

Tipo intermediario	Data pubblicazione	Data inizio validità	Data fine validità
B/F	2020 04 03	2019 05 16	9999 99 99

Generalità

Il ragionamento è da effettuare all'interno della fase ACA ed arricchisce la TCOR76 in modo tale da permettere la determinazione della quota proporzionale dell'esposizione dell'ente all'operazione di cartolarizzazione tradizionale.

Il processo è propedeutico alla determinazione del valore dell'esposizione per le attività sottostanti ad operazioni di cartolarizzazione tradizionale secondo quanto previsto dal regolamento delegato 1187/2014.

Esecuzione del Ragionamento

1. Selezionare tutti i record delle FTO 01063.02/11 e 01079.02 con il campo 05781 = 2, il campo 05760 presente e significativo e l'attributo ATTIVITA' SOTTOSTANTI di TCOR38 = 0,1,2,3 e l'attributo TIPO CARTOLARIZZAZIONE=1;
2. Raggruppare i record a parità di campo 00032 ed effettuare la somma del campo 00609 di ciascun record del gruppo memorizzandola in un campo COMODO1;
3. Con il codice del campo 00032 in lavorazione accedere a TCOR76, prelevare l'attributo VALORE NOMINALE DELLA TRANCHE e memorizzarlo in un campo COMODO2;
4. Eseguire il calcolo della QUOTA DI PARTECIPAZIONE ALLA TRANCHE come rapporto fra COMODO1 e COMODO 2 e scrivere il risultato nel corrispondente attributo di TCOR76;

5. Reiterare gli step da 1 a 4 per i successivi codici ISIN (campo 00032).