

Generalità

La presente funzione provvede a predisporre la segnalazione, individuando – in base alla periodicità prevista dal Regolamento – le tavole effettivamente da segnalare per il mese di riferimento.

Per quanto riguarda l'applicazione del principio dell'*on-change* il Gruppo interbancario ha ritenuto, trattandosi di una facoltà nei confronti della quale non è emerso tra le banche un interesse significativo, di non documentarlo. Tale scelta non pregiudica l'eventuale concreta applicazione di tale principio da parte delle banche ma rimanda ad esse, e alle soluzioni software delle quali si avvalgono, la relativa implementazione.

Processo di calcolo

Se 'SEGNALAZIONE ANACREDIT' di FGL = 1:

- le tavole 2 (Dati dello strumento), 3 (Dati finanziari), 4 (Dati controparte-strumento) e 5 (Dati sulle responsabilità solidali) vanno segnalate, nell'ambito della survey T1M, in tutte le date di riferimento; le tavole 7 (Dati sulla protezione ricevuta), 8 (Dati relativi a strumento-protezione ricevuta), 9 (Dati sul rischio di controparte) e 10 (Dati sul default della controparte) vanno segnalate, nell'ambito della survey T2M, in tutte le date di riferimento;
- la tavola 6 (Dati contabili) va segnalata, nell'ambito della survey T2Q, solo se il mese di riferimento è un fine trimestre.

Se 'SEGNALAZIONE ANACREDIT' di FGL = 2:

- le tavole 2 (Dati dello strumento), 3 (Dati finanziari), 4 (Dati controparte-strumento) e 5 (Dati sulle responsabilità solidali) vanno segnalate, nell'ambito della survey T1M, solo se il mese di riferimento è un fine trimestre;
- le tavole 7 (Dati sulla protezione ricevuta), 8 (Dati relativi a strumento-protezione ricevuta), 9 (Dati sul rischio di controparte) e 10 (Dati sul default della controparte) vanno segnalate, nell'ambito della survey T2M, solo se il mese di riferimento è un fine trimestre;
- la tavola 6 (Dati contabili) va segnalata, nell'ambito della survey T2Q, solo se il mese di riferimento è un fine trimestre.

Se 'SEGNALAZIONE ANACREDIT' di FGL = 3, 5:

- le tavole 2 (Dati dello strumento), 3 (Dati finanziari), 4 (Dati controparte-strumento) e 5 (Dati sulle responsabilità solidali) vanno segnalate, nell'ambito della survey T1M, in tutte le date di riferimento; le tavole 7 (Dati sulla protezione ricevuta) e 8 (Dati relativi a strumento-protezione ricevuta) vanno segnalate, nell'ambito della survey T2M, in tutte le date di riferimento;
- la tavola 6 (Dati contabili) va segnalata, nell'ambito della survey T2Q, solo se il mese di riferimento è un fine trimestre.

Se 'SEGNALAZIONE ANACREDIT' di FGL = 4:

- le tavole 2 (Dati dello strumento), 3 (Dati finanziari), 4 (Dati controparte-strumento) e 5 (Dati sulle responsabilità solidali) vanno segnalate, nell'ambito della survey T1M, solo se il mese di riferimento è un fine trimestre;
- le tavole 7 (Dati sulla protezione ricevuta) e 8 (Dati relativi a strumento-protezione ricevuta) vanno segnalate, nell'ambito della survey T2M, solo se il mese di riferimento è un fine trimestre;

- la tavola 6 (Dati contabili) va segnalata, nell'ambito della survey T2Q, solo se il mese di riferimento è un fine trimestre.

N.B. Per le tavole 2 (Dati dello strumento), 4 (Dati controparte-strumento) e 7 (Dati sulla protezione ricevuta) l'eventuale applicazione del principio *dell'on-change* è demandata alle singole banche segnalanti.