

F77_1	DETERMINAZIONE DELLE CONTROPARTI DETENTRICI PER RESOLUTION PLANS
--------------	---

Tipo intermediario	Data pubblicazione	Data inizio validità	Data fine validità
B	2025 11 XX	2025 12 31	9999 99 99

Generalità

La presente funzione è finalizzata all'individuazione delle controparti detentrici di titoli emessi dall'ente segnalante, ai fini della segnalazione *Resolution Plans*, nel caso in cui la banca non sia in grado di fornire in input, sulle FTO di titoli emessi, l'NDG dell'ultimo prenditore (campo 05630=0,assente)¹.

Essa deve operare prima della fase di generazione.

FASE 1:

1) Selezionare tutti i record delle FTO 01775.XX, 01777.XX, 01779.XX e 01837.02 con:

- campo 00138 uguale a 0 o assente e
- campo 05630 uguale a 0 o assente e
- campo 05312=P013, P020, P030

e a, parità di campo 00032 (codice ISIN) effettuare la somma dei campi 07704, 00602, 00609, 07000 riportandoli nei rispettivi campi COMODO07704, COMODO00602, COMODO00609 COMODO07000 e creare la seguente TABELLA "TITOLI EMESSI":

arricchire la tabella dei titoli emessi con i seguenti campi:

- campo 00678
- campo 06618

¹ Si precisa che per una corretta impostazione degli importi prodotti da tale funzione è fondamentale rispettare la regola di input che prevede l'alimentazione alternativa delle FTO di titoli emessi (campo 05630 valorizzato) o di quelle relative a titoli depositati (FTO 01625.xx) nel caso in cui si conosca la controparte detentrica.

TABELLA TITOLI EMESSI

ISIN	COMODO7704 Outstanding amount	COMODO00602 Outstanding principal amount	COMODO00609 (nominal amount per zero coupon)	COMODO07000 Carrying amount	(COMODO06618) Accrued interest	CAMPO 00678 tasso interesse annuo

2) Selezionare i record delle FTO 01625.XX il cui 'COD_ID_EMITT' di TCOR028, ricercato con campo 00032, sia uguale al "codice fiscale" presente nel file guida lavorazioni:

a. per ciascun record della FTO 01625.xx accedi a tabella TITOLI EMESSI con il codice ISIN e calcolare:

a.1.a per i titoli diversi da zero coupon (con 'TASSO IND' di TCOR028 <> 2): QUOTA_VN_KN (quota valore nominale known) del titolo depositato dal cliente = (campo 00609/COMODO00602) utilizzando il corrispondente COMODO00602 presente nella "TABELLA TITOLI EMESSI";

a.1.b per i titoli del tipo 'zero-coupon' (con 'TASSO IND' di TCOR028 = 2): QUOTA_VN_KN (quota valore nominale known) del titolo depositato dal cliente = (campo 00609/COMODO00609) utilizzando il corrispondente COMODO00609 presente nella "TABELLA TITOLI EMESSI";

e impostare i seguenti campi importo e riportare sulle FTO 01625.xx:

a.2 IMP_OA_KN (*oustanding amount*) titolo depositato dal cliente (**06704**) = QUOTA_VN_KN *COMODO07704;

a.4IMP_PA_KN (*principal amount*) titolo depositato dal cliente (**06702**) = QUOTA_VN_KN *COMODO00602;

a.5 IMP_CA_KN (*carrying amount*) titolo depositato dal cliente (**07604**) = QUOTA_VN_KN *COMODO07000;

a.6 IMP_ACCR_INT_KN (*accrued interest*) titolo depositato dal cliente (**06618**) = QUOTA_VN_KN *(COMODO06618);

riportare sulle FTO 01625.xx anche:

- il valore del campo 00678 presente sulle FTO di titoli emessi;

b. calcolare il totale dell'importo "**KNOWN**" sommando nel TOT_IMP_OA_KN gli importi 06704 (IMP_OA_KNOWN) calcolati al punto a.2;

c. calcolare la quota "**UNKNOWN**" per ciascun ISIN nel seguente modo:

c.1 imposta campo **05687** QUOTA_OA_UNKONWN = 1-
(TOT_IMP_OA_KN/COMODO07704)

c.2 per ciascun record delle FTO relative ai titoli emessi selezionate al punto 1) calcolare i seguenti importi e riportarli sul record in lavorazione:

c.2.1 imposta campo **07705** (O.A. UNKN)=07704* QUOTA_OA_UNKONWN

c.2.2 imposta campo **06706** (P.A._UNKN)=00602* QUOTA_OA_UNK

c.2.3 imposta campo **07708** (CA_UNKN)=07000* QUOTA_OA_UNK

c.2.4 imposta campo **06620** (ACCR_INT_UNKN)=(07704-00602)*QUOTA_OA_UNK

Nel caso in cui l'ISIN non sia presente nella tabella 'TITOLI DEPOSITATI' occorre impostare sulle FTO dei titoli emessi il campo 05687=1.