

Specifiche per la trasmissione informatica dei dati

Di seguito sono riportate le modifiche alle specifiche per la trasmissione informatica dei dati impartite con la circolare 358/D del 15/01/1999.

Si ricorda che i *file* da trasmettere sono denominati **XXTAAAAI.ZZZ**, dove:

- XX indica il tipo di dato e può assumere i seguenti valori:
 - “PA” prospetto di copertura (Modello 1);
 - “AA” allegato A al prospetto di copertura;
 - “AB” allegato B al prospetto di copertura;
 - “BB” prospetto di copertura ex art. 30 commi 1 e 2 (Modello 2);
 - “EA” elenco attivi della categoria A;
 - “EE” elenco attivi a copertura riserve ex art. 30 commi 1 e 2;
- T rappresenta il trimestre cui l'invio fa riferimento (1,2,3,4);
- AAAA rappresenta l'anno cui l'invio fa riferimento;
- I indica la tipologia dell'invio:
 - “1” ordinario;
 - “2” comunicazione annuale allegata al bilancio.
- ZZZ è il codice ISVAP della compagnia.

File PATAAAAI.ZZZ

La struttura del record non subisce modifiche; le nuove voci sono contrassegnate all'interno del *file* con il codice numerico indicato nei prospetti.

File EATAAAAI.ZZZ - record di dettaglio per gli elenchi degli investimenti della categoria A:

Di seguito sono riportate le specifiche di valorizzazione dei campi modificate in relazione alle nuove classi di attivi ammessi a copertura delle riserve tecniche. La codifica delle nuove classi è riportata nell'Allegato 2.

Posizione	Lungh	Tipo	Descrizione
1	3	AN	tipo record: 'EA2'
4	1	AN	gestione: "D" danni, "V" vita
5	2	AN	codice della classe di attività (Allegato 2)
7	5	NU	<ul style="list-style-type: none">• per gli attivi riferiti a contratti allegato B: codice identificativo del contratto• per gli altri attivi: zero

Posizione	Lungh	Tipo	Descrizione
<i>Dati relativi all'investimento a copertura</i>			
12	50	AN	<ul style="list-style-type: none"> classi A.1.1a, A.1.1b, A.1.2a, A.1.2b, A.1.3, A.1.4, A.3.1a, A.3.1b, A.3.2, A.3.3, A.3.4, A.4.4, A.5.1a, A.5.1b, A.5.2a, A.5.2b: denominazione del titolo o del fondo; classe A.1.5: denominazione del titolo sottostante; classe A.1.6: denominazione dell'istituto di credito accentrante; classe A.1.7: denominazione della società garante classe A.1.8: denominazione del titolo cui è riferito il rateo classe A.2: denominazione della società o ente garante per i mutui non garantiti da ipoteca classi A.4.1, A.4.2: ubicazione dell'immobile (comune ed indirizzo) classe A.4.3: spazio
62	12	AN	<ul style="list-style-type: none"> classi A.1.1a, A.1.1b, A.1.2a, A.1.2b, A.1.3, A.1.4, A.1.8, A.3.1a, A.3.1b A.3.2, A.3.3, A.3.4, A.4.4, A.5.1a, A.5.1b, A.5.2a, A.5.2b: codice isin del titolo o del fondo classe A.4.1, A.4.2: codice identificativo dell'immobile (lo stesso riportato nel corrispondente modulo di vigilanza allegato al bilancio d'esercizio)
74	3	AN	classi A.1.5, A.1.6, A.1.7, A.2, A.4.3, A.4.4: codice valuta dell'investimento (Codice numerico U.I.C.)
77	8	NU	classi A.1.5, A.1.6, A.1.7, A.2: data scadenza dell'investimento (aaaammgg);
85	15	NU	classi A.1.4, A.3.1a, A.3.1b, A.3.2, A.3.3, A.3.4, A.4.4, A.5.1a, A.5.1b, A.5.2a, A.5.2b: numero quote, azioni o warrant
100	1	NU	<ul style="list-style-type: none"> classe A.1.2b: "1" se trattasi di deposito bancario con prelevamento soggetto a vincoli di tempo "0" negli altri casi classe A.2: "0" per mutui e prestiti non garantiti da ipoteche "1" per mutui e prestiti garantiti da ipoteca di primo grado "2" per mutui e prestiti garantiti da ipoteca di grado superiore al primo
101	2	AN	classi A.1.1a, A.1.2a, A.3.1a, A.3.2 <ul style="list-style-type: none"> nel caso in cui lo Stato dell'emittente non coincida con quello in cui ha sede il mercato regolamentato nel quale è negoziato il titolo: codice del mercato regolamentato nel quale è quotato il titolo (Allegato 6 alla circolare 358 D) altrimenti: spazio

Posizione	Lungh	Tipo	Descrizione
			- classi A.1.1a, A.1.1b, A.1.2a, A.1.2b, A.1.3, A.5.2a, A.5.2b per titoli con rating: specificare i dati relativi al rating di più recente attribuzione - altre classi e/o titoli senza rating: spazio
103	2	AN	codice della società di rating (Allegato 7 alla circolare 358 D)
105	20	AN	classe di rating
125	8	NU	data di assegnazione del rating (aaaammgg)
133	1	NU	<ul style="list-style-type: none"> classi A.1.1a, A.1.1b, A.1.2a, A.1.2b, A.1.3, A.5.2a, A.5.2b per titoli con regimi cedolari misti (fisso/variabile): "1" altre classi e/o titoli con regimi cedolari semplici: "0"
134	1	NU	<ul style="list-style-type: none"> classi A.1.1a, A.1.1b, A.1.2a, A.1.2b, A.1.3, A.5.2a, A.5.2b per titoli con regimi cedolari misti (fisso/variabile) basati su meccanismi di determinazione indiretta del tasso variabile: "1" altre classi e/o titoli con regimi cedolari semplici: "0"
			<i>Dati relativi alla controparte dell'investimento</i>
135	35	AN	<ul style="list-style-type: none"> classe A.1.5: denominazione controparte dell'operazione (banca, sim, etc) classe A.1.6: denominazione impresa traente classe A.1.7: denominazione impresa emittente classe A.2: denominazione del mutuatario classe A.4.3: denominazione della società immobiliare
170	16	AN	classi A.1.5, A.1.6, A.1.7, A.2, A.4.3 in caso di controparti italiane: codice fiscale della controparte dell'investimento
186	3	AN	classi A.1.5, A.1.6, A.1.7, A.2, A.4.3: codice dello Stato di appartenenza della controparte (Codice numerico U.I.C.)
189	15	NU	classi A.3.1a, A.3.1b: capitale sociale dell'impresa emittente
204	1	NU	<ul style="list-style-type: none"> "1" nell'ipotesi di cui agli artt. 2, comma 2 dei provvedimenti 147, 148 "0" negli altri casi
205	35	AN	classi A.1.1a, A.1.1b, A.1.2a, A.1.2b, A.1.3 - nel caso di titoli "credit linked" (titoli con clausola di trasferimento parziale o totale del rischio di controparte a soggetti diversi dalla società emittente): denominazione della controparte verso la quale transita il rischio

<i>Posizione</i>	<i>Lungh</i>	<i>Tipo</i>	<i>Descrizione</i>
<i>Dati relativi agli importi a copertura</i>			
240	15	NU	<ul style="list-style-type: none"> classi A.1.1a, A.1.1b, A.1.2a, A.1.2b, A.1.3, A.1.4, A.1.5, A.3.1a, A.3.1b, A.5.1a, A.5.1b, A.5.2a, A.5.2b: valore nominale complessivo dell'investimento a copertura classi A.4.1, A.4.2: valore complessivo di bilancio dell'immobile al netto del fondo di ammortamento
255	15	NU	importo a copertura
270	15	NU	classe A.4.1: valore complessivo dell'ipoteca
285	2	AN	caratteri ASCII "CR" e "LF"

Codici delle attività destinabili alla copertura delle riserve tecniche

Identificativo attività come da prospetti	Codice classe
A.1.1a	01
A.1.1b	02
A.1.2a	03
A.1.2b	04
A.1.3	05
A.1.4	06
A.1.5	07
A.1.6	08
A.1.7	09
A.1.8	10
A.2	11
A.3.1a	12
A.3.1b	13
A.3.2	14
A.3.3	15
A.3.4	16
A.4.1	17
A.4.2	18
A.4.3	19
A.4.4 (*)	20
A.5.1a	22
A.5.1b	23
A.5.2a	24
A.5.2b	25

(*) Per la gestione vita, le vecchie classi A.4.4 e A.4.5 confluiscono nell'unica classe A.4.4