

Tipo intermediario	Data pubblicazione	Data inizio validità	Data fine validità
B	2026 02 24	2026 03 31	9999 99 99

Generalità

La presente funzione è finalizzata all'individuazione ai fini del template C.68.00 degli *Additional liquidity monitoring metrics* della concentrazione del funding per tipologia di prodotto. Essa deve operare, una volta eseguita la funzione extratabellare F41, a valle della generazione e prima del compattamento.

Gli enti considerati "piccoli e non complessi" ai sensi dall'art. 4 (1) comma 145 del Regolamento (UE) 876/2019 non devono produrre le informazioni previste nel template C_68.00 - CONCENTRATION OF FUNDING BY PRODUCT TYPE68.00

Processo di calcolo

Fase 1:

Selezionare tutti i record delle FTD intermedie 50000.01 con campo 00350=21 (passività finanziarie) dalla fase di generazione con campo 00007=242 ed eseguire i seguenti passi procedurali:

- a) selezionare i record delle FTD 50000.01 e totalizzare gli importi a parità di TIPOLOGIA DI PRODOTTO (campo 05248), creando in tal modo un "cluster" di operazioni di raccolta riferibile a ciascun prodotto;
- b) arricchire i record dei "cluster" con i seguenti campi di comodo:
 - "SALDO PER GIORNI DURATA ORIGINARIA" (DUR ORIG) e "SALDO PER GIORNI DURATA RESIDUA" (DUR RES) ottenuti moltiplicando l'importo, rispettivamente, per il campo 05246 (NUMERO GIORNI DI DURATA ORIGINARIA) e per il campo 05247 (NUMERO GIORNI DI DURATA RESIDUA).

Fase 2:

Selezionare i record delle FTD 50000.01 con campi 00350=110,111 e 21 e procedere con le fasi successive.

Fase 3:

a) selezionare i record delle FTD 50000.01 con campi 00350=21 per ciascun valore del campo 05248 diverso da 150:

- calcolare la durata originaria media ponderata come risultato della seguente formula: $\sum (DUR\ ORIG * IMPORTO) / \sum IMPORTO$ e memorizzare il risultato nel comodo "MEDIA PONDERATA DURATA ORIGINARIA - PRODOTTO" (MEDIA ORIG PROD);
- calcolare la durata residua media ponderata come risultato della seguente formula: $\sum (DUR\ RES * IMPORTO) / \sum IMPORTO$ e memorizzare il risultato nel comodo "MEDIA PONDERATA DURATA RESIDUA - PRODOTTO" (MEDIA RES PROD);

b) per ciascun valore del campo 05248 diverso da 150 produrre i record della FTD corrispondente secondo il seguente schema:

70440.20 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='020', 08940='010', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248A, C00001Q

70440.31 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='031', 08940='010', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248M, C00010S, C00001Q

70440.31 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='031', 08940='040', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='I' e importo = MEDIA ORIG PROD, C05248M, C00010S, C00001Q

70440.31 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='031', 08940='050', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='I' e importo = MEDIA RES PROD, C05248M, C00010S, C00001Q

70440.41 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='041', 08940='010', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248M, C00010R, C00001Q

70440.41 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='041', 08940='040', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='I' e importo = MEDIA ORIG PROD, C05248M, C00010R, C00001Q

70440.41 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='041', 08940='050', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='I' e importo = MEDIA RES PROD, C05248M, C00010R, C00001Q

70440.80 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='080', 08940='010', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248E, C00001Q

70440.80 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='080', 08940='040', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='I' e importo = MEDIA ORIG PROD, C05248E, C00001Q

70440.80 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='080', 08940='050', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='I' e importo = MEDIA RES PROD, C05248E, C00001Q

70440.90 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='090', 08940='010', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248F, C00001Q

70440.90 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='090', 08940='040', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='I' e importo = MEDIA ORIG PROD, C05248F, C00001Q

70440.90 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='090', 08940='050', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='I' e importo = MEDIA RES PROD, C05248F, C00001Q

70441.20 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='120', 08940='010', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248G, C00001Q

70441.20 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='120', 08940='040', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='I' e importo = MEDIA ORIG PROD, C05248G, C00001Q

70441.20 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='120', 08940='050', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='I' e importo = MEDIA RES PROD, C05248G, C00001Q

70441.30 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='130', 08940='010', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248H, C00001Q

70441.30 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='130', 08940='040', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='I' e importo = MEDIA ORIG PROD, C05248H, C00001Q

70441.30 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='130', 08940='050', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='I' e importo = MEDIA RES PROD, C05248H, C00001Q

70441.60 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='160', 08940='010', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248J, C00001Q

70441.60 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='160', 08940='040', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='I' e importo = MEDIA ORIG PROD, C05248J, C00001Q

70441.60 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='160', 08940='050', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='I' e importo = MEDIA RES PROD, C05248J, C00001Q

70441.70 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='170', 08940='010', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248K, C00001Q

70441.70 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='170', 08940='040', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='I' e importo = MEDIA ORIG PROD, C05248K, C00001Q

70441.70 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='170', 08940='050', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='I' e importo = MEDIA RES PROD, C05248K, C00001Q

70441.80 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='180', 08940='010', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248L, C00001Q

70441.80 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='180', 08940='040', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='I' e importo = MEDIA ORIG PROD, C05248L, C00001Q

70441.80 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='180', 08940='050', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='I' e importo = MEDIA RES PROD, C05248L, C00001Q

e con campo 00007 pari a campo 00007 di input;

c) per i soli record con campo 05631 diverso da 0 e campo 05248=120,130 replicare integralmente il trattamento di cui al punto a) e produrre i record della FTD 70441.40 secondo il seguente schema:

70441.40 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='140', 08940='010', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati , C00001Q

70441.40 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='140', 08940='040', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='I' e importo = MEDIA ORIG PROD , C00001Q

70441.40 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='140', 08940='050', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='I' e importo = MEDIA RES PROD , C00001Q

e con campo 00007 pari a campo 00007 di input;

d) per i soli record con campo 05248=150,160,170,180 replicare integralmente il trattamento di cui al punto a) e produrre i record della FTD 70441.50 secondo il seguente schema:

70441.50 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='150', 08940='010', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248I, C00001Q

70441.50 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='150', 08940='040', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='I' e importo = MEDIA ORIG PROD, C05248I, C00001Q

70441.50 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='150', 08940='050', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='I' e importo = MEDIA RES PROD, C05248I, C00001Q

e con campo 00007 pari a campo 00007 di input;

e) per i soli record con campo 05631 diverso da 0 e campo 05248=160,170,180 replicare integralmente il trattamento di cui al punto a) e produrre i record della FTD 70441.90 secondo il seguente schema con importo pari alla somma degli importi dei record trattati:

70441.90 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='190', 08940='010', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati , C00001Q

70441.90 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='190', 08940='040', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='I' e importo = MEDIA ORIG PROD , C00001Q

70441.90 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='190', 08940='050', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='I' e importo = MEDIA RES PROD , C00001Q

e con campo 00007 pari a campo 00007 di input;

Fase 4:

a) selezionare i record delle FTD 50000.01 con campi 00350=110;

b) per ciascun valore del campo 05248 diverso da 150 produrre i record della FTD corrispondente secondo il seguente schema:

70440.20 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='020', 08940='020', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248A, C00001Q

70440.31 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='031', 08940='020', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248M, C00010S, C00001Q

70440.41 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='041', 08940='020', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248M, C00010R, C00001Q

70440.80 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='080', 08940='020', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248E, C00001Q

70440.90 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='090', 08940='020', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248F, C00001Q

70441.30 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='130', 08940='020', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248H, C00001Q

70441.60 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='160', 08940='020', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248J, C00001Q

70441.70 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='170', 08940='020', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248K, C00001Q

70441.80 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='180', 08940='020', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248L, C00001Q

e con campo 00007 pari a campo 00007 di input;

c) per i soli record con campo 05631 diverso da 0 e campo 05248=120,130 produrre un record della FTD 70441.40 secondo il seguente schema con importo pari alla somma degli importi dei record trattati:

70441.40 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='140', 08940='020', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati , C00001Q

e con campo 00007 pari a campo 00007 di input;

d) per i soli record con campo 05248=150,160,170,180 produrre un record della FTD 70441.50 secondo il seguente schema:

70441.50 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='150', 08940='020', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248I, C00001Q

e con campo 00007 pari a campo 00007 di input;

e) per i soli record con campo 05631 diverso da 0 e campo 05248=160,170,180 produrre un record della FTD 70441.90 secondo il seguente schema:

70441.90 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='190', 08940='020', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C00001Q

e con campo 00007 pari a campo 00007 di input;

Fase 5:

a) selezionare i record delle FTD 50000.01 con campi 00350=111; per ciascun valore del campo 05248 diverso da 150 produrre un record della FTD corrispondente secondo il seguente schema:

70440.20 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='020', 08940='030', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248A, C00001Q

70440.31 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='031', 08940='030', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248M, C00010S, C00001Q

70440.41 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='041', 08940='030', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248M, C00010R, C00001Q

70440.80 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='080', 08940='030', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248E, C00001Q

70440.90 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='090', 08940='030', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248F, C00001Q

70441.20 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='120', 08940='030', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248G, C00001Q

70441.30 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='130', 08940='030', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248H, C00001Q

70441.60 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='160', 08940='030', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248J, C00001Q

70441.70 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='170', 08940='030', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248K, C00001Q

70441.80 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='180', 08940='0 0', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248L, C00001Q

e con campo 00007 pari a campo 00007 di input;

f) per i soli record con campo 05631 diverso da 0 e campo 05248=120,130 produrre un record della FTD 70441.40 secondo il seguente schema:

70441.40 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='140', 08940='030', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati , C00001Q

e con campo 00007 pari a campo 00007 di input;

g) per i soli record con campo 05248=150,160,170,180 produrre un record della FTD 70441.50 secondo il seguente schema:

70441.50 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='150', 08940='030', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati, C05248I, C00001Q

e con campo 00007 pari a campo 00007 di input;

h) per i soli record con campo 05631 diverso da 0 e campo 05248=160,170,180 produrre un record della FTD 70441.90 secondo il seguente schema:

70441.90 00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_68.00.a', 08920='FOGL E', 08930='190', 08940='030', 08909RA, 08960= 'C_68.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati , C00001Q

e con campo 00007 pari a campo 00007 di input;

Fase 6:

Selezionare tutti i record delle FTD intermedie 50000.01 (passività finanziarie) prodotti dalla fase di generazione con campo 00007 diverso da 242 e, distintamente per ciascuna valuta rilevante, rieseguire le Fasi da 1 a 5.

Si fa presente che nella scrittura dei record nelle fasi 3,4 e 5 vanno tenute in considerazione le seguenti eccezioni:

1. campo 08910 = 'C_68.00.w'
campo 08920 = 'FOGL V'
campo 08970 = 'ISO' (codice ISO della valuta rilevante), ovvero con campo 00007 accedere alla TCOR001 e se 'VAL_RIL_LIQ'=1 impostare il campo 08970 con il corrispondente valore ISO;

2. campo 08910 = 'C_68.00.w'
campo 08920 = 'FOGL V'
campo 08970 = 'EUR', ovvero con campo 00007 accedere alla TCOR001 se 'VAL_416_P3_CRR'=1 impostare il campo 08970 = EUR.

Fase 7:

Concluse le Fasi precedenti, inviare i record con FTD 7044X.XX alla fase di compattamento.