

F45	CALCOLO FLUSSI E AGGIUSTAMENTI DI VALORE DEL PERIODO PER RILEVAZIONE TLTRO
------------	---

Tipo intermediario	B
--------------------	---

Generalità

La funzione è di supporto alla produzione dei dati di flusso relativi a:

- erogazioni e rimborsi (oggetto di rilevazione nelle FTD 03838 di base informativa TL);
- aggiustamenti di valore (FTD 03840.02/04/06/10 di base informativa TL).

Essa opera dopo la fase di generazione e prima del compattamento, e deve essere eseguita soltanto per le banche che abbiano scelto di calcolare i flussi del periodo mediante alimentazione analitica di appositi campi importo previsti sulle FTO di rapporto interessate (valore 1 del campo "TLTRO" del File Guida Lavorazioni - TR0FGL3).

Processo di calcolo

Per le FTD 03838.02/06 e 03840.02/04/06/10 di base informativa TL la periodicità di segnalazione è trimestrale ed il periodo di riferimento è costituito dal trimestre indicato espressamente nelle "Istruzioni segnaletiche per la rilevazione finalizzata alla partecipazione alle aste delle *Targeted Longer-Term Refinancing Operations* (TLTRO)" pubblicate dalla Banca d'Italia ad agosto 2014.

In base a tale normativa, i periodi di riferimento da considerare (successivi al 31 ottobre 2014) assumono una estensione difforme dai consueti trimestri solari (ad esempio, un periodo di riferimento va dal 1 novembre 2014 al 31 gennaio 2015 ed ha come data di riferimento il 31 gennaio 2015).

Per le FTD sopra descritte, pertanto, la funzione storicizza i dati mensili prodotti dai cicli elaborativi all'interno di ciascun periodo di riferimento definito e considera come data di riferimento quella espressamente indicata nella predetta normativa.

Al maturare di ogni data di riferimento prevista essa recupera i dati mensili contenuti nel periodo di riferimento e li invia alla fase di compattamento.