

<b>F77_1</b>	<b>DETERMINAZIONE DELLE CONTROPARTI DETENTRICI PER RESOLUTION PLANS</b>
--------------	---

Tipo intermediario	Data pubblicazione	Data inizio validità	Data fine validità
B	2026 04 02	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)<sup>1</sup>.

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 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

---

<sup>1</sup> 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 detentrica.

per le FTO 01837.02 con campo 00120=3 effettuare la somma dei campi 00602 e impostare COMODO00602NOCOMP, calcolare il COMODORAPPNOCOM dividendo il COMODO00602NOCOMP per il COMODO00602 e riportarlo nella TABELLA TITOLI EMESSI.

### TABELLA TITOLI EMESSI

ISIN	COMODO7704 Outstanding amount	COMODO00602 Outstanding principal amount	COMODO00609 (nominal amount per zero coupon)	COMODO07000 Carrying amount	COMODO066 18 Accrued interest	CAMPO 00678 tasso interesse annuo	COMODORAPP NOCOM per titoli subordinati

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);

Per i titoli subordinati (FTO 01625.xx con condizione C05559?<sup>2</sup> soddisfatta) moltiplicare gli importi calcolati nei punti da a.1.a a a.5 per COMODORAPPNOCOM e riportare sulle FTO 01625.xx;

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\*

---

<sup>2</sup> Routine C05559?: con campo 00032 accedi a tcor014 (chiave\_tcor014\_28) e genera se 'ragg\_e\*\*' = 100215, 100217, 100218,100219.

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.