

F54_3	DETERMINAZIONE DEI PRIMI DIECI EMITTENTI - CONTROPARTI AI FINI DELLA COUNTERBALANCING CAPACITY
--------------	---

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_71.00 degli additional liquidity monitoring metrics, dei primi dieci emittenti / controparti¹ utilizzati come capacità di compensazione (counterbalancing capacity).

Essa deve operare, una volta eseguita la funzione extratabellare F52_1, a valle della fase di generazione e prima del compattamento e deve essere eseguita distintamente per ciascuna valuta rilevante ai fini della liquidità (campo 00007).

Processo di calcolo

Fase 1:

Selezionare tutti i record delle FTD intermedie 50000.15 prodotti dalla fase di generazione con campo 00007=242 e con campo 00350=271 ed eseguire i seguenti passi procedurali:

- a) selezionare i record con campo 00348=01003.XX, 01007.XX, 01017.XX² e su di essi impostare il seguente campo comodo "CLASSIFICA PRIMI DIECI CONTROBILANCIATORI" (POS CLASS) pari a 99 e passare direttamente alla Fase 2;
- b) selezionare i record con campo 00348 diverso da 01003.XX, 01007.XX e 01017.XX e su di essi impostare i seguenti campi comodo:

¹ Si suggerisce, per finalità aziendali, di fornire l'evidenza di un congruo numero di emittenti\controparti ulteriori rispetto alle dieci richieste dal template.

² Fatta eccezione per la FTO 01017.58 se campo 00145 è diverso da 8 e per le FTO 01017.92/94 se campo 00011 è diverso da 300,724,725,726 E 791.

- “SOGGETTO CONTROBILANCIATORE” (SC)
 - “CLIENTE/GRUPPO” (CG)
- da valorizzare nel seguente modo:
- se campo 02252 è diverso da 10 impostare SC = campo 00359 e CG = ‘G’;
 - altrimenti impostare SC = campo 00030 e CG = ‘C’;
- c) totalizzare gli importi a parità di SC, creando in tal modo un “cluster” di operazioni riferibile ad ogni soggetto emittente/controparte;
- d) ordinare i “cluster” in ordine di importo totale decrescente, arricchendo i relativi record con il comodo “CLASSIFICA PRIMI DIECI CONTROBILANCIATORI” (POS CLASS) in base alla posizione assunta dal cluster a cui appartengono (01, 02, 03, ecc.) fino a un massimo di dieci posizioni, se sussistono. Ai record degli eventuali “cluster” residui (che superano la decima posizione) attribuire il valore 99 al comodo POS CLASS;
- e) a parità di soggetto controbilanciato (SC), per i soli record con comodo POS CLASS diverso da 99:
- raggruppare per campo 05249 tutti i record relativi al soggetto trattato, sommare il relativo campo importo e valorizzare il comodo “TIPO PRODOTTO PREVALENTE” (PREVAL) col valore del campo 05249 assunto dal sottogruppo avente il sottotale più elevato;
 - attribuire al comodo “VALUTA DEL PRODOTTO PREVALENTE” (VAL PREVAL) il valore del campo 02074 a sua volta maggioritario nel sottogruppo di record definito al punto precedente;
 - raggruppare per campo 05288 tutti i record relativi al soggetto trattato, sommare il relativo campo importo e valorizzare il comodo “CQS PREVALENTE” (CQS PREVAL) col valore del campo 05288 assunto dal sottogruppo avente il sottotale più elevato.

A questo punto la banca dispone fino ad un massimo di undici cluster di record costituiti da quelli che, fino ad un massimo di dieci, sono posizioni significative

destinate alla sezione 1, più il cluster residuale contenente tutto il resto delle attività della banca aventi capacità di compensazione, destinato alla sezione 2.

Fase 2:

Selezionare tutti i record delle FTD intermedie 50000.15 prodotti dalla fase di generazione con campo 00007=242 e con campo 00350=272 e su di essi impostare il comodo POS CLASS col medesimo valore assunto dallo stesso emittente/controparte nella Fase 1.

Fase 3:

a) Con i record aventi POS CLASS da 01 a 10 e campo 00350=271, produrre un record della FTD 70470.01 secondo il seguente schema:

```
00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_71.00.a', 08920='FOGL E', 08930='010', 08940='080',  
08909RA3, 08960='C_71.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei  
record trattati
```

b) Con i record aventi campo 00350=271 e 00350=272 e a seconda del POS CLASS, produrre i seguenti 9 record per ogni riga del template da riga 20 a riga 110 ovvero dalle corrispondenti FTD da 70470.02 a 70470.11 con una zona fissa:

```
70470.XX 00003=1, 00004=1, 00005=3, 08910='C_71.00.a', 08920='FOGL E', 08930='XXX4',  
08909RA, 08960='C_71.00', 08970='EUR'
```

e con:

1. campo 08940='010', campo 08980⁵ 'DENOM_CNP' rilevato da TCOR080 e accedendo con il campo 00030/00359, campo 08998='S' e importo ='-1'
2. campo 08940='020', campo 08980 'COD_LEI' rilevato da TCOR080 e accedendo con il campo 00030/00359, campo 08998='S' e importo = '- 1'

³ 08909RA imposta il campo 08909 con il valore contenuto nella colonna 'REPORTING FRAMEWORK VERSION DPM 2.0' di TCOR070.

⁴ Da valorizzare a seconda delle righe trattate (da 020 a 110).

⁵ Il campo nella documentazione PUMA viene definito alfanumerico di lunghezza 16, mentre sarà cura delle società di software consentire un utilizzo con lunghezze maggiori.

3. se comodo CG='G' questo record non deve essere scritto; altrimenti campo 08940='030', campo 08980= ad uno dei valori previsti dal "DOMINIO" sottostante:

- **GENERAL GOVERNMENTS**
(corrispondente al valore 902 del campo 00011)
 - **CREDIT INSTITUTIONS**
(corrispondente al valore 904 del campo 00011)
 - **FINANCIAL CORPORATIONS OTHER THAN CREDIT INSTITUTIONS**
(corrispondente al valore 923 del campo 00011)
 - **NON-FINANCIAL CORPORATIONS**
(corrispondente al valore 907 del campo 00011)
 - **HOUSEHOLDS**
(corrispondente al valore 908 del campo 00011)
- campo 08998='E' e importo ='-1'

4. campo 08940='040', campo 08980 = 'COD_ISO_STATO' ottenuto accedendo a TCOR006 con campo 00016, campo 08998='E' e importo ='-1'

5. campo 08940='050', campo 08980= con uno dei seguenti valori determinato a partire dal valore del comodo PREVAL:

- se PREVAL = 298 impostare campo 08980 = Gold;
- se PREVAL = 318 impostare campo 08980 = CB;
- se PREVAL = 319 impostare campo 08980 = ABS;
- se PREVAL = 293 impostare campo 08980 = SrB;
- se PREVAL = 294 impostare campo 08980 = SubB;
- se PREVAL = 295 impostare campo 08980 = CP;
- se PREVAL = 296 impostare campo 08980 = US;
- se PREVAL = 516 impostare campo 08980 = CrCl;
- se PREVAL = 297 impostare campo 08980 = Eq;
- se PREVAL = 299 impostare campo 08980 = LiqL;
- se PREVAL = 300 impostare campo 08980 = OPT;

campo 08998='E' e importo ='-1'

6. campo 08940='060', campo 08980 = 'ISO_VAL' ottenuto accedendo a TCOR001 con campo comodo VAL PREVAL, campo 08998='E' e importo ='-1'

7. campo 08940='070', campo 08980= con uno dei seguenti valori determinato a partire dal valore del comodo CQS PREVAL:

- se CQS PREVAL = 01 impostare campo 08980 = CQS 1;
- se CQS PREVAL = 02 impostare campo 08980 = CQS 2;
- se CQS PREVAL = 03 impostare campo 08980 = CQS 3;
- se CQS PREVAL = 04 impostare campo 08980 = CQS 4;
- se CQS PREVAL = 05 impostare campo 08980 = CQS 5;
- se CQS PREVAL = 06 impostare campo 08980 = CQS 6;
- se CQS PREVAL = 07 impostare campo 08980 = CQS 7;
- se CQS PREVAL = 08 impostare campo 08980 = CQS 8;
- se CQS PREVAL = 09 impostare campo 08980 = CQS 9;
- se CQS PREVAL = 10 impostare campo 08980 = CQS 10;
- se CQS PREVAL = 11 impostare campo 08980 = CQS 11;
- se CQS PREVAL = 99 impostare campo 08980 = CQS other;

campo 08998='E' e importo ='-1'

8. campo 08940='080', campo 08998= 'M' e importo = somma degli importi dei record trattati (con 350=271)

9. campo 08940='090', campo 08998= 'M' e importo = somma degli importi dei record trattati (con 350=272)

Con i record aventi POS CLASS 99 e campo 00350=271, produrre un record della FTD 70470.12 secondo il seguente schema:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_71.00.a', 08920='FOGL E', 08930='120', 08940='080', 08909RA, 08960= 'C_71.00', 08970='EUR', 08998='M' e
importo = somma degli importi dei record trattati

c) Con i record aventi POS CLASS da 01 a 10 e campo 00350=272, produrre un record della FTD 70470.01 secondo il seguente schema:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_71.00.a', 08920='FOGL E', 08930='010', 08940='090', 08909RA, 08960= 'C_71.00', 08970='EUR', 08998='M' e
importo = somma degli importi dei record trattati

d) Con i record aventi POS CLASS 99 e campo 00350=272, produrre un record della FTD 70470.12 secondo il seguente schema:

00003=1 00004=1 00005=3 08910='C_71.00.a', 08920='FOGL E', 08930='120', 08940='090', 08909RA, 08960= 'C_71.00', 08970='EUR', 08998='M' e importo = somma degli importi dei record trattati

Fase 4:

Selezionare tutti i record delle FTD intermedie 50000.15 prodotti dalla fase di generazione con campo 00007 diverso da 242 e, distintamente per ciascuna valuta rilevante, rieseguire le Fasi 1,2 e 3.

Si fa presente che nella scrittura dei record nella fase 3 vanno tenute in considerazione le seguenti eccezioni:

1. campo 08910 = 'C_71.00.w'

campo 08920 = 'FOGL V'

campo 08970 = 'ISO' (codice ISO della valuta rilevante), ovvero con campo 00007 per ciascuna valuta rilevante accedere alla TCOR001 e se 'VAL_RIL_LIQ'=1 impostare il campo 08970 con il corrispondente valore ISO;

2. campo 08910 = 'C_67.00.w'

campo 08920 = 'FOGL V'

campo 08970 = 'EUR', ovvero con campo 00007 accedere alla TCOR001 e se 'VAL_416_P3_CRR'=1 impostare il campo 08970 = EUR.

Fase 5:

Concluse le Fasi precedenti, inviare i soli record con FTD 70470.XX alla fase di compattamento.