

Procedura aperta ai sensi del D.Lgs. n. 163/2006 per l'affidamento dei servizi di calcolo degli indicatori del rischio di mercato (CIG 58755121E3).

## CHIARIMENTI

E' stato richiesto se, tra le modalità di calcolo del VaR che sono considerate necessarie per effettuare le analisi di rischio, indicate nel Capitolato tecnico (Allegato A), il VaR parametrico sia obbligatorio.

### RISPOSTA

Tutti i requisiti indicati nel Capitolato tecnico (Allegato A), ivi compreso il VaR parametrico, sono obbligatori (cfr. paragrafi 3.2 e 3.3 del Capitolato tecnico). L'esigenza è legata alla necessità di poter contare su diverse modalità di calcolo per la valutazione del rischio di mercato.

PER DELEGA DEL DIRETTORE GENERALE

[firma 1]