

F88	GENERAZIONE TEMPLATE GRANULARI PER RESOLUTION PLANS
------------	--

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

Generalità

La presente funzione ha lo scopo di generare i template di tipo granulare (da Z 11.00 a Z 17.00) a partire dai record prodotti per il template Z 02.00 (FTD RP_7371X.xx) opportunamente arricchiti dei campi con numerazione da 08700 a 08799 e del campo 05699 (TIPOLOGIA DI PASSIVITA' PER TEMPLATE GRANULARI RP).

Template Z 11.00 - Intragroup Liabilities, excluding Derivatives

Il template Z 11.00 deve essere prodotto da tutti i record relativi agli strumenti, diversi dai derivati, con controparte infragruppo.

Creare la FTD **RP_74119.99** – TEMPLATE GRANULARE: PASSIVITA' INGRAGRUPPO (DIVERSE DA DERIVATI) applicando ai record generati nel template Z 02.00 con campo 08930 = 110,120,130,140,161,180, 200,210,310,320,340,350,360,365,370,380,390,400 le seguenti condizioni:

C08930I – CONDIZIONE RIGHE TEMPLATE Z 02.00

C08755A – SE INFRAGRUPPO

ed impostare le informazioni richieste nelle seguenti colonne con il campo 087xx indicato nella colonna 'ROUTINE':

NUMERO COLONNA	DESCRIZIONE COLONNA	ROUTINE
0010	NUMERO	Numero progressivo da assegnare a ciascun record a cura aziendale
0020	Line	08720..
0021	Column	08721..
0030	Insolvency Ranking	08730..
0040	Contract Identifier	08740..
0045	Name of counterparty	08745..
0050	Identifier of the counterparty	08750..
0053	Type of identifier	08753..
0055	Relationship with counterparty	08755..
0056	Type of Liability	08756..
0060	Governing Law	08760..
0070	If Third Country, Contractual Recognition	08770..
0080	Outstanding Principal Amount	08780..
0090	Accrued Interest	08790..
0100	Currency	08710..
0110	Issuance Date	08711..
0120	Earliest Redemption Date	08712..
0130	Legal Maturity	08713..
0150	Amount of pledge, lien or collateral	08715..
0160	Guarantor if applicable	08716..
0175	Amount meeting the conditions for Internal MREL eligibility (LIAB-G-1)	a cura aziendale
0180	Qualifying as Own Funds	a cura aziendale
0190	Amount Qualifying as Owns Funds	a cura aziendale

Template Z 12.00 - Securities

Il template Z 12.00 deve essere prodotto da tutti i record relativi a titoli¹ emessi non detenuti da controparti infragruppo.

¹ La procedura PUMA documenta solo le informazioni relative ai titoli di debito emessi, pertanto quelle relative ai titoli *'own funds'* (CET1, AT1,T2) dovranno essere prodotte a cura aziendale.

Creare la **FTD 74129.99** – TEMPLATE GRANULARE: TITOLI EMESSI NON DETENUTI DA CONTROPARTE INGRAGRUPPO applicando ai record generati nel template Z 02.00 con campo 08930=120,340,350,360,365,370 (C08930T) le seguenti condizioni:

C08755N – SE NON INFRAGRUPPO

C05699T – SE TITOLI EMESSI

ed impostare le informazioni richieste nelle seguenti colonne con il campo 087xx indicato nella colonna 'ROUTINE':

NUMERO COLONNA	DESCRIZIONE COLONNA	ROUTINE
0010	line	Numero progressivo da assegnare a ciascun record a cura aziendale
0020	Row	08720..
0030	Column	08721..
0040	Insolvency Ranking	08730..
0050	ISIN	08740..
0060	Type of Instrument	08761..
0070	Governing Law	08760..
0080	If Third Country Law, Contractual Recognition	08770..
0090	Currency	08710..
0110	Outstanding Principal Amount	08780..
0120	Accrued Interest	08790..
0130	Coupon Type	08733..
0140	Current coupon rate (%)	08734..
0150	Issue date	08711..
0160	Earliest Redemption Date	08712..
0170	Legal Maturity	08713..
0180	Public/Private Placement	08718..

0190	Paying Agent	08719..
0210	Counterparty identifier	08750..
0215	Type of identifier	08753..
0220	Exchanges Securities are Listed On	08722..
0230	Settlement Systems	08723..
0240	Registrar	08724..
0250	Central Securities Depository	08725..
0270	Amount of pledge, lien or collateral	08715..
0280	Guarantor	08716..
0305	Amount meeting the conditions for MREL eligibility	a cura aziendale
0310	Qualifying as Own Funds	a cura aziendale
0320	Amount Qualifying as Owns Funds	a cura aziendale

Template Z 13.00 – All deposits

Il template Z 13.00 deve essere prodotto da tutti i record relativi a depositi non detenuti da controparte infragruppo.

Creare la **FTD 74139.99**– TEMPLATE GRANULARE: DEPOSITI applicando ai record generati nel template Z 02.00 con campo 08930 = 110,150,310,320,370 (C08930D) le seguenti condizioni:

C05699D – SE DEPOSITI

C08755N – SE NON INFRAGRUPPO

ed impostare le informazioni richieste nelle seguenti colonne con il campo 087xx indicato nella colonna 'ROUTINE':

NUMERO COLONNA	DESCRIZIONE COLONNA	ROUTINE
0010	Line	Numero progressivo da assegnare a ciascun record a cura aziendale
0020	Row	08720..
0025	Column	08721..
0030	Insolvency Ranking	08730..
0035	Contract Identifier	08740..
0040	Counterparty identifier	08750..
0045	Type of identifier	08753..
0050	Governing Law	08760..
0060	Currency	08710..
0070	Outstanding Principal Amount	08780..
0080	Accrued Interest	08790..
0090	Current Interest Rate (%)	08734..
0110	Amount of pledge, lien or collateral	08715..
0115	Amount meeting the conditions for MREL eligibility	a cura aziendale
0120	Issuance Date for Term Deposits	08711..
0130	Earliest Redemption Date	08712..

Template Z 14.00 – Other financial Liabilities

Il template Z 14.00 deve essere prodotto da tutti i record relativi a ‘altre passività finanziarie’ non detenute da controparte infragruppo.

Creare la **FTD 74149.99**– TEMPLATE GRANULARE: OTHER FINANCIAL LIABILITIES applicando ai record generati nel template Z 02.00 con campo 08930=120,340,130,140,150,161,170,180,200,400 (C08930O ²) le seguenti condizioni:

C08755N – SE NON INFRAGRUPPO

ed impostare le informazioni richieste nelle seguenti colonne con il campo 087xx indicato nella colonna ‘ROUTINE’:

NUMERO COLONNA	DESCRIZIONE COLONNA	ROUTINE
----------------	---------------------	---------

² La routine testa anche il campo 05699=05,09 (altre passività finanziarie, passività associate ad attività/gruppi in dismissione)

0010	Line	Numero progressivo da assegnare a ciascun record a cura aziendale
0020	Row	08720..
0030	Column	08721..
0040	Insolvency Ranking	08730..
0050	Contract Identifier	08740..
0055	Name of the counterparty	08745..
0060	Counterparty identifier	08750..
0065	Type of identifier	08753..
0070	Governing Law	08760..
0075	Type of financial liabilities	08775..
0080	If Third Country, Contractual Recognition	08770..
0090	Outstanding Principal Amount	08780..
0100	Accrued Interest	08790..
0110	Current Interest Rate (%)	08734..
0120	Currency	08710..
0130	Issuance Date	08711..
0140	Earliest Redemption Date	08712..
0150	Legal Maturity	08713..
0170	Amount of pledge, lien or collateral	08715..
0180	Guarantor	08716..
0205	Amount meeting the conditions for MREL eligibility	A cura aziendale
0210	Qualifying as Own Funds	A cura aziendale
0220	Amount Qualifying as Owns Funds	A cura aziendale

Template Z 15.00 – Derivatives

Il template Z 15.00 deve essere prodotto da tutti i record relativi a DERIVATI.

Creare la **FTD 74159.99 – TEMPLATE GRANULARE: DERIVATI** applicando ai record generati nel template Z 02.00 con campo 08930=210,331 (C08930V³) le seguenti condizioni:

³ La routine testa anche il valore del campo 05699=07 (derivati).

ed impostare le informazioni richieste nelle seguenti colonne con il campo 087xx indicato nella colonna 'ROUTINE':

NUMERO COLONNA	DESCRIZIONE COLONNA	ROUTINE
0010	Line	Numero progressivo da assegnare a ciascun record a cura aziendale
0020	Column	08721..
0030	Insolvency Ranking	08730=5
0040	Master Agreement ID	08741..
0050	Type of Master Agreement	08768..
0061	ISDA Protocol Adherent - Entity	08769..
0071	Resolution Stay Recognition	08771..
0075	Name of counterparty	08745..
0080	Counterparty identifier	08750..
0085	Type of identifier	08753..
0090	Country of Counterparty	08772..
0095	Intragroup Transaction	08795..
0100	Governing law of master agreement/single contract	08766..
0110	Number of Transactions Covered	08706..
0120	Net Mark-to-Market Value	08702..
0130	Value of Net Collateral Posted	08703..
0140	Estimated Close-Out Amount	08714..
0150	Estimated Early Termination Amount	08705..

Template Z 16.00 – Secured Finance, excluding intragroup

Il template Z 16.00 deve essere prodotto da tutti i record relativi a passività collateralizzate con controparti diverse da quelle infragruppo.

Creare la **FTD 74169.99 – TEMPLATE GRANULARE PASSIVITA' COLLATERALIZZATE** applicando ai record generati nel template Z 02.00 con campo 08930=120,340 (C08930C⁴) le seguenti condizioni:

⁴ La routine testa anche i valori del campo 05699=02,22(passività collateralizzate)

C08755N – SE NON INFRAGRUPPO

ed impostare le informazioni richieste nelle seguenti colonne con il campo 087xx indicato nella colonna 'ROUTINE':

NUMERO COLONNA	DESCRIZIONE	ROUTINE
0010	Line	Numero progressivo da assegnare a ciascun record a cura aziendale
0020	Column	08721..
0030	Insolvency Ranking	08730..
0040	Master Agreement ID	08741..
0050	Type of MA	08708..
0055	Name of the counterparty	08745..
0060	Counterparty identifier	08750..
0065	Type of identifier	08753..
0070	Country of Counterparty	08772..
0080	Governing Law of MA/single deal	08766..
0090	Number of Transactions Covered	08706..
0100	Net Amount of Funding Received	08782..
0110	Net Amount of Collateral Posted	08783..

Template Z 17.00 – Other Non-Financial (not included in other tabs, excluding intragroup)

Il template Z 17.00 deve essere prodotto da tutti i record relativi ad altre passività non finanziarie con controparti diverse da quelle infragruppo.

Creare la **FTD 74179.99**– TEMPLATE GRANULARE ALTRE PASSIVITA' NON FINANZIARIE applicando ai record generati nel template Z 02.00 con campo 08930=190,390,400 (C08930N⁵) le seguenti condizioni:

C08755N – SE NON INFRAGRUPPO

⁵ La routine testa anche i valori del campo 05699= 06,08,81,82,83,84,85,86,87 (impegni e garanzie rilasciate, altre passività non finanziarie, accantonamenti a fondi di varia natura)

ed impostare le informazioni richieste nelle seguenti colonne con il campo 087xx indicato nella colonna 'ROUTINE':

NUMERO COLONNA	DESCRIZIONE COLONNA	ROUTINE
0010	Line	Numero progressivo da assegnare a ciascun record a cura aziendale
0020	Row	08720..
0030	Column	08721..
0040	Insolvency Ranking	08730..
0050	Contract Identifier	08740
0060	Counterparty identifier	08750
0065	Type of identifier	08753
0070	Governing Law	08760
0080	Type of non financial liabilities	08788
0090	Outstanding Amount	08781
0100	Currency	08710
0110	Date of Recognition	08711
0120	Date of Maturity	08713
0130	Qualifying as Own Funds	A cura aziendale
0140	Amount Qualifying as Owns Funds	A cura aziendale