

F54	ADDITIONAL LIQUIDITY MONITORING METRICS
------------	--

Tipo intermediario	B
--------------------	----------

Generalità

Le funzioni specifiche da eseguire nel processo di produzione delle segnalazioni degli Additional liquidity monitoring metrics sono le seguenti:

F54_1 – DETERMINAZIONE DELLE PRIME DIECI CONTROPARTI FINANZIARIE

F54_2 – DETERMINAZIONE DEI PRODOTTI SIGNIFICATIVI

I processi descritti devono essere eseguiti almeno una volta per la produzione dei template “TOTAL”, cioè riferiti all’insieme della raccolta indipendentemente dalla valuta nella quale essa è effettuata.

Per la compilazione delle informazioni relative alle eventuali “valute significative” (pari o superiori al 5% delle passività totali della banca) è sufficiente reiterare il medesimo processo distintamente valuta per valuta, fermo restando che la soglia dell’1% è unica e viene calcolata per il foglio del totale. In segnalazione occorre inviare solo le valute che presentano il digit VALUTA RILEVANTE PER LIQUIDITA’ di TCOR01 uguale a 1¹.

¹ Si precisa che l’euro non dovrà essere segnalato tra le valute significative.