

F77	DETERMINAZIONE DELLE CONTROPARTI DETENTRICI PER RESOLUTION PLANS
------------	---

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

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).

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 a, parità di campo 00032 (codice ISIN) effettuare la somma rispettivamente dei campi 07704 e 00602, riportandole nei due campi COMODO07704 e COMODO00602 e creare la seguente TABELLA "TITOLI EMESSI":

TABELLA TITOLI EMESSI

ISIN	COMODO7704	COMODO602

- 2) Selezionare i record delle FTO 01625.XX il cui "COD. IDENTIFICATIVO EMITTENTE" di TCOR28, ricercato con campo 00032, sia uguale al "codice fiscale" presente nel file guida lavorazioni:

- raggruppare per codice campo 00032 (ISIN) e per campo 05611 (RAGGRUPPAMENTO SAE PER RESOLUTION PLANS)
- eseguire la somma dei relativi campi 00609 nel **COMODO609**

- calcolare la “**QUOTA KNOWN**” nel seguente modo:
(COMODO609/COMODO7704) utilizzando il corrispondente COMODO7704 presente nella “TABELLA TITOLI EMESSI”;
 - se campo 00125=1,2 con codice campo 00030 accedi a TCOR20 e se presente e "METODO DI CONSOLIDAMENTO CONTABILE" = 1,2 eseguire la somma dei relativi campi 00609 e valorizzare **COMODO_IMP_INFR**;
- e aggiungere i campi calcolati TABELLA “TITOLI DEPOSITATI” come segue:

TABELLA TITOLI DEPOSITATI

ISIN	05611	COMODO609	QUOTA KNOWN	COMODO_IMP_INFR

Pertanto, per ogni ISIN la colonna “QUOTA KNOWN” potrà essere valorizzata più volte, una volta per ogni valore del campo 05611.

- 3) Per ogni ISIN presente nella TABELLA “TITOLI EMESSI” accoppiare con ISIN presente in TABELLA “TITOLI DEPOSITATI” e a parità di ISIN aggiungere alla TABELLA “TITOLI EMESSI” il campo COMODO_TIT_DEP, ottenuto dalla somma di tutti i campi COMODO609 della TABELLA “TITOLI DEPOSITATI”:

TABELLA TITOLI EMESSI

ISIN	COMODO7704	COMODO602	COMODO_TIT_DEP

- 4) Per ogni ISIN della tabella ‘TITOLI EMESSI’ calcolare
- $$\text{“QUOTA UNKNOWN”} = (1 - (\text{COMODO_TIT_DEP} / \text{COMODO07704}))$$
- ed aggiungere alla TABELLA “TITOLI EMESSI”;

TABELLA TITOLI EMESSI

ISIN	COMODO7704	COMODO602	COMODO_TIT_DEP	QUOTA UNKNOWN

- 5) Accedere alla tabella “TITOLI DEPOSITATI” sommare a parità di codice ISIN ‘COMODO_IMP_INFR’ in ‘COMODO_IMP_INFR_TOT’ e calcolare la “**QUOTA INFRAGRUPPO**” nel seguente modo:

$$(\text{COMODO_IMP_INFR_TOT} / \text{COMODO7704})$$

ed aggiungerla alla TABELLA “TITOLI EMESSI”.

TABELLA TITOLI EMESSI

ISIN	COMODO7704	COMODO602	COMODO_TIT_DEP	QUOTA UNKNOWN	QUOTA INFRAGRUPPO

- 6) Per ciascun record delle FTO 01775.XX, 01777.XX, 01779.XX e 01837.02 selezionato al punto 1):

- a. con codice ISIN accedere a TABELLA “TITOLI DEPOSITATI” e valorizzare per ciascun valore del campo 05611 i seguenti campi con la corrispondente **QUOTA KNOWN** e riportarli su ciascuna FTO sopra selezionata:

se campo 05611=10 imposta campo 05681

se campo 05611=20 imposta campo 05682

se campo 05611=30 imposta campo 05683

se campo 05611=40 imposta campo 05684

se campo 05611=50 imposta campo 05685

se campo 05611=60 imposta campo 05686

Si precisa che nel caso in cui il campo 05611 sia assente, i relativi campi 0568X non devono essere impostati.

b. con codice ISIN accedere a tabella 'TITOLI EMESSI' e valorizzare i seguenti campi nel seguente modo:

campo 05687='QUOTA UNKNOWN'

campo 05688='QUOTA INFRAGRUPPO'

Nel caso in cui l'ISIN non sia presente nella tabella 'TITOLI DEPOSITATI' occorre impostare i campi 05681, 05682, 05683, 05684, 05685, 05686 e 05688 pari a 0 e il campo 05687=1.

Fase 2:

a) Nella TABELLA TITOLI EMESSI aggiungere la colonna denominata COMODOZ5, con il valore del rapporto fra il COMODO7704 ed il COMODO602, come di seguito indicato:

TABELLA TITOLI EMESSI

ISIN	COMODO7704	COMODO602	COMODO_TIT_DEP	QUOTA UNKNOWN	QUOTA INFRAGRUPPO	COMODOZ5

b) Per ciascun record relativo alle FTO 01625.xx selezionate al punto 2) della Fase1 accedere con codice ISIN a TABELLA "TITOLI EMESSI" e valorizzare Il campo 05678 - RAPPORTO DI CONVERSIONE VALORE NOMINALE IN IMPORTO IN ESSERE con il valore del campo COMODOZ5 e scriverlo su tali FTO. Tale campo verrà utilizzato ai fini della generazione del template Z05.01.

Esempio

FTO 01777.10 – INPUT

COD ISIN	Cliente (primo prenditore)	SAE cliente	campo 05804	campo 00138	campo 07704
y	a	600			100
y	b	600		1	50
y	c	430			500
y	d	615			200
y	e	430	1		150
y	f	430		1	100
y	g	245			40
SUBTOTALE Y					1140
(di cui da segnalare)					(990)
x	z	600			700
x	p	615		1	150
x	s	430			200
x	t	245			300
x	u	600			50
x	v	615			500
SUBTOTALE X					1900
(di cui da segnalare)					(1750)
w	b	600			500
w	c	430			200
w	d	615			250
w	e	430	1		50
w	s	430		1	300
w	t	245			500
w	u	600			400
SUBTOTALE W					2200

(di cui da segnalare)					1900
TOTALE					5240
(di cui da segnalare)					4640

FTO 01625.04 – INPUT

cod ISIN	cliente	SAE cliente	campo 05804	campo 05611	campo 00125	campo 00609 (solo titoli con emittente ente segnalante)
y	a	600		10		100
y	d	615		10		300
y	h	430		30		200
y	l	100		60		150
y	m	101		50		200
SUBTOTALE Y						950
x	z	600		10		700
x	q	600		10		300
x	d	615		10		200
x	f	430		30		150
x	g	245		40	1	100
SUBTOTALE X						1450
w	d	615		10		200
w	e	430	1	20		100
w	l	100		60		500
w	m	101		50		500
w	t	245		40		200
w	u	600		10		300
SUBTOTALE W						1800
TOTALE						4200

FASE 1

Punto 1)

ISIN	COMODO7704	COMODO602
x	1750	1750
y	990	990
w	1900	1900
TOTALE	4640	4640

Punto 2)

TABELLA TITOLI DEPOSITATI

ISIN	05611	COMODO609	QUOTA KNOWN	COMODO_IMP_INFR
x	10	1200	0,685714286	
x	30	150	0,085714286	
x	40	100	0,057142857	100
y	10	400	0,404040404	
y	30	200	0,202020202	
y	50	200	0,202020202	
y	60	150	0,151515152	
w	10	500	0,263157895	
w	20	100	0,052631579	
w	40	200	0,105263158	
w	50	500	0,263157895	
w	60	500	0,263157895	
TOTALE		4200	2,735535809	100

Punto 3)

TABELLA TITOLI EMESSI

ISIN	COMODO7704	COMODO602	COMODO_TIT_DEP
x	1750	1750	1450
y	990	990	950
w	1900	1900	1800
TOTALE		4640	4200

Punto 4)

TABELLA TITOLI EMESSI

ISIN	COMODO7704	COMODO602	COMODO_TIT_DEP	QUOTA UNKNOWN
x	1750	1750	1450	0,171428571
y	990	990	950	0,04040404
w	1900	1900	1800	0,052631579
TOTALE		4640	4200	0,264464191

Punto 5)

TABELLA TITOLI DEPOSITATI

ISIN	05611	COMODO609	QUOTA KNOWN	COMODO_IMP_INFR	COMODO_IMP_INFR_TOT
x	10	1200	0,685714286		100
x	30	150	0,085714286		
x	40	100	0,057142857	100	
y	10	400	0,404040404		0
y	30	200	0,202020202		
y	50	200	0,202020202		
y	60	150	0,151515152		
w	10	500	0,263157895		0
w	20	100	0,052631579		
w	40	200	0,105263158		
w	50	500	0,263157895		
w	60	500	0,263157895		
TOTALE		4200	2,735535809	100	100

TABELLA TITOLI EMESSI

ISIN	COMODO7704	COMODO602	COMODO_TIT_DEP	QUOTA UNKNOWN	QUOTA INFRAGRUPPO
x	1750	1750	1450	0,171428571	0,057142857
y	990	990	950	0,04040404	0
w	1900	1900	1800	0,052631579	0
TOTALE		4640	4640	0,264464191	0,057142857

Punto 6) FTO 01777.10

cod titolo	cliente	SAE cliente	campo 05804	campo 00138	07402 - voce 1777	campo 05681	campo 05682	campo 05683	campo 05684	campo 05685	campo 05686	campo 05687	campo 05688
y	a	600			100	0,404040404	0,202			0,202	0,1515	0,040404	
y	b	600		-	50			0,202		0,202	0,1515	0,040404	
y	c	430			500	0,404040404		0,202		0,202	0,1515	0,040404	
y	d	615			200	0,404040404		0,202		0,202	0,1515	0,040404	
y	e	430	1		150	0,404040404		0,202		0,202	0,1515	0,040404	
y	f	430		-	400								
y	g	245			40	0,404040404	0,202			0,202	0,1515	0,040404	
x	z	600			700	0,685714286	0,0857	0,0571				0,171429	0,0571
x	p	615		-	450								
x	s	430			200	0,685714286		0,0857	0,0571			0,171429	0,0571
x	t	245			300	0,685714286		0,0857	0,0571			0,171429	0,0571
x	u	600			50	0,685714286		0,0857	0,0571			0,171429	0,0571
x	v	615			500	0,685714286	0,0857	0,0571				0,171429	0,0571
w	b	600			500	0,263157895	0,0526		0,1053	0,2632	0,2632	0,052632	
w	c	430			200	0,263157895	0,0526		0,1053	0,2632	0,2632	0,052632	
w	d	615			250	0,263157895	0,0526		0,1053	0,2632	0,2632	0,052632	
w	e	430	1		50	0,263157895	0,0526		0,1053	0,2632	0,2632	0,052632	
w	s	430		-	300								
w	t	245			500	0,263157895	0,0526		0,1053	0,2632	0,2632	0,052632	
w	u	600			400	0,263157895	0,0526		0,1053	0,2632	0,2632	0,052632	
TOTALE					4640								

FASE 2

Lettera a

TABELLA TITOLI EMESSI

ISIN	COMODO7704	COMODO602	COMODO_TIT_DEP	QUOTA UNKNOWN	QUOTA INFRAGRUPPO	COMODOZ5
X	1750	1750	1450	0,171428571	0,057142857	1
Y	990	990	950	0,04040404	0	1
W	1900	1900	1800	0,052631579	0	1
TOTALE	4640	4640	4200	0,264464191	0,057142857	

Lettera b

cod titolo	cliente	SAE cliente	campo 05804	campo 05611	campo 00125	dato 0609 - voce 1625 (solo titoli con emittente ente segnalante)	05678
y	a	600		10		100	1
y	d	615		10		300	1
y	h	430		30		200	1
y	l	100		60		150	1
y	m	101		50		200	1
						950	
x	z	600		10		700	1
x	q	600		10		300	1
x	d	615		10		200	1
x	f	430		30		150	1
x	g	245		40	1	100	1
						1450	
w	d	615		10		200	1
w	e	430	1	20		100	1
w	l	100		60		500	1
w	m	101		50		500	1
w	t	245		40		200	1
w	u	600		10		300	1
						1800	
TOTALE						4200	