

Senza Perdita Caso semplificato - KRES IAS 80.000 - NC INDEX 10.000 CON COMPENSAZIONE - ALTRO pagato tutto in pari valuta			TX Att.	10.4	10.4									
					DOCUMENTO IN CONSULTAZIONE	APPROCCIO PROPOSTO								
									IMPORTO		Importo attualizzato		Importo attualizzato	
Evento	Data	SUM G	Voce	Importo	Importo attualizzato	Importo attualizzato	NATURA VOCE	Descrizione	EAD	RIMB	EAD	RIMB	EAD	RIMB
Ingresso in DFT														
80.000 Kres Ias	01/01/2014		55300	80,000.00	80,000.00	80,000.00	EAD	EAD	80,000.00	0.00	80,000.00	0.00	80,000.00	0.00
INCASSO RATA	28/02/2014	60	55304	13,000.00	12,787.39	12,787.39	RIMB	Rimborso	0.00	13,000.00	0.00	12,787.39	0.00	12,787.39
INCASSO RATA	30/04/2014	120	55304	13,000.00	12,578.25	12,578.25	RIMB	Rimborso	0.00	13,000.00	0.00	12,578.25	0.00	12,578.25
INCASSO RATA	30/06/2014	180	55304	13,000.00	12,372.54	12,372.54	RIMB	Rimborso	0.00	13,000.00	0.00	12,372.54	0.00	12,372.54
NC INDEX	31/07/2014	210	55302	-10,000.00	-9,439.19	-9,439.19	EAD	Diminuzione esposizione	-10,000.00	0.00		9,439.19	-9,439.19	0.00
COMPENSAZIONE NC	31/07/2014	210	55304	-10,000.00	-9,439.19	-9,439.19	RIMB	Rimborso NEGATIVO	0.00	-10,000.00	0.00	-9,439.19	0.00	-9,439.19
INCASSO RATA	31/08/2014	240	55304	13,000.00	12,170.19	12,170.19	RIMB	Rimborso	0.00	13,000.00	0.00	12,170.19	0.00	12,170.19
INCASSO RATA	31/10/2014	300	55304	13,000.00	11,971.15	11,971.15	RIMB	Rimborso	0.00	13,000.00	0.00	11,971.15	0.00	11,971.15
INCASSO RISCATTO	31/12/2014	360	55304	20,000.00	18,115.94	18,115.94	RIMB	Rimborso	0.00	20,000.00	0.00	18,115.94	0.00	18,115.94
					61,117.08	61,117.08				75,000.00				70,556.27
					Con Att.	Con Att.								
				LGD=	0.0057%	0.0064%			70,000.00	75,000.00	80,000.00	79,995.46	70,560.81	70,556.27
						0.88201013						99.99%		99.99%
												0.01%		0.01%
				Stima costi Att	0									

Autore:
LGD EFFETTO
DELL'ATTUALIZZAZIONE
DELLA VARIAZIONE DI
EAD PER NC

NC considerata come
rimborso in presenza
di scaduto:

[illegible]