

A TUTTI GLI INTERMEDIARI SEGNALANTI E AGLI ALTRI SOGGETTI INTERESSATI

OGGETTO: DOCUMENTAZIONE PUMA - BANCHE (GIUGNO 2023).

Si trasmette un aggiornamento della documentazione tecnica banche relativa alla data contabile del 30 giugno 2023, che contiene tutte le modifiche connesse alla versione 3.2 del *Data Point Model* dell'EBA.

Si precisa che la documentazione tecnica contiene, altresì, le modifiche descritte nell'ultima versione della nota tecnica "Aggiornamento delle Circolari nn. 272 (16° agg.to), 217 (22° agg.to) e 286 (15° agg.to)" pubblicata il 27 gennaio 2023. Tali modifiche decorrono dal 1° gennaio 2023 e saranno, pertanto, previste anche sul database riferito al 31 gennaio 2023.

Nella sezione "Manuale" sono pubblicate le istruzioni I0714 - GRANDI ESPOSIZIONI e I0727 - ATTIVITÀ VINCOLATE, le funzioni F11_1 - RISCHIO DI POSIZIONE, F11_4 - RISCHIO DI CAMBIO, F27_10 - ARRICCHIMENTO DELLA TABELLA DI CORREDO TCOR80, F28_2 - CALCOLO FATTORI DI PONDERAZIONE E LOOK-THROUGH, F46_2 - RIPARTIZIONE PER SEGNALAZIONE ATTIVITÀ VINCOLATE, F54 - ADDITIONAL LIQUIDITY MONITORING METRICS, F54_1 - DETERMINAZIONE DELLE PRIME DIECI CONTROPARTI FINANZIARIE, F54_2 - CONCENTRAZIONE DEL FUNDING PER TIPO PRODOTTO, F54_3 - DETERMINAZIONE DEI PRIMI DIECI EMITTENTI - CONTROPARTI AI FINI DELLA COUNTERBALANCING CAPACITY e F54_4 - TRATTAMENTO DEI DERIVATI - ALMM, la tabella di corredo TCOR38 - TAVOLA DELLE CESSIONI DI CREDITO - CARTOLARIZZAZIONI e il tracciato TR0FGL3 - FILE GUIDA LAVORAZIONI (TIPO RECORD "3").

Inoltre nella sezione "Codifiche" è pubblicato l'aggiornamento del file "Raccordo conto economico".

Ciò premesso, il presente flusso contiene:

- il database riferito alla data contabile "giugno 2023";
- le differenze del database rispetto all'ultima versione spedita;

- l'aggiornamento delle codifiche;
- l'aggiornamento del Manuale tecnico funzionale;
- la presente nota.

Distinti saluti.

Roma, 13.02.2023