

<b>F80</b>	<b>GENERAZIONE FTD RELATIVE A REGULAR-WAY (LEVA FINANZIARIA)</b>
------------	--

Tipo intermediario	Data pubblicazione	Data inizio validità	Data fine validità
B	2021 05 28	2021 06 28	9999 99 99

### Generalità

La presente funzione, che deve operare dopo la generazione e prima del compattamento, ha lo scopo di determinare l'ammontare netto per le operazioni in regular-way e da esporre nelle righe:

- 250 col 10 del template C 47.00 (operazioni infragruppo da escludere dal calcolo del totale delle esposizioni per la leva finanziaria);
- 70 col 10 del template C 43.00 (operazioni in regular-way da esporre tra altre attività del trading book).

### Processo di calcolo per determinare l'importo di riga 250 colonna 10 del template C 47.00 per le operazioni regular-way infragruppo :

- 1) Selezionare le FTD fittizie IL\_7205989 e impostare COMODO989 pari alla somma dei campi importo 07780;
- 2) Selezionare le FTD fittizie IL\_7205988 e impostare COMODO988 pari alla somma dei campi importo 07780;
- 3) Se COMODO989 in valore assoluto maggiore di COMODO988 in valore assoluto, impostare  $COMODO989 = COMODO988 * (-1)$ ;
- 4) Se COMODO989 in valore assoluto minore o uguale di COMODO988 in valore assoluto non eseguire

- 5) Trasformare le FTD fittizie IL\_7205989 in IL\_7205250 impostando campo 07780=COMODO989\*(-1)
- 6) Trasformare le FTD fittizie IL\_7205988 in IL\_7205250 impostando campo 07780=COMODO988\*(-1)

**Processo di calcolo per determinare l'importo di riga 70 col 10 del template C 43.00 per la parte relativa alle operazioni regular-way:**

- 1) Selezionare le FTD fittizie IL\_7203989 e impostare COMODO989 pari alla somma dei campi importo 07780;
- 2) Selezionare le FTD fittizie IL\_7203988 e impostare COMODO988 pari alla somma dei campi importo 07780;
- 3) Se COMODO989 in valore assoluto maggiore di COMODO988 in valore assoluto, impostare COMODO989=COMODO988\*(-1);
- 4) Se COMODO989 in valore assoluto minore o uguale di COMODO988 in valore assoluto non eseguire
- 5) Trasformare le FTD fittizie IL\_7203989 in IL\_7203070 impostando campo 07780=COMODO989
- 6) Trasformare le FTD fittizie IL\_7203988 in IL\_7203070 impostando campo 07780=COMODO988