

Tipo intermediario	Data pubblicazione	Data inizio validità	Data fine validità
B	2026 01 23	2025 12 31	9999 99 99

Generalità

La presente funzione è finalizzata all'individuazione delle prime dieci controparti principali (passività ed elementi fuori bilancio diversi dai derivati) da esporre nei Template Z 05.01 e Z 05.02¹.

Tale funzione deve essere eseguita dalle banche che devono produrre la segnalazione a livello individuale e deve operare a valle della fase di generazione e prima del compattamento.

Processo di calcolo per template Z05.01 Fase 1:

Selezionare tutti i record delle FTD intermedie 73740.98 e 73740.99 prodotte dalla fase di generazione ed eseguire i seguenti passi procedurali:

- Ordinare tutti i record a parità di campi 00359;
- Totalizzare gli importi a parità di 00359, creando in tal modo un “cluster” di passività riferibile ad ogni soggetto controparte; valorizzando tale importo nel campo COMODO1;
- Ordinare i “cluster” per importo COMODO1 decrescente, arricchire i relativi record di ogni “cluster” con il comodo “CLASSIFICA PRIMI DIECI FINANZIATORI” (POS CLASS) in base alla posizione assunta dal cluster cui appartengono (01, 02, 03, ecc.) fino a un massimo di dieci diverse controparti. Non considerare più nel processo i restanti record.
- Ordinare a questo punto i record presenti nei “cluster” significativi per campo 00359 e campo 08936 e per ogni combinazione totalizzarne gli

¹ Le istruzioni segnaletiche richiedono di esporre nel template Z 05.02 separatamente le prime 5 controparti per gli elementi fuori bilancio in derivati. Il gruppo Puma ritenendo la fattispecie non presente in Italia non ha sviluppato la documentazione per la loro produzione.

importi presenti nel campo 07476 scrivendolo nel campo COMODO2.

Produrre un record per ogni combinazione di campo 00359 e 08936 in base al seguente tracciato della FTD 73749.99:

00003=1 00004=1 00005=3 08910RB, 08920RB, 08930=K, 08936RA, 08939RA, 08940RA, 08909RA, 08960RA, 08970=A, 08998RA, 07476R9

Le FTD 73749.99 così prodotte devono essere processate dalla funzione **C07_11 - TRATTAMENTO RIGA – TEMPLATE Z (RP).**

Processo di calcolo per template Z05.02 – prime dieci controparti per elementi fuori bilancio diverse dai derivati

Fase 1:

Selezionare tutti i record delle FTD intermedie 73750.98 - FTD INTERMEDIA ELEMENTI FUORI BILANCIO: GARANZIE FINANZIARIE RICEVUTE e 73750.99 - FTD INTERMEDIA ELEMENTI FUORI BILANCIO: IMPEGNI ALL'EROGAZIONE DI FINANZIAMENTI RICEVUTI E ALTRI IMPEGNI RICEVUTI (DIVERSI DA DERIVATI) prodotte dalla fase di generazione ed eseguire i seguenti passi procedurali:

- e) Ordinare tutti i record a parità di campi 00359;
- f) Totalizzare gli importi a parità di 00359, creando in tal modo un “cluster” di passività riferibile ad ogni soggetto controparte; valorizzando tale importo nel campo COMODO1;
- g) Ordinare i “cluster” per importo COMODO1 decrescente, arricchire i relativi record di ogni “cluster” con il comodo “CLASSIFICA PRIMI DIECI FINANZIATORI” (POS CLASS) in base alla posizione assunta dal cluster cui appartengono (01, 02, 03, ecc.) fino a un massimo di dieci diverse controparti. Non considerare più nel processo i restanti record.
- h) Ordinare a questo punto i record presenti nei “cluster” significativi per campo 00359 e campo 08936 e per ogni combinazione totalizzarne gli importi presenti nel campo 07477 scrivendolo nel campo COMODO2.

Produrre un record per ogni combinazione di campo 00359 e 08936 in base al seguente tracciato della FTD 73759.99:

| 00003=1 00004=1 00005=3 08910RB, 08920RB, 08930=K, 08936RA, 08939RA, 08940RA,
08909RA, 08960RA, 08970=A, 08998RA, 07477R9

Le FTD 73759.99 prodotte saranno processate dalla funzione **C07.11 - TRATTAMENTO RIGA – TEMPLATE Z (RP)**.