

F81_1**CALCOLO DEI COEFFICIENTI DI COPERTURA**

Tipo intermediario	Data pubblicazione	Data inizio validità	Data fine validità
B	2023 11 30	2023 12 31	9999 99 99

Generalità

La funzione ha l'obiettivo di produrre, a cadenza trimestrale, le voci 62520.00, 62522.00 e 62524.00, sulla base delle voci 62500, 62504, 62508, 62514 e 62518 ottenute tramite le regole descritte nel database. La fase opera per ciascun programma di emissione (campo 02156); 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 02156) eseguire le seguenti sottofasi.

Sottofase 1: verifica preliminare

Verificare la presenza della FTD 62508.02. 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 62500.02-32 e 62508.02 ed eseguire quanto segue:

- Fare il rapporto tra il totale degli importi delle FTD 62500.02-32 e il totale degli importi della FTD 62508.02.
- Moltiplicare il risultato ottenuto per 10.000 e produrre con tale valore la voce 62520.00.

Sottofase 3: coefficiente di copertura basato sul valore attuale netto

Selezionare le FTD 62504.02-46 e 62508.06/12/16 ed eseguire quanto segue:

- a) Fare il rapporto tra il totale, come somma algebrica, degli importi delle FTD 62504.02-46 meno le FTD 62508.12/16 e il totale degli importi delle FTD 62508.06.
- b) Moltiplicare il risultato ottenuto per 10.000 e produrre con tale valore la voce 62522.00.

Sottofase 4: coefficiente di copertura degli interessi

Selezionare le FTD 62514.02/04/06/08/10 e 62518.02/06/08/10 ed eseguire quanto segue:

- c) Fare il rapporto tra il totale, come somma algebrica, degli importi delle FTD 62514.02/04/06/08/10 e il totale, come somma algebrica, degli importi delle FTD 62518.02/06/08/10.
- d) Moltiplicare il risultato ottenuto per 10.000 e produrre con tale valore la voce 62524.00.