



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 (III)

[13] E' stato richiesto, in merito al Requisito 3.2.3.1, ove si fa riferimento al formato del file contenente i dati di anagrafica per gli strumenti quotati, di chiarire se la fornitura dei dati anagrafici in questione è oggetto del servizio richiesto, e quindi in carico al fornitore, oppure se tale fornitura di dati è resa disponibile, insieme alle posizioni in portafoglio, da sistemi di front/back office, comprensivi di tutte le informazioni necessarie ai fini del pricing.

#### RISPOSTA

L'utente invia un file con l'ISIN come unico identificativo. Il sistema deve autonomamente disporre delle informazioni anagrafiche (scadenza, coupon, emittente, etc.) al fine della valorizzazione e del calcolo degli indicatori di rischio.

14) È stato richiesto, in merito al Requisito 3.2.3.4, in cui si fa riferimento alle tipologie di prodotto, di chiarire:

- il numero indicativo di posizioni in portafoglio per tipologia di prodotto, al fine di definire il perimetro indicativo del servizio di providing dei relativi dati di mercato;
- in relazione agli indici elencati nel requisito (Merryll Lynch, Barclays e JP Morgan), se la fornitura di dati di mercato è relativa esclusivamente al valore dell'indice o anche al dettaglio dei componenti dell'indice stesso.

#### RISPOSTA

- Il numero indicativo di posizioni in portafoglio per tipologia di prodotto è il seguente:

Money market instruments: ordine delle decine;

Bonds: ordine delle migliaia (5.000);

Collateralized bonds: ordine delle centinaia;

Equity: ordine delle centinaia;

Commodities: una, l'oro;

Derivati: ordine delle decine;

FX instruments: ordine delle decine;

Funds: ordine delle decine.

- La fornitura di dati di mercato è relativa anche al dettaglio dei componenti dell'indice stesso.

PER DELEGA DEL DIRETTORE GENERALE

[firma 1]