

| | |
|--------------|---|
| F77_1 | DETERMINAZIONE DELLE CONTROPARTI DETENTRICI PER RESOLUTION PLANS |
|--------------|---|

| Tipo intermediario | Data pubblicazione | Data inizio validità | Data fine validità |
|--------------------|--------------------|----------------------|--------------------|
| B | 2026 03 23 | 2025 12 31 | 9999 99 99 |

Generalità

La presente funzione è finalizzata all'individuazione delle controparti detentrici di titoli emessi dall'ente segnalante, ai fini della segnalazione *Resolution Plans*, nel caso in cui la banca non sia in grado di fornire in input, sulle FTO di titoli emessi, l'NDG dell'ultimo prenditore (campo 05630=0, assente)¹.

Essa deve operare prima della fase di generazione.

FASE 1:

1) Selezionare tutti i record delle FTO 01775.XX, 01777.XX, 01779.XX e 01837.02 (se campo 00120=3) con:

- campo 00138 uguale a 0 o assente e
- campo 05630 uguale a 0 o assente e
- campo 05312=P013, P020, P030

e a, parità di campo 00032 (codice ISIN) effettuare la somma dei campi 07704, 00602, 00609, 07000 riportandoli nei rispettivi campi COMODO07704, COMODO00602, COMODO00609 COMODO07000 e creare la seguente TABELLA "TITOLI EMESSI":

arricchire la tabella dei titoli emessi con i seguenti campi:

- campo 00678
- campo 06618

¹ Si precisa che per una corretta impostazione degli importi prodotti da tale funzione è fondamentale rispettare la regola di input che prevede l'alimentazione alternativa delle FTO di titoli emessi (campo 05630 valorizzato) o di quelle relative a titoli depositati (FTO 01625.xx) nel caso in cui si conosca la controparte detentrici.

TABELLA TITOLI EMESSI

| ISIN | COMODO7704 Outstanding amount | COMODO00602 Outstanding principal amount | COMODO00609 (nominal amount per zero coupon) | COMODO07000 Carrying amount | COMODO06618 Accrued interest | CAMPO 00678 tasso interesse annuo |
|------|-------------------------------------|--|--|--------------------------------|---------------------------------|---|
| | | | | | | |
| | | | | | | |
| | | | | | | |

2) Selezionare i record delle FTO 01625.XX il cui 'COD_ID_EMITT' di TCOR028, ricercato con campo 00032, sia uguale al "codice fiscale" presente nel file guida lavorazioni:

a. per ciascun record della FTO 01625.xx accedi a tabella TITOLI EMESSI con il codice ISIN e calcolare:

a.1.a per i titoli diversi da zero coupon (con 'TASSO_IND' di TCOR014 <> 2): QUOTA_VN_KN (quota valore nominale known) del titolo depositato dal cliente = (campo 00609/COMODO00602) utilizzando il corrispondente COMODO00602 presente nella "TABELLA TITOLI EMESSI";

a.1.b per i titoli del tipo 'zero-coupon' (con 'TASSO_IND' di TCOR014 = 2): QUOTA_VN_KN (quota valore nominale known) del titolo depositato dal cliente = (campo 00609/COMODO00609) utilizzando il corrispondente COMODO00609 presente nella "TABELLA TITOLI EMESSI";

e impostare i seguenti campi importo e riportare sulle FTO 01625.xx:

a.2 IMP_OA_KN (*oustanding amount*) titolo depositato dal cliente (**06704**) = QUOTA_VN_KN *COMODO07704;

a.3 IMP_PA_KN (*principal amount*) titolo depositato dal cliente (**06702**) = QUOTA_VN_KN *COMODO00602;

a.4 IMP_CA_KN (*carrying amount*) titolo depositato dal cliente (**07604**) = QUOTA_VN_KN *COMODO07000;

a.5 IMP_ACCR_INT_KN (*accrued interest*) titolo depositato dal cliente (**06618**) = QUOTA_VN_KN *(COMODO06618);

riportare sulle FTO 01625.xx anche:

- il valore del campo 00678 presente sulle FTO di titoli emessi;

b. calcolare il totale dell'importo "**KNOWN**" sommando nel TOT_IMP_OA_KN gli importi 06704 (IMP_OA_KNOWN) calcolati al punto a.2;

c. calcolare la quota "**UNKNOWN**" per ciascun ISIN nel seguente modo:

c.1 imposta campo **05687** QUOTA_OA_UNKONWN = 1-
(TOT_IMP_OA_KN/COMODO07704)

c.2 per ciascun ISIN della tabella dei titoli emessi costruita al punto 1) calcolare i seguenti importi e riportarli sull'ultimo record in lavorazione (FTO 01625.xx) di ciascun ISIN:

c.2.1 imposta campo **07705** (O.A. UNKN)=COMODO07704*
QUOTA_OA_UNKONWN

c.2.2 imposta campo **06706** (P.A._UNKN)=COMODO00602*
QUOTA_OA_UNK

c.2.3 imposta campo **07708** (CA_UNKN)=COMODO07000*
QUOTA_OA_UNK

c.2.4 imposta campo **06620** (ACCR_INT_UNKN)=(COMODO07704-
COMODO00602)*QUOTA_OA_UNK

Nel caso in cui l'ISIN non sia presente nella tabella 'TITOLI DEPOSITATI' occorre impostare sulle FTO dei titoli emessi il campo 05687=1.