

TCOR76	INFORMAZIONI SU TITOLI CONNESSI CON CARTOLARIZZAZIONI, COVERED BOND E POSIZIONI VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE DIVERSE DAI TITOLI (***)		
data pubblicazione 2024-01-17			
NOME CAMPO	LUNGHEZZA	TIPO	NOTE
CODICE CARTOLARIZZAZIONE	5	N	campo chiave a codifica aziendale
CODICE ISIN	12	A	campo chiave a codifica aziendale
CODICE RAPPORTO DEL FINANZIAMENTO (campo 00204)	12	A	campo chiave a codifica aziendale l'informazione viene determinata dalla procedura (R04_4) per le posizioni verso la cartolarizzazione diverse dai titoli.
VALORE NOMINALE DEI TITOLI IN CIRCOLAZIONE (il campo deve essere valorizzato solo per operazioni di cartolarizzazione che presentano l'attributo ATTIVITA' SOTTOSTANTI di TOCR38 pari a 0,1,2,3).	15	N	valore nominale della tranche cui appartiene il titolo
VALORE NOMINALE DEI FINANZIAMENTI IN CIRCOLAZIONE	15	N	l'informazione viene determinata dalla procedura (R04_4) per le posizioni verso la cartolarizzazione diverse dai titoli.
QUOTA DI PARTECIPAZIONE ALLA TRANCHE	6	N	(informazione determinata dalla procedura in % con 3 interi e 3 decimali)

TCOR76	INFORMAZIONI SU TITOLI CONNESSI CON CARTOLARIZZAZIONI, COVERED BOND E POSIZIONI VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE DIVERSE DAI TITOLI (***)		
data pubblicazione 2024-01-17			
NOME CAMPO	LUNGHEZZA	TIPO	NOTE

GRADO DI SENIORITY

(da alimentare ai fini reg 2401/2017 se ATTIVITA'
SOTTOSTANTI = 0,1,2,3 di TCOR38)

3

N

Il campo è da fornire con 3 interi (N.B.per la compilazione cfr I0503_3)

DURATA DEL SEGMENTO (ML) (da alimentare solo se viene utilizzato il metodo SEC-ERBA) (*)

(da alimentare ai fini reg 2401/2017 se ATTIVITA'
SOTTOSTANTI = 0,1,2,3 di TCOR38)

5

N

da fornire con 1 intero e 4 decimali, tra un valore compreso tra 1,0000 a 5,0000.

PUNTO DI ATTACCO (**)

(da alimentare ai fini reg 2401/2017 se ATTIVITA'
SOTTOSTANTI = 0,1,2,3 di TCOR38)

7

N

Il campo è da fornire con 1 intero e 6 decimali

TCOR76	INFORMAZIONI SU TITOLI CONNESSI CON CARTOLARIZZAZIONI, COVERED BOND E POSIZIONI VERSO LA CARTOLARIZZAZIONE DIVERSE DAI TITOLI (***)		
data pubblicazione 2024-01-17			
NOME CAMPO	LUNGHEZZA	TIPO	NOTE

PUNTO DI DISTACCO (**)

(da alimentare ai fini reg 2401/2017 se ATTIVITA' SOTTOSTANTI = 0,1,2,3 di TCOR38)

7

N

Il campo è da fornire con 1 intero e 6 decimali

PARAMETRO K_{SSFA(KA)} (**)

(da alimentare ai fini reg 2401/2017 se ATTIVITA' SOTTOSTANTI = 0,1,2,3 di TCOR38)

7

N

Il campo è da fornire con 1 intero e 6 decimali

N.B: I campi con (*) devono essere alimentati se la banca utilizza il metodo SEC-ERBA a prescindere dal digit di TCOR38 "modalità di alimentazione attivo cartolarizzato - calcolo parametri"

N.B: I campi con (**) devono essere alimentati nel caso in cui il digit di TCOR38 "modalità di alimentazione attivo cartolarizzato - calcolo parametri"=2 e la banca intende avvalersi delle funzionalità di calcolo del processo PUMA (F28_2) oppure se tale digit è pari a 3 e la banca è autorizzata all'applicazione del metodo SEC-ERBA.

(***)Attraverso il ragionamento R04_4 la tabella di corredo sarà arricchita con i record relativi alle informazioni delle posizioni verso la cartolarizzazione diverse dai titoli.