

F48_2	DETERMINAZIONE DEGLI IMPORTI SECURED IN OPERAZIONI DI RACCOLTA COLLATERALIZZATA DELLE BCC DA UN ISTITUTO CENTRALE
--------------	--

Tipo intermediario	Data pubblicazione	Data inizio validità	Data fine validità
B	2022 04 26	2022 08 31	9999 99 99

Generalità

L'art. 28, paragrafo 3 del RD fornisce le istruzioni per il calcolo dei deflussi per operazioni di prestito garantite e operazioni correlate ai mercati finanziari. Detto calcolo pone la necessità di individuare la quota *secured* in operazioni di raccolta collateralizzata. Per i PCT passivi si rimanda alla funzione F48_1; per la raccolta collateralizzata dall'Eurosistema alla F52. La presente funzione ha invece l'obiettivo di determinare la quota *secured* in operazioni di raccolta collateralizzata delle banche di credito cooperativo da un istituto centrale.

A tal fine la presente funzione, ordina separatamente le informazioni sulle operazioni di raccolta e quelle sugli strumenti finanziari forniti come garanzia. La funzione produce i suoi effetti attraverso la creazione del campo 05610 (DATA SCADENZA DELL'IMPEGNO) sulle attività impegnate.

Processo di calcolo

FASE 1: quadratura delle informazioni di input

- Selezionare le FTO di rapporto 01739.12/14 o 01807.06/08 o 01831.02 con campo 05197 uguale a 1 e le connesse FT degli strumenti forniti a garanzia:
 - a) FTO/FTA riferite a titoli 01063.11, 01621.00, 03904.02, 03904.06, 03936.02 che presentino il campo 00107=59 (TIPO IMPEGNO = A GARANZIA DI OPERAZIONI DI RACCOLTA COLLATERALIZZATA PRESSO L'ENTE CENTRALE);
 - b) FTA 09701.04 riferita a titoli ricevuti in garanzia che presenti i campi 00107=59 (TIPO IMPEGNO = A GARANZIA DI OPERAZIONI DI

RACCOLTA COLLATERALIZZATA PRESSO L'ENTE CENTRALE) e 05070=1 (TITOLO IN DISPONIBILITA');
|

c) FTO relative a crediti 01123.02, 01131.26/76, 01151.05, 01152.32, 01189.03 con campo 05107 uguale a 2 (ATTIVITA' IMPEGNATA PER RACCOLTA COLLATERALIZZATA PRESSO L'ENTE CENTRALE);

- Effettuare la somma dei campi 06060 (VALORE DELLA GARANZIA AL NETTO DELL'HAIRCUT APPLICATO DALLA CONTROPARTE FINANZIATRICE) sulle FTO/FTA dei titoli e dei crediti di cui alle lettere a), b) e c) del precedente punto e memorizzarla in COMODO1;
- Effettuare la somma dei campi 07000 delle varie FTO di rapporto e memorizzarli COMODO3 (quest'ultimo rappresenta il finanziamento effettivamente utilizzato dalla BCC, inclusivo dei ratei passivi e delle eventuali partite in corso di lavorazione);
- Se COMODO3 > di COMODO1 evidenziare un'anomalia bloccante all'azienda.

FASE 2: ordinamento dei record

1. Sulle FTO/FTA selezionate nella fase 1 relative ai titoli (caratterizzate dalla presenza del campo 00107) impostare i seguenti campi:

- **COMODO4** definito per il rispetto dei requisiti di cui all'art. 7 del RD:

valore 1 nel rispetto contemporaneo delle seguenti condizioni:

- ✓ campo 05256=0 (non emissione propria, per il rispetto della condizione di cui all'art. 7, paragrafo 3), derivato dalla procedura in base al campo 00032 e alle tabelle di corredo 13, 25 e 28;
- ✓ campo 05344=1,2 sulla FTO 01063.11 oppure campo 05143=1 sulle altre FTO (rispetto della condizione di cui all'art. 7, paragrafo 5);
- ✓ campo 00552=1 (quotato, per il rispetto della condizione di cui all'art. 7, paragrafo 6);

valore 0: negli altri casi

2. Ordinare i record secondo il seguente ordine di priorità:

- FTO/FTA selezionate nella fase 1 relative ai crediti;
 - FTO/FTA selezionate nella fase 1 relative ai titoli con le seguenti priorità:
 - Campo 05190 in ordine crescente (rispetto dei requisiti di cui all'art. 8), e quindi: "0", "1".
 - COMODO4 in ordine crescente
 - Campo 05196 in ordine decrescente;
3. Ordinare i record riferiti alle FTO 01739.12/14 o 01807.06/08 o 01831.02 con campo 05197 uguale a 1 in ordine crescente rispetto al campo 00010.

FASE 3: determinazione delle scadenze delle attività impegnate

1. Selezionare i primi "n" record delle FTO di rapporto ordinate nel precedente punto 3 della FASE 2 aventi medesimo campo 00010 uguale alla prima scadenza determinata dall'ordinamento e impostare il campo COMODO6 con la somma dei campi 07000 ed il campo COMODO7 = 00010.
2. Selezionare il primo record delle FTO/FTA ordinate nel precedente punto 2 della FASE 2 e, a partire dal primo record sul quale non risultano impostati i campi 05610 e 05620 e:
 - a) Se $\text{COMODO6} \geq 06060$:
 - Impostare sul record dei titoli/crediti il campo 06602 uguale al campo 06060 e i campi 05610 e 05620 uguale al campo COMODO7;
 - Impostare $\text{COMODO6} = \text{COMODO6} - 06060$: se $\text{COMODO6} = 0$ uscire dalla funzione; altrimenti leggere il successivo record delle garanzie (se i record sono terminati uscire dalla funzione) e reiterare i trattamenti del punto 2.a;
 - b) Se $\text{COMODO6} < 06060$
 - Impostare sul record dei titoli/crediti il campo 06602 con COMODO6, i campi 05610 e 05620 con COMODO7.
 - c) Se $\text{COMODO6} = 0$ andare al punto d;

d) Leggere i successivi record delle FTO/FTA ordinate nel precedente punto 2 della FASE 2 e ritornare al punto a (se i record sono terminati uscire dalla funzione).