

TCOR38		TAVOLA DELLE CESSIONI DI CREDITO - CARTOLARIZZAZIONI		
NOME CAMPO		LUNGHEZZA	TIPO	NOTE
CODICE CARTOLARIZZAZIONE		5	N	campo chiave a codifica aziendale
IDENTIFICATIVO DELLA CARTOLARIZZAZIONE		45	A	Primi 8 caratteri del codice ISIN se disponibile oppure "nome" della cartolarizzazione (campo alfanumerico con allineamento a sinistra, la parte non utilizzata del campo deve contenere il carattere "blank")
NUMERO OPERAZIONE (da alimentare solo se si svolge attività di servicing per un'operazione di cartolarizzazione la cui società veicolo sia residente in Italia)		5	N	numero operazione assegnato dalla Banca d'Italia
CODICE CENSITO ORIGINATOR (per operazioni di cartolarizzazione)		13	N	Codice censito dell'originator

TCOR38	TAVOLA DELLE CESSIONI DI CREDITO - CARTOLARIZZAZIONI			
NOME CAMPO		LUNGHEZZA	TIPO	NOTE

IDENTIFICATIVO DELL'ORIGINATOR (per operazioni di cartolarizzazione)	45	A	Codice attribuito all'originator dall'Autorità di vigilanza o, in assenza, denominazione dell'originator (campo alfanumerico con allineamento a sinistra, la parte non utilizzata del campo deve contenere il carattere "blank")
---	----	---	---

TIPOLOGIA ORIGINATOR (da alimentare solo se si svolge attività di servicing per cartolarizzazioni di terzi)	3	N	1=IFM residenti; 2=IFM residenti in altri paesi UEM; 3=intermediari finanziari ex art. 107; 4=altri soggetti
--	---	---	---

TCOR38	TAVOLA DELLE CESSIONI DI CREDITO - CARTOLARIZZAZIONI		
NOME CAMPO	LUNGHEZZA	TIPO	NOTE
ATTIVITA' SOTTOSTANTI	1	N	0=relative a cartolarizzazione di terzi 1= relative a cartolarizzazione propria – rimaste integralmente in bilancio 2= relative a cartolarizzazione propria – parzialmente cancellate dal bilancio 3= relative a cartolarizzazione propria – cancellate integralmente dal bilancio (da valorizzare anche per le cartolarizzazioni ante 30.9.2005) 4= relative a autocartolarizzazione, con o senza deroga, o operazione assimilata (operazione di cartolarizzazione in fase di warehousing, cessione finalizzata all'emissione di covered bond) 5= relative a cessione di credito propria – rimaste integralmente in bilancio 6= relative a cessione di credito propria – parzialmente cancellate dal bilancio 9= relative a cartolarizzazione propria sintetica
TRATTAMENTO COVER POOL A FINI TLTRO (da alimentare soltanto se la banca partecipa alla rilevazione TLTRO)	1	N	0 = CREDITO DA RILEVARE NELLA FTD 03834.00 1 = CREDITO DA NON RILEVARE NELLA FTD 03834.00.

TCOR38	TAVOLA DELLE CESSIONI DI CREDITO - CARTOLARIZZAZIONI			
NOME CAMPO	LUNGHEZZA	TIPO	NOTE	
AUTOCARTOLARIZZAZIONI CON DEROGA (cd. "grandfathered") (da alimentare solo per operazioni con 'ATTIVITA' SOTTOSTANTI'=4)	1	N	0=NO; 1=SI (solo se ante 1.12.2008).	
TIPO CESSIONE (da alimentare solo per operazioni con 'ATTIVITA' SOTTOSTANTI'=4)	3	N	1=cessione finalizzata all'emissione di covered bond e la banca non svolge il ruolo di banca finanziatrice; 2= cessione finalizzata all'emissione di covered bond e la banca svolge anche il ruolo di banca finanziatrice; 3=operazione di cartolarizzazione in fase di warehousing; 4=autocartolarizzazione.	
ACQUISTO TUTTE PASSIVITA' SPV (da alimentare solo per operazioni con 'ATTIVITA' SOTTOSTANTI'=0)	1	N	0=NO; 1=SI	
CARTOLARIZZAZIONE RICONOSCIUTA A FINI PRUDENZIALI	1	N	0=NO (vi rientrano anche tutte le autocartolarizzazioni e le operazioni assimilate); 1=SI (vi rientrano anche tutte le cartolarizzazioni ante 30.9.2005 e quelle cancellate integralmente dal bilancio); 9=non applicabile (da utilizzare solo per le cartolarizzazioni di terzi)	
TIPOLOGIA CARTOLARIZZAZIONE	1	N	0=non applicabile; 1=tradizionale; 2=sintetica.	

TCOR38	TAVOLA DELLE CESSIONI DI CREDITO - CARTOLARIZZAZIONI			
NOME CAMPO	LUNGHEZZA	TIPO	NOTE	
RI-CARTOLARIZZAZIONE (da alimentare solo per operazioni con 'ATTIVITA' SOTTOSTANTI'=0,1,2,3,4)	1	N	0=NO; 1=SI	
RUOLO DELL'AZIENDA	1	N	0=non interessa; 1=cedente (originator); 2=investitore (investor); 3=promotore (sponsor)	
TIPO SERVICER	1	N	1=banca originator; 2=azienda segnalante per cartolarizzazioni di terzi cancellate dall'attivo dell'originator; 3=azienda segnalante per cartolarizzazioni di terzi non cancellate dall'attivo dell'originator; 4=altre banche residenti diverse dalla banca segnalante; 5=intermediari finanziari ex art. 107 TUB; 6=soggetti esteri.	
NDG DELLA SOCIETA' VEICOLO	16	A		

TCOR38	TAVOLA DELLE CESSIONI DI CREDITO - CARTOLARIZZAZIONI		
NOME CAMPO	LUNGHEZZA	TIPO	NOTE

STATO DELLA SOCIETA' VEICOLO

(da alimentare solo per operazioni di cessione/cartolarizzazione in cui la società veicolo è residente nei paesi UEM, inclusa l'Italia)

3

N

codice stato di residenza della società veicolo.

TIPOLOGIA SOTTOSTANTE

3

N

822 = Mutui ipotecari su immobili residenziali
823 = Mutui ipotecari su immobili commerciali
815 = Crediti connessi a carte di credito
022 = Leasing
813 = Prestiti verso imprese (incluse PMI)
527 = Crediti al consumo
816 = Crediti al commercio
248 = Altre attività
245 = Debiti (obbligazioni garantite)
249 = Altre passività

TIPOLOGIA ABCP

1

N

0=NO;
1=SI

CLAUSOLA RIMBORSO ANTICIPATO

(da alimentare soltanto per cartolarizzazioni di attività rotative per le quali è richiesto il requisito aggiuntivo)

1

N

0=non rileva;
1=controllata;
2=non controllata.

TCOR38	TAVOLA DELLE CESSIONI DI CREDITO - CARTOLARIZZAZIONI			
NOME CAMPO	LUNGHEZZA	TIPO	NOTE	

QUOTA PARTECIPAZIONE NELLA
CARTOLARIZZAZIONE (PORTAFOGLIO
BANCARIO)

(da alimentare soltanto per cartolarizzazioni
con 'TIPOLOGIA CARTOLARIZZAZIONE'=1 e
'ATTIVITA' SOTTOSTANTI=0,1,2,3

6

N

(da fornire in percentuale con 3 interi e 3 decimali)

N.B. Nel caso in cui 'CARTOLARIZZAZIONE RICONOSCIUTA A
FINI PRUDENZIALI' è uguale a 0 e 'ESPOSIZIONI ASSUNTE
ANTE 31.01.2010' è uguale a 1 le attività sottostanti la
cartolarizzazione generano per intero e pertanto la somma delle
QUOTE DI PARTECIPAZIONE NELLA CARTOLARIZZAZIONE
relative ai due portafogli, bancario e di negoziazione, deve
convenzionalmente essere pari a 100%.

QUOTA PARTECIPAZIONE NELLA
CARTOLARIZZAZIONE (PORTAFOGLIO DI
NEGOZIAZIONE DI VIGILANZA)

(da alimentare soltanto per cartolarizzazioni
con 'TIPOLOGIA CARTOLARIZZAZIONE'=1 e
'ATTIVITA' SOTTOSTANTI=0,1,2,3

6

N

(da fornire in percentuale con 3 interi e 3 decimali)

N.B. Nel caso in cui 'CARTOLARIZZAZIONE RICONOSCIUTA A
FINI PRUDENZIALI' è uguale a 0 e 'ESPOSIZIONI ASSUNTE
ANTE 31.01.2010' è uguale a 1 le attività sottostanti la
cartolarizzazione generano per intero e pertanto la somma delle
QUOTE DI PARTECIPAZIONE NELLA CARTOLARIZZAZIONE
relative ai due portafogli, bancario e di negoziazione, deve
convenzionalmente essere pari a 100%.

TCOR38	TAVOLA DELLE CESSIONI DI CREDITO - CARTOLARIZZAZIONI			
NOME CAMPO	LUNGHEZZA	TIPO	NOTE	

GRANULARITA' DEL PORTAFOGLIO
CARTOLARIZZATO

(da alimentare soltanto per cartolarizzazioni
con 'TIPOLOGIA CARTOLARIZZAZIONE'=1 e
'ATTIVITA' SOTTOSTANTI'=0,1,2,3 e
'ESPOSIZIONI ASSUNTE ANTE
31.01.2010'=0 e 'METODO UTILIZZATO PER
IL TRATTAMENTO DELLE ATTIVITA'
SOTTOSTANTI A FINI GRANDI RISCHI'=0,2)

1

N

0=NO;
1=SI

ESPOSIZIONI ASSUNTE ANTE 31.01.2010
(da alimentare soltanto per cartolarizzazioni
con 'TIPOLOGIA CARTOLARIZZAZIONE'=1 e
'ATTIVITA' SOTTOSTANTI'=0,1,2,3)

1

N

0=NO;
1=SI, schema in deroga e ripartizione sulle attività sottostanti;
2=SI, schema in deroga senza ripartizione sulle attività
sottostanti (solo per cartolarizzazioni di terzi e proprie ante
30.9.2005).

TCOR38	TAVOLA DELLE CESSIONI DI CREDITO - CARTOLARIZZAZIONI		
NOME CAMPO	LUNGHEZZA	TIPO	NOTE
METODO UTILIZZATO PER IL TRATTAMENTO DELLE ATTIVITA' SOTTOSTANTI A FINI GRANDI RISCHI (da alimentare soltanto per cartolarizzazioni con 'TIPOLOGIA CARTOLARIZZAZIONE'=1 e 'ATTIVITA' SOTTOSTANTI=0,1,2,3)	1	N	0=nessuna scomposizione o schema in deroga (valori 1 e 2 di 'ESPOSIZIONI ASSUNTE ANTE 31.01.2010'); 1=full look-through; 2=partial look-through; 3=structured-based approach.
RAPPORTO TRA EXCESS SPREAD MEDIO E EXCESS SPREAD DI INTRAPPOLAMENTO (da aggiornare trimestralmente)	6	N	(da fornire in percentuale con 3 interi e 3 decimali soltanto per cartolarizzazioni di attività rotative per le quali è richiesto il requisito aggiuntivo)
RAGIONE DI CREDITO DEL CEDENTE	6	N	(da fornire in percentuale con 3 interi e 3 decimali soltanto per cartolarizzazioni di attività rotative per le quali è richiesto il requisito aggiuntivo)
FATTORE DI PONDERAZIONE MEDIO PONDERATO	6	N	(da fornire con 4 interi e 2 decimali soltanto per cartolarizzazioni di terzi per le quali la banca non alimenta le FTO 01519.XX ma vuole applicare il metodo look-through)

TCOR38	TAVOLA DELLE CESSIONI DI CREDITO - CARTOLARIZZAZIONI		
NOME CAMPO	LUNGHEZZA	TIPO	NOTE
ATTIVITA' SOTTOSTANTI – SOFFERENZE	6	N	(da fornire in percentuale con 3 interi e 3 decimali soltanto se si opta per la generazione integrata della tabella C.1.1 della parte E della nota integrativa)
ATTIVITA' SOTTOSTANTI - INCAGLI	6	N	(da fornire in percentuale con 3 interi e 3 decimali soltanto se si opta per la generazione integrata della tabella C.1.1 della parte E della nota integrativa)
ATTIVITA' SOTTOSTANTI – ALTRE ATTIVITA' DETERIORATE	6	N	(da fornire in percentuale con 3 interi e 3 decimali soltanto se si opta per la generazione integrata della tabella C.1.1 della parte E della nota integrativa)
ATTIVITA' SOTTOSTANTI – ALTRE	6	N	(da fornire in percentuale con 3 interi e 3 decimali soltanto se si opta per la generazione integrata della tabella C.1.1 della parte E della nota integrativa)
EMISSIONI SENIOR	6	N	(da fornire in percentuale con 3 interi e 3 decimali soltanto se si opta per la generazione integrata della tabella C.1.1 della parte E della nota integrativa)
EMISSIONI MEZZANINE	6	N	(da fornire in percentuale con 3 interi e 3 decimali soltanto se si opta per la generazione integrata della tabella C.1.1 della parte E della nota integrativa)

TCOR38	TAVOLA DELLE CESSIONI DI CREDITO - CARTOLARIZZAZIONI		
NOME CAMPO	LUNGHEZZA	TIPO	NOTE
EMISSIONI JUNIOR	6	N	(da fornire in percentuale con 3 interi e 3 decimali soltanto se si opta per la generazione integrata della tabella C.1.1 della parte E della nota integrativa)
RIVALSA SOLO SU ATTIVITA' CEDUTE	1	N	Operazioni di cessione con passività aventi rivalsa esclusivamente sulle attività cedute 0=NO; 1=SI
CARTOLARIZZAZIONI – POSIZIONI PONDERATE AL 1250% (da compilare solo per le banche)	1	N	0 = CALCOLO DEL REQUISITO 1 = DEDUZIONE DAL PATRIMONIO DI VIGILANZA
INTERESSE ECONOMICO NETTO	3	N	314 = metodo ex CRR, art. 405(1) lettera (a) 315 = metodo ex CRR, art. 405(1) lettera (b) 316 = metodo ex CRR, art. 405(1) lettera (c) 317 = metodo ex CRR, art. 405(1) lettera (d) 318 = metodo ex CRR, art. 405(1) lettera (e) 319 = esenzione ex CRR, art. 405(3) 777 = non applicabile 320 = altro
PERCENTUALE DI RETENTION (da non fornire se INTERESSE ECONOMICO NETTO = 319/777)	6	N	(da fornire in percentuale con 3 interi e 3 decimali)

TCOR38		TAVOLA DELLE CESSIONI DI CREDITO - CARTOLARIZZAZIONI		
NOME CAMPO	LUNGHEZZA	TIPO	NOTE	
CONFORMITA' NORMATIVA	1	N	1=SI; 0=NO; 7=non applicabile (se INTERESSE ECONOMICO NETTO = 319/777)	
DATA RIFERIMENTO (data di origine dell'operazione di catolarizzazione, da fornire se TIPOLOGIA ABCP=0 e RUOLO DELL'AZIENDA diverso da 2)	8	N	AAAAMMGG	
ESPOSIZIONE ORIGINARIA [E0] ALLA DATA DI EMISSIONE DELLA PRIMA TRANCHE (da fornire se TIPOLOGIA ABCP=0 e RUOLO DELL'AZIENDA diverso da 2)	15	N		
METODOLOGIA APPLICATA (da fornire solo se RUOLO DELL'AZIENDA = 1 oppure se ORIGINAL LENDER =1 e TIPOLOGIA SOTTOSTANTE diverso da 245/249)	1	N	1=standard; 2=IRB; 3=mista (standard e IRB).	
ORIGINAL LENDER (solo se RI-CARTOLARIZZAZIONE = 1)	1	N	0=NO; 1=SI	

TCOR38		TAVOLA DELLE CESSIONI DI CREDITO - CARTOLARIZZAZIONI		
NOME CAMPO	LUNGHEZZA	TIPO	NOTE	
STATO	3	N	codice dello stato di origine delle attività/passività sottostanti cartolarizzate. In presenza di pool va indicato lo stato più importante (quota maggiore); se nessuno stato supera la soglia del 20% basata sull'importo delle attività/passività si deve indicare il valore convenzionale 707	
DATA DI CREAZIONE (da fornire solo se RUOLO DELL'AZIENDA = 1,3 e se TIPOLOGIA ABCP = 0)	8	N	da fornire in formato data AAAAMMGG	
PRIMA DATA DI CHIUSURA PREVEDIBILE	8	N	da fornire in formato data AAAAMMGG	
DATA DI SCADENZA FINALE LEGALE	8	N	da fornire in formato data AAAAMMGG	
TRATTAMENTO TABELLA C.1.1	1	N	0=NO; 1=SI (informazione determinata dalla procedura). Cfr R05-RAG-CART	

TCOR38	TAVOLA DELLE CESSIONI DI CREDITO - CARTOLARIZZAZIONI		
NOME CAMPO	LUNGHEZZA	TIPO	NOTE
EMISSIONI SENIOR - SOFFERENZE	6	N	(informazione determinata dalla procedura in % con 3 interi e 3 decimali)
EMISSIONI SENIOR – INCAGLI	6	N	(informazione determinata dalla procedura in % con 3 interi e 3 decimali)
EMISSIONI SENIOR – ALTRE ATTIVITA' DETERIORATE	6	N	(informazione determinata dalla procedura in % con 3 interi e 3 decimali)
EMISSIONI SENIOR – ALTRE	6	N	(informazione determinata dalla procedura in % con 3 interi e 3 decimali)
EMISSIONI MEZZANINE – SOFFERENZE	6	N	(informazione determinata dalla procedura in % con 3 interi e 3 decimali)
EMISSIONI MEZZANINE – INCAGLI	6	N	(informazione determinata dalla procedura in % con 3 interi e 3 decimali)
EMISSIONI MEZZANINE – ALTRE ATTIVITA' DETERIORATE	6	N	(informazione determinata dalla procedura in % con 3 interi e 3 decimali)

TCOR38	TAVOLA DELLE CESSIONI DI CREDITO - CARTOLARIZZAZIONI		
NOME CAMPO	LUNGHEZZA	TIPO	NOTE
EMISSIONI MEZZANINE – ALTRE	6	N	(informazione determinata dalla procedura in % con 3 interi e 3 decimali)
EMISSIONI JUNIOR - SOFFERENZE	6	N	(informazione determinata dalla procedura in % con 3 interi e 3 decimali)
EMISSIONI JUNIOR - INCAGLI	6	N	(informazione determinata dalla procedura in % con 3 interi e 3 decimali)
EMISSIONI JUNIOR – ALTRE ATTIVITA' DETERIORATE	6	N	(informazione determinata dalla procedura in % con 3 interi e 3 decimali)
EMISSIONI JUNIOR – ALTRE	6	N	(informazione determinata dalla procedura in % con 3 interi e 3 decimali)