



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 (IV) |

|15) E' stato richiesto di fornire chiarimenti circa l'attuale operatività e le attuali modalità operative di gestione dell'attività oggetto di gara. In particolare sono state richieste le seguenti informazioni:

- Numero degli strumenti gestiti per tipologia di forma tecnica (con riferimento al perimetro degli "strumenti gestiti dal sistema" riportati al ID 3.2.3.4 del Capitolato tecnico);
- Divisa delle posizioni in essere;
- Supporto applicativo utilizzato (Software);
- Frequenza di calcolo degli indicatori di rischio;
- Cut/off di disponibilità del dato

### RISPOSTA

Per quanto riguarda il numero degli strumenti gestiti per tipologia di forma tecnica, con riferimento al perimetro degli "strumenti gestiti dal sistema" riportati al ID 3.2.3.4 del Capitolato tecnico, si veda la risposta data al quesito n. 14.

Con riferimento alla divisa delle posizioni in essere, si veda il REQ 3.2.1.5 del Capitolato tecnico. Si chiarifica che oltre alle valute del G20 e gli XDR, devono essere disponibili anche le valute europee NOK, SEK, DKK, CZK, CHF.

Riguardo al supporto applicativo (Software), attualmente si utilizza il prodotto RiskMetrics denominato RiskManager.

Circa la frequenza di calcolo indicatori di rischio, si evidenzia che gli indicatori di rischio devono poter essere calcolati per qualsiasi data. Al momento la frequenza di calcolo è mensile ma non si esclude che essa possa aumentare in futuro.

Per ciò che concerne il cut/off di disponibilità del dato si chiarisce che i dati devono poter essere utilizzabili a partire dal giorno successivo.

PER DELEGA DEL DIRETTORE GENERALE

firma 1