		Il parametro di rischio del metodo IRB è uno dei seguenti: a) PD; b) LGD; c) CCF.  Per un modello interno per esposizioni verso imprese – finanziamenti specializzati a norma dell'articolo 153, paragrafo 5, del regolamento (UE) n. 575/2013 ("Criteri di assegnazione dei finanziamenti specializzati"), il campo è lasciato vuoto o è inserito "NULL".
0040	EAD	Modello C 08.01, colonna 0110, dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2021/451	Indicare il valore aggregato delle esposizioni rientranti nell'ambito di applicazione del modello di rating.
0050	Tasso medio di default ponderato per l'EAD per la calibrazione		Indicare la media ponderata per l'EAD dei tassi di default annuali se utilizzati nella calibrazione dei modelli PD. Informazione da comunicare solo per i modelli PD. Sono utilizzati i dati usati per la calibrazione dei parametri del modello. Se non esistono dati interni e se la calibrazione si basa su dati esterni, sono comunicati i dati esterni.
0060	Tasso medio di default ponderato per i casi per la calibrazione		Indicare la media semplice dei tassi annuali di default ponderati per i casi utilizzati nella calibrazione dei modelli PD. Informazione da comunicare solo per i modelli PD. Sono utilizzati i dati usati per la calibrazione dei parametri del modello. Se non esistono dati interni e se la calibrazione si basa su dati esterni, sono comunicati i dati esterni.
0070	PD di lungo periodo		Indicare la tendenza centrale utilizzata dall'ente nella calibrazione dei modelli che incorpora tutti gli aggiustamenti prudenti della media semplice ponderata per i casi dei tassi annuali di default utilizzati nella calibrazione dei modelli PD. Informazione da comunicare solo per i modelli PD.
0080	Tasso di rientro in bonis (cure rate) delle attività in stato di default		Il tasso di rientro in bonis (cure rate) è la percentuale dei default che tornano in bonis entro un periodo di 12 mesi.  L'ente che per un dato modello non calcola il tasso di rientro in bonis ne calcola una variabile proxy, tenendo presente la definizione fornita. L'ente segnala l'utilizzo della variabile proxy all'autorità competente. Informazione da comunicare solo per i modelli LGD.

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0090	Tasso di recupero delle attività pignorate non tornate in bonis		<p>Indicare il tasso medio di recupero, ponderato per i casi, per i default non tornati in bonis inclusi nella serie temporale utilizzata dall'ente per la calibrazione dei modelli LGD sulle attività non in stato di default.</p> <p>Sono utilizzati i dati usati per la calibrazione dei parametri del modello. Se non esistono dati interni e se la calibrazione si basa su dati esterni, sono comunicati i dati esterni. Se non dispone del tasso specifico di recupero per default non tornati in bonis, a causa di una procedura di recupero non completata, l'ente calcola una variabile proxy tenendo conto dei recuperi osservati e delle stime dei recuperi per le rinegoziazioni non completate. L'ente segnala l'utilizzo della variabile proxy all'autorità competente. Informazione da comunicare solo per i modelli LGD.</p>
0100	Durata del periodo di recupero delle attività pignorate non tornate in bonis		<p>Indicare la durata media ponderata per i casi del periodo di recupero (dall'inizio dello stato di default alla data di completamento delle procedure di recupero) per i default non tornati in bonis inclusi nella serie temporale utilizzata dall'ente per la calibrazione dei modelli LGD sulle attività non in stato di default. La lunghezza media ponderata per i casi è espressa in numero di giorni.</p> <p>Sono utilizzati i dati usati per la calibrazione dei parametri del modello. Se non esistono dati interni e se la calibrazione si basa su dati esterni, sono comunicati i dati esterni.</p> <p>Se non dispone della durata specifica del periodo di recupero per default non tornati in bonis, a causa di una procedura di recupero non completata, l'ente calcola una variabile proxy tenendo presente la definizione fornita. L'ente segnala l'utilizzo della variabile proxy all'autorità competente. Informazione da comunicare solo per i modelli LGD.</p>
0110	Decisione congiunta	Articolo 20, paragrafo 2, lettera a), del regolamento (UE) n. 575/2013	L'ente segnala l'eventuale esistenza di una decisione congiunta sui requisiti prudenziali dell'autorità competente su base consolidata e dell'autorità competente del paese ospitante in merito all'autorizzazione a utilizzare il metodo IRB per il calcolo dei requisiti prudenziali per le esposizioni detenute da filiazioni dell'ente nei portafogli di riferimento segnalati.
0120	Autorità di vigilanza su base consolidata	Articolo 20 del regolamento (UE) n. 575/2013	Si comunica il codice ISO del paese di origine dell'autorità competente incaricata di esercitare la vigilanza su base consolidata dell'ente che utilizza il metodo IRB.
0130	RWA	Modello C 08.01, colonna 0260, dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2021/451	Segnalare l'RWA aggregato dopo l'applicazione dei fattori di sostegno (fattori di sostegno alle PMI e alle infrastrutture) delle esposizioni rientranti nell'ambito di applicazione del modello di rating.

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0140	Maggiorazioni RWA		<p>Le maggiorazioni RWA sono una sottoposizione ("di cui") dell'RWA (modello C 105.01, colonna 0130) e comprendono:</p> <p>a) l'RWA aggiunto all'RWA derivante dall'applicazione dei parametri di rischio del modello a causa di ulteriori misure interne di prudenza applicate direttamente all'RWA, se del caso;</p> <p>b) l'RWA aggiunto all'RWA derivante dall'applicazione dei parametri di rischio del modello a causa di misure di vigilanza applicate direttamente all'RWA, se del caso.</p> <p>Gli importi di cui alle lettere a) e b) non comprendono misure che sono già riflesse in PD (colonna 0060 dei modelli C 102 e C 103), CCF (colonna 0100 dei modelli C 102 e C 103) o LGD (colonna 0130 dei modelli C 102 e C 103), bensì si limitano alle misure direttamente applicate all'RWA e, se del caso, in aggiunta ai margini di cautela e alle misure di vigilanza (fattori moltiplicativi, maggiorazioni, soglie minime o misure simili) che aumentano i parametri di rischio.</p> <p>Le maggiorazioni RWA non includono l'effetto delle potenziali misure di cui all'articolo 458 del regolamento (UE) n. 575/2013. Qualora l'ente non sia in grado di isolare i pertinenti adeguamenti prudenziali, si applica la parte I, punto 3.</p>

### C 105.02 – Corrispondenza tra modelli interni e portafogli

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0010	ID del portafoglio	Modello C 102, colonna 0010, e modello C 103, colonna 0010	<p>Indicare l'ID del portafoglio che identifica in modo univoco il portafoglio conformemente ai modelli C 102 e C 103 dell'allegato I.</p> <p>Le colonne 0010 e 0020 sono un identificatore di riga composito e la loro combinazione deve essere unica per ogni riga del modello.</p>
0020	ID del modello interno	Modello C 105.01, colonna 0010	<p>Indicare l'ID assegnato al modello interno dall'ente segnalante.</p> <p>Le colonne 0010 e 0020 sono un identificatore di riga composito e la loro combinazione deve essere unica per ogni riga del modello C 105.02.</p>
0030	EAD	Modello C 08.01, colonna 0110, dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2021/451	<p>Indicare il valore aggregato dell'esposizione per le esposizioni incluse nel portafoglio definito nella colonna 0010 e nell'intervallo di applicazione del modello di rating definito nella colonna 0020. Se tutte le esposizioni di un dato portafoglio sono trattate con lo stesso specifico modello, il valore delle esposizioni è identico all'importo indicato per lo stesso portafoglio nella colonna 0110 del modello C 102 o C 103 a seconda del caso.</p>
0040	RWA	Modello C 08.01, colonna 0260, dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2021/451	<p>Indicare l'RWA aggregato dopo l'applicazione dei fattori di sostegno per le esposizioni incluse nel portafoglio definito nella colonna 0010 e nell'intervallo di applicazione del modello di rating definito nella colonna 0020. Se tutte le esposizioni di un dato portafoglio sono trattate con lo stesso specifico modello, l'RWA è identico all'importo indicato per lo stesso portafoglio nella colonna 0170 del modello C 102 o C 103 a seconda del caso.</p>



**C 105.03 – Corrispondenza tra modelli interni e paesi**

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0005	ID della riga		Tale codice è un identificativo di riga ed è unico per ogni riga del modello. Segue l'ordine numerico 1, 2, 3 ecc.
0010	ID del modello interno	Modello C 105.01, colonna 0010	Indicare l'ID assegnato al modello interno dall'ente segnalante. Se un ID di modello interno è associato a diversi paesi, compilare righe diverse per ogni combinazione di "ID del modello interno" e "ubicazione dell'ente". Le colonne 0010 e 0020 sono un identificatore di riga composito e la loro combinazione deve essere unica per ogni riga della tabella.
0020	Ubicazione dell'ente	Articolo 20 del regolamento (UE) n. 575/2013	Indicare il codice ISO della sede legale di ciascuna filiazione per la quale sono rilevate le esposizioni IRB segnalate per ogni portafoglio di riferimento, a prescindere dall'autorizzazione ad applicare il metodo IRB concessa dall'autorità di vigilanza del paese ospitante.»

ALLEGATO II

«ALLEGATO V

**STRUMENTI E PORTAFOGLI DI RIFERIMENTO PER IL RISCHIO DI MERCATO**

Sezione 1 -Istruzioni

Sezione 2 -Strumenti

Sezione 3 -Portafogli individuali — Strumento singolo

Sezione 4 -Portafogli individuali — Multistrumento

Sezione 5 -Portafogli aggregati

Sezione 6 -Specifiche aggiuntive per gli strumenti

Sezione 7 -Portafogli di convalida dell'SBM

**Sezione 1 - Istruzioni**

- (a) Ai fini del presente allegato si intende per:
- (i) "data di inserimento in portafoglio": la data e l'ora in cui gli enti registrano le operazioni ai fini dell'esercizio di analisi comparativa;
  - (ii) "valutazione iniziale di mercato" o "IMV": il valore a prezzi di mercato degli strumenti di cui alla sezione 2 del presente allegato, alla data e all'ora di riferimento dell'IMV;
  - (iii) "data di riferimento dell'IMV": la data e l'ora in riferimento alle quali gli enti determinano l'IMV delle operazioni nel portafoglio di riferimento;
  - (iv) "data di invio dell'IMV": la data entro la quale gli enti trasmettono i risultati dell'IMV delle operazioni nel portafoglio di riferimento;
  - (v) "VaR": il valore a rischio;
  - (vi) "sVaR": il valore a rischio in condizioni di stress;
  - (vii) "IRC": la copertura patrimoniale per il rischio incrementale;
  - (viii) "CTP": il portafoglio di negoziazione di correlazione;
  - (ix) "APR": tutti i rischi di prezzo calcolati conformemente all'articolo 377, paragrafo 2, del regolamento (UE) n. 575/2013;
  - (x) "misure di rischio" o "RM": il valore del VaR, dello sVaR e, se richiesto, dell'IRC e dell'APR per i portafogli, come stabilito nelle sezioni 3, 4 e 5 del presente allegato, tra la data di riferimento iniziale delle RM e la data di riferimento finale delle RM;
  - (xi) "data di riferimento iniziale delle RM": la data alla quale gli enti iniziano a calcolare i valori delle RM;
  - (xii) "data di riferimento finale delle RM": la data alla quale gli enti finiscono di calcolare i valori delle RM;
  - (xiii) "data di invio delle RM": la data entro la quale gli enti trasmettono i risultati delle RM delle operazioni nel portafoglio di riferimento;
  - (xiv) "valore attuale" o "PV": il valore a prezzi di mercato dei portafogli, di cui alla sezione 3 del presente allegato, alla data di riferimento finale delle RM;
  - (xv) "ATM": "at the money" (a valore intrinseco nullo) in termini di posizione relativa del prezzo corrente o futuro dell'attività sottostante di un derivato rispetto al prezzo di esercizio di tale derivato;
  - (xvi) "OTM": "out of the money" (a valore intrinseco negativo) in termini di posizione relativa del prezzo corrente o futuro dell'attività sottostante di un derivato rispetto al prezzo di esercizio di tale derivato;
  - (xvii) "ITM": "in the money" (a valore intrinseco positivo) in termini di posizione relativa del prezzo corrente o futuro dell'attività sottostante di un derivato rispetto al prezzo di esercizio di tale derivato;
  - (xviii) "lungo": "acquistato" e "corto": "venduto";
  - (xix) "CDS": credit default swap;
  - (xx) per i CDS, "lungo": "protezione acquistata" e "corto": "protezione venduta";
  - (xxi) "Mln": milioni;
  - (xxii) "OTC": over-the-counter;
  - (xxiii) "ASA": metodo standardizzato alternativo di cui alla parte tre, titolo IV, capo 1 bis, sezione 1, del regolamento (UE) n. 575/2013;
  - (xxiv) "SBM": metodo basato sulle sensibilità di cui alla parte tre, titolo IV, capo 1 bis, sezione 2, del regolamento (UE) n. 575/2013;
  - (xxv) "DRC": requisito per il rischio di default di cui alla parte tre, titolo IV, capo 1 bis, sezione 5, del regolamento (UE) n. 575/2013;
  - (xxvi) "RRAO": maggiorazione per i rischi residui di cui alla parte tre, titolo IV, capo 1 bis, sezione 4, del regolamento (UE) n. 575/2013.

- (b) Per l'esercizio di analisi comparativa si applicano le seguenti date:
- (i) la data di inserimento in portafoglio è il 30 gennaio 2025;
  - (ii) la data di riferimento dell'IMV (e dell'SBM iniziale) è il 6 febbraio 2025 (ore 17:30 CET);
  - (iii) la data di invio dell'IMV (e dell'SBM iniziale e della convalida dell'SBM) è il 28 febbraio 2025;
  - (iv) la data di riferimento iniziale delle RM è il 2 giugno 2025;
  - (v) la data di riferimento finale delle RM (e dell'ASA finale) è il 13 giugno 2025;
  - (vi) la data di invio delle RM (e dell'ASA finale) è il 18 luglio 2025.
- (c) Salvo diversamente specificato nella sezione 2 del presente allegato, tutte le posizioni sono registrate alla data di inserimento in portafoglio di cui alla lettera b), punto i), della presente sezione. Una volta registrate le posizioni, ciascun portafoglio matura per la durata dell'esercizio di analisi comparativa ed è calcolato partendo dall'ipotesi che l'ente non intraprenderà in alcun modo azioni di gestione del portafoglio per l'intera durata dell'esercizio. Salvo diversa indicazione esplicita nelle specifiche di un particolare strumento, i prezzi di esercizio delle posizioni in opzioni sono determinati in relazione ai prezzi del sottostante osservati alla chiusura del mercato alla data di inserimento in portafoglio.
- (d) Ai fini della valutazione iniziale di mercato, la valutazione di ciascuno strumento deve essere trasmessa all'autorità competente per l'ente entro la data di invio dell'IMV. Entro tale data gli enti trasmettono una nota esplicativa che accompagna i risultati, conformemente alla lettera e). L'IMV è fornita, ove possibile, conformemente alla valutazione di front office dell'ente. Nel caso in cui le IMV non siano fornite dal front office dell'ente, quest'ultimo specifica nella nota esplicativa chi è il fornitore della fonte di dati dell'IMV.
- (e) La nota esplicativa che gli enti sono tenuti a trasmettere insieme all'IMV comprende tutti i seguenti elementi per ciascuno strumento:
- (i) i fattori di rischio utilizzati per calcolare l'IMV dello strumento;
  - (ii) il modello di determinazione dei prezzi utilizzato per calcolare l'IMV dello strumento e una descrizione di tale modello;
  - (iii) i fattori di rischio inclusi nel modello VaR per lo strumento;
  - (iv) i fattori di rischio inclusi nel modello VaR che sono anche input di valutazione per l'IMV dello strumento;
  - (v) le specifiche del modello VaR in relazione allo strumento;
  - (vi) i dati di riferimento disponibili per lo strumento nel formato proprio dell'ente;
  - (vii) gli aspetti di cui alle lettere h), i), k), m), n), o), v), w), y), gg) e kk) della presente sezione.
- (f) Ai fini della lettera e), punto v), sono indicati tutti i seguenti elementi:
- (i) una descrizione concisa del modello VaR;
  - (ii) i metodi di rivalutazione applicati;
  - (iii) il modulo funzionale applicato per modellizzare i rendimenti (assoluti, relativi, altri metodi);
  - (iv) informazioni qualitative sulle serie temporali utilizzate per calibrare il modello VaR in relazione allo strumento (ad esempio fonte, metodologia per la normalizzazione, categorie applicate, altre informazioni ritenute pertinenti dagli enti per spiegare i risultati forniti).
- (g) La nota esplicativa di cui alla lettera d) è aggiornata con ogni nuova trasmissione di qualsiasi valore, riflettendo le variazioni tra trasmissioni. La nota esplicativa contiene una sezione in cui sono elencate tutte le date di trasmissione e i motivi delle nuove trasmissioni.
- (h) I rischi delle posizioni sono calcolati senza tenere conto dei costi di finanziamento (funding). Se del caso, gli enti utilizzano il tasso overnight della valuta dello strumento come tasso di sconto. Si ritiene che esista un contratto di garanzia per gli strumenti derivati di cui alla sezione 2 del presente allegato. Qualora ciò non sia possibile, i motivi sono forniti nella nota esplicativa di cui alla lettera d).

- (i) Il rischio di controparte e il rischio di aggiustamento della valutazione del credito (CVA) non sono presi in considerazione nella valutazione dei rischi dei portafogli. Qualora ciò non sia possibile, i motivi sono forniti nella nota esplicativa di cui alla lettera d) della presente sezione. Gli enti indicano i casi in cui altre tipologie di aggiustamento della valutazione sono incluse nell'IMV e spiegano per ciascuno strumento finanziario la metodologia e l'impatto nella nota esplicativa di cui alla lettera d) della presente sezione.
- (j) Per le operazioni che comprendono posizioni lunghe in CDS, gli enti ipotizzano che una commissione iniziale sia pagata immediatamente per aprire la posizione, secondo gli standard e le convenzioni di mercato. Le date di scadenza di tutti i CDS corrispondono alle date di scadenza trimestrali convenzionali.
- (k) Le specifiche aggiuntive necessarie per effettuare il calcolo dei prezzi obbligatorio per le posizioni in CDS sono coerenti con gli standard e le convenzioni di mercato utilizzati abitualmente e sono illustrate nella nota esplicativa di cui alla lettera d) della presente sezione.
- (l) La data di scadenza deve garantire che l'operazione si approssimi il più possibile alla durata residua specificata conformemente agli standard e alle convenzioni di mercato.
- (m) Per quanto riguarda i dettagli degli strumenti non menzionati nella sezione 2 del presente allegato, gli enti forniscono nella nota esplicativa di cui alla lettera d) della presente sezione le ipotesi utilizzate, compresa la convenzione sul conteggio dei giorni e la scelta di uno strumento negoziabile e liquido, ove consentito, unitamente ai risultati.
- (n) Gli enti che ritengono che ipotesi aggiuntive rispetto a quelle specificate nella presente sezione siano rilevanti per l'interpretazione dei risultati dell'esercizio, tra cui l'orario di chiusura delle attività, i coupon rolls, la corrispondenza con indici e altri, presentano una descrizione di tali ipotesi nella nota esplicativa di cui alla lettera d) della presente sezione.
- (o) La nota esplicativa di cui alla lettera d) della presente sezione comprende spiegazioni sui rischi che sfuggono al modello per gli strumenti di cui alla sezione 2 del presente allegato.
- (p) Tutte le opzioni sono trattate come se fossero negoziate fuori borsa (OTC), salvo diversa indicazione esplicita.
- (q) Devono essere seguite le convenzioni standard di determinazione dell'orario per le opzioni OTC. La vita residua di un'opzione a "n mesi" è di n mesi. Se le opzioni scadono in un giorno non lavorativo, gli enti riparametrano la data di scadenza su un giorno lavorativo, secondo gli standard e le convenzioni di mercato.
- (r) Tutte le opzioni OTC vanno trattate come se fossero:
  - i) americane, per strumenti di capitale "single-name" e merci;
  - ii) europee, per indici di azioni, valute estere e swaptions.
- (s) Tutte le opzioni OTC sono considerate "scoperte" in modo che il premio sia escluso dalla valutazione iniziale di mercato.
- (t) Per quanto riguarda i CTP, gli enti ai quali è consentito utilizzare il modello APR per i CTP forniscono i dettagli relativi alle loro ipotesi più pertinenti e agli standard e alle convenzioni di mercato relativi agli strumenti CTP di cui alla sezione 2 del presente allegato, compresi i rapporti di copertura calcolati per rendere gli strumenti CTP CS01 neutri alla data di inserimento in portafoglio.
- (u) L'IMV per ciascuno strumento è fornita nella valuta dello strumento dell'ABE specificata nella sezione 2 del presente allegato per lo strumento stesso.
- (v) Per i portafogli composti da uno o più strumenti denominati in valute di strumenti dell'ABE diverse dalla valuta di portafoglio dell'ABE, il risultato è convertito nella valuta di portafoglio dell'ABE segnalata utilizzando il tasso di cambio a pronti della BCE alla data pertinente. Il risultato convertito è spiegato nella nota esplicativa di cui alla lettera d) della presente sezione.
- (w) Nell'inserire in portafoglio le posizioni, gli enti seguono le opportune convenzioni di mercato salvo diversa istruzione nelle descrizioni degli strumenti (sezione 2 del presente allegato).

- (x) Se lo strumento o il sottostante del derivato è soggetto ad un evento societario che incide sull'esercizio di analisi comparativa (ad esempio un richiamo dell'emittente, un default o un altro evento simile), gli enti escludono lo strumento dall'esercizio unitamente a eventuali CDS o opzioni correlati.
- (y) Per quanto riguarda una serie di indici, "on-the-run" si riferisce alla serie più liquida e commerciabile di tale indice disponibile sul mercato. Gli enti spiegano la loro scelta della serie "on-the-run" insieme ai relativi risultati nella nota esplicativa di accompagnamento di cui alla lettera d) della presente sezione.
- (z) Se non diversamente specificato, gli enti applicano il regolamento UE sugli indici di riferimento per il tasso di interesse al fine di inserire nel portafoglio gli strumenti di cui alla sezione 2 del presente allegato. Gli enti specificano il tasso applicato, ad eccezione di quelli di cui alla sezione 2 del presente allegato, nella nota esplicativa di cui alla lettera d) delle presenti istruzioni.
- (aa) Le misure di rischio per i portafogli di cui alle sezioni 3, 4 e 5, unitamente al valore attuale, sono calcolate dalla "data di riferimento iniziale delle RM" alla "data di riferimento finale delle RM". Le misure del rischio dell'ASA nell'ambito del riesame approfondito del portafoglio di negoziazione (FRTB) (SBM, DRC e RRAO) sono computate per la "data di riferimento finale delle RM". Gli enti trasmettono i risultati di tali calcoli alla loro autorità competente entro la data di invio delle RM. L'IMV e l'SBM sono indicati per ciascun strumento. Le misure di rischio, l'SBM, il DRC, la RRAO e il valore attuale, se del caso, sono indicati per ciascun portafoglio, sia individuale che aggregato. L'SBM, il DRC e la RRAO, se del caso, sono segnalati almeno per gli stessi portafogli per i quali sono segnalate le misure di rischio.
- (bb) Per i portafogli di cui alla sezione 7, gli enti segnalano i risultati dell'SBM e li trasmettono in linea con le date di riferimento della trasmissione IMV.
- (cc) Solo gli enti che hanno ottenuto l'autorizzazione a modellizzare il rischio specifico degli strumenti di debito indicano i portafogli di spread creditizi. Per i portafogli di tassi di interesse che includono rischi associati a determinati strumenti, i portafogli individuali e aggregati sono modellizzati dagli enti che hanno ottenuto l'autorizzazione a modellizzare il rischio generico di tasso di interesse e dagli enti che hanno ottenuto l'autorizzazione a modellizzare il rischio generico e il rischio specifico di tasso di interesse.
- (dd) I risultati per i portafogli sia individuali che aggregati sono presentati solo contestualmente ai risultati degli strumenti che ne fanno parte.
- (ee) Nella sezione 2 del presente allegato (Strumenti) per "anno T" si intende 2025 e per "anno T + X" si intende 2025 + X, con X come specificato nella sezione 2.
- (ff) Nella sezione 2 del presente allegato (Strumenti), gli enti determinano il giorno di scadenza/la scadenza conformemente alle seguenti istruzioni:
- (i) se la data è specificata, deve essere utilizzata tale data specifica;
  - (ii) se la data non è specificata, deve essere utilizzata la convenzione di mercato, ove disponibile; se, ad esempio, esiste una convenzione di mercato secondo cui il giorno di scadenza/la scadenza è il terzo venerdì del mese, per "giugno anno T" si intende il terzo venerdì del mese dell'anno T;
  - (iii) alla fine del mese, se è indicato "fine di", si intende l'ultimo giorno di calendario del mese;
  - (iv) per un periodo di tempo fisso successivo alla "data di inserimento in portafoglio", se il periodo è definito in giorni, è l'ultimo giorno del periodo. Se il periodo è definito in settimane, mesi o anni, è lo stesso giorno della settimana, del mese o dell'anno successivo rispetto alla data di inserimento in portafoglio o, se l'ultimo mese o anno del periodo è più breve, l'ultimo giorno di tale mese o anno; se la "data di inserimento in portafoglio + periodo x" è un giorno festivo, selezionare il giorno lavorativo successivo;
  - (v) salvo altrimenti specificato, si utilizzano le seguenti ipotesi: convenzione di conteggio dei giorni: giorni effettivi/360, calendario dei giorni festivi: Target2.
- (gg) Nella sezione 2 del presente allegato (Strumenti), per tutti i CDS, salvo esplicita indicazione contraria, si applicano i seguenti requisiti:
- (i) frequenza della cedola: trimestrale;
  - (ii) cedola (punti base): 100;
  - (iii) conteggio dei giorni: giorni effettivi/360;
  - (iv) anno secondo le definizioni ISDA: 2014;

- (v) clausola di ristrutturazione: Modified-Modified Restructuring (MMR);
  - (vi) scadenza: dicembre anno T+4;
  - (vii) tipo di debito: senior;
  - (viii) durata (tenor): 5 anni;
  - (ix) la data di efficacia è la data di inserimento in portafoglio;
  - (x) la curva di attualizzazione e il tasso di recupero utilizzati sono indicati nella nota esplicativa di cui alla lettera d) del presente allegato.
- (hh) L'IMV degli strumenti obbligazionari comprende gli interessi maturati.
- (ii) Gli enti forniscono le informazioni relative al momento della valutazione del PV, menzionandone l'ora nella nota esplicativa di cui alla lettera d) della presente sezione. Ove possibile, la valutazione del PV è calcolata alla chiusura delle attività lavorative.
- (jj) Le misure di rischio dei portafogli sono calcolate nella stessa valuta del portafoglio, ad esclusione di qualsiasi rischio di cambio, anche in relazione alla valuta utilizzata dall'ente per le segnalazioni. Il rischio di cambio è considerato solo se intrinsecamente incluso negli strumenti. Se i risultati relativi alla valuta di segnalazione e di portafoglio sono segnalati nell'ambito dell'esercizio, per i dati ASA i risultati calcolati nella valuta di segnalazione dell'ente sono convertiti nella valuta del portafoglio dell'ABE mediante conversione a pronti utilizzando il tasso di cambio a pronti della BCE associato alla data del calcolo. La conversione nella valuta di portafoglio dell'ABE non implica una variazione dei fattori di rischio del rischio di cambio.
- (kk) Nei casi in cui si applica l'articolo 325 octodecies, paragrafo 7, del regolamento (UE) n. 575/2013 ("metodo della valuta di base"), nell'effettuare i calcoli dell'SBM e segnalare le sensibilità dell'SBM, gli enti tengono conto dei fattori di rischio del rischio di cambio derivanti dall'applicazione del metodo della valuta di base. I valori segnalati non sono espressi nella valuta di base scelta, bensì nella valuta di segnalazione dell'ente applicando la conversione a pronti utilizzando il tasso di cambio a pronti della BCE associato alla data pertinente.

## Sezione 2 - Strumenti

Gli enti forniscono l'IMV, conformemente alle istruzioni di cui alla sezione 1 del presente allegato, per gli strumenti finanziari che seguono, per i quali gli enti forniscono misure di rischio e il valore attuale dei portafogli specificati nelle sezioni 3 e 4.

### AZIONI

101. Posizione lunga su future indice EURO STOXX 50 (Ticker: FESX)
- Importo nozionale: equivalente al valore dell'indice per 1 000 EUR
- Borsa: Eurex
- Data di scadenza: giugno anno T
- Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
102. Posizione lunga su 10 000 azioni BAYER (Ticker: BAYN GR)
- Borsa: Xetra
- Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
103. Posizione corta su Futures BAYER (Ticker: BAYN GR).
- Importo nozionale: equivalente al valore di 10 000 azioni dell'attività sottostante
- Borsa: Eurex
- Data di scadenza: giugno anno T
- Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
104. Posizione corta su Futures STELLANTIS (Ticker: STLA FP).
- Importo nozionale: equivalente al valore di 10 000 azioni dell'attività sottostante
- Borsa: Euronext

- Data di scadenza: giugno anno T  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
105. Posizione corta su Futures ALLIANZ (Ticker: ALV GR).
- Importo nozionale: equivalente al valore di 10 000 azioni dell'attività sottostante  
Borsa: Eurex  
Data di scadenza: giugno anno T  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
106. Posizione corta su Futures BARCLAYS (Ticker: BARC LN).
- Importo nozionale: equivalente al valore di 10 000 azioni dell'attività sottostante  
Borsa: Eurex  
Data di scadenza: giugno anno T  
Valuta dello strumento dell'ABE: GBP
107. Posizione corta su Futures DEUTSCHE BANK (Ticker: DBK GR).
- Importo nozionale: equivalente al valore di 10 000 azioni dell'attività sottostante  
Borsa: Eurex  
Data di scadenza: giugno anno T  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
108. Posizione corta su Futures CRÉDIT AGRICOLE (Ticker: ACA FP).
- Importo nozionale: equivalente al valore di 10 000 azioni dell'attività sottostante  
Borsa: Euronext  
Data di scadenza: giugno anno T  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
109. Posizione lunga su opzioni call. Sottostante BAYER (Ticker: BAYN GR), ATM (1 contratto = 100 azioni).
- Importo nozionale: equivalente al valore di 10 000 azioni dell'attività sottostante  
Data di scadenza: giugno anno T  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
110. Posizione corta su opzioni call. Sottostante BAYER (Ticker: BAYN GR), ATM (1 contratto = 100 azioni).
- Importo nozionale: equivalente al valore di 10 000 azioni dell'attività sottostante  
Data di scadenza: dicembre anno T  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
111. Posizione lunga su opzioni call. Sottostante PFIZER (Ticker PFE US) 10 % OTM, (1 contratto = 100 azioni).
- Importo nozionale: equivalente al valore di 10 000 azioni dell'attività sottostante  
Data di scadenza: giugno anno T  
Valuta dello strumento dell'ABE: USD
112. Posizione lunga su opzioni put. Sottostante PFIZER (Ticker PFE US) 10 % OTM, (1 contratto = 100 azioni).
- Importo nozionale: equivalente al valore di 10 000 azioni dell'attività sottostante



- Data di scadenza: giugno anno T  
Valuta dello strumento dell'ABE: USD
113. Posizione lunga su opzioni call. Sottostante BAYER (Ticker: BAYN GR), 10 % OTM (1 contratto = 100 azioni).  
Importo nozionale: equivalente al valore di 10 000 azioni dell'attività sottostante  
Data di scadenza: dicembre anno T  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
114. Posizione corta su opzioni call. Sottostante BAYER (Ticker: BAYN GR), 10 % OTM (1 contratto = 100 azioni).  
Importo nozionale: equivalente al valore di 10 000 azioni dell'attività sottostante  
Data di scadenza: giugno anno T  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
115. Posizione lunga su opzioni call. Sottostante AVIVA (Ticker: AV/LN), 10 % OTM (1 contratto = 100 azioni).  
Importo nozionale: equivalente al valore di 10 000 azioni dell'attività sottostante  
Data di scadenza: dicembre anno T  
Valuta dello strumento dell'ABE: GBP
116. Posizione lunga su opzioni put. Sottostante AVIVA (Ticker: AV/LN), 10 % OTM (1 contratto = 100 azioni).  
Importo nozionale: equivalente al valore di 10 000 azioni dell'attività sottostante  
Data di scadenza: dicembre anno T  
Valuta dello strumento dell'ABE: GBP
117. Posizione corta su Futures NIKKEI 225 (Ticker NKY).  
Importo nozionale: equivalente al valore dell'indice per 20 000 JPY  
Borsa: CME  
Data di scadenza: giugno anno T  
Valuta dello strumento dell'ABE: JPY
118. Prodotto azionario con meccanismo di rimborso automatico (auto-callable).  
Posizione lunga  
Inserimento alla "data di inserimento in portafoglio"  
Importo nozionale ("capitale"): 1 000 000 EUR  
Sottostante: indice EURO STOXX 50 (Ticker: SX5E)  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR  
Scadenza: 5 anni  
Pagamento (pay-out) annuale e osservazione annuale ("Data di inserimento in portafoglio + 1 anno", "Data di inserimento in portafoglio + 2 anni", "Data di inserimento in portafoglio + 3 anni", "Data di inserimento in portafoglio + 4 anni", "Data di inserimento in portafoglio + 5 anni"). Il pagamento (pay-out) è effettuato 10 giorni dopo la data di riferimento.  
Cedola: 6 %  
Livello di attivazione del rimborso automatico ("valore iniziale"): fine giornata data di inserimento in portafoglio + 1 mese  
Barriera pagamento cedola: 60 % del livello di attivazione del rimborso automatico

Barriera di protezione: 55 % del livello di attivazione del rimborso automatico

- capitale non garantito se l'indice è inferiore alla barriera di protezione (il capitale rimborsato il quinto anno sarà calcolato su base proporzionale se il livello è inferiore alla barriera di protezione: ad esempio, se l'indice SX5E = 40 % del suo livello iniziale, il capitale restituito è pari al 40 %);
- se  $SX5E \geq 60$  % (barriera pagamento cedola) del valore iniziale alla fine di un dato anno, è pagata una cedola del 6 %;
- se  $SX5E \geq 100$  % del valore iniziale alla fine di un dato anno, il prodotto è rimborsato ed è effettuato un pagamento costituito dalla cedola più il capitale (100 %);
- se  $SX5E < 60$  % (barriera pagamento cedola) del valore iniziale alla fine di un dato anno, non viene pagata alcuna cedola;
- se  $SX5E < 55$  % (barriera di protezione) del valore iniziale alla fine del quinto anno, il capitale è versato solo su base proporzionale. Altrimenti, se  $SX5E \geq 55$  % (barriera di protezione) del valore iniziale alla fine del quinto anno, il capitale è versato per intero.

119. Posizione lunga su opzioni call. Sottostante EURO STOXX 50 index (Ticker: SX5E), ATM.

Importo nozionale: equivalente al valore dell'indice per 1 000 EUR

Data di scadenza: giugno anno T

Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

120. Posizione lunga su opzioni call. Sottostante EURO STOXX 600 index (Ticker: SXXP), ATM.

Importo nozionale: equivalente al valore dell'indice per 10 000 EUR

Data di scadenza: giugno anno T

Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

121. Posizione lunga su opzioni call. Sottostante VIX (CBOE), ATM.

Importo nozionale: equivalente al valore dell'indice per 100 000 USD

Data di scadenza: giugno anno T

Valuta dello strumento dell'ABE: USD

#### **Tassi di interesse (IR)**

201. Swap su tassi d'interesse (IRS) a 5 anni EUR - riceve tasso fisso e paga tasso variabile.

Gamba fissa: riceve annualmente.

Tasso variabile: EURIBOR a 6 mesi, paga semestralmente. Conteggio dei giorni: giorni effettivi/360.

Importo nozionale: 10 000 000 EUR

Convenzione sui giorni lavorativi e calendario delle festività: standard

La data di efficacia è la data di inserimento in portafoglio (vale a dire che i tassi da usare sono quelli del mercato prossimi alla data di inserimento in portafoglio)

Scadenza: settembre anno T+4

Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

202. Swaption biennale EUR su IRS 5 anni EUR — paga tasso fisso e riceve tasso variabile.

Importo nozionale: 10 000 000 EUR.

L'ente è il venditore dell'opzione sullo swap. La controparte dell'ente acquista il diritto di stipulare un contratto swap con l'ente; se esercita il diritto, la controparte riceve il tasso fisso, mentre l'ente riceve il tasso variabile.

Swaption con scadenza a 2 anni (data di inserimento in portafoglio + 2 anni) sullo swap su tassi di interesse definito come segue: Gamba fissa - paga annualmente; tasso variabile: EURIBOR a 6 mesi, paga semestralmente; importo nozionale: 10 000 000 EUR; convenzione sui giorni lavorativi e calendario delle festività: standard; Data di efficacia dello swap sottostante: data di inserimento in portafoglio + 2 anni.

Scadenza dello swap sottostante: data di inserimento in portafoglio + 7 anni

Premio pagato alla data di inserimento in portafoglio (data di inserimento in portafoglio). Liquidazione in contanti

Il prezzo di esercizio si basa sul tasso ATM dello swap forward-starting definito in questo strumento.

Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

203. IRS a 5 anni USD. Riceve tasso fisso e paga tasso variabile

gamba fissa - riceve annualmente

Tasso variabile: tasso SOFR a 3 mesi in USD, paga trimestralmente

Importo nozionale: 1 000 000 USD

Convenzione sui giorni lavorativi e calendario delle festività: standard

La data di efficacia è la data di inserimento in portafoglio (vale a dire che i tassi da usare sono quelli del mercato prossimi alla data di inserimento in portafoglio)

Data di scadenza: settembre anno T+4

Valuta dello strumento dell'ABE: USD

204. IRS a 2 anni GBP. Riceve tasso fisso e paga tasso variabile

Gamba fissa: riceve annualmente

Tasso variabile: tasso (overnight) SONIA composto e pagato trimestralmente; conteggio dei giorni: Giorni effettivi/365

Importo nozionale: 10 000 000 GBP

Convenzione sui giorni lavorativi e calendario delle festività: standard

La data di efficacia è la data di inserimento in portafoglio (vale a dire che i tassi da usare sono quelli del mercato prossimi alla data di inserimento in portafoglio)

scadenza: data di inserimento in portafoglio + 2 anni

Valuta dello strumento dell'ABE GBP

205. Collared 10y floating rate note (obbligazione a tasso variabile a 10 anni con collar) venduta da UBS.

Importo (del capitale) nozionale: 1 000 000 USD

Le obbligazioni a tasso variabile ("notes") sono obbligazioni non garantite di primo rango (senior) di UBS AG ("UBS").

Valuta dello strumento dell'ABE USD

— Le obbligazioni producono interessi a un tasso annuale uguale al SOFR a 3 mesi in USD più l'1,5 % l'anno (il "tasso di interesse variabile"), entro i limiti di un tasso di interesse massimo del 7,5 % l'anno (il "tasso d'interesse massimo") e un tasso di interesse minimo del 2,5 % l'anno (il "tasso d'interesse minimo").

— Tutti i pagamenti sulle obbligazioni, compresi gli interessi e il capitale alla scadenza, sono soggetti al merito di credito di UBS AG. Gli enti sono tenuti a utilizzare una curva di attualizzazione adeguata che devono motivare nella nota esplicativa.

- Proventi: le obbligazioni producono interessi su base trimestrale a un tasso pari al tasso di interesse variabile alle seguenti condizioni: se, alla data di determinazione della cedola, i) il tasso di interesse variabile è inferiore al tasso di interesse minimo, il tasso di interesse applicabile per il periodo di interesse in questione sarà uguale al tasso di interesse minimo; oppure, se alla data di determinazione della cedola ii) il tasso di interesse variabile è superiore al tasso di interesse massimo, il tasso di interesse applicabile per il periodo di interesse in questione sarà uguale al tasso di interesse massimo.

Importo di pagamento degli interessi	L'importo degli interessi da pagare sulle obbligazioni per un periodo di interesse è pari al prodotto a) dell'importo del capitale delle obbligazioni, b) del tasso di interesse applicabile per tale periodo di interesse e c) di una frazione, il cui numeratore è il numero di giorni del periodo di interesse (calcolato sulla base di un anno di 360 giorni di dodici mesi di 30 giorni) e il cui denominatore è 360.
Data di negoziazione e di liquidazione	"Data di inserimento nel portafoglio"
Date di pagamento degli interessi	Trimestralmente, alla data di inserimento in portafoglio + 3 mesi, data di inserimento in portafoglio + 6 mesi, data di inserimento in portafoglio + 9 mesi e data di inserimento in portafoglio + 1 anno, a partire dalla data di inserimento in portafoglio + 3 mesi, per la durata delle obbligazioni (fatti salvi gli adeguamenti descritti di seguito).
Data di scadenza Valuta	data di inserimento in portafoglio + 10 anni USD
Convenzione di conteggio dei giorni:	30/360
Convenzione sui giorni lavorativi	Giorno successivo, non adeguato
Data di determinazione della cedola	Per ciascun periodo di interesse, il secondo giorno di operatività delle banche a Londra precedente la data di interesse pertinente. Con l'espressione "giorno di operatività delle banche a Londra" si fa riferimento al giorno in cui le banche commerciali a Londra sono aperte per esercitare le loro attività (comprese le operazioni di cambio e i depositi in valuta estera) e in cui le operazioni in dollari statunitensi sono effettuate sul mercato interbancario londinese.

206. Posizione lunga su titoli di Stato della Germania (indicizzati all'inflazione) (GERMANY GOVT), 1 000 000 EUR (ISIN DE0001030583)

Scadenza: 15 aprile 2033

Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

207. Posizione corta su titoli di Stato della Germania (GERMANY GOVT), 1 000 000 EUR (ISIN DE0001030708).

Scadenza: 15 agosto 2030

Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

208. Posizione lunga su titoli di Stato dell'Italia (indicizzati all'inflazione) (ITALY GOVT), 1 000 000 EUR (ISIN IT0005138828).

Scadenza: 15 settembre 2032

Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

209. Posizione lunga su titoli di Stato dell'Italia (ITALY GOVT), 1 000 000 EUR (ISIN IT0005340929).

Scadenza: 1° dicembre 2028

Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

210. Posizione lunga su titoli di Stato della Spagna (SPAIN GOVT), 1 000 000 EUR (ISIN ES00000127A2).

Scadenza: 30 luglio 2030

Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

211. Posizione corta su titoli di Stato della Francia (FRANCE GOVT), 1 000 000 EUR (ISIN FR0012993103).  
Scadenza: 25 maggio 2031  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
212. Posizione corta su titoli di Stato della Germania (GERMANY GOVT), 1 000 000 EUR (ISIN DE0001135176).  
Scadenza: 4 gennaio 2031  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
213. Posizione lunga su titoli di Stato del Regno Unito (UNITED KINGDOM GOVT), 1 000 000 GBP (ISIN GB0004893086).  
Scadenza: 7 giugno 2032  
Valuta dello strumento dell'ABE: GBP
214. Posizione lunga su titoli di Stato del Portogallo (PORTUGAL GOVT), 1 000 000 EUR (ISIN PTOTEXOE0024).  
Scadenza: 15 giugno 2029  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
215. Posizione corta su titoli di Stato degli Stati Uniti (UNITED STATES GOVT), 1 000 000 USD (ISIN US91282CAV37).  
Scadenza: 15 novembre 2030  
Valuta dello strumento dell'ABE USD
216. Posizione lunga su titoli di Stato del Brasile (callable) (BRAZIL GOVT), 1 000 000 USD (ISIN US105756BZ27).  
Scadenza: 13 gennaio 2028  
Valuta dello strumento dell'ABE: USD
217. Posizione lunga su titoli di Stato del Messico (callable) (MEXICO GOVT), 1 000 000 USD (ISIN US91087BAT70).  
Scadenza: 19 maggio 2033  
Valuta dello strumento dell'ABE USD
218. IRS a 10 anni EURO - riceve tasso variabile e paga tasso fisso  
Gamba fissa: paga annualmente  
Tasso variabile: EURIBOR a 3 mesi, riceve trimestralmente. Conteggio dei giorni: Giorni effettivi/360  
Importo nozionale: 10 000 000 EUR  
Convenzione sui giorni lavorativi e calendario delle festività: standard  
La data di efficacia è la data di inserimento in portafoglio (vale a dire che i tassi da usare sono quelli alla chiusura del mercato alla data di inserimento in portafoglio).  
Scadenza: data di inserimento in portafoglio + 10 anni  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
219. IRS a 5 anni EURO - riceve tasso variabile e paga tasso fisso  
Gamba fissa: paga annualmente  
Tasso variabile: EURIBOR a 6 mesi, riceve ogni 6 mesi. Conteggio dei giorni: Giorni effettivi/360  
Importo nozionale: 10 000 000 EUR  
Convenzione sui giorni lavorativi e calendario delle festività: standard  
La data di efficacia è la data di inserimento in portafoglio (vale a dire che i tassi da usare sono quelli alla chiusura del mercato alla data di inserimento in portafoglio).  
scadenza: data di inserimento in portafoglio + 5 anni  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

220. SWAP su valute EUR/USD a 5 anni a valore di mercato (MtM). Riceve USD e paga EUR.

EUR: ESTER a 3 mesi, paga trimestralmente, composto, con un ritardo di pagamento di 2 giorni. Conteggio dei giorni: giorni effettivi/360

USD: SOFR a 3 mesi, riceve trimestralmente, composto, con un ritardo di pagamento di 2 giorni. Conteggio dei giorni: giorni effettivi/360

Gamba 1 – USD: nozionale equivalente 10 000 000 EUR adeguato su base trimestrale

Gamba 2 – EUR: nozionale 10 000 000 EUR

Convenzione sui giorni lavorativi e calendario delle festività: standard

La data di efficacia è la data di inserimento in portafoglio + 6 mesi

Scadenza: data di inserimento in portafoglio + 5,5 anni

Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

Cfr. anche la sezione 6 del presente allegato – Specifiche aggiuntive dello strumento

221. IRS a 10 anni EURO - riceve ESTER e paga EURIBOR.

Gamba ESTER: riceve annualmente. Conteggio dei giorni: giorni effettivi/360

Gamba EURIBOR: EURIBOR a 3 mesi + base, paga trimestralmente. Conteggio dei giorni: Giorni effettivi/360

Importo nozionale: 10 000 000 EUR

convenzione sui giorni lavorativi e calendario delle festività: standard

La data di efficacia è la data di inserimento in portafoglio (vale a dire che i tassi da usare sono quelli del mercato prossimi alla data di inserimento in portafoglio)

Scadenza: settembre anno T + 9 anni

Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

222. Posizione lunga su titoli di Stato dell'Italia (indicizzati all'inflazione) (ITALY GOVT), 1 000 000 EUR (ISIN IT0005387052).

Scadenza: 15 maggio 2030

Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

223. Swap sull'inflazione senza cedola 5 anni EUR – riceve rendimento indicizzato all'inflazione e paga tasso fisso (r).

Indice di inflazione: CPI (HICPxT)

Gamba fissa (Paga fisso):  $[(1 + r)^5 - 1]$

Riceve rendimento indicizzato all'inflazione:  $\left[ \left( \frac{\text{CPI a fine giornata (alla data di scadenza)}}{\text{CPI alla data di inizio}} \right) - 1 \right]$

Importo nozionale: 10 000 000 EUR

Data fixing di base: giugno anno T-1

Fixing finale: agosto anno T+4

scadenza: settembre anno T+4

Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

224. Swaption biennale EUR su IRS 5 anni EUR – riceve tasso fisso e paga tasso variabile.

Importo nozionale: 10 000 000 EUR.

L'ente è il venditore dell'opzione sullo swap. La controparte dell'ente acquista il diritto di stipulare un contratto swap con l'ente; se esercita il diritto, la controparte riceve il tasso variabile, mentre l'ente riceve il tasso fisso.

Swaption con scadenza a 2 anni (data di inserimento in portafoglio + 2 anni) sullo swap su tassi di interesse definito come segue: gamba fissa - riceve annualmente; tasso variabile: EURIBOR a 6 mesi, paga ogni 6 mesi; importo nozionale: 10 000 000 EUR; convenzione sui giorni lavorativi e calendario delle festività: standard; Data di efficacia dello swap sottostante: data di inserimento in portafoglio + 2 anni.

Scadenza dello swap sottostante: data di inserimento in portafoglio + 7 anni

Premio pagato alla data di inserimento in portafoglio (data di inserimento in portafoglio). Liquidazione in contanti

Il prezzo di esercizio si basa sul tasso ATM dello swap forward-starting definito in questo strumento + 100 punti base

Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

## FX

301. Contratto forward a 6 mesi USD/EUR. Liquidazione in contanti. Posizione lunga USD – posizione corta EUR; nozionale 10 000 000 USD; forward strike: 100 % del pertinente tasso di riferimento a pronti della BCE rilevato a fine giornata alla data di inserimento in portafoglio.

Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

302. Contratto forward a 6 mesi EUR/GBP. Liquidazione in contanti. Posizione lunga EUR – posizione corta GBP; nozionale 10 000 000 GBP; forward strike: 100 % del pertinente tasso di riferimento a pronti della BCE rilevato a fine giornata alla data di inserimento in portafoglio.

Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

303. Posizione lunga, 10 000 000 USD in contanti.

Posizione in contanti. Da considerare come una posizione avente un rischio di cambio intrinseco come descritto al paragrafo (kk).

Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

304. Posizione lunga su opzione call in EUR/USD (EUR lunga, USD corta). Liquidazione in contanti. Importo nozionale: 10 000 000 EUR. Importo equivalente basato sul tasso di riferimento a pronti della BCE per EUR/USD rilevato a fine giornata alla data di inserimento in portafoglio.

Prezzo di esercizio: 110 % del tasso di riferimento della BCE per EUR/USD rilevato a fine giornata alla data di inserimento in portafoglio.

Data di scadenza: data di inserimento in portafoglio + 1 anno

Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

305. Posizione lunga su opzione call in EUR/USD (EUR lunga, USD corta). Liquidazione in contanti. Importo nozionale: 10 000 000 EUR. Importo equivalente basato sul tasso di riferimento a pronti della BCE per EUR/USD rilevato a fine giornata alla data di inserimento in portafoglio.

Prezzo di esercizio: 90 % del tasso di riferimento della BCE per EUR/USD rilevato a fine giornata alla data di inserimento in portafoglio.

Data di scadenza: data di inserimento in portafoglio + 1 anno

Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

306. Posizione corta su opzione call in EUR/USD (EUR corta, USD lunga). Liquidazione in contanti. Importo nozionale: 10 000 000 EUR. Importo equivalente basato sul tasso di riferimento a pronti della BCE per EUR/USD rilevato a fine giornata alla data di inserimento in portafoglio.

Prezzo di esercizio: 100 % del tasso di riferimento della BCE per EUR/USD rilevato a fine giornata alla data di inserimento in portafoglio.

Data di scadenza: data di inserimento in portafoglio + 1 anno

Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

307. Posizione corta su opzione call in EUR/GBP (EUR corta, GBP lunga). Liquidazione in contanti. Importo nozionale: 10 000 000 EUR. Importo equivalente basato sul tasso di riferimento a pronti della BCE per EUR/GBP rilevato a fine giornata alla data di inserimento in portafoglio.

Prezzo di esercizio: 110 % del tasso di riferimento della BCE per EUR/GBP rilevato a fine giornata alla data di inserimento in portafoglio.

Data di scadenza: data di inserimento in portafoglio + 1 anno

Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

308. Posizione lunga su opzione put in EUR/JPY (EUR corta, JPY lunga). Liquidazione in contanti. Importo nozionale: 10 000 000 EUR. Importo equivalente basato sul tasso di riferimento a pronti della BCE per EUR/JPY rilevato a fine giornata alla data di inserimento in portafoglio.

Prezzo di esercizio: 110 % del tasso di riferimento della BCE per EUR/JPY rilevato a fine giornata alla data di inserimento in portafoglio.

Data di scadenza: data di inserimento in portafoglio + 1 anno

Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

309. Posizione corta su opzione put in EUR/AUD (EUR lunga, AUD corta). Liquidazione in contanti. Importo nozionale: 10 000 000 EUR. Importo equivalente basato sul tasso di riferimento a pronti della BCE per EUR/AUD rilevato a fine giornata alla data di inserimento in portafoglio.

Prezzo di esercizio: 110 % del tasso di riferimento della BCE per EUR/AUD rilevato a fine giornata alla data di inserimento in portafoglio.

Data di scadenza: data di inserimento in portafoglio + 1 anno

Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

310. Contratto forward a 6 mesi EUR/DKK (EUR lunga, DKK corta). Liquidazione in contanti; nozionale 10 000 000 EUR; tasso di riferimento a pronti della BCE per EUR/DKK rilevato a fine giornata alla data di inserimento in portafoglio per determinare il tasso forward.

Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

311. Contratto forward non deliverable a 6 mesi EUR/BRL (EUR lunga, BRL corta); nozionale 10 000 000 EUR; tasso di riferimento a pronti della BCE per EUR/BRL rilevato a fine giornata alla data di inserimento in portafoglio per determinare il tasso forward.

Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

#### MERCI

401. Posizione lunga su forward oro Londra a 6 mesi su 3 500 once troy (oro lunga, USD corta). Liquidazione in contanti. Prezzo di esercizio: prezzo a termine a 6 mesi a fine giornata alla data di inserimento in portafoglio.

Valuta dello strumento dell'ABE: USD

402. Posizione corta su forward oro Londra a 12 mesi su 3 500 once troy (oro corta, USD lunga). Liquidazione in contanti. Prezzo di esercizio: prezzo a termine a 12 mesi a fine giornata alla data di inserimento in portafoglio.

Valuta dello strumento dell'ABE: USD

403. Posizione lunga su opzione call su 30 000 barili di greggio Brent (WTI lunga, USD corta). Liquidazione in contanti. Prezzo di esercizio: prezzo a termine a 12 mesi a fine giornata alla data di inserimento in portafoglio. Data di scadenza: Data di inserimento in portafoglio + 6 mesi

Valuta dello strumento dell'ABE USD

404. Posizione corta su opzione put su 30 000 barili di greggio Brent (WTI lunga, USD corta). Liquidazione in contanti. Prezzo di esercizio: prezzo a termine a 12 mesi a fine giornata alla data di inserimento in portafoglio. Data di scadenza: Data di inserimento in portafoglio + 6 mesi

Valuta dello strumento dell'ABE USD

405. Posizione lunga su opzione call su 5 000 once troy di oro Londra (oro lunga, USD corta). Liquidazione in contanti. Prezzo di esercizio: prezzo a termine a 18 mesi a fine giornata alla data di inserimento in portafoglio. Data di scadenza: Data di inserimento in portafoglio + 18 mesi

Valuta dello strumento dell'ABE: USD

#### SPREAD CREDITIZIO

501. Posizione lunga (ossia comprare protezione), CDS 1 000 000 USD sul PORTOGALLO

Clausola di ristrutturazione: PIENA

Valuta dello strumento dell'ABE: USD



502. Posizione lunga (ossia comprare protezione), 1 000 000 USD CDS sull'ITALIA  
Clausola di ristrutturazione: PIENA  
Valuta dello strumento dell'ABE: USD
503. Posizione corta (ossia vendere protezione), 1 000 000 USD CDS sulla SPAGNA  
Clausola di ristrutturazione: PIENA  
Valuta dello strumento dell'ABE: USD
504. Posizione lunga (ossia comprare protezione), 1 000 000 USD CDS sul MESSICO  
Clausola di ristrutturazione: PIENA  
Valuta dello strumento dell'ABE: USD
505. Posizione lunga (ossia comprare protezione), 1 000 000 USD CDS sul BRASILE  
Clausola di ristrutturazione: PIENA  
Valuta dello strumento dell'ABE: USD
506. Posizione lunga (ossia comprare protezione), 1 000 000 USD CDS sul REGNO UNITO  
Clausola di ristrutturazione: PIENA  
Valuta dello strumento dell'ABE: USD
507. Posizione corta (ossia vendere protezione) per 1 000 000 EUR CDS su Telefonica (Ticker TEF SM)  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
508. Posizione lunga (ossia comprare protezione) per 1 000 000 EUR CDS su Telefonica (Ticker TEF SM)  
Scadenza: dicembre anno T+2  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
509. Posizione corta (ossia vendere protezione), 1 000 000 EUR CDS su Aviva (Ticker AV LN)  
Anno delle definizioni ISDA 2003  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
510. Posizione lunga (ossia comprare protezione), 1 000 000 EUR CDS su Aviva (Ticker AV LN)  
Anno delle definizioni ISDA 2003  
Scadenza: dicembre anno T+2  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
511. Posizione corta (ossia vendere protezione), 1 000 000 EUR CDS su Vodafone (Ticker VOD LN)  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
512. Posizione corta (ossia vendere protezione), 1 000 000 EUR CDS su ENI SpA (Ticker ENI IM)  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
513. Posizione corta (ossia vendere protezione), 1 000 000 USD CDS su Eli Lilly (Ticker LLY US)  
Clausola di ristrutturazione: nessuna ristrutturazione (XR14)  
Valuta dello strumento dell'ABE: USD
514. Posizione corta (ossia vendere protezione), 1 000 000 EUR CDS su Unilever (Ticker UNA NA)  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

515. Posizione lunga (ossia comprare protezione), 1 000 000 EUR CDS su Total SA (Ticker FP FP)  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
516. Posizione lunga (ossia comprare protezione) di 1 000 000 EUR CDS su Volkswagen Group (Ticker VOW GR)  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
517. Posizione lunga su obbligazioni della TURCHIA (TURKEY Govt.), 1 000 000 USD (ISIN US900123CT57)  
Scadenza: 26 aprile 2029  
Valuta dello strumento dell'ABE: USD
518. Posizione lunga (ossia comprare protezione), 1 000 000 USD CDS sulla TURCHIA La data di efficacia è la data di inserimento in portafoglio.  
Clausola di ristrutturazione: PIENA  
Valuta dello strumento dell'ABE: USD
519. Posizione lunga su obbligazioni Telefonica per 1 000 000 EUR (ISIN XS1681521081)  
Scadenza: 12 gennaio 2028  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
520. Posizione lunga su obbligazioni Volkswagen Group, 1 000 000 EUR (ISIN XS2234567233)  
Scadenza: 22 settembre 2028  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
521. Posizione corta su obbligazioni Volkswagen Group, 1 000 000 EUR (ISIN XS1167667283)  
Scadenza: 16 gennaio 2030  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
522. Posizione lunga su obbligazioni Total SA, 1 000 000 EUR (ISIN XS1856281834)  
Scadenza: 11 luglio 2033  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
523. Posizione lunga su titoli di Stato dell'Austria (AUSTRIA GOVT) per 1 000 000 EUR (ISIN AT0000A04967)  
Scadenza: 15 marzo 2037  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
524. Posizione lunga (ossia comprare protezione) per 1 000 000 USD CDS sull'AUSTRIA  
Scadenza: giugno anno T+15  
Valuta dello strumento dell'ABE: USD
525. Posizione lunga su titoli di Stato dei Paesi Bassi (NETHERLANDS GOVT) per 1 000 000 EUR (ISIN NL0013552060)  
Scadenza: 15 gennaio 2040  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
526. Posizione lunga (ossia comprare protezione) per 1 000 000 USD CDS sui PAESI BASSI  
Scadenza: giugno anno T+20  
Valuta dello strumento dell'ABE: USD
527. Posizione lunga su titoli di Stato del Belgio (BELGIUM GOVT) per 1 000 000 EUR (ISIN BE0000348574)  
Scadenza: 22 giugno 2050  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

528. Posizione lunga (ossia comprare protezione) per 1 000 000 USD CDS sul BELGIO  
Scadenza: giugno anno T+30  
Valuta dello strumento dell'ABE: USD
529. Posizione lunga (comprare protezione) 10 000 000 EUR CDS sulla serie on-the-run dell'indice iTraxx Europe  
Scadenza: giugno anno T+4  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
530. Posizione corta su opzione put. 10 000 000 EUR. Sottostante serie on-the-run dell'indice iTraxx Europe index (stesso strumento di 529).  
Prezzo di esercizio: ATM  
Data di scadenza: Data di inserimento in portafoglio + 6 mesi  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
531. Posizione lunga su AXA SA (callable), 1 000 000 EUR (ISIN XS1799611642)  
Scadenza: 28 maggio 2049  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
532. Posizione lunga su obbligazioni AT&T (callable), 1 000 000 USD (ISIN US00206RFW79)  
Scadenza: 15 agosto 2037  
Valuta dello strumento dell'ABE: USD
533. Posizione lunga su BAYER AG (callable), 1 000 000 EUR (ISIN XS2199266268)  
Scadenza: 6 gennaio 2030  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
534. Posizione lunga su obbligazioni ORANGE SA (callable), 1 000 000 EUR (ISIN FR0013323870)  
Scadenza: 20 marzo 2028  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR

**CTP**

601. Posizione corta (ossia vendere protezione) sulla serie on-the-run dell'indice iTraxx Europe  
Punto di attacco (attachment point): 3 %  
Punto di distacco (detachment point): 6 %  
Importo nozionale: 5 000 000 EUR  
Scadenza: 5 anni  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
602. Posizione lunga (ossia comprare protezione) 5 000 000 EUR CDS sulla serie più recente on-the-run dell'indice iTraxx Europe  
Scadenza: giugno anno T+4  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR  
Aggiustamento nozionale per coprire completamente CS01 di 601 senza necessità di ricopertura
603. Posizione lunga (ossia comprare protezione) sulla serie on-the-run dell'indice iTraxx Europe  
Punto di attacco (attachment point): 3 %  
Punto di distacco (detachment point): 6 %  
Importo nozionale: 5 000 000 EUR

- Scadenza: 5 anni  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
604. Posizione corta (ossia vendere protezione) 5 000 000 EUR CDS sulla serie più recente on-the-run dell'indice iTraxx Europe
- Scadenza: giugno anno T+4  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR  
Aggiustamento nozionale per coprire completamente CS01 di603 senza necessità di ricopertura
605. Posizione corta (ossia vendere protezione) sulla serie on-the-run dell'indice iTraxx Europe
- Punto di attacco (attachment point): 12 %  
Punto di distacco (detachment point): 100 %  
Importo nozionale: 5 000 000 EUR  
Scadenza: 5 anni  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
606. Posizione lunga (ossia comprare protezione) 5 000 000 EUR CDS sulla serie più recente on-the-run dell'indice iTraxx Europe
- Scadenza: giugno anno T+4  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR  
Aggiustamento nozionale per coprire completamente CS01 di605 senza necessità di ricopertura
607. Posizione lunga (ossia comprare protezione) sulla serie on-the-run dell'indice iTraxx Europe
- Punto di attacco (attachment point): 12 %  
Punto di distacco (detachment point): 100 %  
Importo nozionale: 5 000 000 EUR  
Scadenza: 5 anni  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR
608. Posizione corta (ossia vendere protezione) 5 000 000 EUR CDS sulla serie più recente on-the-run dell'indice iTraxx Europe
- Scadenza: giugno anno T+4  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR  
Aggiustamento nozionale per coprire completamente CS01 di607 senza necessità di ricopertura
609. Posizione corta (ossia vendere protezione) sulla serie on-the-run dell'indice iTraxx Europe
- Punto di attacco (attachment point): 3 %  
Punto di distacco (detachment point): 6 %  
Importo nozionale: 5 000 000 EUR  
Scadenza: 5 anni  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR  
Tasso di recupero: 40 % fisso.
610. Posizione lunga (ossia comprare protezione) 5 000 000 EUR CDS sulla serie più recente on-the-run dell'indice iTraxx Europe
- Scadenza: giugno anno T+4  
Valuta dello strumento dell'ABE: EUR  
Aggiustamento nozionale per coprire completamente CS01 di609 senza necessità di ricopertura

### Sezione 3 - Portafogli individuali — Strumento singolo

Gli enti forniscono le misure di rischio prescritte, insieme al valore attuale, dei seguenti portafogli individuali:

Porta-foglio	Combinazione di strumenti La prima cifra rappresenta lo strumento (di cui alla sezione 2 del presente allegato). La seconda cifra rappresenta la quantità di ciascuno strumento o il numero di contratti, a seconda dei casi.	Valuta del porta-foglio dell'ABE	Misure di rischio prescritte
1001	101 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
1002	102 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
1003	103 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
1004	104 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
1005	105 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
1006	106 – 1 strumento	GBP	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
1007	107 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
1008	108 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
1009	109 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
1010	110 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
1011	111 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
1012	112 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
1013	113 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
1014	114 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
1015	115 – 1 strumento	GBP	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
1016	116 – 1 strumento	GBP	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
1017	117 – 1 strumento	JPY	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
1018	118 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO

1019	119 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
1020	120 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
1021	121 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
2001	201 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
2002	202 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
2003	203 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
2004	204 – 1 strumento	GBP	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
2005	205 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
2006	206 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
2007	207 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
2008	208 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
2009	209 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
2010	210 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
2011	211 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
2012	212 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
2013	213 – 1 strumento	GBP	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
2014	214 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
2015	215 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
2016	216 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
2017	217 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
2018	218 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
2019	219 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
2020	220 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
2021	221 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
2022	222 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO

2023	223 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
2024	224 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
3001	301 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
3002	302 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
3003	303 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
3004	304 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
3005	305 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
3006	306 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
3007	307 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
3008	308 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
3009	309 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
3010	310 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
3011	311 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
4001	401 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
4002	402 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
4003	403 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
4004	404 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
4005	405 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
5001	501 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5002	502 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5003	503 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5004	504 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5005	505 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5006	506 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5007	507 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO

5008	508 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5009	509 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5010	510 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5011	511 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5012	512 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5013	513 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5014	514 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5015	515 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5016	516 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5017	517 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5018	518 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5019	519 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5020	520 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5021	521 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5022	522 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5023	523 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5024	524 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5025	525 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5026	526 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5027	527 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5028	528 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5029	529 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5030	530 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5031	531 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5032	532 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO



5033	533 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5034	534 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
6001	601 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; APR; SBM; DRC; RRAO
6002	602 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; APR; SBM; DRC; RRAO
6003	603 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; APR; SBM; DRC; RRAO
6004	604 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; APR; SBM; DRC; RRAO
6005	605 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; APR; SBM; DRC; RRAO
6006	606 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; APR; SBM; DRC; RRAO
6007	607 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; APR; SBM; DRC; RRAO
6008	608 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; APR; SBM; DRC; RRAO
6009	609 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; APR; SBM; DRC; RRAO
6010	610 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; APR; SBM; DRC; RRAO

#### Sezione 4 - Portafogli individuali — Multistrumento

Gli enti forniscono le misure di rischio prescritte, insieme al valore attuale, dei seguenti portafogli individuali:

Porta-foglio	Combinazione di strumenti La prima cifra rappresenta lo strumento (di cui alla sezione 2 del presente allegato). La seconda cifra rappresenta la quantità di ciascuno strumento o il numero di contratti, a seconda dei casi.	Valuta del porta-foglio dell'ABE	Misure di rischio prescritte
1101	103 – 1 strumento 104 – 1 strumento 105 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
1102	113 – 1 strumento 110 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
1103	115 – 1 strumento 116 – 1 strumento	GBP	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
1104	109 – 1 strumento 110 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO

1105	111 – 1 strumento 112 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
1106	102 – 1 strumento 114 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
1107	106 – 1 strumento 107 – 1 strumento 108 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
1108	101 – 1 strumento 103 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
1109	101 – 1 strumento 103 – 1 strumento 104 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
1110	102 – 1 strumento 104 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
2201	206 – 1 strumento 207 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
2202	206 – 1 strumento 207 – 1 strumento 208 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
2203	206 – 1 strumento 207 – 1 strumento 208 – 1 strumento 209 – 1 strumento 210 – 1 strumento 211 – 1 strumento 212 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
2204	201 – 1 strumento 218 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
2205	201 – 1 strumento 219 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
2206	218 – 1 strumento 219 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
2207	201 – 1 strumento 202 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
2208	215 – 1 strumento 216 – 1 strumento 217 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
2209	203 – 1 strumento 215 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO

2210	208 – 1 strumento 209 – 1 strumento 210 – 1 strumento 214 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
2211	209 – 1 strumento 219 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
2212	201 – 1 strumento 223 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
3301	301 – 1 strumento 302 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
3302	303 – 1 strumento 304 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
3303	304 – 1 strumento 305 – 1 strumento 306 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
3304	307 – 1 strumento 308 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
4401	401 – 1 strumento 402 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
4402	403 – 1 strumento 404 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
4403	401 – 1 strumento 404 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
5501	501 – 1 strumento 502 – 1 strumento 503 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5502	504 – 1 strumento 505 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5503	507 – 1 strumento 508 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5504	503 – 1 strumento 504 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5505	509 – 1 strumento 510 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5506	511 – 1 strumento 512 – 1 strumento 514 – 1 strumento 515 – 1 strumento 516 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO

5507	517 – 1 strumento 518 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5508	519 – 1 strumento 520 – 1 strumento 522 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5509	520 – 1 strumento 521 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5510	519 – 1 strumento 508 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5511	515 – 1 strumento 522 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5512	520 – 1 strumento 521 – 1 strumento 516 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5513	506 – 1 strumento 503 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5514	502 – 1 strumento 209 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5515	504 – 1 strumento 217 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5516	505 – 1 strumento 216 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5517	504 – 1 strumento 217 – 1 strumento 505 – 1 strumento 216 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5518	502 – 1 strumento 209 – 1 strumento 219 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5519	523 – 1 strumento 525 – 1 strumento 527 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5520	524 – 1 strumento 526 – 1 strumento 528 – 1 strumento	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
5521	523 – 1 strumento 524 – 1 strumento 525 – 1 strumento 526 – 1 strumento 527 – 1 strumento 528 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO

5522	529 – 1 strumento 530 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
6601	601 – 1 strumento 602 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; APR; SBM; DRC; RRAO
6602	603 – 1 strumento 604 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; APR; SBM; DRC; RRAO
6603	605 – 1 strumento 606 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; APR; SBM; DRC; RRAO
6604	607 – 1 strumento 608 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; APR; SBM; DRC; RRAO
6605	609 – 1 strumento 610 – 1 strumento	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; APR; SBM; DRC; RRAO

### Sezione 5 - Portafogli aggregati

Gli enti forniscono le misure di rischio prescritte, insieme al valore attuale, dei portafogli finanziari aggregati che seguono.

Portafoglio aggregato	Descrizione	Combinazione di portafogli individuali (portafogli individuali come indicati dal rispettivo numero di cui alle sezioni 3 e 4 del presente allegato)	Valuta del porta-foglio dell'ABE	Misure di rischio prescritte
10000	ALL-IN no CTP	1001, 1101, 1104, 1106, 2001, 2002, 2203, 2206, 3301, 3303, 3304, 4401, 4402, 5503, 5506, 5508, 5521	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
11000	AZIONI - cumulativo	1001, 1101, 1104, 1106	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
12000	Tassi di interesse - cumulativo	2001, 2002, 2203, 2206	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
13000	Cambi - cumulativo	3301, 3303, 3304	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
14000	Merci - cumulativo	4401, 4402	USD	VaR; VaR in condizioni di stress; SBM; DRC; RRAO
15000	Spread creditizio - cumulativo	5503, 5506, 5508, 5521	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; IRC; SBM; DRC; RRAO
16000	CTP - cumulativo, EUR	6601, 6602	EUR	VaR; VaR in condizioni di stress; APR; SBM; DRC; RRAO

### Sezione 6 - Specifiche aggiuntive per gli strumenti

Gli enti applicano le seguenti specifiche aggiuntive agli strumenti finanziari descritti nella sezione 2 del presente allegato.

Strumento	220
Descrizione	SWAP su valute EUR/USD a 5 anni a valore di mercato (MtM) Riceve USD e paga EUR Importo nozionale: 10 000 000 EUR, USD (10 000 000 EUR * FX USD/EUR)
Paga	Gamba variabile 2
Riceve	Gamba variabile 1
Scambio e revisione del nozionale	Alla data di efficacia e alla data di scadenza. Inoltre, a ogni data di pagamento della cedola, viene effettuato un pagamento aggiuntivo corrispondente all'adeguamento del valore nozionale in USD sulla gamba variabile 2. Il valore nozionale in USD è adeguato a 10 000 000 EUR, al tasso a pronti, 2 giorni lavorativi prima della data di pagamento.
Saldo in contanti	Incluso
<i>Gamba variabile 1</i>	
importo nozionale:	Equivalente 10 000 000 EUR convertiti in USD a pronti alla data di efficacia, equivalente aggiustato su base trimestrale
Data di efficacia	Data di inserimento in portafoglio + 6 mesi
Data di scadenza	Data di inserimento in portafoglio + 5,5 anni
Generazione della data di pagamento	Dalla data di efficacia in avanti
Frequenza di pagamento della cedola	Trimestrale
Tasso della cedola	SOFR a 3 mesi + 0 punti base
Frequenza di revisione del tasso della cedola	Trimestrale
Convenzione relativa alla fissazione del tasso della cedola	Composto quotidianamente nel periodo di 3 mesi
Frequenza di composizione del tasso della cedola	Interesse semplice
Conteggio dei giorni	Giorni effettivi/360
Giorno lavorativo di pagamento	LON, NYC, TARGET
Convenzione relativa al giorno lavorativo di pagamento	Giorno successivo modificato
Giorno lavorativo di revisione del nozionale	LON, NYC, TARGET
Convenzione relativa al giorno lavorativo di revisione del nozionale	Precedente
Giorno lavorativo di revisione del tasso della cedola	LON, NYC, TARGET
Convenzione relativa al giorno lavorativo di revisione del tasso della cedola	Precedente

<i>Gamba variabile 2</i>	
importo nozionale:	10 000 000 EUR
Data di efficacia	Data di inserimento in portafoglio + 6 mesi
Data di scadenza	Data di inserimento in portafoglio + 5,5 anni
Generazione della data di pagamento	Dalla data di efficacia in avanti
Frequenza di pagamento della cedola	Trimestrale
Tasso della cedola	ESTER a 3 mesi + 0 punti base
Frequenza di revisione del tasso della cedola	Trimestrale
Convenzione relativa alla fissazione del tasso della cedola	Composto quotidianamente nel periodo di 3 mesi
Frequenza di composizione del tasso della cedola	Interesse semplice
Conteggio dei giorni	Giorni effettivi/360
Giorno lavorativo di pagamento	LON, NYC, TARGET
Giorno lavorativo di pagamento	Giorno successivo modificato
Giorno lavorativo di revisione del nozionale	LON, NYC, TARGET
Convenzione relativa al giorno lavorativo di revisione del nozionale	Precedente
Giorno lavorativo di revisione del tasso della cedola	LON, NYC, TARGET
Convenzione relativa al giorno lavorativo di revisione del tasso della cedola	Precedente"

#### Sezione 7 - Portafogli di convalida dell'SBM

- (a) Gli enti forniscono la misura del rischio SBM dei portafogli definiti nell'allegato X (portafogli di convalida SBM) nell'ambito della trasmissione IMV e li trasmettono in linea con le date di riferimento della trasmissione IMV.
- (b) Per la trasmissione dei risultati corrispondenti ai portafogli di convalida dell'SBM si applica quanto segue:
- i. gli enti presentano solo il modello C 120.02 e limitano le segnalazioni di questo modello ai risultati nella valuta di segnalazione (ossia la colonna 0060 del modello C 120.02 non deve essere compilata e, per i portafogli di convalida dell'SBM, i modelli C 106.00 e C 106.01 non devono essere presentati);
  - ii. gli enti presuppongono che le sensibilità al rischio e le posizioni di rischio di curvatura definite dagli strumenti specificati nell'allegato X siano espresse nella valuta utilizzata dall'ente per le segnalazioni e che le informazioni siano fornite nel formato specificato nelle istruzioni per la segnalazione per il modello C 106.01/C 120.01 e nella corrispondente tabella contenente indicazioni per la presentazione di tali modelli nell'allegato VI (istruzioni per il modello).»

## ALLEGATO III

## «ALLEGATO VI

**RISULTATI DEI PORTAFOGLI DI RIFERIMENTO A FINI DI VIGILANZA****ISTRUZIONI RELATIVE AI MODELLI**

C 106.00 – Valutazione iniziale di mercato e motivo dell'esclusione .....	57
C 106.01 – SBM. Sensibilità al rischio per strumento .....	57
C 107.01 – VaR e sVaR non CTP. Dettagli .....	61
C 107.02 – VaR, sVaR e PV - non CTP. Risultati nella valuta del portafoglio ABE .....	63
C 108.00 – Serie temporali di profitti e perdite .....	64
C 109.01 – IRC. Dettagli del modello .....	65
C 109.02 – IRC. Dettagli per portafoglio .....	65
C 109.03 – IRC. Importo per portafoglio/data .....	66
C 110.01 – CT. Dettagli del modello .....	67
C 110.02 – CT. Dettagli per portafoglio .....	68
C 110.03 – CT. APR per portafoglio/data .....	69
C 120.01 – SBM. SENSIBILITÀ AL RISCHIO PER STRUMENTO/PORTAFOGLIO .....	69
C 120.02 – SBM. COMPOSIZIONE DELL'OFR PER PORTAFOGLIO .....	72
C 120.04 – DRC. VALORI DI MERCATO E IMPORTI JTD LORDI PER STRUMENTO/PORTAFOGLIO .....	74
C 120.05 – DRC. COMPOSIZIONE DELL'OFR PER PORTAFOGLIO .....	80
C 120.06 – ASA. OFR .....	82



**ISTRUZIONI RELATIVE AI MODELLI**

**C 106.00 – Valutazione iniziale di mercato e motivo dell'esclusione**

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0010	Numero dello strumento	Allegato V, sezione 2	Segnalare il numero dello strumento tratto dall'allegato V.
0020	Strumento modellizzato per VaR e sVaR (TRUE/FALSE)		Indicare TRUE (vero) o FALSE (falso).
0030	Strumento modellizzato per IRC (TRUE/FALSE)		Indicare TRUE (vero) o FALSE (falso).
0040	Strumento modellizzato per la negoziazione di correlazione (TRUE/FALSE)		Indicare TRUE (vero) o FALSE (falso).
0050	Motivo dell'esclusione	Articolo 3, paragrafo 2	Si comunica uno dei motivi seguenti: (a) modello non autorizzato dall'autorità di regolamentazione; (b) strumento o sottostante non autorizzati internamente; (c) sottostante o caratteristica di modellizzazione non contemplati internamente; (d) altro motivo dell'esclusione. Precisarne nella colonna 0060.
0060	Riquadro di testo libero		In questa colonna l'ente può fornire ulteriori informazioni.
0070	Valutazione iniziale di mercato (IMV)		Il valore a prezzi di mercato di ciascuno strumento alla data di riferimento alle ore 17.30 CET (di cui all'allegato V, sezione 1, lettera b)).  La casella non va compilata se l'ente non desidera fornire una valutazione iniziale di mercato (IMV) per un determinato portafoglio (vale a dire che il valore zero va indicato solo se il risultato del calcolo è zero).

**C 106.01 – SBM. Sensibilità al rischio per strumento**

Gli enti segnalano le sensibilità nei confronti dei fattori di rischio ai quali lo strumento è esposto. Compilare una riga per fattore di rischio/sensibilità al rischio. La posizione di rischio di curvatura netta al rialzo di tale fattore di rischio (CVRk+) o la posizione di rischio di curvatura netta al ribasso di tale fattore di rischio (CVRk-), come specificato all'articolo 325 octies del regolamento (UE) n. 575/2013, è segnalata in singole righe. Tutti i valori si riferiscono alla "data di riferimento dell'IMV (e SBM iniziale)" come specificato nell'allegato V, sezione 1, lettera b), punto ii), del presente regolamento. Gli enti segnalano ogni combinazione di numero dello strumento, identificativo del rischio (colonna 0010), categoria (colonna 0020) e identificativo aggiuntivo (colonna 0030) una sola volta.

## Istruzioni relative ai fogli (asse z)

Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
Numero dello strumento	Allegato V, sezione 2	Segnalare il numero dello strumento tratto dall'allegato V.

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0010	Identificativo del fattore di rischio	Articoli 325 terdecies, 325 quaterdecies, 325 quindecies, 325 sexdecies, 325 septdecies e 325 octodecies del regolamento (UE) n. 575/2013	È segnalato l'identificativo del fattore di rischio come specificato nella tabella alla fine del presente allegato.
0020	Categoria	Articolo 325 quinquies, punto 3, del regolamento (UE) n. 575/2013	<p>Se l'identificativo del fattore di rischio selezionato nella colonna 0010 corrisponde alla classe di rischio, deve essere indicata la categoria:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>— rischio generico di tasso di interesse (GIRR), la risposta è il nome della valuta del pertinente tasso privo di rischio, fattore di rischio inflazione o fattore di rischio di base cross currency (secondo la designazione della valuta ISO 4217, ad esempio "EUR");</li> <li>— rischio di differenziali creditizi non inerente a cartolarizzazione, la risposta è il numero della categoria di cui alla tabella 4 dell'articolo 325 quintricies, paragrafo 1, del regolamento (UE) n. 575/2013;</li> <li>— rischio di differenziali creditizi inerente a cartolarizzazione all'esterno del portafoglio di negoziazione di correlazione alternativo (CSR non-ACTP), la risposta è il numero della categoria di cui alla tabella 7 dell'articolo 325 quadragies, paragrafo 1, del regolamento (UE) n. 575/2013;</li> <li>— rischio di differenziali creditizi inerente a cartolarizzazione all'interno del portafoglio di negoziazione di correlazione alternativo (CSR ACTP), la risposta è il numero della categoria di cui alla tabella 6 dell'articolo 325 octotricies del regolamento (UE) n. 575/2013;</li> <li>— rischio azionario, la risposta è il numero della categoria di cui alla tabella 8 dell'articolo 325 triquadragies, paragrafo 1, del regolamento (UE) n. 575/2013;</li> <li>— rischio di posizione in merci, la risposta è il numero della categoria di cui alla tabella 9 dell'articolo 325 sexquadragies del regolamento (UE) n. 575/2013;</li> <li>— rischio di cambio e componenti delta o curvatura, la risposta è il nome della valuta (ad esempio "USD", i codici valutari segnalati devono seguire la designazione della valuta ISO 4217);</li> <li>— rischio di cambio e componente vega, la risposta è il nome della coppia di valute (ad esempio "EUR_USD", i codici valutari segnalati devono seguire la designazione della valuta ISO 4217).</li> </ul>
0030	Identificativo aggiuntivo 1	Articoli da 325 terdecies a 325 octodecies e articolo 325 sextricies del regolamento (UE) n. 575/2013	<p>Sono segnalate le seguenti informazioni che distinguono il fattore di rischio a livello intra-categoria. Se l'identificativo del fattore di rischio selezionato nella colonna 0010 corrisponde alla classe di rischio:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>— rischio generico di tasso di interesse e componente delta, la risposta è il nome della curva priva di rischio o un altro identificativo univoco corrispondente;</li> <li>— rischio di differenziali creditizi non inerente a cartolarizzazione o il rischio di differenziali creditizi per classe di rischio inerente a cartolarizzazione all'interno del portafoglio di negoziazione di correlazione alternativo (CSR ACTP), la</li> </ul>

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
			<p>risposta è il nome dell'emittente o un altro identificativo univoco corrispondente ed è identica per due qualsiasi sensibilità segnalate rispetto a due fattori di rischio che ricevono un parametro di correlazione <math>\rho_{kl}^{(nome)}</math> pari a 1 conformemente all'articolo 325 sextricies, paragrafo 1, del regolamento (UE) n. 575/2013;</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>— rischio di differenziali creditizi inerente a cartolarizzazione all'esterno del portafoglio di negoziazione di correlazione alternativo (CSR non-ACTP), la risposta è il nome del segmento o un altro identificativo univoco corrispondente;</li> <li>— rischio azionario, la risposta è il nome dell'emittente di strumenti di capitale o un identificativo univoco corrispondente;</li> <li>— rischio di posizione in merci, la risposta è il nome della merce o un altro identificativo univoco corrispondente.</li> </ul> <p>Se non ricorre nessuno di questi casi, gli enti indicano un valore esplicito (NULL) per contrassegnare il campo come non applicabile.</p>
0050	Sensibilità al rischio (risultati nella valuta di segnalazione)	Articolo 325 quinquies, punto 2, e articoli 325 octies, 325 novodecies, 325 vicies, 325 unvicies e 325 unquingages del regolamento (UE) n. 575/2013	<p>Le sensibilità al rischio (sensibilità delta/vega e posizioni di rischio di curvatura) sono segnalate a livello di ciascuno strumento per tutti i fattori di rischio pertinenti, come specificato nelle colonne da 0010 a 0030. I valori sono segnalati nella valuta utilizzata dall'ente per le segnalazioni. Se l'identificativo del fattore di rischio selezionato nella colonna 0010 corrisponde a:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>— componente di rischio delta del metodo basato sulle sensibilità, è segnalata la sensibilità netta al fattore di rischio (<math>S_k</math>) come specificato all'articolo 325 novodecies del regolamento (UE) n. 575/2013. Gli enti che hanno ottenuto l'autorizzazione dalla loro autorità competente a utilizzare le definizioni alternative delle sensibilità al rischio delta conformemente all'articolo 325 unvicies, paragrafo 5, del medesimo regolamento fanno riferimento a tali definizioni alternative per la segnalazione;</li> <li>— componente di rischio vega del metodo basato sulle sensibilità, è segnalata la sensibilità al rischio vega di un'opzione a un dato fattore di rischio (<math>S_k</math>) come specificato all'articolo 325 vicies del regolamento (UE) n. 575/2013; Gli enti che hanno ottenuto l'autorizzazione dalla loro autorità competente a utilizzare modalità di calcolo alternative delle sensibilità al rischio vega conformemente all'articolo 325 unvicies, paragrafo 6, del medesimo regolamento fanno riferimento a tali modalità di calcolo alternative per la segnalazione. Indipendentemente dal fatto che l'ente utilizzi la definizione di cui all'articolo 325 vicies o una modalità di calcolo alternativa a norma dell'articolo 325 unvicies, paragrafo 6, di tale regolamento, la sensibilità è segnalata previa ponderazione per la volatilità implicita corrispondente;</li> <li>— componente di rischio di curvatura del metodo basato sulle sensibilità, è segnalata la posizione di rischio di curvatura netta al rialzo di tale fattore di rischio (<math>CVR_k^+</math>) o la posizione di rischio di curvatura netta al ribasso di tale fattore di rischio (<math>CVR_k^-</math>), come specificato all'articolo 325 octies del regolamento (UE) n. 575/2013.</li> </ul> <p>Il dato comunicato è espresso come decimale con una precisione minima di due decimali. Indicare valori pari a zero solo se il risultato del calcolo è effettivamente pari a zero.</p>
0060	Valuta di segnalazione		È segnalato il nome della valuta utilizzata per le segnalazioni dall'ente (il valore segnalato segue la designazione della valuta ISO 4217, ad esempio "EUR").

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0070	Sensibilità al rischio (risultati nella valuta dello strumento ABE)	Allegato V, sezione 2, del presente regolamento e articolo 325 quinquies, punto 2, e articoli 325 octies, 325 novodecies e 325 vicies del regolamento (UE) n. 575/2013	I valori sono segnalati seguendo le istruzioni per la colonna 0050 ma convertiti al tasso di cambio a pronti BCE associato alla valuta dello strumento come definito nell'allegato V, sezione 2, del presente regolamento.
0080	Modello di determinazione del prezzo	Articolo 325 unvicies del regolamento (UE) n. 575/2013	L'ente specifica quale modello di determinazione del prezzo si applica per ricavare le sensibilità. Si comunica uno dei metodi seguenti: (a) "modelli di determinazione del prezzo dell'ente che fungono da base per la segnalazione dei profitti e delle perdite all'alta dirigenza" (ai sensi dell'articolo 325 unvicies, paragrafo 1, primo comma, del regolamento (UE) n. 575/2013); (b) "metodo dei modelli interni dell'ente" (ai sensi dell'articolo 325 unvicies, paragrafo 1, secondo comma, del medesimo regolamento).
0090	Definizione delle sensibilità	Articoli 325 novodecies, 325 vicies e 325 unvicies del regolamento (UE) n. 575/2013	L'ente specifica quale definizione di sensibilità è applicata nel calcolo dei requisiti in materia di fondi propri. Si comunica una delle seguenti: (a) la definizione di sensibilità di cui agli articoli 325 novodecies e 325 vicies del regolamento (UE) n. 575/2013; (b) la definizione di sensibilità di cui all'articolo 325 unvicies, paragrafi 5 e 6, del regolamento (UE) n. 575/2013.  Nel caso in cui l'identificativo del fattore di rischio selezionato nella colonna 0010 corrisponda alla componente del rischio di curvatura del metodo basato sulle sensibilità, è segnalato il valore di cui alla lettera b) se una qualsiasi delle sensibilità utilizzate nel calcolo della posizione di rischio di curvatura indicata si basa su una definizione di sensibilità a norma dell'articolo 325 unvicies, paragrafi 5 e 6, del regolamento (UE) n. 575/2013; negli altri casi è segnalato il valore di cui alla lettera a).
0100	Riquadro di testo libero		L'ente può fornire informazioni aggiuntive in questa colonna in merito al modello di determinazione del prezzo e alla definizione di sensibilità applicati.
0110	Identificativo aggiuntivo 2	Articolo 325 septdecies, paragrafo 2, del regolamento (UE) n. 575/2013	Se l'identificativo del fattore di rischio selezionato nella colonna 0010 corrisponde alla classe di rischio "Rischio di posizione in merci" e alla componente di rischio delta del metodo basato sulle sensibilità, la risposta è la serie di termini giuridici relativi al luogo di consegna o un altro identificativo univoco corrispondente.  Se non ricorre nessuno di questi casi, gli enti indicano un valore esplicito (NULL) per contrassegnare il campo come non applicabile.

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0120	Categoria di classe di merito di credito	Articolo 325 quaterdecies, paragrafo 1, e articolo 325 quintricies, paragrafo 1, del regolamento (UE) n. 575/2013	<p>Se l'identificativo del fattore di rischio selezionato nella colonna 0010 corrisponde alla classe di rischio "Rischio di differenziali creditizi per strumenti non inerenti a cartolarizzazione" e alla componente di rischio delta del metodo basato sulle sensibilità, la risposta è una delle seguenti:</p> <p>(a) "CQS 1";                      (b) "CQS 2";                      (c) "CQS 3";                      (d) "CQS 4";                      (e) "CQS 5";                      (f) "CQS 6";                      (g) "Nessuna CQS assegnata (senza rating)".</p> <p>Se non ricorre nessuno di questi casi, gli enti indicano un valore esplicito (NULL) per contrassegnare il campo come non applicabile.</p>

**C 107.01 – VaR e sVaR non CTP. Dettagli**

Riga	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0010 - 0060	VaR		
0010	Metodologia		<p>Nella colonna 0010 indicare una delle voci seguenti:</p> <p>(a) simulazione storica;                      (b) simulazione Monte Carlo;                      (c) metodologia parametrica;                      (d) combinazione / altra metodologia (specificare).</p> <p>L'ente utilizza la colonna 0020 per chiarire la risposta fornita nella colonna 0010. In caso di selezione dell'opzione d) nella colonna 0010, l'ente è tenuto a fornire dettagli nella colonna 0020.</p>
0020	Calcolo su un orizzonte di 10 giorni	Articolo 365, paragrafo 1, del regolamento (UE) n. 575/2013	<p>Nella colonna 0010 indicare una delle voci seguenti:</p> <p>(a) 1 giorno riportato a 10 giorni;                      (b) 10 giorni con periodi sovrapposti;                      (c) 10 giorni, altra metodologia.</p> <p>L'ente utilizza la colonna 0020 per chiarire la risposta fornita nella colonna 0010.</p>
0030	Durata del periodo di osservazione	Articolo 365, paragrafo 1, lettera d), del regolamento (UE) n. 575/2013	<p>Nella colonna 0010 indicare una delle voci seguenti:</p> <p>(a) fino a 1 anno;                      (b) tra 1 anno e 2 anni;                      (c) tra 2 anni e 3 anni;                      (d) più di 3 anni.</p> <p>L'ente utilizza la colonna 0020 per chiarire la risposta fornita nella colonna 0010.</p>

Riga	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0040	Ponderazione dei dati	Articolo 365, paragrafo 1, lettera d), del regolamento (UE) n. 575/2013	Nella colonna 0010 indicare una delle voci seguenti: (a) non ponderato (ponderazione dei dati VaR); (b) ponderato (ponderazione dei dati VaR); (c) il più elevato tra ponderato e non ponderato (ponderazione dei dati VaR) di cui alle lettere a) e b). L'ente utilizza la colonna 0020 per chiarire la risposta fornita nella colonna 0010.
0050	Maggiorazione per i test retrospettivi	Articolo 366, paragrafo 2, del regolamento (UE) n. 575/2013	Per "maggiorazione per i test retrospettivi" si intende l'addendo, di valore compreso tra 0 e 1, di cui alla tabella 1 dell'articolo 366, paragrafo 2, del regolamento (UE) n. 575/2013. L'ente utilizza la colonna 0020 per chiarire la risposta fornita nella colonna 0010.
0060	Maggiorazione regolamentare VaR	Articolo 366, paragrafo 2, del regolamento (UE) n. 575/2013 ("almeno 3")	Per "maggiorazione regolamentare VaR" si intende il valore che l'autorità competente impone di aggiungere al fattore moltiplicativo per il VaR (almeno 3) a norma dell'articolo 366, paragrafo 2, del regolamento (UE) n. 575/2013. La maggiorazione regolamentare VaR è la somma della maggiorazione per i test retrospettivi e della maggiorazione qualitativa, se applicabile, superiore a 3. L'ente utilizza la colonna 0020 per chiarire la risposta fornita nella colonna 0010.
0070-0100	sVaR (ossia VaR in condizioni di stress)		
0070	Metodologia		Nella colonna 0010 indicare una delle voci seguenti: (a) simulazione storica; (b) simulazione Monte Carlo; (c) metodologia parametrica; (d) combinazione / altra metodologia (specificare). L'ente utilizza la colonna 0020 per chiarire la risposta fornita nella colonna 0010. In caso di selezione dell'opzione d) nella colonna 0010, l'ente è tenuto a fornire dettagli nella colonna 0020.
0080	Calcolo su un orizzonte di 10 giorni	Articolo 365, paragrafo 1, del regolamento (UE) n. 575/2013	Nella colonna 0010 indicare una delle voci seguenti: (a) 1 giorno riportato a 10 giorni; (b) 10 giorni con periodi sovrapposti; (c) 10 giorni, altra metodologia. L'ente utilizza la colonna 0020 per chiarire la risposta fornita nella colonna 0010.
0090	Maggiorazione regolamentare sVaR	Articolo 366, paragrafo 2, del regolamento (UE) n. 575/2013	Per "maggiorazione regolamentare" si intende il valore che l'autorità competente impone di aggiungere al fattore moltiplicativo per lo sVaR (almeno 3) a norma dell'articolo 366, paragrafo 2, del regolamento (UE) n. 575/2013. La maggiorazione regolamentare è la somma di 3, della maggiorazione per i test retrospettivi e della maggiorazione qualitativa (se applicabile).

Riga	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
			L'ente utilizza la colonna 0020 per chiarire la risposta fornita nella colonna 0010.
0100	Periodo sVaR	Articolo 365, paragrafo 2, del regolamento (UE) n. 575/2013	<p>Nella colonna 0010 indicare una delle voci seguenti:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>(a) calcolo giornaliero del VaR in condizioni di stress calibrato per un periodo continuato di 12 mesi a partire dalla data specificata nella colonna 0020;</li> <li>(b) calcolo settimanale del VaR in condizioni di stress calibrato per un periodo continuato di 12 mesi a partire dalla data specificata nella colonna 0020;</li> <li>(c) calcolo giornaliero del VaR in condizioni di stress calibrato per differenti periodi continuati di 12 mesi alle date di segnalazione del VaR in condizioni di stress indicate nella colonna 0010 del modello C 107.02, a partire dalle date specificate nella colonna 0020;</li> <li>(d) calcolo settimanale del VaR in condizioni di stress calibrato per differenti periodi continuati di 12 mesi alle date di segnalazione del VaR in condizioni di stress indicate nella colonna 0010 del modello C 107.02, a partire dalle date specificate nella colonna 0020;</li> <li>(e) massimo dei calcoli giornalieri del VaR in condizioni di stress calibrati per un periodo superiore a 12 mesi;</li> <li>(f) massimo dei calcoli settimanali del VaR in condizioni di stress calibrati per un periodo superiore a 12 mesi;</li> <li>(g) altre opzioni per la calibrazione del VaR in condizioni di stress (specificare).</li> </ul> <p>L'ente utilizza la colonna 0020 per indicare la data di inizio nel formato "gg/mm/aaaa" nel caso delle opzioni a) o b) di cui alla colonna 0010 e le date di inizio nel formato "gg/mm/aaaa" utilizzate per ciascun calcolo del VaR in condizioni di stress nel caso delle opzioni c) o d) indicate nella colonna 0010. L'ente utilizza la colonna 0020 anche per fornire maggiori chiarimenti sul periodo di 12 mesi utilizzato per ciascun calcolo del VaR in condizioni di stress nel caso in cui nella colonna 0010 siano state specificate le opzioni e), f) e g).</p>

**C 107.02 – VaR, sVaR e PV - non CTP. Risultati nella valuta del portafoglio ABE**

Istruzioni relative ai fogli (asse z)

Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
Portafoglio	Allegato V, sezioni 3, 4 e 5	Segnalare il numero del portafoglio tratto dall'allegato V.

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0010	Data		I risultati riguardanti il VaR, lo sVaR e il valore attuale (PV) sono comunicati per tutti i 10 giorni lavorativi tra la "data di riferimento iniziale delle RM" e la "data di riferimento finale delle RM (e ASA finale)" come specificato nell'allegato V, sezione 1, lettera b). Per indicare le date è adottata la convenzione "gg/mm/aaaa".

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0020	VaR	Articolo 365 del regolamento (UE) n. 575/2013	Indicare il VaR regolamentare a 10 giorni ottenuto per ogni portafoglio, senza applicare il fattore moltiplicativo regolamentare di «almeno 3». Comunicare i numeri per ognuna delle date indicate nella colonna 0010. La casella non va compilata se l'ente non calcola un VaR alla data indicata nella colonna 0010 (vale a dire che il valore zero va indicato solo se il risultato del calcolo è zero).
0030	sVaR	Articolo 365 del regolamento (UE) n. 575/2013	Indicare lo sVaR regolamentare a 10 giorni ottenuto per ogni portafoglio, senza applicare il fattore moltiplicativo regolamentare di «almeno 3». Comunicare i numeri per ognuna delle date indicate nella colonna 0010. La casella non va compilata se l'ente non calcola uno sVaR alla data indicata nella colonna 0010 (vale a dire che il valore zero va indicato solo se il risultato del calcolo è zero).
0040	PV		Indicare il valore attuale (PV) per ogni portafoglio. Comunicare i numeri per ognuna delle date indicate nella colonna 0010. La casella non va compilata se l'ente non calcola un PV alla data indicata nella colonna 0010 (vale a dire che il valore zero va indicato solo se il risultato del calcolo è zero).

### C 108.00 – Serie temporali di profitti e perdite

Il modello C 108.00 ("Serie temporali di profitti e perdite") deve essere compilato solo dagli enti che calcolano il VaR utilizzando una simulazione storica.

Istruzioni relative ai fogli (asse z)

Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
Portafoglio	Allegato V, sezioni 3, 4 e 5	Segnalare il numero del portafoglio tratto dall'allegato V.

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0010	Data	Articolo 365, paragrafo 1, lettera d), del regolamento (UE) n. 575/2013	Ogni giorno lavorativo, in base al calendario vigente nel paese dell'ente, gli enti devono trasmettere le serie di dati su profitti e perdite utilizzate per calcolare il VaR nella colonna 0010 del modello C 107.02, con un minimo di 250 osservazioni a partire dalla data di riferimento finale delle RM (e ASA finale), come specificato nell'allegato V, sezione 1, lettera b), punto v), andando a ritroso.
0020	Profitti e perdite giornalieri		Gli enti che calcolano il VaR applicando la simulazione storica compilano l'intera serie storica utilizzata, e almeno la serie annuale di dati, inserendo la variazione della valutazione del portafoglio (vale a dire profitti e perdite giornalieri) verificatasi utilizzando le variazioni quotidiane del fattore di rischio simulate storicamente (ovvero le serie quotidiane di profitti e perdite utilizzate per derivare il VaR regolamentare di 1 giorno).



Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
			Se uno dei giorni in questione è festivo nella giurisdizione pertinente, la casella non va compilata (vale a dire che un valore profitti e perdite pari a zero va indicato solo se non vi è stata alcuna variazione del valore ipotetico del portafoglio in un dato giorno lavorativo).

**C 109.01 – IRC. Dettagli del modello**

Riga	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0010	Numero di fattori di modellizzazione		EBA/GL/2012/3 Indicare il numero dei fattori di modellizzazione a livello generale di modello IRC. La risposta è una delle seguenti: (a) 1 fattore di modellizzazione; (b) 2 fattori di modellizzazione; (c) più di 2 fattori di modellizzazione. L'ente utilizza la colonna 0020 per chiarire la risposta fornita nella colonna 0010.
0020	Fonte delle LGD		EBA/GL/2012/3 Comunicare la fonte delle LGD a livello generale di modello IRC. La risposta è una delle seguenti: (a) convenzione di mercato; (b) LGD usata nel metodo IRB; (c) altra fonte di LGD (specificare). L'ente utilizza la colonna 0020 per chiarire la risposta fornita nella colonna 0010. In caso di selezione dell'opzione c) nella colonna 0010, l'ente è tenuto a fornire dettagli in questa colonna.

**C 109.02 – IRC. Dettagli per portafoglio**

Istruzioni relative ai fogli (asse z)

Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
Portafoglio	Allegato V, sezioni 3, 4 e 5	Segnalare il numero del portafoglio tratto dall'allegato V unicamente per i portafogli per i quali è richiesta l'IRC.

Riga	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0010	Orizzonte di liquidità	Articolo 374, paragrafo 5, del regolamento (UE) n. 575/2013	EBA/GL/2012/3 Comunicare l'orizzonte di liquidità applicato a livello di portafoglio. La risposta è una delle seguenti: (a) fino a 3 mesi; (b) tra 3 e 6 mesi; (c) tra 6 e 9 mesi; (d) tra 9 e 12 mesi.
0020	Fonte delle PD		EBA/GL/2012/3 Indicare la fonte delle PD applicate a livello di portafoglio. La risposta è una delle seguenti: (a) agenzie di rating; (b) IRB; (c) PD implicite di mercato; (d) altra fonte di PD (specificare).  L'ente utilizza la colonna 0020 per chiarire la risposta fornita nella colonna 0010. In caso di selezione dell'opzione d) nella colonna 0010, l'ente è tenuto a fornire dettagli in questa colonna 0020.
0030	Fonte delle matrici di transizione		EBA/GL/2012/3 Comunicare la fonte delle matrici di transizione applicate a livello di portafoglio. La risposta è una delle seguenti: (a) agenzie di rating; (b) IRB; (c) matrici di transizione implicite di mercato; (d) altre fonti di matrici di transizione (specificare).  L'ente utilizza la colonna 0020 per chiarire la risposta fornita nella colonna 0010. In caso di selezione dell'opzione d) nella colonna 0010, l'ente è tenuto a fornire dettagli in questa colonna 0020.

### C 109.03 – IRC. Importo per portafoglio/data

Istruzioni relative ai fogli (asse z)

Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
Portafoglio	Allegato V, sezioni 3, 4 e 5	Segnalare il numero del portafoglio tratto dall'allegato V unicamente per i portafogli per i quali è richiesta l'IRC.

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0010	Data		L'IRC va comunicata per tutti i 10 giorni lavorativi tra la "data di riferimento iniziale delle RM" e la "data di riferimento finale delle RM (e ASA finale)", come specificato nell'allegato V, sezione 1, lettera b). Per indicare le date è adottata la convenzione "gg/mm/aaaa".
0020	IRC	Articoli da 372 a 376 del regolamento (UE) n. 575/2013	EBA/GL/2012/3 Indicare l'IRC regolamentare ottenuta per ogni portafoglio.  Comunicare i numeri per ognuna delle date indicate nella colonna 0010. La casella non va compilata se l'ente non calcola l'IRC alla data indicata nella colonna 0010 (vale a dire che il valore zero va indicato solo se il risultato del calcolo è zero).

**C 110.01 – CT. Dettagli del modello**

Riga	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0010	Numero di fattori di modellizzazione	Articolo 377 del regolamento (UE) n. 575/2013	Indicare il numero di fattori di modellizzazione a livello generale di modello per la negoziazione di correlazione. La risposta è una delle seguenti: (a) 1 fattore di modellizzazione; (b) 2 fattori di modellizzazione; (c) più di 2 fattori di modellizzazione.  L'ente utilizza la colonna 0020 per chiarire la risposta fornita nella colonna 0010.
0020	Fonte delle LGD	Articolo 377 del regolamento (UE) n. 575/2013	Indicare la fonte delle LGD a livello generale di modello per la negoziazione di correlazione. La risposta è una delle seguenti: (a) convenzione di mercato; (b) LGD usata nel metodo IRB; (c) altre fonti di LGD (specificare).  L'ente utilizza la colonna 0020 per chiarire la risposta fornita nella colonna 0010. In caso di selezione dell'opzione c) nella colonna 0010, l'ente è tenuto a fornire dettagli in questa colonna.

**C 110.02 – CT. Dettagli per portafoglio**

Istruzioni relative ai fogli (asse z)

Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
Portafoglio	Allegato V, sezioni 3, 4 e 5	Segnalare il numero del portafoglio tratto dall'allegato V unicamente per i portafogli per i quali è richiesto l'APR.

Riga	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0010	Orizzonte di liquidità	Articolo 377, paragrafo 2, del regolamento (UE) n. 575/2013	Comunicare l'orizzonte di liquidità applicato a livello di portafoglio. La risposta è una delle seguenti: (a) fino a 3 mesi; (b) tra 3 e 6 mesi; (c) tra 6 e 9 mesi; (d) tra 9 e 12 mesi.
0020	Fonte delle PD	Articolo 377 del regolamento (UE) n. 575/2013	Indicare la fonte delle PD applicate a livello di portafoglio. La risposta è una delle seguenti: (a) agenzie di rating; (b) IRB; (c) PD implicite di mercato; (d) altra fonte di PD (specificare).  L'ente utilizza la colonna 0020 per chiarire la risposta fornita nella colonna 0010. In caso di selezione dell'opzione d) nella colonna 0010, l'ente è tenuto a fornire dettagli nella colonna 0020.
0030	Fonte delle matrici di transizione	Articolo 377 del regolamento (UE) n. 575/2013	Indicare la fonte delle matrici di transizione applicate a livello di portafoglio. La risposta è una delle seguenti: (a) agenzie di rating; (b) IRB; (c) matrici di transizione implicite di mercato; (d) altra fonte di matrici di transizione (specificare).  L'ente utilizza la colonna 0020 per chiarire la risposta fornita nella colonna 0010. In caso di selezione dell'opzione d) nella colonna 0010, l'ente è tenuto a fornire dettagli nella colonna 0020.

**C 110.03 – CT. APR per portafoglio/data**

Istruzioni relative ai fogli (asse z)

Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
Portafoglio	Allegato V, sezioni 3, 4 e 5	Segnalare il numero del portafoglio tratto dall'allegato V unicamente per i portafogli per i quali è richiesto l'APR.

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0010	Data	Articolo 377 del regolamento (UE) n. 575/2013	L'APR (tutti i rischi di prezzo) va comunicato per tutti i 10 giorni lavorativi tra la "data di riferimento iniziale delle RM" e la "data di riferimento finale delle RM (e ASA finale)", come specificato nell'allegato V, sezione 1, lettera b). Per indicare le date è adottata la convenzione "gg/mm/aaaa".
0060	APR	Articolo 377 del regolamento (UE) n. 575/2013	Indicare i risultati ottenuti applicando il modello regolamentare di negoziazione di correlazione ad ogni portafoglio. Comunicare i numeri per ognuna delle date indicate nella colonna 0010. La casella non va compilata se l'ente non usa un modello di negoziazione di correlazione alla data indicata nella colonna 0010 (vale a dire che il valore zero va indicato solo se il risultato del calcolo è zero).

**C 120.01 – SBM. SENSIBILITÀ AL RISCHIO PER STRUMENTO/PORTAFOGLIO**

Gli enti segnalano, strumento per strumento, le sensibilità nei confronti dei fattori di rischio ai quali lo strumento è esposto. Compilare una riga per fattore di rischio/sensibilità al rischio. La posizione di rischio di curvatura netta al rialzo di tale fattore di rischio (CVRk+) o la posizione di rischio di curvatura netta al ribasso di tale fattore di rischio (CVRk-), come specificato all'articolo 325 octies del regolamento (UE) n. 575/2013, è segnalata in singole righe. Tutti i valori si riferiscono alla "data di riferimento finale delle RM (e ASA finale)" (ai sensi dell'allegato V, sezione 1, lettera b), punto v), del presente regolamento). Gli enti segnalano ogni combinazione di numero del portafoglio, numero dello strumento (colonna 0010), identificativo del rischio (colonna 0020), categoria (colonna 0030) e identificativo aggiuntivo (colonna 0040) una sola volta.

Istruzioni relative ai fogli (asse z)

Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
Portafoglio	Allegato V, sezioni 3, 4 e 5	Segnalare il numero del portafoglio tratto dall'allegato V.

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0010	Numero dello strumento	Allegato V, sezione 2	Segnalare il numero dello strumento tratto dall'allegato V.

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0020	Identificativo del fattore di rischio	Articoli 325 terdecies, 325 quaterdecies, 325 quindecies, 325 sexdecies, 325 septdecies e 325 octodecies del regolamento (UE) n. 575/2013	È segnalato l'identificativo del fattore di rischio come specificato nella tabella alla fine del presente allegato.
0030	Categoria	Articolo 325 quinquies, punto 3, del regolamento (UE) n. 575/2013	<p>Se l'identificativo del fattore di rischio selezionato nella colonna 0020 corrisponde alla classe di rischio, deve essere indicata la categoria:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>— rischio generico di tasso di interesse, la risposta è il nome della valuta del pertinente tasso privo di rischio, fattore di rischio inflazione o fattore di rischio di base cross currency (secondo la designazione della valuta ISO 4217, ad esempio "EUR");</li> <li>— rischio di differenziali creditizi non inerente a cartolarizzazione, la risposta è il numero della categoria di cui alla tabella 4 dell'articolo 325 quintricies, paragrafo 1, del regolamento (UE) n. 575/2013;</li> <li>— rischio di differenziali creditizi inerente a cartolarizzazione all'esterno del portafoglio di negoziazione di correlazione alternativo (CSR non-ACTP), la risposta è il numero della categoria di cui alla tabella 7 dell'articolo 325 quadragies, paragrafo 1, del regolamento (UE) n. 575/2013;</li> <li>— rischio di differenziali creditizi inerente a cartolarizzazione all'interno del portafoglio di negoziazione di correlazione alternativo (CSR ACTP), la risposta è il numero della categoria di cui alla tabella 6 dell'articolo 325 octotricies del regolamento (UE) n. 575/2013;</li> <li>— rischio azionario, la risposta è il numero della categoria di cui alla tabella 8 dell'articolo 325 triquadragies, paragrafo 1, del regolamento (UE) n. 575/2013;</li> <li>— rischio di posizione in merci, la risposta è il numero della categoria di cui alla tabella 9 dell'articolo 325 sexquadragies del regolamento (UE) n. 575/2013;</li> <li>— rischio di cambio e componenti delta o curvatura, la risposta è il nome della valuta (ad esempio "USD", i codici valutari segnalati devono seguire la designazione della valuta ISO 4217);</li> <li>— rischio di cambio e componente vega, la risposta è il nome della coppia di valute (ad esempio "EUR_USD", i codici valutari segnalati devono seguire la designazione della valuta ISO 4217).</li> </ul>
0040	Identificativo aggiuntivo 1	Articoli da 325 terdecies a 325 octodecies e articolo 325 sextricies del regolamento (UE) n. 575/2013	<p>Sono segnalate le seguenti informazioni che distinguono il fattore di rischio a livello intra-categoria. Se l'identificativo del fattore di rischio selezionato nella colonna 0020 corrisponde alla classe di rischio:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>— rischio generico di tasso di interesse e componente delta, la risposta è il nome della curva priva di rischio o un altro identificativo univoco corrispondente;</li> <li>— rischio di differenziali creditizi non inerente a cartolarizzazione o il rischio di differenziali creditizi per classe di rischio inerente a cartolarizzazione all'interno del portafoglio di negoziazione di correlazione alternativo (CSR ACTP), la risposta è il nome dell'emittente o un altro identificativo univoco corrispondente ed è identica per due qualsiasi sensibilità segnalate rispetto a due fattori di rischio che ricevono un parametro di correlazione <math>\rho_{kl}^{(nome)}</math> pari a 1 conformemente all'articolo 325 sextricies, paragrafo 1, del regolamento (UE) n. 575/2013;</li> <li>— rischio di differenziali creditizi inerente a cartolarizzazione all'esterno del portafoglio di negoziazione di correlazione alternativo (CSR non-ACTP), la risposta è il nome del segmento o un altro identificativo univoco corrispondente;</li> <li>— rischio azionario, la risposta è il nome dell'emittente di strumenti di capitale o un identificativo univoco corrispondente;</li> </ul>

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
			<p>— rischio di posizione in merci, la risposta è il nome della merce o un altro identificativo univoco corrispondente.</p> <p>Se non ricorre nessuno di questi casi, gli enti indicano un valore esplicito (NULL) per contrassegnare il campo come non applicabile.</p>
0060	Sensibilità al rischio (Risultati nella valuta di segnalazione)	Articolo 325 quinquies, punto 2, e articoli 325 octies, 325 novodecies, 325 vicies, 325 unvicies e 325 unquingages del regolamento (UE) n. 575/2013	<p>Le sensibilità al rischio (sensibilità delta/vega e posizioni di rischio di curvatura) sono segnalate a livello di ciascuno strumento per tutti i fattori di rischio pertinenti, come specificato nelle colonne da 0020 a 0040. I valori sono segnalati nella valuta utilizzata dall'ente per le segnalazioni. Se l'identificativo del fattore di rischio selezionato nella colonna 0020 corrisponde a:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>— componente di rischio delta del metodo basato sulle sensibilità, è segnalata la sensibilità netta al fattore di rischio (<math>S_k</math>) come specificato all'articolo 325 novodecies del regolamento (UE) n. 575/2013. Gli enti che hanno ottenuto l'autorizzazione dalla loro autorità competente a utilizzare i calcoli alternativi delle sensibilità al rischio delta conformemente all'articolo 325 unvicies, paragrafo 5, del medesimo regolamento fanno riferimento a tali definizioni alternative per la segnalazione;</li> <li>— componente di rischio vega del metodo basato sulle sensibilità, è segnalata la sensibilità al rischio vega di un'opzione a un dato fattore di rischio (<math>S_k</math>) come specificato all'articolo 325 vicies del regolamento (UE) n. 575/2013; Gli enti che hanno ottenuto l'autorizzazione dalla loro autorità competente a utilizzare modalità di calcolo alternative delle sensibilità al rischio vega conformemente all'articolo 325 unvicies, paragrafo 6, del medesimo regolamento fanno riferimento a tali modalità di calcolo alternative per la segnalazione. Independentemente dal fatto che l'ente utilizzi la modalità di calcolo di cui all'articolo 325 vicies o una modalità di calcolo alternativa a norma dell'articolo 325 unvicies, paragrafo 6, di tale regolamento, la sensibilità è segnalata previa ponderazione per la volatilità implicita corrispondente;</li> <li>— componente di rischio di curvatura del metodo basato sulle sensibilità, è segnalata la posizione di rischio di curvatura netta al rialzo di tale fattore di rischio (<math>CVR_k^+</math>) o la posizione di rischio di curvatura netta al ribasso di tale fattore di rischio (<math>CVR_k^-</math>), come specificato all'articolo 325 octies del regolamento (UE) n. 575/2013.</li> </ul> <p>Il dato comunicato è espresso come decimale con una precisione minima di due decimali.</p> <p>Indicare valori pari a zero solo se il risultato del calcolo è effettivamente pari a zero.</p>
0070	Valuta di segnalazione		È segnalato il nome della valuta utilizzata per le segnalazioni dall'ente (il valore segnalato segue la designazione della valuta ISO 4217, ad esempio "EUR").
0080	Sensibilità al rischio (risultati nella valuta del portafoglio ABE)	Allegato V, sezioni 3 e 4, del presente regolamento e articolo 325 quinquies, punto 2, e articoli 325 octies, 325 novodecies, 325 vicies, 325 unvicies e 325 unquingages del regolamento (UE) n. 575/2013	I valori sono segnalati seguendo le istruzioni per la colonna 0060 ma convertiti al tasso di cambio a pronti BCE associato alla valuta del portafoglio come definito nell'allegato V, sezioni 3 e 4, del presente regolamento.

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0090	Fattore di ponderazione del rischio	Parte tre, titolo IV, capo 1 bis, sezione 6, del regolamento (UE) n. 575/2013	Indicare il fattore di ponderazione del rischio corrispondente al fattore di rischio specificato nelle colonne da 0020 a 0040. Se l'identificativo del fattore di rischio selezionato nella colonna 0020 corrisponde alla componente del rischio di curvatura, indicare il fattore di ponderazione del rischio utilizzato per determinare lo spostamento relativo applicabile.  Il dato comunicato è espresso come decimale con una precisione minima di quattro decimali.
0110	Identificativo aggiuntivo 2	Articolo 325 septdecies, paragrafo 2, del regolamento (UE) n. 575/2013	Se l'identificativo del fattore di rischio selezionato nella colonna 0010 corrisponde alla classe di rischio "Rischio di posizione in merci" e alla componente di rischio delta del metodo basato sulle sensibilità, la risposta è la serie di termini giuridici relativi al luogo di consegna o un altro identificativo univoco corrispondente.  Se non ricorre nessuno di questi casi, gli enti indicano un valore esplicito (NULL) per contrassegnare il campo come non applicabile.
0120	Categoria di classe di merito di credito	Articolo 325 quaterdecies, paragrafo 1, e articolo 325 quintricies, paragrafo 1, del regolamento (UE) n. 575/2013	Se l'identificativo del fattore di rischio selezionato nella colonna 0010 corrisponde alla classe di rischio "Rischio di differenziali creditizi per strumenti non inerenti a cartolarizzazione" e alla componente di rischio delta del metodo basato sulle sensibilità, la risposta è una delle seguenti:  (a) "CQS 1"; (b) "CQS 2"; (c) "CQS 3"; (d) "CQS 4"; (e) "CQS 5"; (f) "CQS 6"; (g) "Nessuna CQS assegnata (senza rating)".  Se non ricorre nessuno di questi casi, gli enti indicano un valore esplicito (NULL) per contrassegnare il campo come non applicabile.

#### C 120.02 – SBM. COMPOSIZIONE DELL'OFI PER PORTAFOGLIO

Istruzioni relative ai fogli (asse z)

Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
Portafoglio	Allegato V, sezioni 3, 4 e 5	Segnalare il numero del portafoglio tratto dall'allegato V.



Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0010	Classe di rischio	Articolo 325 quinquies, punto 1, del regolamento (UE) n. 575/2013	<p>Segnalare la classe di rischio. La risposta è una delle seguenti:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>(a) "rischio generico di tasso di interesse (GIRR)";</li> <li>(b) "rischio di spread creditizio. CSR non inerente a cartolarizzazione" (rischio di differenziali creditizi (CSR) non inerente a cartolarizzazione);</li> <li>(c) "rischio di spread creditizio. CSR non-ACTP (rischio di differenziali creditizi inerente a cartolarizzazione all'esterno del portafoglio di negoziazione di correlazione alternativo (CSR non-ACTP));</li> <li>(d) "rischio di spread creditizio. CSR ACTP" (rischio di differenziali creditizi inerente a cartolarizzazione all'interno del portafoglio di negoziazione di correlazione alternativo (CSR ACTP));</li> <li>(e) "rischio azionario";</li> <li>(f) "rischio di posizione in merci";</li> <li>(g) "rischio di cambio".</li> </ul>
0020	Componente	Articolo 325 sexies, paragrafo 1, del regolamento (UE) n. 575/2013	<p>Segnalare la componente del metodo basato sulle sensibilità. La risposta è una delle seguenti:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>(a) "Rischio delta";</li> <li>(b) "Rischio Vega";</li> <li>(c) "Rischio di curvatura";</li> </ul>
0030	Scenario delle correlazioni	Articolo 325 nonies del regolamento (UE) n. 575/2013	<p>Segnalare lo scenario delle correlazioni. La risposta è una delle seguenti:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>(a) "Scenario delle correlazioni medie";</li> <li>(b) "Scenario delle correlazioni alte";</li> <li>(c) "Scenario delle correlazioni basse".</li> </ul>
0040	Requisiti di fondi propri (risultati nella valuta di segnalazione)	Articolo 325 nonies del regolamento (UE) n. 575/2013	I valori dei requisiti di fondi propri sono segnalati per la "data di riferimento finale delle RM (e ASA finale)" (come specificato nell'allegato V, sezione 1, lettera b), del presente regolamento) per ciascun portafoglio per tutte le pertinenti combinazioni di classe di rischio, componente e scenario delle correlazioni. I valori sono segnalati nella valuta utilizzata dall'ente per le segnalazioni e sono espressi con una precisione minima di due decimali.
0050	Valuta di segnalazione		È segnalata la valuta utilizzata per le segnalazioni dall'ente (il valore segnalato segue la designazione della valuta ISO 4217).
0060	Requisiti di fondi propri (risultati nella valuta del portafoglio ABE)	Allegato V, sezioni 3 e 4, del presente regolamento e articolo 325 nonies del regolamento (UE) n. 575/2013	I valori sono segnalati seguendo le istruzioni per la colonna 0040 ma convertiti al tasso di cambio a pronti BCE associato alla valuta del portafoglio come definito nell'allegato V, sezioni 3 e 4, del presente regolamento.
0070	Posizioni senza opzionalità soggette a requisiti di fondi propri per il rischio di curvatura	Articolo 325 sexies, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 575/2013	<p>Se la componente della colonna 0020 corrisponde al rischio di curvatura:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>(a) indicare "TRUE" se l'ente applica il metodo di cui all'articolo 325 sexies, paragrafo 3, primo comma, del regolamento (UE) n. 575/2013 per calcolare il risultato segnalato nelle colonne 0040 e 0060.</li> <li>(b) Negli altri casi indicare "FALSE".</li> </ul> <p>Anche nel caso in cui non ricorra nessuno di questi casi, deve essere indicata la dicitura "FALSE" (falso).</p>

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0080	Metodo della valuta di base applicato al delta e alla curvatura del rischio di cambio	Articolo 325 octodecies, paragrafo 7, del regolamento (UE) n. 575/2013	Se la classe di rischio della colonna 0010 corrisponde al rischio di cambio e la componente della colonna 0020 corrisponde al rischio delta o al rischio di curvatura: (a) indicare "TRUE" se l'ente applica il metodo di cui all'articolo 325 octodecies, paragrafo 7, del regolamento (UE) n. 575/2013 per calcolare il risultato segnalato nelle colonne 0040 e 0060. (b) Negli altri casi indicare "FALSE". Anche nel caso in cui non ricorra nessuno di questi casi, deve essere indicata la dicitura "FALSE" (falso).
0090	Divisione per scalare delle componenti del rischio di curvatura per il rischio di cambio	Articolo 325 octodecies, paragrafo 6, del regolamento (UE) n. 575/2013	Se la classe di rischio della colonna 0010 corrisponde al rischio di cambio e la componente della colonna 0020 corrisponde al rischio di curvatura: (a) indicare "TRUE" se l'ente applica il metodo di cui all'articolo 325 octodecies, paragrafo 6, del regolamento (UE) n. 575/2013 per calcolare il risultato segnalato nelle colonne 0040 e 0060. (b) Negli altri casi indicare "FALSE". Anche nel caso in cui non ricorra nessuno di questi casi, deve essere indicata la dicitura "FALSE" (falso).
0095	Trasmissione dei risultati del portafoglio di convalida dell'SBM	Articolo 325 sexies, paragrafo 1, del regolamento (UE) n. 575/2013	Se il portafoglio per il quale sono segnalate le informazioni è un portafoglio di convalida dell'SBM di cui all'allegato V, sezione 7: a) indicare "Trasmesso" se l'ente trasmette i risultati corrispondenti a tale portafoglio; b) indicare "Non trasmesso - nessuna esposizione al fattore di rischio" se l'ente sceglie di non trasmettere i risultati per il pertinente portafoglio di convalida dell'SBM, in quanto la dirigenza dell'ente non ha approvato internamente che l'ente operi in strumenti che genererebbero esposizioni verso il fattore di rischio pertinente.  Indicare "Non applicabile" se il portafoglio per il quale sono segnalate le informazioni è un portafoglio di cui all'allegato V, sezione 3, 4 o 5.
0100	Riquadro di testo libero		In questa colonna l'ente può fornire ulteriori informazioni.

#### C 120.04 – DRC. VALORI DI MERCATO E IMPORTI JTD LORDI PER STRUMENTO/PORTAFOGLIO

Gli enti segnalano, strumento per strumento, le esposizioni corrispondenti allo strumento. Compilare una riga per esposizione. Tutti i valori si riferiscono alla "data di riferimento finale delle RM (e ASA finale)" (ai sensi dell'allegato V, sezione 1, lettera b), punto v), del presente regolamento). Le esposizioni sono segnalate prima di qualsiasi compensazione, ma dopo le fasi di replicazione o scomposizione (quali definite agli articoli 325 septvicies e 325 tricies del regolamento (UE) n. 575/2013), se del caso.

Istruzioni relative ai fogli (asse z)

Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
Portafoglio	Allegato V, sezioni 3, 4 e 5	Segnalare il numero del portafoglio tratto dall'allegato V.

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0010	Numero dello strumento	Allegato V, sezione 2	Segnalare il numero dello strumento tratto dall'allegato V.
0020	Classe di rischio	Articolo 325 tercivics, paragrafo 2, del regolamento (UE) n. 575/2013	Indicare la classe di rischio per la quale è segnalato il requisito per il rischio di default (DRC) nelle colonne 0030 e 0040. La risposta è uno dei seguenti tipi di strumenti: (a) "Strumenti diversi dalle posizioni verso la cartolarizzazione"; (b) "Posizioni verso la cartolarizzazione che non sono incluse nell'ACTP"; (c) "Posizioni verso la cartolarizzazione che sono incluse nell'ACTP".
0030	Categoria 1	Articolo 325 sexvicies, paragrafo 3, articolo 325 octovicies, paragrafo 4, e articolo 325 untricies, paragrafo 2, del regolamento (UE) n. 575/2013	È segnalata la categoria. Se la classe di rischio segnalata nella colonna 0020 corrisponde a "Strumenti non inerenti a cartolarizzazione", la risposta è una delle seguenti: (a) "Imprese"; (b) "Emittenti sovrani"; (c) "Amministrazioni locali/comuni". Se invece la classe di rischio segnalata nella colonna 0020 corrisponde a "Posizioni verso la cartolarizzazione che non sono incluse nell'ACTP", la risposta è la risposta a) di cui sopra o una delle seguenti: (d) "ABCP - Asia"; (e) "ABCP - Europa"; (f) "ABCP - Nordamerica"; (g) "ABCP - resto del mondo"; (h) "Acquisto o leasing di automobili - Asia"; (i) "Acquisto o leasing di automobili - Europa"; (j) "Acquisto o leasing di automobili - Nordamerica"; (k) "Acquisto o leasing di automobili - resto del mondo"; (l) "CDO-squared (collateralised debt obligation squared) - Asia"; (m) "CDO-squared (collateralised debt obligation squared) - Europa"; (n) "CDO-squared (collateralised debt obligation squared) - Nordamerica"; (o) "CDO-squared (collateralised debt obligation squared) - resto del mondo"; (p) "Collateralised loan obligations - Asia"; (q) "Collateralised loan obligations - Europa"; (r) "Collateralised loan obligations - Nordamerica"; (s) "Collateralised loan obligations - resto del mondo"; (t) "CMBS (commercial mortgage-backed securities) - Asia"; (u) "CMBS (commercial mortgage-backed securities) - Europa"; (v) "CMBS (commercial mortgage-backed securities) - Nordamerica"; (w) "CMBS (commercial mortgage-backed securities) - resto del mondo"; (x) "Carte di credito - Asia"; (y) "Carte di credito - Europa"; (z) "Carte di credito - Nordamerica"; (aa) "Carte di credito - resto del mondo"; (bb) "Altre attività al dettaglio - Asia"; (cc) "Altre attività al dettaglio - Europa"; (dd) "Altre attività al dettaglio - Nordamerica";

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
			(ee) "Altre attività al dettaglio - resto del mondo"; (ff) "Altre attività all'ingrosso - Asia"; (gg) "Altre attività all'ingrosso - Europa"; (hh) "Altre attività all'ingrosso - Nordamerica"; (ii) "Altre attività all'ingrosso - resto del mondo"; (jj) "Titoli garantiti da mutui ipotecari residenziali (RMBS) - Asia"; (kk) "Titoli garantiti da mutui ipotecari residenziali (RMBS) - Europa"; (ll) "Titoli garantiti da mutui ipotecari residenziali (RMBS) - Nordamerica"; (mm) "Titoli garantiti da mutui ipotecari residenziali (RMBS) - resto del mondo"; (nn) "Piccole e medie imprese (PMI) - Asia"; (oo) "Piccole e medie imprese (PMI) - Europa"; (pp) "Piccole e medie imprese (PMI) - Nordamerica"; (qq) "Piccole e medie imprese (PMI) - resto del mondo"; (rr) "Prestiti destinati agli studenti - Asia"; (ss) "Prestiti destinati agli studenti - Europa"; (tt) "Prestiti destinati agli studenti - Nordamerica"; (uu) "Prestiti destinati agli studenti - resto del mondo".  Se invece la classe di rischio segnalata nella colonna 0020 corrisponde a "Posizioni verso la cartolarizzazione che sono incluse nell'ACTP", la risposta è "Posizioni verso la cartolarizzazione che sono incluse nell'ACTP".
0040	Categoria 2	Articolo 325 untricies, paragrafo 2, del regolamento (UE) n. 575/2013	Se la classe di rischio segnalata nella colonna 0020 corrisponde a "Posizioni verso la cartolarizzazione che sono incluse nell'ACTP", la risposta è il nome dell'indice; negli altri casi indicare "NULL" .
0050	Debitore	Articolo 325 tervicies, paragrafo 2, articolo 325 quinvicies, paragrafo 1, e articoli 325 septvicies e 325 tricies del regolamento (UE) n. 575/2013	Gli enti segnalano le informazioni relative al debitore. Se la classe di rischio indicata nella colonna 0020 corrisponde a: <ul style="list-style-type: none"> <li>— "Strumenti diversi dalle posizioni verso la cartolarizzazione", la risposta è il nome del debitore;</li> <li>— "Posizioni verso la cartolarizzazione che non sono incluse nell'ACTP", la risposta è il nome del debitore o un identificativo unico che indichi il portafoglio di attività sottostanti e il segmento;</li> <li>— "Posizioni verso la cartolarizzazione che sono incluse nell'ACTP", la risposta è un identificativo unico che indichi la famiglia, la serie e il segmento di indici.</li> </ul>
0060	Categoria di classe di merito di credito	Articolo 325 sexvicies, paragrafi 1 e 2, articolo 325 octovicies, paragrafo 1, e articolo 325 untricies, paragrafo 1, del regolamento (UE) n. 575/2013	Gli enti comunicano la classe di merito di credito. La risposta è una delle seguenti: <ul style="list-style-type: none"> <li>(a) "CQS 1";</li> <li>(b) "CQS 2";</li> <li>(c) "CQS 3";</li> <li>(d) "CQS 4";</li> <li>(e) "CQS 5";</li> <li>(f) "CQS 6";</li> <li>(g) "Nessuna CQS assegnata (senza rating)";</li> </ul>

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
			<p>(h) "Nessuna CQS assegnata (in stato di default)";</p> <p>(i) "Nessuna CQS assegnata (fattore di ponderazione del rischio dello 0 %)".</p> <p>Se la classe di rischio segnalata nella colonna 0020 corrisponde a "Posizioni verso la cartolarizzazione che sono incluse nell'ACTP" o "Posizioni verso la cartolarizzazione che non sono incluse nell'ACTP", la risposta è una tra quelle indicate sopra o una tra le seguenti:</p> <p>(j) "CQS 7";</p> <p>(k) "CQS 8";</p> <p>(l) "CQS 9";</p> <p>(m) "CQS 10";</p> <p>(n) "CQS 11";</p> <p>(o) "CQS 12";</p> <p>(p) "CQS 13";</p> <p>(q) "CQS 14";</p> <p>(r) "CQS 15";</p> <p>(s) "CQS 16";</p> <p>(t) "CQS 17";</p> <p>(u) "Tutte le altre CQS".</p>
0070	Fattore di ponderazione del rischio di default	Articolo 325 tervicies, paragrafo 1, lettera f), articolo 325 sexvicies, paragrafi 1 e 2, articolo 325 octovicies, paragrafo 1, e articolo 325 untricies, paragrafo 1, del regolamento (UE) n. 575/2013	Gli enti segnalano il pertinente fattore di ponderazione del rischio. I fattori di ponderazione del rischio applicati alle esposizioni verso la cartolarizzazione sono segnalati dopo essere stati moltiplicati per l'8 % conformemente all'articolo 325 octovicies, paragrafo 1, del regolamento (UE) n. 575/2013.
0080	Rango	Articolo 325 quatervicies, paragrafi 3 e 6, del regolamento (UE) n. 575/2013	<p>Indicare il rango dell'esposizione. Se la classe di rischio segnalata nella colonna 0020 corrisponde a "Strumenti diversi dalle posizioni verso la cartolarizzazione" o "Posizioni verso la cartolarizzazione che non sono incluse nell'ACTP", la risposta è una tra le seguenti:</p> <p>(a) "Strumenti di capitale";</p> <p>(b) "Strumenti di debito non di primo rango (non-senior)";</p> <p>(c) "Strumenti di debito di primo rango (senior)";</p> <p>(d) "Obbligazioni garantite".</p> <p>Se non ricorre nessuno di questi casi, la casella è lasciata in bianco.</p>
0090	Scadenza	Articoli 325 quinvicies, 325 septvicies e 325 tricicies del regolamento (UE) n. 575/2013	Indicare la data di scadenza dell'esposizione. Per indicare la data è adottata la convenzione "gg/mm/aaaa".

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0100	Tasso di recupero	Articolo 325 tervicies, paragrafo 1, lettera e), del regolamento (UE) n. 575/2013	Gli enti comunicano il tasso di recupero. Il tasso di recupero è calcolato utilizzando la perdita in caso di default (LGD) applicabile come tasso di recupero = 1 - LGD. Il tasso di recupero comunicato è espresso in valore decimale, tra 0 e 1, con una precisione minima di quattro decimali.
0110	Direzione	Articolo 325 tervicies, paragrafo 1, lettere a) e b), del regolamento (UE) n. 575/2013	Gli enti segnalano la direzione dell'esposizione conformemente alle definizioni di cui all'articolo 325 tervicies, paragrafo 1, lettere a) e b), del regolamento (UE) n. 575/2013. La risposta è una delle seguenti: (a) "Esposizione corta"; (b) "Esposizione lunga".
0120	Punto di attacco (attachment point) %	Articoli 325 octovicies e 325 untricies del regolamento (UE) n. 575/2013	Se l'esposizione segnalata si riferisce a un segmento, gli enti segnalano il punto di attacco del segmento. Il dato comunicato è espresso come decimale con una precisione minima di quattro decimali.
0130	Punto di distacco (detachment point) %	Articoli 325 octovicies e 325 untricies del regolamento (UE) n. 575/2013	Se l'esposizione segnalata si riferisce a un segmento, gli enti segnalano il punto di distacco del segmento. Il dato comunicato è espresso come decimale con una precisione minima di quattro decimali.
0140-0170	Risultati nella valuta di segnalazione		I valori sono segnalati con riferimento alla valuta utilizzata dall'ente per le segnalazioni e sono espressi con una precisione minima di due decimali, ove applicabile.
0140	Valore nozionale	Articolo 325 quatervicies, paragrafi 1, 2 e 5, del regolamento (UE) n. 575/2013	Se la classe di rischio segnalata nella colonna 0020 corrisponde a "Strumenti diversi dalle posizioni verso la cartolarizzazione", gli enti segnalano l'importo nozionale dello strumento. Il valore corrisponde al termine $V_{\text{nozionale}}$ di cui all'articolo 325 quatervicies, paragrafi 1 e 2, del regolamento (UE) n. 575/2013 o al termine $V$ di cui all'articolo 325 quatervicies, paragrafo 5, del medesimo regolamento, a seconda del tipo di esposizione. La casella non va compilata se non si applica nessuno di questi casi o se l'ente non calcola o non utilizza esplicitamente l'importo da segnalare in questa colonna per stimare l'importo lordo del Jump-to-default (JTD).
0150	P&L + Aggiustamento	Articolo 325 quatervicies, paragrafi 1, 2 e 5, del regolamento (UE) n. 575/2013	Gli enti segnalano la somma di P&L e aggiustamento per ciascuna esposizione: — se la classe di rischio segnalata nella colonna 0020 corrisponde a "Strumenti diversi dalle posizioni verso la cartolarizzazione" e l'esposizione segnalata è un'esposizione lunga, gli enti indicano la somma di $P\&L_{\text{lunga}}$ e $\text{aggiustamento}_{\text{lunga}}$ a norma dell'articolo 325 quatervicies, paragrafo 1, del regolamento (UE) n. 575/2013; — se la classe di rischio segnalata nella colonna 0020 corrisponde a "Strumenti diversi dalle posizioni verso la cartolarizzazione" e l'esposizione segnalata è un'esposizione corta, gli enti indicano la somma di $P\&L_{\text{corta}}$ e $\text{aggiustamento}_{\text{corta}}$ a norma dell'articolo 325 quatervicies, paragrafo 2, del medesimo regolamento;

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
			La casella non va compilata se non si applica nessuno di questi casi o se l'ente non calcola o non utilizza esplicitamente l'importo da segnalare in questa colonna per stimare l'importo lordo del JTD.
0160	Importo JTD lordo	Articolo 325 tervicies, paragrafo 1, lettera c), articolo 325 quaterVICES, paragrafi 1, 2 e 5, articolo 325 septVICES, paragrafo 1, e articolo 325 tricIES, paragrafo 2, del regolamento (UE) n. 575/2013	Gli enti segnalano l'importo lordo del JTD per l'esposizione specifica.
0170	Valuta		È segnalata la valuta utilizzata per le segnalazioni dall'ente (il valore segnalato segue la designazione della valuta ISO 4217).
0180-0200	Risultati nella valuta del portafoglio ABE	Allegato V, sezioni 3 e 4, del presente regolamento e articoli 325 sexVICES, 325 octovICES e 325 untrICES del regolamento (UE) n. 575/2013	I valori sono segnalati seguendo le istruzioni per la colonna 0030 ma convertiti al tasso di cambio a pronti BCE associato alla valuta del portafoglio come definito nell'allegato V, sezioni 3 e 4, del presente regolamento.
0180	Valore nozionale	Articolo 325 quaterVICES, paragrafi 1, 2 e 5, del regolamento (UE) n. 575/2013	Se la classe di rischio segnalata nella colonna 0020 corrisponde a "Strumenti diversi dalle posizioni verso la cartolarizzazione", gli enti segnalano l'importo nozionale dello strumento. Il valore corrisponde al termine $V_{\text{nozionale}}$ di cui all'articolo 325 quaterVICES, paragrafi 1 e 2, del regolamento (UE) n. 575/2013 o al termine V di cui all'articolo 325 quaterVICES, paragrafo 5, del medesimo regolamento, a seconda del tipo di esposizione.  La casella non va compilata se non si applica nessuno di questi casi o se l'ente non calcola o non utilizza esplicitamente l'importo da segnalare in questa colonna per stimare l'importo lordo del JTD.
0190	P&L + Aggiustamento	Articolo 325 quaterVICES, paragrafi 1, 2 e 5, del regolamento (UE) n. 575/2013	Gli enti segnalano la somma di P&L e aggiustamento per ciascuna esposizione: <ul style="list-style-type: none"> <li>— se la classe di rischio segnalata nella colonna 0020 corrisponde a "Strumenti diversi dalle posizioni verso la cartolarizzazione" e l'esposizione segnalata è un'esposizione lunga, gli enti indicano la somma di <math>P\&amp;L_{\text{lunga}}</math> e <math>\text{aggiustamento}_{\text{lunga}}</math> a norma dell'articolo 325 quaterVICES, paragrafo 1, del regolamento (UE) n. 575/2013;</li> <li>— se la classe di rischio segnalata nella colonna 0020 corrisponde a "Strumenti diversi dalle posizioni verso la cartolarizzazione" e l'esposizione segnalata è un'esposizione corta, gli enti indicano la somma di <math>P\&amp;L_{\text{corta}}</math> e <math>\text{aggiustamento}_{\text{corta}}</math> a norma dell'articolo 325 quaterVICES, paragrafo 2, del medesimo regolamento;</li> </ul>

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
			La casella non va compilata se non si applica nessuno di questi casi o se l'ente non calcola o non utilizza esplicitamente l'importo da segnalare in questa colonna per stimare l'importo lordo del JTD.
0200	Importo JTD lordo	Articolo 325 tervicies, paragrafo 1, lettera c), articolo 325 quaterVICES, paragrafi 1, 2 e 5, articolo 325 septvicies, paragrafo 1, e articolo 325 tricies, paragrafo 2, del regolamento (UE) n. 575/2013	Gli enti segnalano l'importo lordo del Jump-to-default (JTD) per l'esposizione specifica.

#### C 120.05 – DRC. COMPOSIZIONE DELL'OFr PER PORTAFOGLIO

Istruzioni relative ai fogli (asse z)

Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
Portafoglio	Allegato V, sezioni 3, 4 e 5	Segnalare il numero del portafoglio tratto dall'allegato V.

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0010	Classe di rischio	Articolo 325 tervicies, paragrafo 2, del regolamento (UE) n. 575/2013	Indicare la classe di rischio per la quale è segnalato il requisito per il rischio di default nelle colonne 0030 e 0040. La risposta è uno dei seguenti tipi di strumenti: (a) "Strumenti diversi dalle posizioni verso la cartolarizzazione"; (b) "Posizioni verso la cartolarizzazione che non sono incluse nell'ACTP"; (c) "Posizioni verso la cartolarizzazione che sono incluse nell'ACTP".
0020	Categoria 1	Articolo 325 sexvicies, paragrafo 3, articolo 325 octovicies, paragrafo 4, e articolo 325 untricies, paragrafo 2, del regolamento (UE) n. 575/2013	È segnalata la categoria. Se la classe di rischio segnalata nella colonna 0010 corrisponde a "Strumenti diversi dalle posizioni verso la cartolarizzazione", la risposta è una delle seguenti: (a) "Imprese"; (b) "Emittenti sovrani"; (c) "Amministrazioni locali/comuni".



Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
			<p>Se invece la classe di rischio segnalata nella colonna 0010 corrisponde a "Posizioni verso la cartolarizzazione che non sono incluse nell'ACTP", la risposta è una delle seguenti:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>(d) "ABCP - Asia";</li> <li>(e) "ABCP - Europa";</li> <li>(f) "ABCP - Nordamerica";</li> <li>(g) "ABCP - resto del mondo";</li> <li>(h) "Acquisto o leasing di automobili - Asia";</li> <li>(i) "Acquisto o leasing di automobili - Europa";</li> <li>(j) "Acquisto o leasing di automobili - Nordamerica";</li> <li>(k) "Acquisto o leasing di automobili - resto del mondo";</li> <li>(l) "CDO-squared (collateralised debt obligation squared) - Asia";</li> <li>(m) "CDO-squared (collateralised debt obligation squared) - Europa";</li> <li>(n) "CDO-squared (collateralised debt obligation squared) - Nordamerica";</li> <li>(o) "CDO-squared (collateralised debt obligation squared) - resto del mondo";</li> <li>(p) "Collateralised loan obligations - Asia";</li> <li>(q) "Collateralised loan obligations - Europa";</li> <li>(r) "Collateralised loan obligations - Nordamerica";</li> <li>(s) "Collateralised loan obligations - resto del mondo";</li> <li>(t) "CMBS (commercial mortgage-backed securities) - Asia";</li> <li>(u) "CMBS (commercial mortgage-backed securities) - Europa";</li> <li>(v) "CMBS (commercial mortgage-backed securities) - Nordamerica";</li> <li>(w) "CMBS (commercial mortgage-backed securities) - resto del mondo";</li> <li>(x) "Carte di credito - Asia";</li> <li>(y) "Carte di credito - Europa";</li> <li>(z) "Carte di credito - Nordamerica";</li> <li>(aa) "Carte di credito - resto del mondo";</li> <li>(bb) "Altre attività al dettaglio - Asia";</li> <li>(cc) "Altre attività al dettaglio - Europa";</li> <li>(dd) "Altre attività al dettaglio - Nordamerica";</li> <li>(ee) "Altre attività al dettaglio - resto del mondo";</li> <li>(ff) "Altre attività all'ingrosso - Asia";</li> <li>(gg) "Altre attività all'ingrosso - Europa";</li> <li>(hh) "Altre attività all'ingrosso - Nordamerica";</li> <li>(ii) "Altre attività all'ingrosso - resto del mondo";</li> <li>(jj) "Titoli garantiti da mutui ipotecari residenziali (RMBS) - Asia";</li> <li>(kk) "Titoli garantiti da mutui ipotecari residenziali (RMBS) - Europa";</li> <li>(ll) "Titoli garantiti da mutui ipotecari residenziali (RMBS) - Nordamerica";</li> <li>(mm) "Titoli garantiti da mutui ipotecari residenziali (RMBS) - resto del mondo";</li> <li>(nn) "Piccole e medie imprese (PMI) - Asia";</li> <li>(oo) "Piccole e medie imprese (PMI) - Europa";</li> <li>(pp) "Piccole e medie imprese (PMI) - Nordamerica";</li> <li>(qq) "Piccole e medie imprese (PMI) - resto del mondo";</li> <li>(rr) "Prestiti destinati agli studenti - Asia";</li> </ul>

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
			(ss) "Prestiti destinati agli studenti - Europa"; (tt) "Prestiti destinati agli studenti - Nordamerica"; (uu) "Prestiti destinati agli studenti - resto del mondo".  Se invece la classe di rischio segnalata nella colonna 0010 corrisponde a "Posizioni verso la cartolarizzazione che sono incluse nell'ACTP", la risposta è "Posizioni verso la cartolarizzazione che sono incluse nell'ACTP".
0030	Categoria 2	Articolo 325 untricies, paragrafo 2, del regolamento (UE) n. 575/2013	Se la classe di rischio segnalata nella colonna 0010 corrisponde a "Posizioni verso la cartolarizzazione che sono incluse nell'ACTP", la risposta è il nome dell'indice; negli altri casi indicare "NULL" .
0040	Requisiti di fondi propri (risultati nella valuta di segnalazione)	Articoli 325 sexvicies, 325 octovicies e 325 untricies del regolamento (UE) n. 575/2013	I requisiti di fondi propri per il rischio di default sono segnalati per la "data di riferimento finale delle RM (e ASA finale)" (come specificato nell'allegato V, sezione 1, lettera b), del presente regolamento). I valori sono segnalati nella valuta utilizzata dall'ente per le segnalazioni e sono espressi con una precisione minima di due decimali.
0050	Valuta di segnalazione		È segnalata la valuta utilizzata per le segnalazioni dall'ente (il valore segnalato segue la designazione della valuta ISO 4217).
0060	Requisiti di fondi propri (risultati nella valuta del portafoglio ABE)	Allegato V, sezioni 3 e 4, del presente regolamento e articoli 325 sexvicies, 325 octovicies e 325 untricies del regolamento (UE) n. 575/2013	I valori sono segnalati seguendo le istruzioni per la colonna 0030 ma convertiti al tasso di cambio a pronti BCE associato alla valuta del portafoglio come definito nell'allegato V, sezioni 3 e 4, del presente regolamento.

**C 120.06 – ASA. OFR**

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0010	Numero del portafoglio	Allegato V, sezioni 3, 4 e 5	Segnalare il numero del portafoglio tratto dall'allegato V.
0020-0040	Risultati nella valuta di segnalazione	Allegato V, sezioni 3 e 4	

Colonna	Intestazione	Riferimenti giuridici	Istruzioni
0020	OFR SBM	Articolo 325 nonies del regolamento (UE) n. 575/2013	I requisiti di fondi propri per il metodo basato sulle sensibilità del metodo standardizzato alternativo sono segnalati per la "data di riferimento finale delle RM (e ASA finale)" (come specificato nell'allegato V, sezione 1, lettera b), del presente regolamento) per ciascun portafoglio.
0030	OFR DRC	Articolo 325 tervicies del regolamento (UE) n. 575/2013	I requisiti di fondi propri per il requisito per il rischio di default del metodo standardizzato alternativo sono segnalati per la "data di riferimento finale delle RM (e ASA finale)" (come specificato nell'allegato V, sezione 1, lettera b), del presente regolamento) per ciascun portafoglio.
0040	OFR RRAO	Articolo 325 duovicies del regolamento (UE) n. 575/2013	I requisiti di fondi propri per la maggiorazione per i rischi residui del metodo standardizzato alternativo sono segnalati per la "data di riferimento finale delle RM (e ASA finale)" (come specificato nell'allegato V, sezione 1, lettera b), del presente regolamento) per ciascun portafoglio.
0050-0070	Risultati nella valuta del portafoglio ABE	Allegato V, sezioni 3 e 4	Quando la valuta di segnalazione dell'ente è diversa dalle valute del portafoglio ABE specificate nell'allegato V, sezioni 3 e 4, gli enti convertono la valuta di segnalazione al tasso di cambio a pronti BCE applicabile.
0050	OFR SBM	Articolo 325 nonies del regolamento (UE) n. 575/2013	I requisiti di fondi propri per il metodo basato sulle sensibilità del metodo standardizzato alternativo sono segnalati per la "data di riferimento finale delle RM (e ASA finale)" (come specificato nell'allegato V, sezione 1, lettera b), del presente regolamento) per ciascun portafoglio.
0060	OFR DRC	Articolo 325 tervicies del regolamento (UE) n. 575/2013	I requisiti di fondi propri per il requisito per il rischio di default del metodo standardizzato alternativo sono segnalati per la "data di riferimento finale delle RM (e ASA finale)" (come specificato nell'allegato V, sezione 1, lettera b), del presente regolamento) per ciascun portafoglio.
0070	OFR RRAO	Articolo 325 duovicies del regolamento (UE) n. 575/2013	I requisiti di fondi propri per la maggiorazione per i rischi residui del metodo standardizzato alternativo sono segnalati per la "data di riferimento finale delle RM (e ASA finale)" (come specificato nell'allegato V, sezione 1, lettera b), del presente regolamento) per ciascun portafoglio.

**Tabella - Orientamenti per la segnalazione dei modelli 106.01 (colonna 0010) e 120.01 (colonna 0020)**

- La colonna "classe di rischio" si riferisce all'articolo 325 quinquies, punto 1, del regolamento (UE) n. 575/2013. Per indicare le classi di rischio sono utilizzati i seguenti acronimi:
  - a) "GIRR" (rischio generico di tasso di interesse);
  - b) "CSR\_NON\_SEC" (rischio di differenziali creditizi (CSR) non inerente a cartolarizzazione);
  - c) "CSR\_SEC\_NON\_ACTP" (rischio di differenziali creditizi inerente a cartolarizzazione all'esterno del portafoglio di negoziazione di correlazione alternativo (CSR non-ACTP));
  - d) "CSR\_SEC\_ACTP" (rischio di differenziali creditizi inerente a cartolarizzazione all'interno del portafoglio di negoziazione di correlazione alternativo (CSR ACTP));
  - e) "EQ" (rischio azionario);
  - f) "CM" (rischio di posizione in merci);
  - g) "FX" (rischio di cambio).
  
- La colonna "componente" si riferisce all'articolo 325 sexies, paragrafo 1, del regolamento (UE) n. 575/2013. Per indicare le componenti del metodo basato sulle sensibilità sono utilizzati i seguenti acronimi:
  - a) "DELTA" (rischio delta);
  - b) "VEGA" (rischio vega);
  - c) "CURVATURE" (rischio di curvatura).
  
- La colonna "scadenza" si riferisce alla scadenza del fattore di rischio, dove i fattori di rischio sono definiti in base a specifici vertici conformemente agli articoli 325 terdecies, 325 quaterdecies, 325 quindecies, 325 sexdecies, 325 septdecies e 325 octodecies del regolamento (UE) n. 575/2013. Per i fattori del rischio generico di tasso di interesse vega specificati all'articolo 325 terdecies, paragrafo 7, del medesimo regolamento, due scadenze sono indicate e separate da un trattino (ad esempio "0,5 anni - 0,5 anni"), la prima si riferisce alla scadenza dell'opzione e la seconda alla durata residua del sottostante dell'opzione alla data di scadenza dell'opzione.
  
- La colonna "Specifiche aggiuntive" specifica ulteriormente il rispettivo fattore di rischio per quanto riguarda la distinzione tra il fattore di rischio inflazione e il fattore di rischio di base cross currency ai sensi dell'articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013, la distinzione tra i fattori di rischio relativi agli strumenti di debito e i fattori di rischio relativi ai credit default swap a norma degli articoli 325 quaterdecies e 325 quindecies del medesimo regolamento, la distinzione tra il fattore di rischio del prezzo a pronti di strumenti di capitale e il fattore di rischio del tasso di pronti contro termine su strumenti di capitale a norma dell'articolo 325 sexdecies del regolamento (UE) n. 575/2013 e la distinzione tra la posizione di rischio di curvatura netta verso l'alto di tale fattore di rischio (CVRk+) o la posizione di rischio di curvatura netta verso il basso di tale fattore di rischio (CVRk-), come specificato all'articolo 325 octies del medesimo regolamento.

Classe di rischio	Componente	Scadenza	Specifiche aggiuntive	Identificativo del fattore di rischio	Riferimenti giuridici
CM	DELTA	0 anni		CM_D_00.00	Articolo 325 septdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CM	DELTA	0,25 anni		CM_D_00.25	Articolo 325 septdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CM	DELTA	0,5 anni		CM_D_00.50	Articolo 325 septdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CM	DELTA	1 anno		CM_D_01.00	Articolo 325 septdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CM	DELTA	2 anni		CM_D_02.00	Articolo 325 septdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CM	DELTA	3 anni		CM_D_03.00	Articolo 325 septdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CM	DELTA	5 anni		CM_D_05.00	Articolo 325 septdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CM	DELTA	10 anni		CM_D_10.00	Articolo 325 septdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CM	DELTA	15 anni		CM_D_15.00	Articolo 325 septdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CM	DELTA	20 anni		CM_D_20.00	Articolo 325 septdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CM	DELTA	30 anni		CM_D_30.00	Articolo 325 septdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CM	VEGA	0,5 anni		CM_V_00.50	Articolo 325 septdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CM	VEGA	1 anno		CM_V_01.00	Articolo 325 septdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CM	VEGA	3 anni		CM_V_03.00	Articolo 325 septdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CM	VEGA	5 anni		CM_V_05.00	Articolo 325 septdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CM	VEGA	10 anni		CM_V_10.00	Articolo 325 septdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CM	CURVA-TURA		Spostamento verso l'alto	CM_CU	Articoli 325 septdecies e 325 octies del regolamento (UE) n. 575/2013

Classe di rischio	Componente	Scadenza	Specifiche aggiuntive	Identificativo del fattore di rischio	Riferimenti giuridici
CM	CURVA-TURA		Spostamento verso il basso	CM_CD	Articoli 325 septdecies e 325 octies del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	0,5 anni	Strumento di debito	CSR_NON_SEC_D_00.50_DEBT	Articolo 325 quaterdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	1 anno	Strumento di debito	CSR_NON_SEC_D_01.00_DEBT	Articolo 325 quaterdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	3 anni	Strumento di debito	CSR_NON_SEC_D_03.00_DEBT	Articolo 325 quaterdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	5 anni	Strumento di debito	CSR_NON_SEC_D_05.00_DEBT	Articolo 325 quaterdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	10 anni	Strumento di debito	CSR_NON_SEC_D_10.00_DEBT	Articolo 325 quaterdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	0,5 anni	Credit default swap	CSR_NON_SEC_D_00.50_CDS	Articolo 325 quaterdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	1 anno	Credit default swap	CSR_NON_SEC_D_01.00_CDS	Articolo 325 quaterdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	3 anni	Credit default swap	CSR_NON_SEC_D_03.00_CDS	Articolo 325 quaterdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	5 anni	Credit default swap	CSR_NON_SEC_D_05.00_CDS	Articolo 325 quaterdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	10 anni	Credit default swap	CSR_NON_SEC_D_10.00_CDS	Articolo 325 quaterdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	0,5 anni		CSR_NON_SEC_V_00.50	Articolo 325 quaterdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	1 anno		CSR_NON_SEC_V_01.00	Articolo 325 quaterdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	3 anni		CSR_NON_SEC_V_03.00	Articolo 325 quaterdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	5 anni		CSR_NON_SEC_V_05.00	Articolo 325 quaterdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	10 anni		CSR_NON_SEC_V_10.00	Articolo 325 quaterdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_NON_SEC	CURVA-TURA		Spostamento verso l'alto	CSR_NON_SEC_CU	Articoli 325 quaterdecies e 325 octies del regolamento (UE) n. 575/2013

Classe di rischio	Componente	Scadenza	Specifiche aggiuntive	Identificativo del fattore di rischio	Riferimenti giuridici
CSR_NON_SEC	CURVA-TURA		Spostamento verso il basso	CSR_NON_SEC_CD	Articoli 325 quaterdecies e 325 octies del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	0,5 anni	Strumento di debito	CSR_SEC_ACTP_D_00.50_DEBT	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	1 anno	Strumento di debito	CSR_SEC_ACTP_D_01.00_DEBT	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	3 anni	Strumento di debito	CSR_SEC_ACTP_D_03.00_DEBT	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	5 anni	Strumento di debito	CSR_SEC_ACTP_D_05.00_DEBT	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	10 anni	Strumento di debito	CSR_SEC_ACTP_D_10.00_DEBT	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	0,5 anni	Credit default swap	CSR_SEC_ACTP_D_00.50_CDS	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	1 anno	Credit default swap	CSR_SEC_ACTP_D_01.00_CDS	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	3 anni	Credit default swap	CSR_SEC_ACTP_D_03.00_CDS	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	5 anni	Credit default swap	CSR_SEC_ACTP_D_05.00_CDS	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	10 anni	Credit default swap	CSR_SEC_ACTP_D_10.00_CDS	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	0,5 anni		CSR_SEC_ACTP_V_00.50	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	1 anno		CSR_SEC_ACTP_V_01.00	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	3 anni		CSR_SEC_ACTP_V_03.00	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	5 anni		CSR_SEC_ACTP_V_05.00	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	10 anni		CSR_SEC_ACTP_V_10.00	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	CURVA-TURA		Spostamento verso l'alto	CSR_SEC_ACTP_CU	Articoli 325 quindices e 325 octies del regolamento (UE) n. 575/2013

Classe di rischio	Componente	Scadenza	Specifiche aggiuntive	Identificativo del fattore di rischio	Riferimenti giuridici
CSR_SEC_ACTP	CURVA-TURA		Spostamento verso il basso	CSR_SEC_ACTP_CD	Articoli 325 quindices e 325 octies del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	0,5 anni	Strumento di debito	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_00.50_DEBT	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	1 anno	Strumento di debito	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_01.00_DEBT	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	3 anni	Strumento di debito	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_03.00_DEBT	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	5 anni	Strumento di debito	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_05.00_DEBT	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	10 anni	Strumento di debito	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_10.00_DEBT	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	0,5 anni	Credit default swap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_00.50_CDS	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	1 anno	Credit default swap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_01.00_CDS	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	3 anni	Credit default swap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_03.00_CDS	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	5 anni	Credit default swap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_05.00_CDS	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	10 anni	Credit default swap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_10.00_CDS	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	0,5 anni		CSR_SEC_NON_ACTP_V_00.50	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	1 anno		CSR_SEC_NON_ACTP_V_01.00	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	3 anni		CSR_SEC_NON_ACTP_V_03.00	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	5 anni		CSR_SEC_NON_ACTP_V_05.00	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	10 anni		CSR_SEC_NON_ACTP_V_10.00	Articolo 325 quindices del regolamento (UE) n. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	CURVA-TURA		Spostamento verso l'alto	CSR_SEC_NON_ACTP_CU	Articoli 325 quindices e 325 octies del regolamento (UE) n. 575/2013



Classe di rischio	Componente	Scadenza	Specifiche aggiuntive	Identificativo del fattore di rischio	Riferimenti giuridici
CSR_SEC_NO- N_ACTP	CURVA- TURA		Spostamento verso il basso	CSR_SEC_NON_ACTP_CD	Articoli 325 quindices e 325 octies del regolamento (UE) n. 575/2013
EQ	DELTA		Prezzo a pronti	EQ_D_SPOT	Articolo 325 sexdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
EQ	DELTA		Tasso pronti contro termine	EQ_D_REPO	Articolo 325 sexdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
EQ	VEGA	0,5 anni		EQ_V_00.50	Articolo 325 sexdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
EQ	VEGA	1 anno		EQ_V_01.00	Articolo 325 sexdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
EQ	VEGA	3 anni		EQ_V_03.00	Articolo 325 sexdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
EQ	VEGA	5 anni		EQ_V_05.00	Articolo 325 sexdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
EQ	VEGA	10 anni		EQ_V_10.00	Articolo 325 sexdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
EQ	CURVA- TURA		Spostamento verso l'alto	EQ_CU	Articoli 325 sexdecies e 325 octies del regolamento (UE) n. 575/2013
EQ	CURVA- TURA		Spostamento verso il basso	EQ_CD	Articoli 325 sexdecies e 325 octies del regolamento (UE) n. 575/2013
FX	DELTA			FX_D	Articolo 325 octodecies del regolamento (UE) n. 575/2013
FX	VEGA	0,5 anni		FX_V_00.50	Articolo 325 octodecies del regolamento (UE) n. 575/2013
FX	VEGA	1 anno		FX_V_01.00	Articolo 325 octodecies del regolamento (UE) n. 575/2013
FX	VEGA	3 anni		FX_V_03.00	Articolo 325 octodecies del regolamento (UE) n. 575/2013
FX	VEGA	5 anni		FX_V_05.00	Articolo 325 octodecies del regolamento (UE) n. 575/2013
FX	VEGA	10 anni		FX_V_10.00	Articolo 325 octodecies del regolamento (UE) n. 575/2013
FX	CURVA- TURA		Spostamento verso l'alto	FX_CU	Articoli 325 octodecies e 325 octies del regolamento (UE) n. 575/2013

Classe di rischio	Componente	Scadenza	Specifiche aggiuntive	Identificativo del fattore di rischio	Riferimenti giuridici
FX	CURVA-TURA		Spostamento verso il basso	FX_CD	Articoli 325 octodecies e 325 octies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	DELTA	0,25 anni		GIRR_D_00.25	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	DELTA	0,5 anni		GIRR_D_00.50	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	DELTA	1 anno		GIRR_D_01.00	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	DELTA	2 anni		GIRR_D_02.00	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	DELTA	3 anni		GIRR_D_03.00	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	DELTA	5 anni		GIRR_D_05.00	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	DELTA	10 anni		GIRR_D_10.00	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	DELTA	15 anni		GIRR_D_15.00	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	DELTA	20 anni		GIRR_D_20.00	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	DELTA	30 anni		GIRR_D_30.00	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	DELTA		Inflazione	GIRR_D_INF	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	DELTA		Base cross currency (su EUR)	GIRR_D_CRO_EUR	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	DELTA		Base cross currency (su USD)	GIRR_D_CRO_USD	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 anni - 0,5 anni		GIRR_V_00.50_00.50	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	1 anno - 0,5 anni		GIRR_V_01.00_00.50	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	3 anni - 0,5 anni		GIRR_V_03.00_00.50	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013

Classe di rischio	Componente	Scadenza	Specifiche aggiuntive	Identificativo del fattore di rischio	Riferimenti giuridici
GIRR	VEGA	5 anni - 0,5 anni		GIRR_V_05.00_00.50	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	10 anni - 0,5 anni		GIRR_V_10.00_00.50	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 anni - 1 anno		GIRR_V_00.50_01.00	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	1 anno - 1 anno		GIRR_V_01.00_01.00	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	3 anni - 1 anno		GIRR_V_03.00_01.00	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	5 anni - 1 anno		GIRR_V_05.00_01.00	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	10 anni - 1 anno		GIRR_V_10.00_01.00	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 anni - 3 anni		GIRR_V_00.50_03.00	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	1 anno - 3 anni		GIRR_V_01.00_03.00	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	3 anni - 3 anni		GIRR_V_03.00_03.00	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	5 anni - 3 anni		GIRR_V_05.00_03.00	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	10 anni - 3 anni		GIRR_V_10.00_03.00	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 anni - 5 anni		GIRR_V_00.50_05.00	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	1 anno - 5 anni		GIRR_V_01.00_05.00	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	3 anni - 5 anni		GIRR_V_03.00_05.00	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	5 anni - 5 anni		GIRR_V_05.00_05.00	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	10 anni - 5 anni		GIRR_V_10.00_05.00	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013

Classe di rischio	Componente	Scadenza	Specifiche aggiuntive	Identificativo del fattore di rischio	Riferimenti giuridici
GIRR	VEGA	0,5 anni - 10 anni		GIRR_V_00.50_10.00	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	1 anno - 10 anni		GIRR_V_01.00_10.00	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	3 anni - 10 anni		GIRR_V_03.00_10.00	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	5 anni - 10 anni		GIRR_V_05.00_10.00	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	10 anni - 10 anni		GIRR_V_10.00_10.00	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 anni	Inflazione	GIRR_V_00.50_INF	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	1 anno	Inflazione	GIRR_V_01.00_INF	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	3 anni	Inflazione	GIRR_V_03.00_INF	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	5 anni	Inflazione	GIRR_V_05.00_INF	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	10 anni	Inflazione	GIRR_V_10.00_INF	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 anni	Base cross currency (su EUR)	GIRR_V_00.50_CRO_EUR	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	1 anno	Base cross currency (su EUR)	GIRR_V_01.00_CRO_EUR	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	3 anni	Base cross currency (su EUR)	GIRR_V_03.00_CRO_EUR	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	5 anni	Base cross currency (su EUR)	GIRR_V_05.00_CRO_EUR	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	10 anni	Base cross currency (su EUR)	GIRR_V_10.00_CRO_EUR	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 anni	Base cross currency (su USD)	GIRR_V_00.50_CRO_USD	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	1 anno	Base cross currency (su USD)	GIRR_V_01.00_CRO_USD	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013

Classe di rischio	Componente	Scadenza	Specifiche aggiuntive	Identificativo del fattore di rischio	Riferimenti giuridici
GIRR	VEGA	3 anni	Base cross currency (su USD)	GIRR_V_03.00_CRO_USD	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	5 anni	Base cross currency (su USD)	GIRR_V_05.00_CRO_USD	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	VEGA	10 anni	Base cross currency (su USD)	GIRR_V_10.00_CRO_USD	Articolo 325 terdecies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	CURVA-TURA		Spostamento verso l'alto	GIRR_CU	Articoli 325 terdecies e 325 octies del regolamento (UE) n. 575/2013
GIRR	CURVA-TURA		Spostamento verso il basso	GIRR_CD	Articoli 325 terdecies e 325 octies del regolamento (UE) n. 575/2013»

## RISULTATI DEI PORTAFOGLI DI RIFERIMENTO A FINI DI VIGILANZA RISCHIO DI MERCATO

RISULTATI DEI PORTAFOGLI DI RIFERIMENTO - RISCHIO DI MERCATO			
Numero del modello	Codice del modello	Nome del modello/gruppo di modelli	Abbreviazione
		<b>VALUTAZIONE INIZIALE DI MERCATO</b>	
106,1	C 106.00	VALUTAZIONE INIZIALE DI MERCATO E MOTIVO DELL'ESCLUSIONE	IMV
106,2	C 106.01	SENSIBILITÀ AL RISCHIO PER STRUMENTO	SENSIBILITÀ
		<b>VaR, sVaR e PV</b>	
107,1	C 107.01	DETTAGLI	VaR&SVaR 1
107,2	C 107.02	RISULTATI NELLA VALUTA DEL <b>PORTAFOGLIO ABE</b>	VaR&SVaR 2
		<b>SERIE TEMPORALI DI PROFITTI E PERDITE</b>	
108	C 108.00	SERIE TEMPORALI DI PROFITTI E PERDITE	PROFITTI E PERDITE
		<b>COPERTURA PATRIMONIALE PER IL RISCHIO INCREMENTALE (IRC)</b>	
109,1	C 109.01	IRC. DETTAGLI DEL MODELLO	IRC 1
109,2	C 109.02	IRC. DETTAGLI PER PORTAFOGLIO	IRC 2
109,3	C 109.03	IRC. IMPORTO PER PORTAFOGLIO/DATA	IRC 3
		<b>NEGOZIAZIONE DI CORRELAZIONE (CT)</b>	
110,1	C 110.01	CT. DETTAGLI DEL MODELLO	CT 1
110,2	C 110.02	CT. DETTAGLI PER PORTAFOGLIO	CT 2
110,3	C 110.03	CT. IMPORTO PER PORTAFOGLIO/DATA	CT 3
		<b>ASA (SBM &amp; DRC)</b>	
120,1	C 120.01	SBM. SENSIBILITÀ AL RISCHIO PER STRUMENTO/PORTAFOGLIO	SBM 1
120,2	C 120.02	SBM. COMPOSIZIONE DELL'OFr PER PORTAFOGLIO	SBM 2
120,4	C 120.04	DRC. VALORI DI MERCATO E IMPORTI JTD LORDI PER STRUMENTO/PORTAFOGLIO	DRC 1
120,5	C 120.05	DRC. COMPOSIZIONE DELL'OFr PER PORTAFOGLIO	DRC 2
120,6	C 120.06	ASA. OFr PER PORTAFOGLIO	OFr ASA

**C 106.00 – VALUTAZIONE INIZIALE DI MERCATO E MOTIVO DELL’ESCLUSIONE**

Numero dello strumento	Strumento modellizzato per VaR + sVaR (True/False)	Strumento modellizzato per IRC (True/False)	Strumento modellizzato per la negoziazione di correlazione (True/False)	Motivo dell’esclusione	Riquadro di testo libero	Valutazione iniziale di mercato
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070

**C 106.01 - SENSIBILITÀ AL RISCHIO PER STRUMENTO**

Numero dello strumento

Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Sensibilità al rischio (Risultati nella valuta di segnalazione)	Valuta di segnalazione	Sensibilità al rischio (risultati nella valuta dello strumento ABE)	Modello di determinazione del prezzo	Definizione delle sensibilità	Riquadro di testo libero	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito
0010	0020	0030	0050	0060	0070	0080	0090	0100	110	120

**C 107.01 - VaR, sVaR e PV. DETTAGLI**

		Opzione	Riquadro di testo libero
		0010	0020
<b>VaR</b>			
0010	Metodologia		
0020	Calcolo dell’orizzonte di 10 giorni		

		Opzione	Riquadro di testo libero
		0010	0020
0030	Durata del periodo di osservazione		
0040	Ponderazione dei dati		
0050	Maggiorazione per i test retrospettivi		
0060	Maggiorazione regolamentare VaR		
<b>sVaR</b>			
0070	Metodologia		
0080	Calcolo dell'orizzonte di 10 giorni		
0090	Maggiorazione regolamentare sVaR		
0100	Periodo sVaR		

**C 107.02 - VaR e sVaR NON CTP. RISULTATI NELLA VALUTA DEL PORTAFOGLIO ABE**

Portafoglio

Data	VaR	sVaR	PV
0010	0020	0030	0040



**C 108.00 - SERIE TEMPORALI DI PROFITTI E PERDITE**

Portafoglio

Data	Profitti e perdite giornalieri
0010	0020

**C 109.01 - IRC. DETTAGLI DEL MODELLO**

		Opzione	Riquadro di testo libero
Riga	Voce	0010	0020
0010	Numero di fattori di modellizzazione		
0020	Fonte delle LGD		

**C 109.02 - IRC. DETTAGLI PER PORTAFOGLIO**

Portafoglio

		Opzione	Riquadro di testo libero
Riga	Voce	0010	0020
0010	Orizzonte di liquidità		
0020	Fonte delle PD		
0030	Fonte delle matrici di transizione		

**C 109.03 - IRC. IMPORTO PER PORTAFOGLIO/DATA**

Portafoglio

Data	IRC
0010	0020

**C 110.01 – CT. DETTAGLI DEL MODELLO**

		Opzione	Riquadro di testo libero
Riga	Voce	0010	0020
0010	<b>Numero di fattori di modellizzazione</b>		
0020	<b>Fonte delle LGD</b>		

**C 110.02 – CT. DETTAGLI PER PORTAFOGLIO**

Portafoglio

		Opzione	Riquadro di testo libero
Riga	Voce	0010	0020
0010	<b>Orizzonte di liquidità</b>		
0020	<b>Fonte delle PD</b>		
0030	<b>Fonte delle matrici di transizione</b>		

**C 110.03 – CT. APR PER PORTAFOGLIO/DATA**

Portafoglio

Data	APR
0010	0060

**C 120.01 – SBM. SENSIBILITÀ AL RISCHIO PER STRUMENTO/PORTAFOGLIO**

Portafoglio

Numero dello strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Sensibilità al rischio (Risultati nella valuta di segnalazione)	Valuta di segnalazione	Sensibilità al rischio (Risultati nella valuta del portafoglio ABE)	Fattore di ponderazione del rischio	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito
0010	0020	0030	0040	0060	0070	0080	0090	110	120

**C 120.02 – SBM. COMPOSIZIONE DELL’OFR PER PORTAFOGLIO**

Portafoglio

Classe di rischio	Componente di rischio	Scenario delle correlazioni	Requisiti di fondi propri (risultati nella valuta di segnalazione)	Valuta di segnalazione	Requisiti di fondi propri (risultati nella valuta del portafoglio ABE)	Posizioni senza opzionalità soggette a requisiti di fondi propri per il rischio di curvatura	Metodo della valuta di base applicato al delta e alla curvatura del rischio di cambio	Divisione per scalare delle componenti del rischio di curvatura per il rischio di cambio	Trasmissione dei risultati del portafoglio di convalida dell’SBM	Riquadro di testo libero
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0950	0100

**C 120.04 - DRC. Valori di mercato e importi JTD lordi per strumento/portafoglio**

Portafoglio

Numero intero

Numero dello strumento	Classe di rischio	Categor- ria1	Catego- ria2	Debi- tore	Categoria di classe di merito di credito	Fattore di ponderazione del rischio di default	Rango	Durata	Tasso di recupero	Direzione	Punto di attacco (attachment point) %	Punto di distacco (detachment point) %	Risultati nella valuta di segnalazione				Risultati nella valuta del portafoglio ABE		
													Valore nozionale	P&L + Aggiustamento	Importo JTD lordo	Valuta	Valore nozionale	P&L + Aggiustamento	Importo JTD lordo
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120	0130	0140	0150	0160	0170	0180	0190	0200

**C 120.05 - DRC. COMPOSIZIONE DELL'OFER PER PORTAFOGLIO**

Portafoglio

Numero intero

Classe di rischio	Categoria1	Categoria2	Requisiti di fondi propri (risultati nella valuta di segnalazione)	Valuta di segnalazione	Requisiti di fondi propri (risultati nella valuta del portafoglio ABE)
0010	0020	0030	0040	0050	0060

**C 120.06 - ASA. OFER**

Numero del portafoglio	Risultati nella valuta di segnalazione			Risultati nella valuta del portafoglio ABE		
	OFER SBM	OFER DRC	OFER RRAO	OFER SBM	OFER DRC	OFER RRAO
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070»

ALLEGATO V

«ALLEGATO X –

**Portafogli di convalida dell'SBM**

Nome dello sheet	Descrizione
Strumenti	Strumenti (sensibilità e posizioni di rischio di curvatura) ai fini della convalida dell'SBM
Portafogli	Portafogli di convalida dell'SBM definiti come combinazioni degli strumenti definiti nel presente allegato

Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_IRV_b25#	GIRR_V_10.00_10.00	USD				400,00
S_IRV_b24#	GIRR_V_10.00_05.00	USD				200,00
S_IRV_b23#	GIRR_V_10.00_03.00	USD				- 900,00
S_IRV_b22#	GIRR_V_10.00_01.00	USD				950,00
S_IRV_b21#	GIRR_V_10.00_00.50	USD				- 350,00
S_IRV_b20#	GIRR_V_05.00_10.00	USD				1 000,00
S_IRV_b19#	GIRR_V_05.00_05.00	USD				- 300,00
S_IRV_b18#	GIRR_V_05.00_03.00	USD				50,00
S_IRV_b17#	GIRR_V_05.00_01.00	USD				300,00
S_IRV_b16#	GIRR_V_05.00_00.50	USD				- 50,00
S_IRV_e3#	GIRR_V_03.00_CRO_USD	BRL				500,00
S_IRV_b15#	GIRR_V_03.00_10.00	USD				- 400,00

Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_IRV_b14#	GIRR_V_03.00_05.00	USD				700,00
S_IRV_b13#	GIRR_V_03.00_03.00	USD				- 800,00
S_IRV_b12#	GIRR_V_03.00_01.00	USD				700,00
S_IRV_b11#	GIRR_V_03.00_00.50	USD				- 100,00
S_IRV_e2#	GIRR_V_01.00_INF	BRL				750,00
S_IRV_b10#	GIRR_V_01.00_10.00	USD				500,00
S_IRV_b9#	GIRR_V_01.00_05.00	USD				50,00
S_IRV_b8#	GIRR_V_01.00_03.00	USD				- 500,00
S_IRV_b7#	GIRR_V_01.00_01.00	USD				200,00
S_IRV_b6#	GIRR_V_01.00_00.50	USD				900,00
S_IRV_b5#	GIRR_V_00.50_10.00	USD				100,00
S_IRV_c5#	GIRR_V_00.50_10.00	CLP				- 100,00
S_IRV_d5#	GIRR_V_00.50_10.00	EUR				- 2 000,00
S_IRV_b4#	GIRR_V_00.50_05.00	USD				100,00
S_IRV_c4#	GIRR_V_00.50_05.00	CLP				100,00
S_IRV_d4#	GIRR_V_00.50_05.00	EUR				1 500,00
S_IRV_b3#	GIRR_V_00.50_03.00	USD				- 500,00
S_IRV_c3#	GIRR_V_00.50_03.00	CLP				- 300,00
S_IRV_d3#	GIRR_V_00.50_03.00	EUR				1 000,00
S_IRV_b2#	GIRR_V_00.50_01.00	USD				400,00
S_IRV_c2#	GIRR_V_00.50_01.00	CLP				150,00
S_IRV_d2#	GIRR_V_00.50_01.00	EUR				3 750,00
S_IRV_a1#	GIRR_V_00.50_00.50	USD				- 100,00
S_IRV_b1#	GIRR_V_00.50_00.50	USD				700,00



Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_IRV_c1#	GIRR_V_00.50_00.50	CLP				300,00
S_IRV_d1#	GIRR_V_00.50_00.50	EUR				- 4 750,00
S_IRV_e1#	GIRR_V_00.50_00.50	BRL				- 500,00
S_IRD_b11#	GIRR_D_INF	USD				- 50 000,00
S_IRD_d11#	GIRR_D_INF	CLP				95 000,00
S_IRD_e11#	GIRR_D_INF	EUR	DE			- 65 000,00
S_IRD_e13#	GIRR_D_INF	EUR	FR			- 100 000,00
S_IRD_d12#	GIRR_D_CRO_USD	CLP				10 500,00
S_IRD_e12#	GIRR_D_CRO_USD	EUR				- 85 000,00
S_IRD_b12#	GIRR_D_CRO_EUR	USD				- 65 000,00
S_IRD_b10#	GIRR_D_30.00	USD	OIS			- 50 000,00
S_IRD_c10#	GIRR_D_30.00	USD	Libor3m			10 000,00
S_IRD_d10#	GIRR_D_30.00	CLP	OIS			15 000,00
S_IRD_e10#	GIRR_D_30.00	EUR	OIS			- 120 000,00
S_IRD_b9#	GIRR_D_20.00	USD	OIS			200 000,00
S_IRD_c9#	GIRR_D_20.00	USD	Libor3m			- 30 000,00
S_IRD_d9#	GIRR_D_20.00	CLP	OIS			90 000,00
S_IRD_e9#	GIRR_D_20.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b8#	GIRR_D_15.00	USD	OIS			30 000,00
S_IRD_c8#	GIRR_D_15.00	USD	Libor3m			10 000,00
S_IRD_d8#	GIRR_D_15.00	CLP	OIS			70 000,00

Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_IRD_e8#	GIRR_D_15.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b7#	GIRR_D_10.00	USD	OIS			2 000,00
S_IRD_c7#	GIRR_D_10.00	USD	Libor3m			- 100 000,00
S_IRD_d7#	GIRR_D_10.00	CLP	OIS			- 25 000,00
S_IRD_e7#	GIRR_D_10.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b6#	GIRR_D_05.00	USD	OIS			- 90 000,00
S_IRD_c6#	GIRR_D_05.00	USD	Libor3m			- 35 000,00
S_IRD_d6#	GIRR_D_05.00	CLP	OIS			- 5 000,00
S_IRD_e6#	GIRR_D_05.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b5#	GIRR_D_03.00	USD	OIS			85 000,00
S_IRD_c5#	GIRR_D_03.00	USD	Libor3m			55 000,00
S_IRD_d5#	GIRR_D_03.00	CLP	OIS			- 100 000,00
S_IRD_e5#	GIRR_D_03.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b4#	GIRR_D_02.00	USD	OIS			- 10 000,00
S_IRD_c4#	GIRR_D_02.00	USD	Libor3m			10 000,00
S_IRD_d4#	GIRR_D_02.00	CLP	OIS			5 000,00
S_IRD_e4#	GIRR_D_02.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b3#	GIRR_D_01.00	USD	OIS			- 65 000,00
S_IRD_c3#	GIRR_D_01.00	USD	Libor3m			70 000,00
S_IRD_d3#	GIRR_D_01.00	CLP	OIS			10 000,00
S_IRD_e3#	GIRR_D_01.00	EUR	OIS			- 50 000,00
S_IRD_b2#	GIRR_D_00.50	USD	OIS			15 000,00
S_IRD_c2#	GIRR_D_00.50	USD	Libor3m			- 40 000,00
S_IRD_d2#	GIRR_D_00.50	CLP	OIS			45 000,00
S_IRD_e2#	GIRR_D_00.50	EUR	OIS			100,00
S_IRD_a1#	GIRR_D_00.25	USD	OIS			30 000,00
S_IRD_b1#	GIRR_D_00.25	USD	OIS			20 000,00

Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_IRD_c1#	GIRR_D_00.25	USD	Libor3m			- 30 000,00
S_IRD_d1#	GIRR_D_00.25	CLP	OIS			- 30 000,00
S_IRD_e1#	GIRR_D_00.25	EUR	OIS			100,00
S_IRD_f1#	GIRR_D_00.25	DKK	OIS			100,00
S_IRC_a1#	GIRR_CU	USD				- 18 466,83
S_IRC_b1#	GIRR_CU	USD				92 233,09
S_IRC_c1#	GIRR_CU	CLP				- 1 270,00
S_IRC_d1#	GIRR_CU	EUR				- 253,12
S_IRC_e1#	GIRR_CU	VND				- 11 950,00
S_IRC_a1#	GIRR_CD	USD				18 647,66
S_IRC_b1#	GIRR_CD	USD				- 93 178,71
S_IRC_c1#	GIRR_CD	CLP				450,00
S_IRC_d1#	GIRR_CD	EUR				- 3 237,08
S_IRC_e1#	GIRR_CD	VND				- 4 030,00
S_FXV_b4#	FX_V_5.00	EUR_CLP				200,00
S_FXV_d4#	FX_V_5.00	CHF_VND				1 500,00
S_FXV_b3#	FX_V_3.00	EUR_CLP				- 400,00
S_FXV_d3#	FX_V_3.00	CHF_VND				1 000,00
S_FXV_b5#	FX_V_10.00	EUR_CLP				150,00
S_FXV_d5#	FX_V_10.00	CHF_VND				- 2 000,00
S_FXV_b2#	FX_V_1.00	EUR_CLP				300,00
S_FXV_d2#	FX_V_1.00	CHF_VND				3 750,00

Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_FXV_a1#	FX_V_0.50	EUR_CLP				- 100,00
S_FXV_b1#	FX_V_0.50	EUR_CLP				700,00
S_FXV_c1#	FX_V_0.50	AUD_JPY				450,00
S_FXV_d1#	FX_V_0.50	CHF_VND				- 4 800,00
S_FXD_a1#	FX_D	GBP				5 000,00
S_FXD_b1#	FX_D	GBP				- 8 000,00
S_FXD_c1#	FX_D	CLP				3 000,00
S_FXD_d1#	FX_D	DKK				1 000,00
S_FXD_f1#	FX_D	BGN				1 000,00
S_FXC_a1#	FX_CU	EUR				- 16 037,91
S_FXC_b1#	FX_CU	EUR				80 159,24
S_FXC_c1#	FX_CU	CLP				- 800,00
S_FXC_d1#	FX_CU	JPY				- 1 472,88
S_FXC_e1#	FX_CU	VND				- 3 400,00
S_FXC_f1#	FX_CU	DKK				- 48,61
S_FXC_a1#	FX_CD	EUR				16 162,18
S_FXC_b1#	FX_CD	EUR				- 80 723,02
S_FXC_c1#	FX_CD	CLP				700,00
S_FXC_d1#	FX_CD	JPY				- 1 324,35
S_FXC_e1#	FX_CD	VND				- 2 100,00
S_FXC_f1#	FX_CD	DKK				48,61
S_EQV_a5#	EQ_V_5.00	1	EMITTENTE A			100,00

Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_EQV_aa4#	EQ_V_5.00	5	EMITTENTE AA			1 200,00
S_EQV_ac1#	EQ_V_5.00	7	EMITTENTE AC			- 50,00
S_EQV_ae4#	EQ_V_5.00	9	EMITTENTE AE			600,00
S_EQV_af4#	EQ_V_5.00	10	EMITTENTE AF			375,00
S_EQV_b4#	EQ_V_5.00	1	EMITTENTE B			50,00
S_EQV_f4#	EQ_V_5.00	5	EMITTENTE F			450,00
S_EQV_j4#	EQ_V_5.00	9	EMITTENTE J			- 200,00
S_EQV_k4#	EQ_V_5.00	10	EMITTENTE K			- 825,00
S_EQV_m1#	EQ_V_5.00	11	EMITTENTE M			- 700,00
S_EQV_n4#	EQ_V_5.00	12	INDICE N			850,00
S_EQV_o4#	EQ_V_5.00	12	INDICE O			150,00
S_EQV_y1#	EQ_V_5.00	3	EMITTENTE Y			700,00
S_EQV_a4#	EQ_V_3.00	1	EMITTENTE A			- 500,00
S_EQV_aa3#	EQ_V_3.00	5	EMITTENTE AA			- 850,00
S_EQV_ad1#	EQ_V_3.00	8	EMITTENTE AD			300,00
S_EQV_ae3#	EQ_V_3.00	9	EMITTENTE AE			- 450,00
S_EQV_af3#	EQ_V_3.00	10	EMITTENTE AF			- 725,00
S_EQV_b3#	EQ_V_3.00	1	EMITTENTE B			- 500,00

Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_EQV_f3#	EQ_V_3.00	5	EMITTENTE F			250,00
S_EQV_j3#	EQ_V_3.00	9	EMITTENTE J			- 900,00
S_EQV_k3#	EQ_V_3.00	10	EMITTENTE K			- 975,00
S_EQV_n3#	EQ_V_3.00	12	INDICE N			- 1 250,00
S_EQV_o3#	EQ_V_3.00	12	INDICE O			100,00
S_EQV_x1#	EQ_V_3.00	2	EMITTENTE X			- 200,00
S_EQV_z1#	EQ_V_3.00	4	EMITTENTE Z			- 800,00
S_EQV_a6#	EQ_V_10.00	1	EMITTENTE A			100,00
S_EQV_aa5#	EQ_V_10.00	5	EMITTENTE AA			- 300,00
S_EQV_ab1#	EQ_V_10.00	6	EMITTENTE AB			- 400,00
S_EQV_ae5#	EQ_V_10.00	9	EMITTENTE AE			- 850,00
S_EQV_af5#	EQ_V_10.00	10	EMITTENTE AF			525,00
S_EQV_b5#	EQ_V_10.00	1	EMITTENTE B			500,00
S_EQV_f5#	EQ_V_10.00	5	EMITTENTE F			600,00
S_EQV_j5#	EQ_V_10.00	9	EMITTENTE J			150,00
S_EQV_k5#	EQ_V_10.00	10	EMITTENTE K			300,00
S_EQV_n5#	EQ_V_10.00	12	INDICE N			225,00
S_EQV_o5#	EQ_V_10.00	12	INDICE O			- 200,00

Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_EQV_q1#	EQ_V_10.00	13	INDICE Q			- 800,00
S_EQV_a3#	EQ_V_1.00	1	EMITTENTE A			400,00
S_EQV_aa2#	EQ_V_1.00	5	EMITTENTE AA			- 400,00
S_EQV_ae2#	EQ_V_1.00	9	EMITTENTE AE			- 250,00
S_EQV_af2#	EQ_V_1.00	10	EMITTENTE AF			- 1 150,00
S_EQV_b2#	EQ_V_1.00	1	EMITTENTE B			200,00
S_EQV_f2#	EQ_V_1.00	5	EMITTENTE F			- 750,00
S_EQV_j2#	EQ_V_1.00	9	EMITTENTE J			350,00
S_EQV_k2#	EQ_V_1.00	10	EMITTENTE K			1 050,00
S_EQV_n2#	EQ_V_1.00	12	INDICE N			- 800,00
S_EQV_o2#	EQ_V_1.00	12	INDICE O			400,00
S_EQV_a1#	EQ_V_0.50	1	EMITTENTE A			- 100,00
S_EQV_a2#	EQ_V_0.50	1	EMITTENTE A			700,00
S_EQV_aa1#	EQ_V_0.50	5	EMITTENTE AA			950,00
S_EQV_ae1#	EQ_V_0.50	9	EMITTENTE AE			50,00
S_EQV_af1#	EQ_V_0.50	10	EMITTENTE AF			- 300,00
S_EQV_b1#	EQ_V_0.50	1	EMITTENTE B			900,00
S_EQV_c1#	EQ_V_0.50	2	EMITTENTE C			- 500,00

Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_EQV_d1#	EQ_V_0.50	3	EMITTENTE D			600,00
S_EQV_e1#	EQ_V_0.50	4	EMITTENTE E			- 800,00
S_EQV_f1#	EQ_V_0.50	5	EMITTENTE F			1 000,00
S_EQV_g1#	EQ_V_0.50	6	EMITTENTE G			- 400,00
S_EQV_h1#	EQ_V_0.50	7	EMITTENTE H			- 50,00
S_EQV_i1#	EQ_V_0.50	8	EMITTENTE I			300,00
S_EQV_j1#	EQ_V_0.50	9	EMITTENTE J			50,00
S_EQV_k1#	EQ_V_0.50	10	EMITTENTE K			- 300,00
S_EQV_l1#	EQ_V_0.50	11	EMITTENTE L			1 000,00
S_EQV_n1#	EQ_V_0.50	12	INDICE N			750,00
S_EQV_o1#	EQ_V_0.50	12	INDICE O			- 500,00
S_EQV_p1#	EQ_V_0.50	13	INDICE P			40,00
S_EQD_a1#	EQ_D_SPOT	1	EMITTENTE A			16 500,00
S_EQD_a2#	EQ_D_SPOT	1	EMITTENTE A			- 35 000,00
S_EQD_b1#	EQ_D_SPOT	1	EMITTENTE B			20 000,00
S_EQD_c1#	EQ_D_SPOT	2	EMITTENTE C			66 000,00
S_EQD_d1#	EQ_D_SPOT	3	EMITTENTE D			1 700,00
S_EQD_e1#	EQ_D_SPOT	4	EMITTENTE E			1 100,00



Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_EQD_f1#	EQ_D_SPOT	5	EMITTENTE F			25 000,00
S_EQD_g1#	EQ_D_SPOT	5	EMITTENTE G			8 400,00
S_EQD_h1#	EQ_D_SPOT	6	EMITTENTE H			22 500,00
S_EQD_i1#	EQ_D_SPOT	7	EMITTENTE I			- 12 300,00
S_EQD_j1#	EQ_D_SPOT	8	EMITTENTE J			- 450,00
S_EQD_k1#	EQ_D_SPOT	9	EMITTENTE K			- 143,00
S_EQD_l1#	EQ_D_SPOT	9	EMITTENTE L			- 143,00
S_EQD_m1#	EQ_D_SPOT	10	EMITTENTE M			- 100,00
S_EQD_n1#	EQ_D_SPOT	10	EMITTENTE N			- 100,00
S_EQD_o1#	EQ_D_SPOT	11	EMITTENTE O			- 19 600,00
S_EQD_q1#	EQ_D_SPOT	12	INDICE Q			1 100,00
S_EQD_r1#	EQ_D_SPOT	12	INDICE R			- 40 000,00
S_EQD_s1#	EQ_D_SPOT	13	INDICE S			- 1 950,00
S_EQD_s2#	EQ_D_SPOT	13	INDICE S			280,00
S_EQD_t2#	EQ_D_SPOT	13	INDICE T			3 150,00
S_EQD_u1#	EQ_D_SPOT	9	EMITTENTE U			- 57,00
S_EQD_v1#	EQ_D_SPOT	10	EMITTENTE V			- 100,00

Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_EQD_a3#	EQ_D_REPO	1	EMITTENTE A			50 000,00
S_EQD_aa1#	EQ_D_REPO	6	EMITTENTE AA			79 000,00
S_EQD_ab1#	EQ_D_REPO	7	EMITTENTE AB			31 000,00
S_EQD_ac1#	EQ_D_REPO	8	EMITTENTE AC			- 10 000,00
S_EQD_b2#	EQ_D_REPO	1	EMITTENTE B			- 39 000,00
S_EQD_f2#	EQ_D_REPO	5	EMITTENTE F			90 000,00
S_EQD_g2#	EQ_D_REPO	5	EMITTENTE G			60 000,00
S_EQD_k2#	EQ_D_REPO	9	EMITTENTE K			- 14 250,00
S_EQD_l2#	EQ_D_REPO	9	EMITTENTE L			- 150 000,00
S_EQD_m2#	EQ_D_REPO	10	EMITTENTE M			- 85 000,00
S_EQD_n2#	EQ_D_REPO	10	EMITTENTE N			- 72 000,00
S_EQD_p1#	EQ_D_REPO	11	EMITTENTE P			48 000,00
S_EQD_q2#	EQ_D_REPO	12	INDICE Q			85 000,00
S_EQD_r2#	EQ_D_REPO	12	INDICE R			- 40 000,00
S_EQD_t1#	EQ_D_REPO	13	INDICE T			- 125 000,00
S_EQD_x1#	EQ_D_REPO	2	EMITTENTE X			75 000,00
S_EQD_y1#	EQ_D_REPO	3	EMITTENTE Y			4 800,00

Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_EQD_z1#	EQ_D_REPO	4	EMITTENTE Z			- 15 000,00
S_EQC_a1#	EQ_CU	1	EMITTENTE A			- 37 820,00
S_EQC_a2#	EQ_CU	1	EMITTENTE A			77 655,00
S_EQC_aa1#	EQ_CU	2	EMITTENTE AA			39 300,00
S_EQC_ab1#	EQ_CU	4	EMITTENTE AB			17 262,00
S_EQC_ac1#	EQ_CU	5	EMITTENTE AC			7 139,60
S_EQC_ad1#	EQ_CU	6	EMITTENTE AD			- 3 642,50
S_EQC_ae1#	EQ_CU	7	EMITTENTE AE			3 900,00
S_EQC_af1#	EQ_CU	8	EMITTENTE AF			41 550,00
S_EQC_ag1#	EQ_CU	9	EMITTENTE AG			36 860,00
S_EQC_ah1#	EQ_CU	10	EMITTENTE AH			22 150,00
S_EQC_b1#	EQ_CU	1	EMITTENTE B			20 677,50
S_EQC_c1#	EQ_CU	2	EMITTENTE C			- 31 440,00
S_EQC_d1#	EQ_CU	3	EMITTENTE D			6 238,00
S_EQC_e1#	EQ_CU	4	EMITTENTE E			- 21 605,00
S_EQC_f1#	EQ_CU	5	EMITTENTE F			- 2 850,00
S_EQC_g1#	EQ_CU	6	EMITTENTE G			- 3 642,50

Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_EQC_h1#	EQ_CU	7	EMITTENTE H			- 7 800,00
S_EQC_i1#	EQ_CU	8	EMITTENTE I			- 29 550,00
S_EQC_j1#	EQ_CU	9	EMITTENTE J			- 216 320,00
S_EQC_k1#	EQ_CU	10	EMITTENTE K			1 950,00
S_EQC_q1#	EQ_CU	11	EMITTENTE Q			- 19 142,00
S_EQC_r1#	EQ_CU	11	EMITTENTE R			28 713,00
S_EQC_s1#	EQ_CU	3	EMITTENTE S			- 17 025,00
S_EQC_t1#	EQ_CU	12	EMITTENTE T			7 466,67
S_EQC_u1#	EQ_CU	13	EMITTENTE U			11 160,00
S_EQC_v1#	EQ_CU	12	EMITTENTE V			- 39 200,00
S_EQC_w1#	EQ_CU	13	EMITTENTE W			- 58 590,00
S_EQC_y1#	EQ_CU	1	EMITTENTE Y			- 23 930,00
S_EQC_z1#	EQ_CU	1	EMITTENTE Z			- 47 860,00
S_EQC_a1#	EQ_CD	1	EMITTENTE A			39 157,50
S_EQC_a2#	EQ_CD	1	EMITTENTE A			- 80 349,00
S_EQC_aa1#	EQ_CD	2	EMITTENTE AA			- 30 600,00
S_EQC_ab1#	EQ_CD	4	EMITTENTE AB			- 9 826,00
S_EQC_ac1#	EQ_CD	5	EMITTENTE AC			- 5 414,60

Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_EQC_ad1#	EQ_CD	6	EMITTENTE AD			2 617,50
S_EQC_ae1#	EQ_CD	7	EMITTENTE AE			- 2 720,00
S_EQC_af1#	EQ_CD	8	EMITTENTE AF			- 28 250,00
S_EQC_ag1#	EQ_CD	9	EMITTENTE AG			- 30 935,00
S_EQC_ah1#	EQ_CD	10	EMITTENTE AH			- 15 025,00
S_EQC_b1#	EQ_CD	1	EMITTENTE B			- 238 910,00
S_EQC_c1#	EQ_CD	2	EMITTENTE C			24 480,00
S_EQC_d1#	EQ_CD	3	EMITTENTE D			- 6 068,00
S_EQC_e1#	EQ_CD	4	EMITTENTE E			12 310,00
S_EQC_f1#	EQ_CD	5	EMITTENTE F			2 160,00
S_EQC_g1#	EQ_CD	6	EMITTENTE G			2 617,50
S_EQC_h1#	EQ_CD	7	EMITTENTE H			5 440,00
S_EQC_i1#	EQ_CD	8	EMITTENTE I			20 050,00
S_EQC_j1#	EQ_CD	9	EMITTENTE J			181 560,00
S_EQC_k1#	EQ_CD	10	EMITTENTE K			- 2 900,00
S_EQC_q1#	EQ_CD	11	EMITTENTE Q			20 052,00
S_EQC_r1#	EQ_CD	11	EMITTENTE R			- 30 078,00
S_EQC_s1#	EQ_CD	3	EMITTENTE S			- 9 435,00

Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_EQC_t1#	EQ_CD	12	EMITTENTE T			- 7 400,00
S_EQC_u1#	EQ_CD	13	EMITTENTE U			- 11 040,00
S_EQC_v1#	EQ_CD	12	EMITTENTE V			38 850,00
S_EQC_w1#	EQ_CD	13	EMITTENTE W			57 960,00
S_EQC_y1#	EQ_CD	1	EMITTENTE Y			13 590,00
S_EQC_z1#	EQ_CD	1	EMITTENTE Z			27 180,00
S_CNV_a5#	CSR_NON_SEC_V_5.00	1	EMITTENTE A			100,00
S_CNV_b4#	CSR_NON_SEC_V_5.00	1	EMITTENTE B			50,00
S_CNV_c4#	CSR_NON_SEC_V_5.00	3	EMITTENTE C			150,00
S_CNV_hb1#	CSR_NON_SEC_V_5.00	9	EMITTENTE HA			- 750,00
S_CNV_a4#	CSR_NON_SEC_V_3.00	1	EMITTENTE A			- 500,00
S_CNV_ab1#	CSR_NON_SEC_V_3.00	2	EMITTENTE AB			325,00
S_CNV_b3#	CSR_NON_SEC_V_3.00	1	EMITTENTE B			- 500,00
S_CNV_c3#	CSR_NON_SEC_V_3.00	3	EMITTENTE C			100,00
S_CNV_v1#	CSR_NON_SEC_V_3.00	20	INDICE V			500,00
S_CNV_a6#	CSR_NON_SEC_V_10.00	1	EMITTENTE A			100,00
S_CNV_b5#	CSR_NON_SEC_V_10.00	1	EMITTENTE B			500,00

Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_CNV_c5#	CSR_NON_SEC_V_10.00	3	EMITTENTE C			- 200,00
S_CNV_a3#	CSR_NON_SEC_V_1.00	1	EMITTENTE A			400,00
S_CNV_b2#	CSR_NON_SEC_V_1.00	1	EMITTENTE B			200,00
S_CNV_c2#	CSR_NON_SEC_V_1.00	3	EMITTENTE C			400,00
S_CNV_a1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	EMITTENTE A			- 100,00
S_CNV_a2#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	EMITTENTE A			700,00
S_CNV_b1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	EMITTENTE B			900,00
S_CNV_c1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	3	EMITTENTE C			- 500,00
S_CNV_d1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	4	EMITTENTE D			700,00
S_CNV_e1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	5	EMITTENTE E			- 800,00
S_CNV_f1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	6	EMITTENTE F			700,00
S_CNV_g1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	7	EMITTENTE G			- 400,00
S_CNV_h1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	8	EMITTENTE H			- 50,00
S_CNV_i1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	10	EMITTENTE I			300,00
S_CNV_j1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	11	EMITTENTE J			50,00
S_CNV_k1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	12	EMITTENTE K			- 300,00
S_CNV_l1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	13	EMITTENTE L			1 000,00

Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_CNV_m1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	14	EMITTENTE M			- 350,00
S_CNV_n1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	15	EMITTENTE N			950,00
S_CNV_o1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	16	EMITTENTE O			- 900,00
S_CNV_p1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	17	EMITTENTE P			200,00
S_CNV_q1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	18	EMITTENTE Q			400,00
S_CNV_r1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	18	EMITTENTE R			- 300,00
S_CNV_s1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	19	INDICE S			850,00
S_CNV_t1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	20	INDICE T			- 650,00
S_CNV_u1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	19	INDICE U			- 350,00
S_CND_hb2#	CSR_NON_- SEC_D_3.00_DEBT	9	EMITTENTE HB			- 17 000,00
S_CND_t1#	CSR_NON_- SEC_D_3.00_DEBT	3	EMITTENTE T			- 6 000,00
S_CND_y1#	CSR_NON_- SEC_D_3.00_DEBT	20	INDICE Y			9 000,00
S_CND_ab2#	CSR_NON_SEC_D_3.00_CDS	2	EMITTENTE AC			14 000,00
S_CND_b2#	CSR_NON_SEC_D_3.00_CDS	1	EMITTENTE B			- 17 000,00
S_CND_w1#	CSR_NON_- SEC_D_10.00_DEBT	10	EMITTENTE W		CQS 1	9 000,00
S_CND_a4#	CSR_NON_- SEC_D_1.00_DEBT	1	EMITTENTE A			- 10 000,00
S_CND_s1#	CSR_NON_- SEC_D_1.00_DEBT	3	EMITTENTE S			- 6 000,00



Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_CND_x1#	CSR_NON_SEC_D_1.00_CDS	19	INDICE X			- 18 500,00
S_CND_a1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	1	EMITTENTE A			20 000,00
S_CND_a2#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	1	EMITTENTE A			- 30 000,00
S_CND_b1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	1	EMITTENTE B			12 000,00
S_CND_c1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	3	EMITTENTE C			- 6 000,00
S_CND_d1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	4	EMITTENTE D			25 000,00
S_CND_e1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	5	EMITTENTE E			- 4 000,00
S_CND_f1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	6	EMITTENTE F			- 8 000,00
S_CND_g1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	7	EMITTENTE G			8 000,00
S_CND_h1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	8	EMITTENTE H			3 000,00
S_CND_hb1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	9	EMITTENTE HA			- 23 000,00
S_CND_i1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	10	EMITTENTE I		CQS 2	- 5 000,00
S_CND_j1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	11	EMITTENTE J			2 000,00
S_CND_k1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	12	EMITTENTE K			7 000,00
S_CND_l1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	13	EMITTENTE L			- 9 000,00
S_CND_m1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	14	EMITTENTE M			10 000,00
S_CND_n1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	15	EMITTENTE N			- 20 000,00

Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_CND_o1#	CSR_NON_- SEC_D_0.50_DEBT	16	EMITTENTE O			5 000,00
S_CND_p1#	CSR_NON_- SEC_D_0.50_DEBT	17	EMITTENTE P			- 3 000,00
S_CND_q1#	CSR_NON_- SEC_D_0.50_DEBT	18	EMITTENTE Q			10 000,00
S_CND_r1#	CSR_NON_- SEC_D_0.50_DEBT	18	EMITTENTE R			- 5 000,00
S_CND_a3#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	1	EMITTENTE A			15 000,00
S_CND_ab1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	2	EMITTENTE AB			21 000,00
S_CND_u1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	19	INDICE U			- 32 000,00
S_CND_v1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	20	INDICE V			- 13 000,00
S_CND_x2#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	19	INDICE X			52 500,00
S_CNC_a1#	CSR_NON_SEC_CU	1	EMITTENTE A			- 2 338,64
S_CNC_a2#	CSR_NON_SEC_CU	1	EMITTENTE A			35 116,67
S_CNC_aa1#	CSR_NON_SEC_CU	10	EMITTENTE AA		CQS 1	- 1 212,50
S_CNC_ab1#	CSR_NON_SEC_CU	2	EMITTENTE AB1			- 247,47
S_CNC_b1#	CSR_NON_SEC_CU	1	EMITTENTE B			890,91
S_CNC_c1#	CSR_NON_SEC_CU	3	EMITTENTE C			- 500,00
S_CNC_d1#	CSR_NON_SEC_CU	4	EMITTENTE D			415,00
S_CNC_e1#	CSR_NON_SEC_CU	5	EMITTENTE E			- 1 050,00

Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_CNC_f1#	CSR_NON_SEC_CU	6	EMITTENTE F			- 150,00
S_CNC_g1#	CSR_NON_SEC_CU	7	EMITTENTE G			- 318,75
S_CNC_h1#	CSR_NON_SEC_CU	8	EMITTENTE H			- 425,00
S_CNC_hb1#	CSR_NON_SEC_CU	9	EMITTENTE HB1			- 500,00
S_CNC_i1#	CSR_NON_SEC_CU	10	EMITTENTE I		CQS 2	- 937,50
S_CNC_j1#	CSR_NON_SEC_CU	11	EMITTENTE J			- 4 650,00
S_CNC_k1#	CSR_NON_SEC_CU	12	EMITTENTE K			- 425,00
S_CNC_l1#	CSR_NON_SEC_CU	13	EMITTENTE L			- 27 660,00
S_CNC_m1#	CSR_NON_SEC_CU	14	EMITTENTE M			- 488,00
S_CNC_n1#	CSR_NON_SEC_CU	15	EMITTENTE N			13 237,50
S_CNC_o1#	CSR_NON_SEC_CU	16	EMITTENTE O			- 1 127,50
S_CNC_p1#	CSR_NON_SEC_CU	17	EMITTENTE P			- 5 775,00
S_CNC_q1#	CSR_NON_SEC_CU	18	EMITTENTE Q			- 7 842,00
S_CNC_r1#	CSR_NON_SEC_CU	18	EMITTENTE R			15 684,00
S_CNC_s1#	CSR_NON_SEC_CU	4	EMITTENTE S			- 750,00
S_CNC_t1#	CSR_NON_SEC_CU	19	EMITTENTE T			3 550,00
S_CNC_u1#	CSR_NON_SEC_CU	20	EMITTENTE U			1 660,00
S_CNC_v1#	CSR_NON_SEC_CU	19	EMITTENTE V			- 18 637,50

Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_CNC_w1#	CSR_NON_SEC_CU	20	EMITTENTE W			- 8 715,00
S_CNC_x1#	CSR_NON_SEC_CU	3	EMITTENTE X			- 500,00
S_CNC_y1#	CSR_NON_SEC_CU	1	EMITTENTE Y			- 249,95
S_CNC_z1#	CSR_NON_SEC_CU	1	EMITTENTE Z			- 249,95
S_CNC_a1#	CSR_NON_SEC_CD	1	EMITTENTE A			2 363,38
S_CNC_a2#	CSR_NON_SEC_CD	1	EMITTENTE A			- 35 314,65
S_CNC_aa1#	CSR_NON_SEC_CD	10	EMITTENTE AA		CQS 1	1 150,00
S_CNC_ab1#	CSR_NON_SEC_CD	2	EMITTENTE AB1			247,47
S_CNC_b1#	CSR_NON_SEC_CD	1	EMITTENTE B			- 5 543,43
S_CNC_c1#	CSR_NON_SEC_CD	3	EMITTENTE C			500,00
S_CNC_d1#	CSR_NON_SEC_CD	4	EMITTENTE D			- 385,00
S_CNC_e1#	CSR_NON_SEC_CD	5	EMITTENTE E			575,00
S_CNC_f1#	CSR_NON_SEC_CD	6	EMITTENTE F			75,00
S_CNC_g1#	CSR_NON_SEC_CD	7	EMITTENTE G			287,50
S_CNC_h1#	CSR_NON_SEC_CD	8	EMITTENTE H			400,00
S_CNC_hb1#	CSR_NON_SEC_CD	9	EMITTENTE HB1			500,00
S_CNC_i1#	CSR_NON_SEC_CD	10	EMITTENTE I		CQS 2	750,00
S_CNC_j1#	CSR_NON_SEC_CD	11	EMITTENTE J			4 100,00

Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_CNC_k1#	CSR_NON_SEC_CD	12	EMITTENTE K			387,50
S_CNC_l1#	CSR_NON_SEC_CD	13	EMITTENTE L			22 130,00
S_CNC_m1#	CSR_NON_SEC_CD	14	EMITTENTE M			160,00
S_CNC_n1#	CSR_NON_SEC_CD	15	EMITTENTE N			- 23 437,50
S_CNC_o1#	CSR_NON_SEC_CD	16	EMITTENTE O			1 246,25
S_CNC_p1#	CSR_NON_SEC_CD	17	EMITTENTE P			6 225,00
S_CNC_q1#	CSR_NON_SEC_CD	18	EMITTENTE Q			8 752,00
S_CNC_r1#	CSR_NON_SEC_CD	18	EMITTENTE R			- 17 504,00
S_CNC_s1#	CSR_NON_SEC_CD	4	EMITTENTE S			- 250,00
S_CNC_t1#	CSR_NON_SEC_CD	19	EMITTENTE T			- 3 500,00
S_CNC_u1#	CSR_NON_SEC_CD	20	EMITTENTE U			- 1 540,00
S_CNC_v1#	CSR_NON_SEC_CD	19	EMITTENTE V			18 375,00
S_CNC_w1#	CSR_NON_SEC_CD	20	EMITTENTE W			8 085,00
S_CNC_x1#	CSR_NON_SEC_CD	3	EMITTENTE X			500,00
S_CNC_y1#	CSR_NON_SEC_CD	1	EMITTENTE Y			- 226,77
S_CNC_z1#	CSR_NON_SEC_CD	1	EMITTENTE Z			- 226,77
S_CMV_a5#	CM_V_5.00	1	CARBONE			- 300,00

Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_CMV_b4#	CM_V_5.00	1	URANIO			450,00
S_CMV_a4#	CM_V_3.00	1	CARBONE			800,00
S_CMV_b3#	CM_V_3.00	1	URANIO			800,00
S_CMV_a6#	CM_V_10.00	1	CARBONE			100,00
S_CMV_b5#	CM_V_10.00	1	URANIO			- 250,00
S_CMV_a3#	CM_V_1.00	1	CARBONE			- 200,00
S_CMV_b2#	CM_V_1.00	1	URANIO			- 750,00
S_CMV_d1#	CM_V_1.00	2	WTI			- 175,00
S_CMV_f1#	CM_V_1.00	3	FWD ENERGIA ELETTRICA NE			- 450,00
S_CMV_h1#	CM_V_1.00	4	PANAMAX			- 5 500,00
S_CMV_j1#	CM_V_1.00	5	RAME			- 200,00
S_CMV_l1#	CM_V_1.00	6	GAS NATURALE LIQUEFATTO			1 000,00
S_CMV_n1#	CM_V_1.00	7	ARGENTO			500,00
S_CMV_p1#	CM_V_1.00	8	MAIS			- 1 000,00
S_CMV_r1#	CM_V_1.00	9	SIERO DI LATTE			- 125,00
S_CMV_t1#	CM_V_1.00	10	GOMMA			- 50,00
S_CMV_v1#	CM_V_1.00	11	POTASSA			- 1 800,00

Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_CMV_a1#	CM_V_0.50	1	CARBONE			1 000,00
S_CMV_a2#	CM_V_0.50	1	CARBONE			- 350,00
S_CMV_b1#	CM_V_0.50	1	URANIO			150,00
S_CMV_c1#	CM_V_0.50	2	BRENT			200,00
S_CMV_e1#	CM_V_0.50	3	SPOT ENERGIA ELETTRICA SE			- 300,00
S_CMV_g1#	CM_V_0.50	4	SUPRAMAX			- 5 000,00
S_CMV_i1#	CM_V_0.50	5	ACCIAIO			550,00
S_CMV_k1#	CM_V_0.50	6	GAS NATURALE			400,00
S_CMV_m1#	CM_V_0.50	7	ORO			- 200,00
S_CMV_o1#	CM_V_0.50	8	SEMI DI SOIA			- 750,00
S_CMV_q1#	CM_V_0.50	9	PESCE			250,00
S_CMV_s1#	CM_V_0.50	10	CACAO			350,00
S_CMV_u1#	CM_V_0.50	11	VETRO PIANO			3 000,00
S_CMV_w1#	CM_V_0.50	4	SUPRAMAX			- 5 000,00
S_CMV_x1#	CM_V_0.50	4	PANAMAX			15 000,00
S_CMD_p1#	CM_D_30.00	8	MAIS	OKLAHOMA		- 10 000,00
S_CMD_f1#	CM_D_3.00	3	FWD ENERGIA ELETTRICA NE	TEXAS		- 4 500,00

Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_CMD_h1#	CM_D_3.00	4	PANAMAX	NEW ORLEANS		- 68 750,00
S_CMD_n1#	CM_D_20.00	7	ARGENTO	EU1		5 000,00
S_CMD_r1#	CM_D_20.00	9	SIERO DI LATTE	NEWCASTLE		- 1 250,00
S_CMD_d1#	CM_D_2.00	2	WTI	OKLAHOMA		- 1 750,00
S_CMD_l1#	CM_D_15.00	6	GAS NATURALE LIQUEFATTO	OKLAHOMA		10 000,00
S_CMD_t1#	CM_D_15.00	10	GOMMA	NEWCASTLE		- 500,00
S_CMD_j1#	CM_D_10.00	5	RAME	OKLAHOMA		- 2 000,00
S_CMD_v1#	CM_D_10.00	11	POTASSA	NEWCASTLE		- 18 000,00
S_CMD_b1#	CM_D_1.00	1	URANIO	OKLAHOMA		1 500,00
S_CMD_g1#	CM_D_1.00	4	SUPRAMAX	SANTOS		- 62 500,00
S_CMD_w1#	CM_D_1.00	4	SUPRAMAX	SANTOS		- 62 500,00
S_CMD_x1#	CM_D_1.00	4	PANAMAX	NEW ORLEANS		187 500,00
S_CMD_a4#	CM_D_0.50	1	CARBONE	NEWCASTLE		8 000,00
S_CMD_a1#	CM_D_0.00	1	CARBONE	NEWCASTLE		10 000,00
S_CMD_a2#	CM_D_0.00	1	CARBONE	NEWCASTLE		- 3 500,00
S_CMD_a3#	CM_D_0.00	1	CARBONE	LONDRA		- 2 000,00
S_CMD_c1#	CM_D_0.00	2	BRENT	LE HAVRE		2 000,00



Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_CMD_e1#	CM_D_0.00	3	SPOT ENERGIA ELETTRICA SE	LONDRA		- 3 000,00
S_CMD_i1#	CM_D_0.00	5	ACCIAIO	LE HAVRE		5 500,00
S_CMD_k1#	CM_D_0.00	6	GAS NATURALE	LE HAVRE		4 000,00
S_CMD_m1#	CM_D_0.00	7	ORO	UK1		- 2 000,00
S_CMD_o1#	CM_D_0.00	8	SEMI DI SOIA	LE HAVRE		- 7 500,00
S_CMD_q1#	CM_D_0.00	9	PESCE	LONDRA		2 500,00
S_CMD_s1#	CM_D_0.00	10	CACAO	LONDRA		3 500,00
S_CMD_u1#	CM_D_0.00	11	VETRO PIANO	LONDRA		30 000,00
S_CMC_a1#	CM_CU	1	CARBONE			17 335,00
S_CMC_a2#	CM_CU	1	CARBONE			36 936,00
S_CMC_b1#	CM_CU	1	URANIO			6 635,00
S_CMC_c1#	CM_CU	2	BRENT			- 11 600,00
S_CMC_d1#	CM_CU	2	WTI			- 36 900,00
S_CMC_e1#	CM_CU	3	SPOT ENERGIA ELETTRICA SE			8 563,00
S_CMC_f1#	CM_CU	3	FWD ENERGIA ELETTRICA NE			- 27 250,00
S_CMC_g1#	CM_CU	4	SUPRAMAX			- 36 880,00
S_CMC_h1#	CM_CU	4	PANAMAX			29 472,00

Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_CMC_i1#	CM_CU	5	ACCIAIO			- 5 850,00
S_CMC_j1#	CM_CU	5	RAME			14 644,80
S_CMC_k1#	CM_CU	6	GAS NATURALE			- 6 147,50
S_CMC_l1#	CM_CU	6	GAS NATURALE LIQUEFATTO			- 6 147,50
S_CMC_m1#	CM_CU	7	ORO			- 1 486,67
S_CMC_n1#	CM_CU	7	ARGENTO			743,33
S_CMC_o1#	CM_CU	8	SEMI DI SOIA			- 14 535,00
S_CMC_p1#	CM_CU	8	MAIS			20 475,00
S_CMC_q1#	CM_CU	9	PESCE			- 19 900,00
S_CMC_r1#	CM_CU	9	SIERO DI LATTE			3 387,00
S_CMC_s1#	CM_CU	10	CACAO			1 005,00
S_CMC_t1#	CM_CU	10	GOMMA			10 892,20
S_CMC_u1#	CM_CU	11	VETRO PIANO			- 13 790,00
S_CMC_v1#	CM_CU	11	POTASSA			20 685,00
S_CMC_x1#	CM_CU	9	LATTE			- 6 300,00
S_CMC_y1#	CM_CU	1	URANIO			- 65 864,00
S_CMC_z1#	CM_CU	4	PANAMAX			29 472,00

Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_CMC_a1#	CM_CD	1	CARBONE			- 18 260,00
S_CMC_a2#	CM_CD	1	CARBONE			- 37 630,00
S_CMC_b1#	CM_CD	1	URANIO			- 70 460,00
S_CMC_c1#	CM_CD	2	BRENT			8 320,00
S_CMC_d1#	CM_CD	2	WTI			3 550,00
S_CMC_e1#	CM_CD	3	SPOT ENERGIA ELETTRICA SE			- 8 233,00
S_CMC_f1#	CM_CD	3	FWD ENERGIA ELETTRICA NE			16 370,00
S_CMC_g1#	CM_CD	4	SUPRAMAX			29 110,00
S_CMC_h1#	CM_CD	4	PANAMAX			- 15 256,00
S_CMC_i1#	CM_CD	5	ACCIAIO			4 080,00
S_CMC_j1#	CM_CD	5	RAME			- 10 219,80
S_CMC_k1#	CM_CD	6	GAS NATURALE			4 222,50
S_CMC_l1#	CM_CD	6	GAS NATURALE LIQUEFATTO			4 222,50
S_CMC_m1#	CM_CD	7	ORO			1 353,33
S_CMC_n1#	CM_CD	7	ARGENTO			- 676,67
S_CMC_o1#	CM_CD	8	SEMI DI SOIA			10 435,00
S_CMC_p1#	CM_CD	8	MAIS			- 14 735,00

Strumento	Identificativo del fattore di rischio	Categoria	Identificativo aggiuntivo	Identificativo aggiuntivo2	Categoria di classe di merito di credito	Sensibilità al rischio
S_CMC_q1#	CM_CD	9	PESCE			6 700,00
S_CMC_r1#	CM_CD	9	SIERO DI LATTE			- 3 012,00
S_CMC_s1#	CM_CD	10	CACAO			- 1 415,00
S_CMC_t1#	CM_CD	10	GOMMA			- 7 817,20
S_CMC_u1#	CM_CD	11	VETRO PIANO			14 200,00
S_CMC_v1#	CM_CD	11	POTASSA			- 21 300,00
S_CMC_x1#	CM_CD	9	LATTE			- 4 700,00
S_CMC_y1#	CM_CD	1	URANIO			- 66 344,00
S_CMC_z1#	CM_CD	4	PANAMAX			- 22 856,00

Portafoglio	Classe di rischio	Componente	Strumenti
G000	GIRR	DELTA	S_IRD_a1#
G001	GIRR	DELTA	S_IRD_b1#
G002	GIRR	DELTA	S_IRD_b2#
G003	GIRR	DELTA	S_IRD_b3#
G004	GIRR	DELTA	S_IRD_b4#
G005	GIRR	DELTA	S_IRD_b5#
G006	GIRR	DELTA	S_IRD_b6#
G007	GIRR	DELTA	S_IRD_b7#
G008	GIRR	DELTA	S_IRD_b8#
G009	GIRR	DELTA	S_IRD_b9#
G010	GIRR	DELTA	S_IRD_b10#
G011	GIRR	DELTA	S_IRD_b11#
G012	GIRR	DELTA	S_IRD_b12#
G013	GIRR	DELTA	S_IRD_d1#
G014	GIRR	DELTA	S_IRD_d2#
G015	GIRR	DELTA	S_IRD_d3#
G016	GIRR	DELTA	S_IRD_d4#
G017	GIRR	DELTA	S_IRD_d5#
G018	GIRR	DELTA	S_IRD_d6#
G019	GIRR	DELTA	S_IRD_d7#
G020	GIRR	DELTA	S_IRD_d8#
G021	GIRR	DELTA	S_IRD_d9#
G022	GIRR	DELTA	S_IRD_d10#
G023	GIRR	DELTA	S_IRD_d11#
G024	GIRR	DELTA	S_IRD_d12#
G025	GIRR	DELTA	S_IRD_a1# S_IRD_b1#
G026	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10#
G027	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_c1#
G028	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10#

Portafoglio	Classe di rischio	Componente	Strumenti
G029	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11#
G030	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12#
G031	GIRR	DELTA	S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c6#
G032	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10# S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12#
G033	GIRR	DELTA	S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12# S_IRD_e1# S_IRD_e2# S_IRD_e3# S_IRD_e4# S_IRD_e5# S_IRD_e6# S_IRD_e7# S_IRD_e8# S_IRD_e9# S_IRD_e10# S_IRD_e11# S_IRD_e12# S_IRD_e13#
G034	GIRR	DELTA	S_IRD_a1# S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10# S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12# S_IRD_e1# S_IRD_e2# S_IRD_e3# S_IRD_e4# S_IRD_e5# S_IRD_e6# S_IRD_e7# S_IRD_e8# S_IRD_e9# S_IRD_e10# S_IRD_e11# S_IRD_e12# S_IRD_e13# S_IRD_f1#
G035	GIRR	VEGA	S_IRV_b1#
G036	GIRR	VEGA	S_IRV_a1# S_IRV_b1#
G037	GIRR	VEGA	S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5#
G038	GIRR	VEGA	S_IRV_b1# S_IRV_b6# S_IRV_b11# S_IRV_b16# S_IRV_b21#

Portafoglio	Classe di rischio	Componente	Strumenti
G039	GIRR	VEGA	S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25#
G040	GIRR	VEGA	S_IRV_e1# S_IRV_e2#
G041	GIRR	VEGA	S_IRV_e1# S_IRV_e3#
G042	GIRR	VEGA	S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5#
G043	GIRR	VEGA	S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25# S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5#
G044	GIRR	VEGA	S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5# S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5#
G045	GIRR	VEGA	S_IRV_a1# S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25# S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5# S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5# S_IRV_e1# S_IRV_e2# S_IRV_e3#
G046	GIRR	CURVATURA	S_IRC_b1#
G047	GIRR	CURVATURA	S_IRC_c1#
G048	GIRR	CURVATURA	S_IRC_a1# S_IRC_b1#
G049	GIRR	CURVATURA	S_IRC_d1#
G050	GIRR	CURVATURA	S_IRC_b1# S_IRC_c1#
G051	GIRR	CURVATURA	S_IRC_c1# S_IRC_e1#
G052	GIRR	CURVATURA	S_IRC_d1# S_IRC_e1#
G053	GIRR	CURVATURA	S_IRC_a1# S_IRC_a1# S_IRC_b1# S_IRC_b1# S_IRC_c1# S_IRC_c1# S_IRC_d1# S_IRC_d1# S_IRC_e1# S_IRC_e1#

Portafoglio	Classe di rischio	Componente	Strumenti
G054	GIRR	TUTTI	S_IRD_a1# S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10# S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12# S_IRD_e1# S_IRD_e2# S_IRD_e3# S_IRD_e4# S_IRD_e5# S_IRD_e6# S_IRD_e7# S_IRD_e8# S_IRD_e9# S_IRD_e10# S_IRD_e11# S_IRD_e12# S_IRD_e13# S_IRD_f1# S_IRV_a1# S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25# S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5# S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5# S_IRV_e1# S_IRV_e2# S_IRV_e3# S_IRC_a1# S_IRC_a1# S_IRC_b1# S_IRC_b1# S_IRC_c1# S_IRC_c1# S_IRC_d1# S_IRC_d1# S_IRC_e1# S_IRC_e1#
G055	GIRR	DELTA	S_IRD_e11# S_IRD_e13#
G056	GIRR	DELTA	S_IRD_e1# S_IRD_f1#
E001	EQ	DELTA	S_EQD_a2#
E002	EQ	DELTA	S_EQD_c1#
E003	EQ	DELTA	S_EQD_d1#
E004	EQ	DELTA	S_EQD_e1#
E005	EQ	DELTA	S_EQD_f1#
E006	EQ	DELTA	S_EQD_h1#
E007	EQ	DELTA	S_EQD_i1#
E008	EQ	DELTA	S_EQD_j1#
E009	EQ	DELTA	S_EQD_k1#
E010	EQ	DELTA	S_EQD_m1#
E011	EQ	DELTA	S_EQD_o1#
E012	EQ	DELTA	S_EQD_q1#
E013	EQ	DELTA	S_EQD_s1#
E014	EQ	DELTA	S_EQD_a3#



Portafoglio	Classe di rischio	Componente	Strumenti
E015	EQ	DELTA	S_EQD_x1#
E016	EQ	DELTA	S_EQD_y1#
E017	EQ	DELTA	S_EQD_z1#
E018	EQ	DELTA	S_EQD_f2#
E019	EQ	DELTA	S_EQD_aa1#
E020	EQ	DELTA	S_EQD_ab1#
E021	EQ	DELTA	S_EQD_ac1#
E022	EQ	DELTA	S_EQD_k2#
E023	EQ	DELTA	S_EQD_m2#
E024	EQ	DELTA	S_EQD_p1#
E025	EQ	DELTA	S_EQD_q2#
E026	EQ	DELTA	S_EQD_t1#
E027	EQ	DELTA	S_EQD_a1# S_EQD_a2#
E028	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_a3#
E029	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_b1#
E030	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_b2#
E031	EQ	DELTA	S_EQD_f1# S_EQD_f2#
E032	EQ	DELTA	S_EQD_f1# S_EQD_g1#
E033	EQ	DELTA	S_EQD_f1# S_EQD_g2#
E034	EQ	DELTA	S_EQD_k1# S_EQD_k2#
E035	EQ	DELTA	S_EQD_k1# S_EQD_l1#
E036	EQ	DELTA	S_EQD_k1# S_EQD_l2#
E037	EQ	DELTA	S_EQD_m1# S_EQD_m2#
E038	EQ	DELTA	S_EQD_m1# S_EQD_n1#
E039	EQ	DELTA	S_EQD_m1# S_EQD_n2#
E040	EQ	DELTA	S_EQD_o1# S_EQD_p1#
E041	EQ	DELTA	S_EQD_q1# S_EQD_q2#
E042	EQ	DELTA	S_EQD_q1# S_EQD_r1#
E043	EQ	DELTA	S_EQD_s1# S_EQD_t1#
E044	EQ	DELTA	S_EQD_s1# S_EQD_t1# S_EQD_t2#

Portafoglio	Classe di rischio	Componente	Strumenti
E045	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_c1# S_EQD_d1# S_EQD_e1# S_EQD_f1# S_EQD_h1# S_EQD_i1# S_EQD_j1# S_EQD_k1# S_EQD_m1#
E046	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_o1#
E047	EQ	DELTA	S_EQD_q1# S_EQD_s1#
E048	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_q1#
E049	EQ	DELTA	S_EQD_k1# S_EQD_l1# S_EQD_m1# S_EQD_n1# S_EQD_q1# S_EQD_s2# S_EQD_u1# S_EQD_v1#
E050	EQ	DELTA	S_EQD_a1# S_EQD_a2# S_EQD_a3# S_EQD_b1# S_EQD_b2# S_EQD_c1# S_EQD_x1# S_EQD_d1# S_EQD_y1# S_EQD_e1# S_EQD_z1# S_EQD_f1# S_EQD_f2# S_EQD_g1# S_EQD_g2# S_EQD_h1# S_EQD_aa1# S_EQD_i1# S_EQD_ab1# S_EQD_j1# S_EQD_ac1# S_EQD_k1# S_EQD_k2# S_EQD_l1# S_EQD_l2# S_EQD_m1# S_EQD_m2# S_EQD_n1# S_EQD_n2# S_EQD_o1# S_EQD_p1# S_EQD_q1# S_EQD_q2# S_EQD_r1# S_EQD_r2# S_EQD_s1# S_EQD_s2# S_EQD_t1# S_EQD_t2# S_EQD_u1# S_EQD_v1#
E051	EQ	VEGA	S_EQV_a2#
E052	EQ	VEGA	S_EQV_c1#
E053	EQ	VEGA	S_EQV_d1#
E054	EQ	VEGA	S_EQV_e1#
E055	EQ	VEGA	S_EQV_f1#
E056	EQ	VEGA	S_EQV_g1#
E057	EQ	VEGA	S_EQV_h1#
E058	EQ	VEGA	S_EQV_i1#
E059	EQ	VEGA	S_EQV_j1#
E060	EQ	VEGA	S_EQV_k1#
E061	EQ	VEGA	S_EQV_l1#
E062	EQ	VEGA	S_EQV_n1#
E063	EQ	VEGA	S_EQV_p1#
E064	EQ	VEGA	S_EQV_a1# S_EQV_a2#
E065	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6#
E066	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_b1#
E067	EQ	VEGA	S_EQV_a1# S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6# S_EQV_b1# S_EQV_b2# S_EQV_b3# S_EQV_b4# S_EQV_b5#

Portafoglio	Classe di rischio	Componente	Strumenti
E068	EQ	VEGA	S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5#
E069	EQ	VEGA	S_EQV_f1# S_EQV_aa1#
E070	EQ	VEGA	S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5# S_EQV_aa1# S_EQV_aa2# S_EQV_aa3# S_EQV_aa4# S_EQV_aa5#
E071	EQ	VEGA	S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5#
E072	EQ	VEGA	S_EQV_j1# S_EQV_ae1#
E073	EQ	VEGA	S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5# S_EQV_ae1# S_EQV_ae2# S_EQV_ae3# S_EQV_ae4# S_EQV_ae5#
E074	EQ	VEGA	S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5#
E075	EQ	VEGA	S_EQV_k1# S_EQV_af1#
E076	EQ	VEGA	S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5# S_EQV_af1# S_EQV_af2# S_EQV_af3# S_EQV_af4# S_EQV_af5#
E077	EQ	VEGA	S_EQV_l1# S_EQV_m1#
E078	EQ	VEGA	S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5#
E079	EQ	VEGA	S_EQV_n1# S_EQV_o1#
E080	EQ	VEGA	S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5# S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5#
E081	EQ	VEGA	S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5#
E082	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_c1# S_EQV_d1# S_EQV_e1# S_EQV_f1# S_EQV_g1# S_EQV_h1# S_EQV_i1# S_EQV_j1# S_EQV_k1#
E083	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_m1#
E084	EQ	VEGA	S_EQV_n1# S_EQV_p1#
E085	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_n1#
E086	EQ	VEGA	S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5# S_EQV_p1#

Portafoglio	Classe di rischio	Componente	Strumenti
E087	EQ	VEGA	S_EQV_a1# S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6# S_EQV_b1# S_EQV_b2# S_EQV_b3# S_EQV_b4# S_EQV_b5# S_EQV_c1# S_EQV_x1# S_EQV_d1# S_EQV_y1# S_EQV_e1# S_EQV_z1# S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5# S_EQV_aa1# S_EQV_aa2# S_EQV_aa3# S_EQV_aa4# S_EQV_aa5# S_EQV_g1# S_EQV_ab1# S_EQV_h1# S_EQV_ac1# S_EQV_i1# S_EQV_ad1# S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5# S_EQV_ae1# S_EQV_ae2# S_EQV_ae3# S_EQV_ae4# S_EQV_ae5# S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5# S_EQV_af1# S_EQV_af2# S_EQV_af3# S_EQV_af4# S_EQV_af5# S_EQV_l1# S_EQV_m1# S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5# S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5# S_EQV_p1# S_EQV_q1#
E088	EQ	CURVATURA	S_EQC_b1#
E089	EQ	CURVATURA	S_EQC_c1#
E090	EQ	CURVATURA	S_EQC_d1#
E091	EQ	CURVATURA	S_EQC_e1#
E092	EQ	CURVATURA	S_EQC_f1#
E093	EQ	CURVATURA	S_EQC_g1#
E094	EQ	CURVATURA	S_EQC_h1#
E095	EQ	CURVATURA	S_EQC_i1#
E096	EQ	CURVATURA	S_EQC_j1#
E097	EQ	CURVATURA	S_EQC_k1#
E098	EQ	CURVATURA	S_EQC_q1#
E099	EQ	CURVATURA	S_EQC_t1#
E100	EQ	CURVATURA	S_EQC_u1#
E101	EQ	CURVATURA	S_EQC_a1# S_EQC_a2#
E102	EQ	CURVATURA	S_EQC_a1# S_EQC_b1#
E103	EQ	CURVATURA	S_EQC_f1# S_EQC_ac1#
E104	EQ	CURVATURA	S_EQC_j1# S_EQC_ag1#
E105	EQ	CURVATURA	S_EQC_k1# S_EQC_ah1#
E106	EQ	CURVATURA	S_EQC_q1# S_EQC_r1#
E107	EQ	CURVATURA	S_EQC_t1# S_EQC_v1#

Portafoglio	Classe di rischio	Componente	Strumenti
E108	EQ	CURVATURA	S_EQC_a1# S_EQC_a2# S_EQC_b1# S_EQC_y1# S_EQC_z1#
E109	EQ	CURVATURA	S_EQC_s1#
E110	EQ	CURVATURA	S_EQC_a2# S_EQC_c1# S_EQC_d1# S_EQC_e1# S_EQC_f1# S_EQC_g1# S_EQC_h1# S_EQC_i1# S_EQC_j1# S_EQC_k1#
E111	EQ	CURVATURA	S_EQC_a2# S_EQC_q1#
E112	EQ	CURVATURA	S_EQC_t1# S_EQC_u1#
E113	EQ	CURVATURA	S_EQC_a2# S_EQC_t1#
E114	EQ	CURVATURA	S_EQC_a1# S_EQC_b1# S_EQC_d1# S_EQC_s1#
E115	EQ	CURVATURA	S_EQC_a1# S_EQC_b1# S_EQC_t1# S_EQC_u1#
E116	EQ	CURVATURA	S_EQC_a1# S_EQC_a1# S_EQC_a2# S_EQC_a2# S_EQC_b1# S_EQC_b1# S_EQC_c1# S_EQC_c1# S_EQC_aa1# S_EQC_aa1# S_EQC_d1# S_EQC_d1# S_EQC_e1# S_EQC_e1# S_EQC_ab1# S_EQC_ab1# S_EQC_f1# S_EQC_f1# S_EQC_ac1# S_EQC_ac1# S_EQC_g1# S_EQC_g1# S_EQC_ad1# S_EQC_ad1# S_EQC_h1# S_EQC_h1# S_EQC_ae1# S_EQC_ae1# S_EQC_i1# S_EQC_i1# S_EQC_af1# S_EQC_af1# S_EQC_j1# S_EQC_j1# S_EQC_ag1# S_EQC_ag1# S_EQC_k1# S_EQC_k1# S_EQC_ah1# S_EQC_ah1# S_EQC_q1# S_EQC_q1# S_EQC_r1# S_EQC_r1# S_EQC_s1# S_EQC_s1# S_EQC_t1# S_EQC_t1# S_EQC_u1# S_EQC_u1# S_EQC_v1# S_EQC_v1# S_EQC_w1# S_EQC_w1# S_EQC_y1# S_EQC_y1# S_EQC_z1# S_EQC_z1#
E117	EQ	TUTTI	S_EQD_a1# S_EQD_a2# S_EQD_a3# S_EQD_b1# S_EQD_b2# S_EQD_c1# S_EQD_x1# S_EQD_d1# S_EQD_y1# S_EQD_e1# S_EQD_z1# S_EQD_f1# S_EQD_f2# S_EQD_g1# S_EQD_g2# S_EQD_h1# S_EQD_aa1# S_EQD_j1# S_EQD_ab1# S_EQD_j1# S_EQD_ac1# S_EQD_k1# S_EQD_k2# S_EQD_l1# S_EQD_l2# S_EQD_m1# S_EQD_m2# S_EQD_n1# S_EQD_n2# S_EQD_o1# S_EQD_p1# S_EQD_q1# S_EQD_q2# S_EQD_r1# S_EQD_r2# S_EQD_s1# S_EQD_s2# S_EQD_t1# S_EQD_t2# S_EQD_u1# S_EQD_v1# S_EQV_a1# S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6# S_EQV_b1# S_EQV_b2# S_EQV_b3# S_EQV_b4# S_EQV_b5# S_EQV_c1# S_EQV_x1# S_EQV_d1# S_EQV_y1# S_EQV_e1# S_EQV_z1# S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5# S_EQV_aa1# S_EQV_aa2# S_EQV_aa3# S_EQV_aa4# S_EQV_aa5# S_EQV_g1# S_EQV_ab1# S_EQV_h1# S_EQV_ac1# S_EQV_i1# S_EQV_ad1# S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5#

Portafoglio	Classe di rischio	Componente	Strumenti
			S_EQV_ae1# S_EQV_ae2# S_EQV_ae3# S_EQV_ae4# S_EQV_ae5# S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5# S_EQV_af1# S_EQV_af2# S_EQV_af3# S_EQV_af4# S_EQV_af5# S_EQV_l1# S_EQV_m1# S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5# S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5# S_EQV_p1# S_EQV_q1# S_EQC_a1# S_EQC_a1# S_EQC_a2# S_EQC_a2# S_EQC_b1# S_EQC_b1# S_EQC_c1# S_EQC_c1# S_EQC_aa1# S_EQC_aa1# S_EQC_d1# S_EQC_d1# S_EQC_e1# S_EQC_e1# S_EQC_ab1# S_EQC_ab1# S_EQC_f1# S_EQC_f1# S_EQC_ac1# S_EQC_ac1# S_EQC_g1# S_EQC_g1# S_EQC_ad1# S_EQC_ad1# S_EQC_h1# S_EQC_h1# S_EQC_ae1# S_EQC_ae1# S_EQC_i1# S_EQC_i1# S_EQC_af1# S_EQC_af1# S_EQC_j1# S_EQC_j1# S_EQC_ag1# S_EQC_ag1# S_EQC_k1# S_EQC_k1# S_EQC_ah1# S_EQC_ah1# S_EQC_q1# S_EQC_q1# S_EQC_r1# S_EQC_r1# S_EQC_s1# S_EQC_s1# S_EQC_t1# S_EQC_t1# S_EQC_u1# S_EQC_u1# S_EQC_v1# S_EQC_v1# S_EQC_w1# S_EQC_w1# S_EQC_y1# S_EQC_y1# S_EQC_z1# S_EQC_z1#
F001	FX	DELTA	S_FXD_b1#
F002	FX	DELTA	S_FXD_c1#
F003	FX	DELTA	S_FXD_a1# S_FXD_b1#
F005	FX	DELTA	S_FXD_b1# S_FXD_c1#
F007	FX	DELTA	S_FXD_a1# S_FXD_b1# S_FXD_c1# S_FXD_d1# S_FXD_e1# S_FXD_f1#
F008	FX	VEGA	S_FXV_b1#
F009	FX	VEGA	S_FXV_a1# S_FXV_b1#
F010	FX	VEGA	S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5#
F011	FX	VEGA	S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5#
F012	FX	VEGA	S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5# S_FXV_c1#
F013	FX	VEGA	S_FXV_c1# S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5#
F014	FX	VEGA	S_FXV_a1# S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5# S_FXV_c1# S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5#

Portafoglio	Classe di rischio	Componente	Strumenti
F015	FX	CURVATURA	S_FXC_b1#
F016	FX	CURVATURA	S_FXC_c1#
F017	FX	CURVATURA	S_FXC_a1# S_FXC_b1#
F018	FX	CURVATURA	S_FXC_d1#
F019	FX	CURVATURA	S_FXC_b1# S_FXC_c1#
F020	FX	CURVATURA	S_FXC_c1# S_FXC_e1#
F021	FX	CURVATURA	S_FXC_b1# S_FXC_d1# S_FXC_e1#
F022	FX	CURVATURA	S_FXC_a1# S_FXC_a1# S_FXC_b1# S_FXC_b1# S_FXC_c1# S_FXC_c1# S_FXC_d1# S_FXC_d1# S_FXC_e1# S_FXC_e1# S_FXC_f1# S_FXC_f1#
F023	FX	TUTTI	S_FXD_a1# S_FXD_b1# S_FXD_c1# S_FXD_d1# S_FXD_e1# S_FXD_f1# S_FXV_a1# S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5# S_FXV_c1# S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5# S_FXC_a1# S_FXC_a1# S_FXC_b1# S_FXC_b1# S_FXC_c1# S_FXC_c1# S_FXC_d1# S_FXC_d1# S_FXC_e1# S_FXC_e1# S_FXC_f1# S_FXC_f1#
F024	FX	DELTA	S_FXD_d1#
F026	FX	DELTA	S_FXD_f1#
F028	FX	CURVATURA	S_FXC_f1#
N001	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1#
N002	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_c1#
N003	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_d1#
N004	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_e1#
N005	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_f1#
N006	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_g1#
N007	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_h1#
N008	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_i1#
N009	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_w1#
N010	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_j1#
N011	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_k1#
N012	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_l1#
N013	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_m1#
N014	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_n1#

Portafoglio	Classe di rischio	Componente	Strumenti
N015	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_o1#
N016	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_p1#
N017	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_q1#
N018	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_u1#
N019	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_v1#
N020	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_a2#
N021	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a2# S_CND_a3#
N022	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a2# S_CND_a4#
N023	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a3# S_CND_a4#
N024	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_b1#
N025	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a3# S_CND_b1#
N026	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a4# S_CND_b1#
N027	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_b2#
N028	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_q1# S_CND_r1#
N029	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_u1# S_CND_x2#
N030	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_v1# S_CND_y1#
N031	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_u1# S_CND_x1# S_CND_x2#
N032	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1#
N033	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1#
N034	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1#
N035	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#
N036	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1#
N037	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1#
N038	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#
N039	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1#
N040	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#



Portafoglio	Classe di rischio	Componente	Strumenti
N041	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#
N042	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a3# S_CND_b1# S_CND_c1# S_CND_s1# S_CND_t1#
N043	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_a2# S_CND_a3# S_CND_a4# S_CND_b1# S_CND_b2# S_CND_ab1# S_CND_ab2# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_hb1# S_CND_hb2# S_CND_i1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1# S_CND_q1# S_CND_r1# S_CND_s1# S_CND_t1# S_CND_u1# S_CND_v1# S_CND_w1# S_CND_x1# S_CND_x2# S_CND_y1#
N044	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a2#
N045	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_a2#
N046	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6#
N047	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a2# S_CNV_b1#
N048	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6# S_CNV_b1# S_CNV_b2# S_CNV_b3# S_CNV_b4# S_CNV_b5#
N049	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_q1# S_CNV_r1#
N050	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_s1# S_CNV_u1#
N051	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_t1# S_CNV_v1#
N052	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5#
N053	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1#
N054	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1#
N055	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1#
N056	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#
N057	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1#
N058	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1#
N059	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#

Portafoglio	Classe di rischio	Componente	Strumenti
N060	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1#
N061	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#
N062	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#
N063	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_b4# S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5#
N064	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6# S_CNV_b1# S_CNV_b2# S_CNV_b3# S_CNV_b4# S_CNV_b5# S_CNV_ab1# S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_hb1# S_CNV_i1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1# S_CNV_q1# S_CNV_r1# S_CNV_s1# S_CNV_t1# S_CNV_u1# S_CNV_v1#
N065	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_b1#
N066	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_c1#
N067	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_d1#
N068	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_e1#
N069	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_f1#
N070	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_g1#
N071	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_h1#
N072	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_i1#
N073	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_aa1#
N074	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_j1#
N075	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_k1#
N076	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_l1#
N077	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_m1#
N078	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_n1#
N079	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_o1#
N080	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_p1#

Portafoglio	Classe di rischio	Componente	Strumenti
N081	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_q1#
N082	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_t1#
N083	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_u1#
N084	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_a1# S_CNC_a2#
N085	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_a1# S_CNC_b1#
N086	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_q1# S_CNC_r1#
N087	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_t1# S_CNC_v1#
N088	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_u1# S_CNC_w1#
N089	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_b1# S_CNC_y1# S_CNC_z1#
N090	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_s1#
N091	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1#
N092	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1#
N093	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1#
N094	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N095	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1#
N096	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1#
N097	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N098	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1#
N099	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N100	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N101	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_c1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_z1#
N102	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_a1# S_CNC_b1# S_CNC_d1# S_CNC_s1#

Portafoglio	Classe di rischio	Componente	Strumenti
N103	CSR_NON_SEC	CURVATURA	<p>S_CNC_a1# S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_a2#  S_CNC_b1# S_CNC_b1# S_CNC_ab1#  S_CNC_ab1# S_CNC_c1# S_CNC_c1# S_CNC_d1#  S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_e1# S_CNC_f1#  S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_g1# S_CNC_h1#  S_CNC_h1# S_CNC_hb1# S_CNC_hb1#  S_CNC_i1# S_CNC_i1# S_CNC_j1# S_CNC_j1#  S_CNC_k1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_l1#  S_CNC_m1# S_CNC_m1# S_CNC_n1# S_CNC_n1#  S_CNC_o1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_p1#  S_CNC_q1# S_CNC_q1# S_CNC_r1# S_CNC_r1#  S_CNC_s1# S_CNC_s1# S_CNC_t1# S_CNC_t1#  S_CNC_u1# S_CNC_u1# S_CNC_v1# S_CNC_v1#  S_CNC_w1# S_CNC_w1# S_CNC_x1# S_CNC_x1#  S_CNC_y1# S_CNC_y1# S_CNC_z1# S_CNC_z1#  S_CNC_aa1# S_CNC_aa1#</p>
N104	CSR_NON_SEC	TUTTI	<p>S_CND_a1# S_CND_a2# S_CND_a3# S_CND_a4#  S_CND_b1# S_CND_b2# S_CND_ab1#  S_CND_ab2# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1#  S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_hb1#  S_CND_hb2# S_CND_i1# S_CND_j1# S_CND_k1#  S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_n1# S_CND_o1#  S_CND_p1# S_CND_q1# S_CND_r1# S_CND_s1#  S_CND_t1# S_CND_u1# S_CND_v1# S_CND_w1#  S_CND_x1# S_CND_x2# S_CND_y1# S_CNV_a1#  S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5#  S_CNV_a6# S_CNV_b1# S_CNV_b2# S_CNV_b3#  S_CNV_b4# S_CNV_b5# S_CNV_ab1# S_CNV_c1#  S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5#  S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_f1# S_CNV_g1#  S_CNV_h1# S_CNV_hb1# S_CNV_i1# S_CNV_j1#  S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_n1#  S_CNV_o1# S_CNV_p1# S_CNV_q1# S_CNV_r1#  S_CNV_s1# S_CNV_t1# S_CNV_u1# S_CNV_v1#  S_CNC_a1# S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_a2#  S_CNC_b1# S_CNC_b1# S_CNC_ab1#  S_CNC_ab1# S_CNC_c1# S_CNC_c1# S_CNC_d1#  S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_e1# S_CNC_f1#  S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_g1# S_CNC_h1#  S_CNC_h1# S_CNC_hb1# S_CNC_hb1#  S_CNC_i1# S_CNC_i1# S_CNC_j1# S_CNC_j1#  S_CNC_k1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_l1#  S_CNC_m1# S_CNC_m1# S_CNC_n1# S_CNC_n1#  S_CNC_o1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_p1#  S_CNC_q1# S_CNC_q1# S_CNC_r1# S_CNC_r1#  S_CNC_s1# S_CNC_s1# S_CNC_t1# S_CNC_t1#  S_CNC_u1# S_CNC_u1# S_CNC_v1# S_CNC_v1#  S_CNC_w1# S_CNC_w1# S_CNC_x1# S_CNC_x1#  S_CNC_y1# S_CNC_y1# S_CNC_z1# S_CNC_z1#  S_CNC_aa1# S_CNC_aa1#</p>

Portafoglio	Classe di rischio	Componente	Strumenti
N104(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_ab1#
N105(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_hb1#
N106(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_ab1#
N107(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_hb1#
C001	CM	DELTA	S_CMD_a2#
C002	CM	DELTA	S_CMD_c1#
C003	CM	DELTA	S_CMD_e1#
C004	CM	DELTA	S_CMD_g1#
C005	CM	DELTA	S_CMD_i1#
C006	CM	DELTA	S_CMD_k1#
C007	CM	DELTA	S_CMD_m1#
C008	CM	DELTA	S_CMD_o1#
C009	CM	DELTA	S_CMD_q1#
C010	CM	DELTA	S_CMD_s1#
C011	CM	DELTA	S_CMD_u1#
C012	CM	DELTA	S_CMD_a1# S_CMD_a2#
C013	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_a3#
C014	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_a4#
C015	CM	DELTA	S_CMD_a3# S_CMD_a4#
C016	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_b1#
C017	CM	DELTA	S_CMD_c1# S_CMD_d1#
C018	CM	DELTA	S_CMD_e1# S_CMD_f1#
C019	CM	DELTA	S_CMD_g1# S_CMD_h1#
C020	CM	DELTA	S_CMD_i1# S_CMD_j1#
C021	CM	DELTA	S_CMD_k1# S_CMD_l1#
C022	CM	DELTA	S_CMD_m1# S_CMD_n1#
C023	CM	DELTA	S_CMD_o1# S_CMD_p1#
C024	CM	DELTA	S_CMD_q1# S_CMD_r1#
C025	CM	DELTA	S_CMD_s1# S_CMD_t1#
C026	CM	DELTA	S_CMD_u1# S_CMD_v1#

Portafoglio	Classe di rischio	Componente	Strumenti
C027	CM	DELTA	S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_w1# S_CMD_x1#
C028	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_c1# S_CMD_e1# S_CMD_g1# S_CMD_i1# S_CMD_k1# S_CMD_m1# S_CMD_o1# S_CMD_q1# S_CMD_s1#
C029	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_u1#
C030	CM	DELTA	S_CMD_c1# S_CMD_d1# S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_w1# S_CMD_x1#
C031	CM	DELTA	S_CMD_a1# S_CMD_a2# S_CMD_a3# S_CMD_a4# S_CMD_b1# S_CMD_c1# S_CMD_d1# S_CMD_e1# S_CMD_f1# S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_i1# S_CMD_j1# S_CMD_k1# S_CMD_l1# S_CMD_m1# S_CMD_n1# S_CMD_o1# S_CMD_p1# S_CMD_q1# S_CMD_r1# S_CMD_s1# S_CMD_t1# S_CMD_u1# S_CMD_v1# S_CMD_w1# S_CMD_x1#
C032	CM	VEGA	S_CMV_a2#
C033	CM	VEGA	S_CMV_a1# S_CMV_a2#
C034	CM	VEGA	S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6#
C035	CM	VEGA	S_CMV_a1# S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6# S_CMV_b1# S_CMV_b2# S_CMV_b3# S_CMV_b4# S_CMV_b5#
C036	CM	VEGA	S_CMV_c1# S_CMV_d1#
C037	CM	VEGA	S_CMV_e1# S_CMV_f1#
C038	CM	VEGA	S_CMV_g1# S_CMV_h1#
C039	CM	VEGA	S_CMV_i1# S_CMV_j1#
C040	CM	VEGA	S_CMV_k1# S_CMV_l1#
C041	CM	VEGA	S_CMV_m1# S_CMV_n1#
C042	CM	VEGA	S_CMV_o1# S_CMV_p1#
C043	CM	VEGA	S_CMV_q1# S_CMV_r1#
C044	CM	VEGA	S_CMV_s1# S_CMV_t1#
C045	CM	VEGA	S_CMV_u1# S_CMV_v1#
C046	CM	VEGA	S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_w1# S_CMV_x1#
C047	CM	VEGA	S_CMV_a2# S_CMV_c1# S_CMV_e1# S_CMV_g1# S_CMV_i1# S_CMV_k1# S_CMV_m1# S_CMV_o1# S_CMV_q1# S_CMV_s1#
C048	CM	VEGA	S_CMV_a2# S_CMV_u1#

Portafoglio	Classe di rischio	Componente	Strumenti
C049	CM	VEGA	S_CMV_c1# S_CMV_d1# S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_w1# S_CMV_x1#
C050	CM	VEGA	S_CMV_a1# S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6# S_CMV_b1# S_CMV_b2# S_CMV_b3# S_CMV_b4# S_CMV_b5# S_CMV_c1# S_CMV_d1# S_CMV_e1# S_CMV_f1# S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_i1# S_CMV_j1# S_CMV_k1# S_CMV_l1# S_CMV_m1# S_CMV_n1# S_CMV_o1# S_CMV_p1# S_CMV_q1# S_CMV_r1# S_CMV_s1# S_CMV_t1# S_CMV_u1# S_CMV_v1# S_CMV_w1# S_CMV_x1#
C051	CM	CURVATURA	S_CMC_b1#
C052	CM	CURVATURA	S_CMC_c1#
C053	CM	CURVATURA	S_CMC_e1#
C054	CM	CURVATURA	S_CMC_g1#
C055	CM	CURVATURA	S_CMC_i1#
C056	CM	CURVATURA	S_CMC_k1#
C057	CM	CURVATURA	S_CMC_m1#
C058	CM	CURVATURA	S_CMC_o1#
C059	CM	CURVATURA	S_CMC_q1#
C060	CM	CURVATURA	S_CMC_s1#
C061	CM	CURVATURA	S_CMC_u1#
C062	CM	CURVATURA	S_CMC_a1# S_CMC_a2#
C063	CM	CURVATURA	S_CMC_a1# S_CMC_b1#
C064	CM	CURVATURA	S_CMC_c1# S_CMC_d1#
C065	CM	CURVATURA	S_CMC_e1# S_CMC_f1#
C066	CM	CURVATURA	S_CMC_g1# S_CMC_h1#
C067	CM	CURVATURA	S_CMC_i1# S_CMC_j1#
C068	CM	CURVATURA	S_CMC_k1# S_CMC_l1#
C069	CM	CURVATURA	S_CMC_m1# S_CMC_n1#
C070	CM	CURVATURA	S_CMC_o1# S_CMC_p1#
C071	CM	CURVATURA	S_CMC_q1# S_CMC_r1#
C072	CM	CURVATURA	S_CMC_s1# S_CMC_t1#
C073	CM	CURVATURA	S_CMC_u1# S_CMC_v1#
C074	CM	CURVATURA	S_CMC_a2# S_CMC_b1#
C075	CM	CURVATURA	S_CMC_g1# S_CMC_z1#

Portafoglio	Classe di rischio	Componente	Strumenti
C076	CM	CURVATURA	S_CMC_b1# S_CMC_c1# S_CMC_e1# S_CMC_g1# S_CMC_i1# S_CMC_k1# S_CMC_m1# S_CMC_o1# S_CMC_q1# S_CMC_s1#
C077	CM	CURVATURA	S_CMC_a2# S_CMC_u1#
C078	CM	CURVATURA	S_CMC_a1# S_CMC_a2# S_CMC_b1# S_CMC_y1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_x1#
C079	CM	CURVATURA	S_CMC_x1# S_CMC_g1# S_CMC_z1#
C080	CM	CURVATURA	S_CMC_a1# S_CMC_a1# S_CMC_a2# S_CMC_a2# S_CMC_b1# S_CMC_b1# S_CMC_c1# S_CMC_c1# S_CMC_d1# S_CMC_d1# S_CMC_e1# S_CMC_e1# S_CMC_f1# S_CMC_f1# S_CMC_g1# S_CMC_g1# S_CMC_h1# S_CMC_h1# S_CMC_i1# S_CMC_i1# S_CMC_j1# S_CMC_j1# S_CMC_k1# S_CMC_k1# S_CMC_l1# S_CMC_l1# S_CMC_m1# S_CMC_m1# S_CMC_n1# S_CMC_n1# S_CMC_o1# S_CMC_o1# S_CMC_p1# S_CMC_p1# S_CMC_q1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_r1# S_CMC_s1# S_CMC_s1# S_CMC_t1# S_CMC_t1# S_CMC_u1# S_CMC_u1# S_CMC_v1# S_CMC_v1# S_CMC_x1# S_CMC_x1# S_CMC_y1# S_CMC_y1# S_CMC_z1# S_CMC_z1#
C081	CM	TUTTI	S_CMD_a1# S_CMD_a2# S_CMD_a3# S_CMD_a4# S_CMD_b1# S_CMD_c1# S_CMD_d1# S_CMD_e1# S_CMD_f1# S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_i1# S_CMD_j1# S_CMD_k1# S_CMD_l1# S_CMD_m1# S_CMD_n1# S_CMD_o1# S_CMD_p1# S_CMD_q1# S_CMD_r1# S_CMD_s1# S_CMD_t1# S_CMD_u1# S_CMD_v1# S_CMD_w1# S_CMD_x1# S_CMV_a1# S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6# S_CMV_b1# S_CMV_b2# S_CMV_b3# S_CMV_b4# S_CMV_b5# S_CMV_c1# S_CMV_d1# S_CMV_e1# S_CMV_f1# S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_i1# S_CMV_j1# S_CMV_k1# S_CMV_l1# S_CMV_m1# S_CMV_n1# S_CMV_o1# S_CMV_p1# S_CMV_q1# S_CMV_r1# S_CMV_s1# S_CMV_t1# S_CMV_u1# S_CMV_v1# S_CMV_w1# S_CMV_x1# S_CMC_a1# S_CMC_a1# S_CMC_a2# S_CMC_a2# S_CMC_b1# S_CMC_b1# S_CMC_c1# S_CMC_c1# S_CMC_d1# S_CMC_d1# S_CMC_e1# S_CMC_e1# S_CMC_f1# S_CMC_f1# S_CMC_g1# S_CMC_g1# S_CMC_h1# S_CMC_h1# S_CMC_i1# S_CMC_i1# S_CMC_j1# S_CMC_j1# S_CMC_k1# S_CMC_k1# S_CMC_l1# S_CMC_l1# S_CMC_m1# S_CMC_m1# S_CMC_n1# S_CMC_n1# S_CMC_o1# S_CMC_o1# S_CMC_p1# S_CMC_p1# S_CMC_q1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_r1# S_CMC_s1# S_CMC_s1# S_CMC_t1# S_CMC_t1# S_CMC_u1# S_CMC_u1# S_CMC_v1# S_CMC_v1# S_CMC_x1# S_CMC_x1# S_CMC_y1# S_CMC_y1# S_CMC_z1# S_CMC_z1#»