

Generalità

La presente funzione è finalizzata all'individuazione, ai fini del template C. 67.00 degli *additional liquidity monitoring metrics*, delle prime dieci controparti finanziatrici, ciascuna delle quali eccedente l'1% del totale delle passività (cfr. riga 300 del template F01.02 – Q&A 2015_1952).

Essa deve operare completata la fase di generazione e prima del compattamento.

Processo di calcolo

Fase 1:

In fase di generazione si ottiene per ogni FTO del passivo (template F01.02) una FTD intermedia 50000.01 per le passività finanziarie o 50000.03 per le altre passività; quindi elaborando tali FTD occorre:

- a) calcolare la soglia di rilevanza dell'1% sul totale delle passività (somma dei campi importo delle predette 50000.01 e 50000.03¹), memorizzandola nel comodo "SOGLIA";
- b) le FTD intermedie 50000.03 d'ora in avanti non devono essere più considerate;
- c) arricchire ogni record con FTD 50000.01 prodotto dalla fase di generazione con i seguenti comodi:
 - "saldo per giorni durata originaria" (DUR ORIG) ottenuto moltiplicando il saldo (CAMPO 07000) per il CAMPO 05246 (numero giorni di durata originaria);

¹ Le suddette FTD dovranno essere riutilizzate per altri trattamenti (es. F54_2).

- “saldo per giorni durata residua” (DUR RES) ottenuto moltiplicando il saldo (CAMPO 07000) per il CAMPO 05247 (numero giorni di durata residua);
- “soggetto finanziatore” (SF) e “cliente/gruppo” (CG) da valorizzare nel seguente modo:
 - se campo 02252 è diverso da 10, imposta il COMODO SF = 00359 e il COMODO CG = G altrimenti imposta il COMODO SF = 00030 e il COMODO CG = C;
- d) totalizzare gli importi a parità di COMODO SF, creando in tal modo un “cluster” di operazioni di raccolta riferibile ad ogni soggetto controparte;
- e) confrontare ogni “cluster” con il comodo “SOGLIA” e identificare i “cluster” che non superano il comodo “SOGLIA”, arricchendoli con il comodo “classifica primi dieci finanziatori” (POS CLASS) valorizzato a “99”;
- f) ordinare i “cluster” che superano il comodo “SOGLIA” in modo decrescente di importo, arricchendoli con il comodo “classifica primi dieci finanziatori” (POS CLASS) in base alla posizione assunta (01, 02, 03, ecc.) fino a un massimo di dieci posizioni se sussistono. Agli eventuali “cluster” residui (che superano la decima posizione) attribuire il valore “99” al comodo POS CLASS;
- g) a parità di soggetto finanziatore (SF), per i soli record con comodo POS CLASS diverso da “99”, costruire il “product type” prevalente di ciascuna posizione (il tipo prodotto memorizzato nel CAMPO 05245 con importo più elevato) memorizzando l’informazione nel comodo PREVAL.
- h) Nel caso in cui il campo 05631 sia uguale a 1, sovrascrivere il comodo PREVAL (come sopra calcolato) con il valore 292 (INFRAGRUPPO)²

A questo punto disponiamo fino ad un massimo di undici cluster di record costituiti da quelli che, fino ad un massimo di dieci, sono posizioni significative

² Nel caso in cui, a parità di soggetto, emergessero valori discordanti sul campo 05631 dare evidenza dell’errore.

destinate alla sezione 1, più il cluster residuale contenente tutto il resto della raccolta della banca destinato alla sezione 2.

i) a parità di POS CLASS (incluso quello residuale):

- calcolare la durata originaria media ponderata come risultato della seguente formula: $\sum \text{DUR ORIG} / \sum \text{dei CAMPI 07000}$ e memorizzare il risultato nel comodo "media ponderata durata originaria" (MEDIA ORIG);
- calcolare la durata residua media ponderata come risultato della seguente formula: $\sum \text{DUR RES} / \sum \text{dei CAMPI 07000}$ e memorizzare il risultato nel comodo "media ponderata durata residua" (MEDIA RES);

j) per tutti i record con POS CLASS da 01 a 10 incluso, dopo aver eseguito il processo descritto al punto precedente, produrre un record di totale con FTD 59341.02 redatta conformemente alle istruzioni segnaletiche contenute nella Circolare n.154 secondo il seguente schema:

50000.01 59341.02 00003=1 00004=1 00005=3 00007.. 00350=21 02070.. 02072.. 07000..

Campo Importo 07000 pari al totale degli importi dei record componenti l'insieme trattato

Media ponderata durata originaria e residua (campi 02070 e 02072) calcolate con modalità analoghe a quelle descritte al punto precedente.

k) produrre per ogni insieme con POS CLASS diverso da "99", un record (FTD da 59341.04 a 59341.22), redatto conformemente alle istruzioni segnaletiche contenute nella Circolare n.154 secondo il seguente schema:

50000.01 59341.04/22 00003=1 00004=1 00005=3 00007.. 00011.. 00212.. 00350=21 01167.. 02070.. 02072.. 07000..

Campo 00212 relativo al comodo SF

Campo 00011: se comodo CG=C col campo 00011, altrimenti col valore “non applicabile” (777)

Campo 01167 col valore del comodo PREVAL

Campo Importo 07000 pari al totale degli importi dei record componenti l'insieme trattato

Media ponderata durata originaria e residua (campi 02070 e 02072) calcolate con modalità analoghe a quelle descritte al punto precedente

Il campo 00212 si ottiene dalla conversione del codice anagrafico aziendale presente nella 50000.01 considerata (CAMPO 00359 e CAMPO 00030).

- a. Per l'insieme dei record con POS CLASS uguale a “99”, produrre un record con FTD 59341.24 redatta conformemente alle istruzioni segnaletiche contenute nella Circolare n.154 secondo il seguente schema:

50000.01 59341.24 00003=1 00004=1 00005=3 00007.. 00350=21 02070.. 02072.. 07000..

Campo Importo 07000 pari al totale degli importi dei record componenti l'insieme trattato

Media ponderata durata originaria e residua (campi 02070 e 02072) calcolate con modalità analoghe a quelle descritte al punto precedente.

Concluse le operazioni sopra descritte, inviare i record con FTD 59341.XX alla fase di compattamento.