

<b>F66_1</b>	<b>CREAZIONE TAVOLE DA INPUT</b>
--------------	----------------------------------

<b>Tipo intermedio</b>	<b>B</b>
------------------------	----------

## **Generalità**

La presente funzione provvede a creare, per gli strumenti presenti nell'input del mese di riferimento, tutte le tavole richieste dal Regolamento (a prescindere dal principio dell' *on-change*, la cui eventuale concreta applicazione è rimandata alle banche e alle soluzioni software delle quali si avvalgono), a operare le necessarie trasformazioni di codifiche e formati e ad eliminare le informazioni non richieste (ad es. importi con valore 8888888888888888 e date con valore 88888888).

**N.B. Si rammenta che nella segnalazione AnaCredit devono essere rappresentati anche gli importi con valore 0.**

## **Processo di calcolo**

### **Creazione della Tavola 4**

Scorrere il file A0044, prodotto dalla funzione F65\_4 e, per ciascun record, produrre la tavola 4 "Dati controparte-strumento" (cfr. F66\_1\_4).

### **Creazione delle restanti Tavole**

La presente funzione utilizza l'archivio A0042 ed elabora le FTD 88050.00 con campo 05928 uguale a S, C, W. Tale insieme rappresenta il perimetro degli strumenti da segnalare in AnaCredit di cui si dispone dell'input alla data di riferimento (il perimetro segnaletico viene completato dalla F66\_2).

Al fine di ottimizzare il processo si ritiene opportuno seguire il flusso logico di seguito descritto che ha natura reiterativa e deve essere ripetuto per ogni record elaborabile.

1. Ordinare i record della FTD 88050.00 per ID\_CONTRATTO e ID\_STRUMENTO<sup>1</sup>.
2. Per ogni record produrre le Tavole 2 “Dati sullo strumento”, 3 “Dati finanziari” e 6 “Dati contabili” (cfr. F66\_1\_2, F66\_1\_3 e F66\_1\_6). Per evitare di replicare lo stesso strumento più volte in caso di cointestazioni, non processare le FTD 88050.00 con campo 05964 = 2.
3. Per ogni record accedere a file A0043 (cfr. “Informazioni prodotte nella ripartizione” della F05\_2\_10) e produrre le Tavole 7 “Dati sulla protezione ricevuta” e 8 “Dati relativi a strumento protezione ricevuta” (cfr. F66\_1\_7 e F66\_1\_8). Per evitare di replicare lo stesso record più volte in caso di cointestazioni, non processare le FTD 88050.00 con campo 05964 = 2.
4. Per ogni campo 05961 delle FTD 88050.00 con campo 05964 diverso da 1 (in quanto nelle Tavole non devono essere inserite le controparti di tipo “cointestazione”) produrre le Tavole 9 “Dati sul rischio di controparte” e 10 “Dati sul default della controparte” per controparti debitorie. Completare successivamente queste Tavole per ciascun “fornitore di protezione” (campo 05962) presente in Tavola 7 che non sia stato già scritto nelle Tavole 9 e 10 in qualità di debitore (cfr. F66\_1\_9 e F66\_1\_10).
5. Per ogni FTD 88050.00 relativa a debitori “cointestatari” (campo 05964 uguale a 2), produrre la Tavola 5 “Dati sulle responsabilità solidali” (cfr. successiva F66\_1\_5).

---

<sup>1</sup> La presenza di più record con lo stesso Id\_contratto ed Id\_strumento è possibile e rispecchia la casistica dei contestatari.

## Indicazioni generali

Una rappresentazione grafica del presente processo è disegnata nel file “flusso procedurale Anacredit”.

L’abbinamento tra le sottofunzioni della presente funzione e le tavole da produrre è il seguente:

TAVOLA	DESCRIZIONE	FUNZIONE	SURVEY
Tavola 2	Dati dello strumento	F66_1_2	T1M
Tavola 3	Dati finanziari	F66_1_3	T1M
Tavola 4	Dati controparte- strumento	F66_1_4	T1M
Tavola 5	Dati sulle responsabilità solidali	F66_1_5	T1M
Tavola 6	Dati contabili	F66_1_6	T2Q
Tavola 7	Dati sulla protezione ricevuta	F66_1_7	T2M
Tavola 8	Dati relativi a strumento-protezione ricevuta	F66_1_8	T2M
Tavola 9	Dati sul rischio di controparte	F66_1_9	T2M
Tavola 10	Dati sul default della controparte	F66_1_10	T2M

## Trasformazioni di codifiche e formati

Nel produrre i record per la segnalazione, secondo le strutture definite nelle sottofunzioni della F66\_1, occorre anche:

- transcodificare i codici delle variabili Puma nei corrispondenti codici delle variabili previsti nel sistema delle codifiche;
- trasformare il formato delle seguenti variabili di output contenenti “date” da AAAAMMGG a AAAA-MM-GG così come previsto dal sistema delle codifiche della rilevazione AnaCredit: 00010, 00378, 05809, 05810, 05905, 05914, 05916, 05919, 05921, 05957, 05959, 05960;
- trasformare il formato della variabile di output 00678 contenente un “tasso” in formato “percentuale”, da 2 interi e 4 decimali senza separatore a numero reale, sia positivo che negativo, con punto separatore dei decimali e 6 decimali (ad es. per un tasso dell’ 1% alimentato con 010000 il valore da produrre in segnalazione deve essere 0.010000);
- trasformare il formato delle variabili di output 05907, 05908 e 05909 contenenti un “tasso” in formato “numero reale” con 4 interi e 6 decimali senza separatore a numero reale, sia positivo che negativo, con punto separatore dei decimali (ad es. per un tasso dell’ 1% alimentato con 0000010000 il valore da produrre in segnalazione deve essere 0.010000); se il valore generato è pari a 0000000001 i campi 05907, 05908 e 05909 devono essere prodotti in segnalazione pari a 0.000000;
- impostare l’attributo SYNDCTD\_CNTRCT\_ID uguale a ‘NA’ per le FTD 88050.00 che presentano il campo 00109=0;
- arrotondare gli importi all’unità di euro, per difetto se il primo decimale è fino a 5, per eccesso se uguale o maggiore di 5;
- transcodificare i codici anagrafici aziendali delle controparti e dei fornitori di protezione nei corrispondenti codici dell’Anagrafe dei Soggetti;
- eliminare le seguenti informazioni non richieste:
  - importi con valore 8888888888888888;

- date con valore 88888888;
- tassi di interesse con valore 888888 (campi 00678 e 00679);
- tassi di interesse con valore 8888888888 (campi 05908 e 05909);
- altri attributi come da relativa SK A.