

Tipo intermediario	Data pubblicazione	Data inizio validità	Data fine validità
B	2023 08 23	2023 12 31	9999 99 99

Generalità

La funzione ha l'obiettivo di produrre, a cadenza trimestrale, le voci aaaaa.00, bbbbb.00 e ccccc.00, sulla base delle voci xxxx1, xxxx2, xxxx3, xxxx5 e xxxx6 ottenute tramite le regole descritte nel database. La fase opera per ciascun programma di emissione (campo PROG_EMISS); i coefficienti vengono calcolati solo per i programmi che alla data di riferimento della segnalazione presentano obbligazioni bancarie garantite in circolazione.

Processo di calcolo

Per ogni "Programma di emissione" (campo PROG_EMISS) eseguire le seguenti sottofasi.

Sottofase 1: verifica preliminare

Verificare la presenza della FTD xxxx3.02. Se presente, passare alla sottofase 2; se assente, non calcolare i coefficienti e passare al successivo "Programma di emissione".

Sottofase 2: coefficiente di copertura basato sul valore nominale

Selezionare le FTD xxxx1.02-52 e xxxx3.02 ed eseguire quanto segue:

- Fare il rapporto tra il totale degli importi delle FTD xxxx1.02-52 e il totale degli importi della FTD xxxx3.02.
- Moltiplicare il risultato ottenuto per 10.000 e produrre con tale valore la voce aaaaa.00.

Sottofase 3: coefficiente di copertura basato sul valore attuale netto

Selezionare le FTD xxxx2.02-54 e xxxx3.06/12/16 ed eseguire quanto segue:

- Fare il rapporto tra il totale, come somma algebrica, degli importi delle FTD

xxxx2.02-54 e il totale degli importi delle FTD xxxx3.06/12/16.

- b) Moltiplicare il risultato ottenuto per 10.000 e produrre con tale valore la voce bbbbb.00.

Sottofase 4: coefficiente di copertura degli interessi

Selezionare le FTD xxxx5.02/04/06/08/10 e xxxx6.02/06/08/10 ed eseguire quanto segue:

- c) Fare il rapporto tra il totale, come somma algebrica, degli importi delle FTD xxxx5.02/04/06/08/10 e il totale, come somma algebrica, degli importi delle FTD xxxx6.02/06/08/10.
- d) Moltiplicare il risultato ottenuto per 10.000 e produrre con tale valore la voce ccccc.00.