

REGOLAMENTO DI ESECUZIONE (UE) 2020/1225 DELLA COMMISSIONE**del 29 ottobre 2019****che stabilisce le norme tecniche di attuazione per quanto riguarda il formato e i moduli standardizzati per la messa a disposizione delle informazioni e dei dati sulle cartolarizzazioni da parte del cedente, del promotore e della SSPE****(Testo rilevante ai fini del SEE)**

LA COMMISSIONE EUROPEA,

visto il trattato sul funzionamento dell'Unione europea,

visto il regolamento (UE) 2017/2402 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 12 dicembre 2017, che stabilisce un quadro generale per la cartolarizzazione, instaura un quadro specifico per cartolarizzazioni semplici, trasparenti e standardizzate e modifica le direttive 2009/65/CE, 2009/138/CE e 2011/61/UE e i regolamenti (CE) n. 1060/2009 e (UE) n. 648/2012 ⁽¹⁾, in particolare l'articolo 7, paragrafo 4, e l'articolo 17, paragrafo 3,

considerando quanto segue:

- (1) L'ambito di applicazione dell'articolo 7, paragrafo 4, del regolamento (UE) 2017/2402 riguarda tutte le cartolarizzazioni, comprese quelle il cui prospetto deve essere compilato a norma del regolamento (UE) 2017/1129 ⁽²⁾ (denominate comunemente cartolarizzazioni «pubbliche») e quelle per le quali non è necessario redigere un prospetto (denominate comunemente cartolarizzazioni «private»). L'articolo 17, paragrafo 3, del regolamento (UE) 2017/2402 fa riferimento alle cartolarizzazioni le cui informazioni sono messe a disposizione tramite un repertorio di dati sulle cartolarizzazioni, escludendo pertanto le cartolarizzazioni private.
- (2) Le cartolarizzazioni sono complesse ed eterogenee. Per consentire l'efficiente raccolta e valutazione dei dati da parte degli investitori, dei potenziali investitori, delle autorità competenti e, per le cartolarizzazioni pubbliche, da parte degli altri soggetti elencati all'articolo 17, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2017/2402, le informazioni di cui all'articolo 7, paragrafo 1, lettere a) ed e), e all'articolo 17, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2017/2402 dovrebbero essere messe a disposizione in un formato armonizzato. Inoltre, laddove le informazioni debbano essere messe a disposizione tramite un repertorio di dati sulle cartolarizzazioni, il formato armonizzato facilita anche la perfetta aggregazione e comparazione dei dati detenuti dai diversi repertori.
- (3) Dovrebbero essere ridotti al minimo i costi per i partecipanti al mercato. Pertanto, il formato di segnalazione delle cartolarizzazioni dovrebbe essere per quanto possibile analogo a quello prescritto per la segnalazione dei contratti derivati ai sensi dell'articolo 9 del regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio ⁽³⁾ e per la segnalazione delle informazioni relative alle operazioni di finanziamento tramite titoli (SFT) ai sensi dell'articolo 4 del regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio ⁽⁴⁾. Inoltre, laddove le informazioni sono messe a disposizione tramite un repertorio di dati sulle cartolarizzazioni, il formato di segnalazione dovrebbe tenere conto anche delle soluzioni sviluppate dagli attuali centri di raccolta di dati sulle cartolarizzazioni. È quindi opportuno imporre, anche per la segnalazione relativa alle cartolarizzazioni, l'uso del formato XML, comunemente utilizzato per la segnalazione delle informazioni su prestiti e analoghe esposizioni sottostanti.
- (4) Le disposizioni del presente regolamento sono strettamente interconnesse in quanto determinano il formato e i modelli con cui il cedente, il promotore o la SSPE di una cartolarizzazione devono mettere a disposizione di varie parti le informazioni relative a tale cartolarizzazione, come previsto dal regolamento (UE) 2017/2402. Per garantire la coerenza tra dette disposizioni, che dovrebbero entrare in vigore contemporaneamente, e per offrire una visione globale e un accesso agevole a tutte le informazioni pertinenti della cartolarizzazione, è necessario riunire tali norme tecniche di attuazione in un unico regolamento.

⁽¹⁾ GU L 347 del 28.12.2017, pag. 35.

⁽²⁾ Regolamento (UE) 2017/1129 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 14 giugno 2017, relativo al prospetto da pubblicare per l'offerta pubblica o l'ammissione alla negoziazione di titoli in un mercato regolamentato, e che abroga la direttiva 2003/71/CE (GU L 168 del 30.6.2017, pag. 12).

⁽³⁾ Regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 4 luglio 2012, sugli strumenti derivati OTC, le controparti centrali e i repertori di dati sulle negoziazioni (GU L 201 del 27.7.2012, pag. 1).

⁽⁴⁾ Regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 25 novembre 2015, sulla trasparenza delle operazioni di finanziamento tramite titoli e del riutilizzo e che modifica il regolamento (UE) n. 648/2012 (GU L 337 del 23.12.2015, pag. 1).

- (5) Il presente regolamento si basa sul progetto di norme tecniche di attuazione che l'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (ESMA) ha presentato alla Commissione.
- (6) L'ESMA ha condotto una consultazione pubblica aperta sul progetto di norme tecniche di attuazione sul quale è basato il presente regolamento, ha analizzato i potenziali costi e benefici collegati e ha chiesto il parere del gruppo delle parti interessate nel settore degli strumenti finanziari e dei mercati istituito dall'articolo 37 del regolamento (UE) n. 1095/2010 del Parlamento europeo e del Consiglio ⁽⁵⁾,

HA ADOTTATO IL PRESENTE REGOLAMENTO:

SEZIONE 1

MODELLI PER TUTTE LE CARTOLARIZZAZIONI

Articolo 1

Modelli per le esposizioni sottostanti

1. Le informazioni di cui all'articolo 2, paragrafi 1 e 2, del regolamento delegato (UE) 2020/1224 della Commissione ⁽⁶⁾, sono messe a disposizione utilizzando i seguenti modelli:
- a) il modello di cui all'allegato II del presente regolamento per i prestiti alle famiglie garantiti da immobili residenziali, indipendentemente dalla finalità di tali prestiti;
 - b) il modello di cui all'allegato III del presente regolamento per i prestiti destinati all'acquisto di immobili non residenziali o garantiti da immobili non residenziali;
 - c) il modello di cui all'allegato IV del presente regolamento per le esposizioni sottostanti verso imprese, comprese le esposizioni sottostanti verso microimprese e piccole e medie imprese;
 - d) il modello di cui all'allegato V del presente regolamento per le esposizioni sottostanti su automobili, compresi sia i prestiti che i leasing a persone fisiche o giuridiche garantiti da automobili;
 - e) il modello di cui all'allegato VI del presente regolamento per le esposizioni sottostanti verso consumatori;
 - f) il modello di cui all'allegato VII del presente regolamento per le esposizioni sottostanti su carte di credito;
 - g) il modello di cui all'allegato VIII del presente regolamento per le esposizioni sottostanti su leasing;
 - h) il modello di cui all'allegato IX del presente regolamento per le esposizioni sottostanti che non rientrano in nessuna delle categorie di cui alle lettere da a) a g).
2. Le informazioni di cui all'articolo 2, paragrafo 3, del regolamento delegato (UE) 2020/1224 sono messe a disposizione utilizzando i seguenti modelli:
- a) i modelli di cui al paragrafo 1 del presente articolo, in funzione del tipo di esposizione sottostante;
 - b) il modello di cui all'allegato X per le cartolarizzazioni di esposizioni deteriorate di cui all'articolo 2, paragrafo 3, secondo comma, del regolamento delegato (UE) 2020/1224.
3. Le informazioni di cui all'articolo 2, paragrafo 4, del regolamento delegato (UE) 2020/1224 sono messe a disposizione utilizzando il modello di cui all'allegato XI.

⁽⁵⁾ Regolamento (UE) n. 1095/2010 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 24 novembre 2010, che istituisce l'Autorità europea di vigilanza (Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati), modifica la decisione n. 716/2009/CE e abroga la decisione 2009/77/CE della Commissione (GU L 331 del 15.12.2010, pag. 84).

⁽⁶⁾ Regolamento delegato (UE) 2020/1224 della Commissione, del 16 ottobre 2019, che integra il regolamento (UE) 2017/2402 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione che specificano le informazioni e i dati sulle cartolarizzazioni che devono essere messi a disposizione dal cedente, dal promotore e dalla SSPE (Cfr. pag. 1 della presente Gazzetta ufficiale).

*Articolo 2***Modelli per le comunicazioni agli investitori**

1. Le informazioni di cui all'articolo 3, paragrafo 1, del regolamento delegato (UE) 2020/1224 sono messe a disposizione utilizzando il modello di cui all'allegato XII.
2. Le informazioni di cui all'articolo 3, paragrafo 2, del regolamento delegato (UE) 2020/1224 sono messe a disposizione utilizzando il modello di cui all'allegato XIII.

SEZIONE 2

MODELLI PER LE CARTOLARIZZAZIONI PER CUI OCCORRE REDIGERE UN PROSPETTO (CARTOLARIZZAZIONI PUBBLICHE)*Articolo 3***Modelli per le informazioni privilegiate**

1. Le informazioni di cui all'articolo 6, paragrafo 1, del regolamento delegato (UE) 2020/1224 sono messe a disposizione utilizzando il modello di cui all'allegato XIV.
2. Le informazioni di cui all'articolo 6, paragrafo 2, del regolamento delegato (UE) 2020/1224 sono messe a disposizione utilizzando il modello di cui all'allegato XV.

*Articolo 4***Modelli per gli eventi significativi**

1. Le informazioni di cui all'articolo 7, paragrafo 1, del regolamento delegato (UE) 2020/1224 sono messe a disposizione utilizzando il modello di cui all'allegato XIV.
2. Le informazioni di cui all'articolo 7, paragrafo 2, del regolamento delegato (UE) 2020/1224 sono messe a disposizione utilizzando il modello di cui all'allegato XV.

SEZIONE 3

DISPOSIZIONI COMUNI*Articolo 5***Formato delle informazioni**

1. Il formato delle informazioni fornite nei modelli di cui agli allegati da I a XV corrisponde al formato indicato nella tabella 1 dell'allegato I.
2. Le informazioni sono messe a disposizione in formato elettronico e leggibile da dispositivo automatico tramite modelli XML comuni.

*Articolo 6***Entrata in vigore**

Il presente regolamento entra in vigore il ventesimo giorno successivo alla pubblicazione nella *Gazzetta ufficiale dell'Unione europea*.

Il presente regolamento è obbligatorio in tutti i suoi elementi e direttamente applicabile in ciascuno degli Stati membri.

Fatto a Bruxelles, il 29 ottobre 2019

Per la Commissione
Il president
Jean Claude JUNCKER

ALLEGATO I

Formati dei campi

| SIMBOLO | TIPO DI DATI | DEFINIZIONE |
|------------------|---|--|
| {ALPHANUM-n} | Fino a n caratteri alfanumerici | Campo di testo libero. Da inserire in formato ASCII in lettere maiuscole (senza caratteri accentati). |
| {COUNTRYCODE_2} | 2 caratteri alfanumerici | Codice del paese a 2 lettere in base ai codici paese alpha-2 dell'ISO 3166-1. Da inserire in formato ASCII (senza caratteri accentati). |
| {CURRENCYCODE_3} | 3 caratteri alfanumerici | Codice della valuta a 3 lettere secondo i codici valuta di ISO 4217. Da inserire in formato ASCII (senza caratteri accentati). |
| {YEAR} | Formato dell'anno ISO 8601 | Gli anni devono essere formattati come segue: AAAA |
| {DATEFORMAT} | Formato della data secondo ISO 8601 | Le date devono essere formattate come segue: AAAA-MM-GG |
| {MONETARY} | 0-18 cifre, di cui fino a 5 possono essere cifre frazionarie. | Un numero di unità monetarie specificate in una valuta, in cui l'unità monetaria è esplicita e conforme a ISO 4217. |
| {NUMERIC} | 0-18 cifre, di cui fino a 5 possono essere cifre frazionarie. | Fino a un massimo di 18 caratteri numerici compresi al massimo 5 decimali. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito deve essere rappresentato da un punto. |
| {INTEGER-n} | Numero intero fino a n | Campo numerico per valori interi sia positivi sia negativi. |
| {Y/N} | 1 carattere alfanumerico | «vero» — Y «falso» — N |
| {ISIN} | 12 caratteri alfanumerici | Codice ISIN secondo ISO 6166 |
| {LEI} | 20 caratteri alfanumerici | Identificativo del soggetto giuridico, come specificato in ISO 17442 |
| {LIST} | | Come stabilito nella descrizione specifica del campo. |
| {NUTS} | 5 caratteri alfanumerici | Riferirsi alla Nomenclatura delle unità territoriali per la statistica di Eurostat. Le informazioni devono essere fornite al livello NUTS3. http://ec.europa.eu/eurostat/web/nuts/ |
| {NACE} | 7 caratteri alfanumerici | Si riferisce alla classificazione statistica delle attività economiche nell'Unione europea pubblicata sul sito citato in questo riquadro come stabilito dal regolamento (CE) n. 1893/2006 del Parlamento europeo e del Consiglio ⁽¹⁾ . Per ogni attività economica deve essere reso disponibile il livello di classificazione più dettagliato (ossia il codice completo a livello di 6 o 7 caratteri, compresi i decimali) http://ec.europa.eu/competition/mergers/cases/index/nace_all.html . |

| SIMBOLO | TIPO DI DATI | DEFINIZIONE |
|--------------|---|--|
| {PERCENTAGE} | 0-11 cifre, di cui fino a 10 possono essere cifre frazionarie. | Tasso espresso in percentuale, ossia in centinaia, ad esempio, 0,7 è 7/10 di cento e 7,0 è 7 %. |
| {TELEPHONE} | Il segno «+» seguito dal codice del paese (da 1 a 3 caratteri) e dal segno «-» e infine una qualsiasi combinazione di numeri; «(», «)», «+» e «-» (massimo 30 caratteri). | Le informazioni che consentono di individuare uno specifico numero di telefono come definito dai servizi di telecomunicazione. |
| {ESA} | 7 caratteri alfanumerici | Il settore secondo il sistema europeo dei conti (2010), utilizzando i codici di cui all'allegato I, tabella 1, del regolamento delegato (UE) 2020/1224 messi a disposizione dal cedente, dal promotore e dalla SSPE ⁽²⁾ http://ec.europa.eu/eurostat/cache/metadata/Annexes/nasa_10_f_esms_an1.pdf |
| {WATCHLIST} | 2 caratteri alfanumerici | Il codice dell'elenco di controllo del gestore (servicer) di cui all'allegato I, tabella 2, del regolamento delegato (UE) 2020/1224 messo a disposizione dal cedente, dal promotore e dalla SSPE. |

(¹) Regolamento (CE) n. 1893/2006 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 20 dicembre 2006, che definisce la classificazione statistica delle attività economiche NACE Revisione 2 e modifica il regolamento (CEE) n. 3037/90 del Consiglio nonché alcuni regolamenti (CE) relativi a settori statistici specifici (GU L 393 del 30.12.2006, pag. 1).

(²) Regolamento delegato (UE) 2020/1224 della Commissione, del 16 ottobre 2019, che integra il regolamento (UE) 2017/2402 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione che specificano le informazioni e i dati sulle cartolarizzazioni che devono essere messi a disposizione dal cedente, dal promotore e dalla SSPE (Cfr. pag. ... della presente Gazzetta ufficiale).

ALLEGATO II

Modello per le esposizioni sottostanti — Immobili residenziali (RRE)

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|---|--|------------------|
| Sezione relativa alle informazioni sulle esposizioni sottostanti | | |
| RREL1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| RREL2 | Identificativo originario dell'esposizione sottostante | {ALPHANUM-1000} |
| RREL3 | Nuovo identificativo dell'esposizione sottostante | {ALPHANUM-1000} |
| RREL4 | Identificativo originario del debitore | {ALPHANUM-1000} |
| RREL5 | Nuovo identificativo del debitore | {ALPHANUM-1000} |
| RREL6 | Data limite dei dati | {DATEFORMAT} |
| RREL7 | Data di aggiunta all'aggregato | {DATEFORMAT} |
| RREL8 | Data di riacquisto | {DATEFORMAT} |
| RREL9 | Data di riscatto | {DATEFORMAT} |
| RREL10 | Residente | {Y/N} |
| RREL11 | Regione geografica — debitore | {NUTS} |
| RREL12 | Classificazione delle regioni geografiche | {YEAR} |
| RREL13 | Situazione occupazionale | {LIST} |
| RREL14 | Debitore di affidabilità creditizia deteriorata | {Y/N} |
| RREL15 | Tipo di cliente | {LIST} |
| RREL16 | Reddito principale | {MONETARY} |
| RREL17 | Tipo di reddito principale | {LIST} |
| RREL18 | Valuta del reddito principale | {CURRENCYCODE_3} |
| RREL19 | Verifica del reddito principale | {LIST} |
| RREL20 | Reddito secondario | {MONETARY} |
| RREL21 | Verifica del reddito secondario | {LIST} |
| RREL22 | Regime speciale | {ALPHANUM-10000} |
| RREL23 | Data di creazione | {DATEFORMAT} |
| RREL24 | Data di scadenza | {DATEFORMAT} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|---|------------------|
| RREL25 | Durata originaria | {INTEGER-9999} |
| RREL26 | Canale di creazione | {LIST} |
| RREL27 | Finalità | {LIST} |
| RREL28 | Valuta di denominazione | {CURRENCYCODE_3} |
| RREL29 | Saldo originario del capitale | {MONETARY} |
| RREL30 | Saldo corrente del capitale | {MONETARY} |
| RREL31 | Saldi del capitale di rango prioritario | {MONETARY} |
| RREL32 | Esposizioni sottostanti pari passu | {MONETARY} |
| RREL33 | Limite del credito totale | {MONETARY} |
| RREL34 | Prezzo di acquisto | {PERCENTAGE} |
| RREL35 | Tipo di ammortamento | {LIST} |
| RREL36 | Data di fine del periodo di grazia per il capitale | {DATEFORMAT} |
| RREL37 | Frequenza del pagamento del capitale programmato | {LIST} |
| RREL38 | Frequenza del pagamento degli interessi programmato | {LIST} |
| RREL39 | Pagamento dovuto | {MONETARY} |
| RREL40 | Rapporto tra debito e reddito | {PERCENTAGE} |
| RREL41 | Importo della maxi rata finale | {MONETARY} |
| RREL42 | Tipo di tasso di interesse | {LIST} |
| RREL43 | Tasso di interesse corrente | {PERCENTAGE} |
| RREL44 | Indice del tasso di interesse corrente | {LIST} |
| RREL45 | Durata dell'indice del tasso di interesse corrente | {LIST} |
| RREL46 | Margine sul tasso di interesse corrente | {PERCENTAGE} |
| RREL47 | Intervallo di ricalcolo del tasso di interesse | {INTEGER-9999} |
| RREL48 | Tasso di interesse massimo | {PERCENTAGE} |
| RREL49 | Tasso di interesse minimo | {PERCENTAGE} |
| RREL50 | Margine alla revisione 1 | {PERCENTAGE} |
| RREL51 | Data 1 di revisione dell'interesse | {DATEFORMAT} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|--|-----------------|
| RREL52 | Margine alla revisione 2 | {PERCENTAGE} |
| RREL53 | Data 2 di revisione dell'interesse | {DATEFORMAT} |
| RREL54 | Margine alla revisione 3 | {PERCENTAGE} |
| RREL55 | Data 3 di revisione dell'interesse | {DATEFORMAT} |
| RREL56 | Indice del tasso di interesse rivisto | {LIST} |
| RREL57 | Durata dell'indice del tasso di interesse rivisto | {LIST} |
| RREL58 | Numero di pagamenti prima della cartolarizzazione | {INTEGER-9999} |
| RREL59 | Percentuale di rimborsi anticipati consentiti per anno | {PERCENTAGE} |
| RREL60 | Data di fine del divieto di rimborso anticipato | {DATEFORMAT} |
| RREL61 | Penale di rimborso anticipato | {MONETARY} |
| RREL62 | Data di fine della penale di rimborso anticipato | {DATEFORMAT} |
| RREL63 | Data del rimborso anticipato | {DATEFORMAT} |
| RREL64 | Rimborsi anticipati cumulati | {MONETARY} |
| RREL65 | Data della ristrutturazione | {DATEFORMAT} |
| RREL66 | Ultima data di arretrato | {DATEFORMAT} |
| RREL67 | Saldo degli arretrati | {MONETARY} |
| RREL68 | Numero di giorni di arretrato | {INTEGER-9999} |
| RREL69 | Situazione del conto | {LIST} |
| RREL70 | Motivo del default o dell'esecuzione forzata | {LIST} |
| RREL71 | Importo del default | {MONETARY} |
| RREL72 | Data del default | {DATEFORMAT} |
| RREL73 | Perdite allocate | {MONETARY} |
| RREL74 | Recuperi cumulativi | {MONETARY} |
| RREL75 | Contenzioso | {Y/N} |
| RREL76 | Rivalsa | {Y/N} |
| RREL77 | Importo in deposito | {MONETARY} |
| RREL78 | Fornitore dell'assicurazione o dell'investimento | {ALPHANUM-1000} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|------------------|---|-----------------|
| RREL79 | Nome del prestatore originario | {ALPHANUM-100} |
| RREL80 | Identificativo del soggetto giuridico del prestatore originario | {LEI} |
| RREL81 | Paese di stabilimento del prestatore originario | {COUNTRYCODE_2} |
| RREL82 | Nome del cedente | {ALPHANUM-100} |
| RREL83 | Identificativo del soggetto giuridico del cedente | {LEI} |
| RREL84 | Paese di stabilimento del cedente | {COUNTRYCODE_2} |

Sezione relativa alle informazioni sulla garanzia reale

| | | |
|--------|--|-----------------|
| RREC1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| RREC2 | Identificativo dell'esposizione sottostante | {ALPHANUM-1000} |
| RREC3 | Identificativo originario della garanzia reale | {ALPHANUM-1000} |
| RREC4 | Nuovo identificativo della garanzia reale | {ALPHANUM-1000} |
| RREC5 | Tipo di garanzia reale | {LIST} |
| RREC6 | Regione geografica — garanzia reale | {NUTS} |
| RREC7 | Tipo di occupazione | {LIST} |
| RREC8 | Privilegio | {INTEGER-9999} |
| RREC9 | Tipo di bene immobile | {LIST} |
| RREC10 | Valore della certificazione energetica | {LIST} |
| RREC11 | Nome del fornitore della certificazione energetica | {ALPHANUM-100} |
| RREC12 | Rapporto prestito/valore corrente | {PERCENTAGE} |
| RREC13 | Importo della valutazione corrente | {MONETARY} |
| RREC14 | Metodo della valutazione corrente | {LIST} |
| RREC15 | Data della valutazione corrente | {DATEFORMAT} |
| RREC16 | Rapporto prestito/valore originario | {PERCENTAGE} |
| RREC17 | Importo della valutazione originaria | {MONETARY} |
| RREC18 | Metodo della valutazione originaria | {LIST} |
| RREC19 | Data della valutazione originaria | {DATEFORMAT} |
| RREC20 | Data della vendita | {DATEFORMAT} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|-----------------------------|------------------|
| RREC21 | Prezzo di vendita | {MONETARY} |
| RREC22 | Valuta della garanzia reale | {CURRENCYCODE_3} |
| RREC23 | Tipo di garante | {LIST} |

ALLEGATO III

Modello per le esposizioni sottostanti — Immobili non residenziali (CRE)

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|---|--|------------------|
| Sezione relativa alle informazioni sulle esposizioni sottostanti | | |
| CREL1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| CREL2 | Identificativo originario del debitore | {ALPHANUM-1000} |
| CREL3 | Nuovo identificativo del debitore | {ALPHANUM-1000} |
| CREL4 | Identificativo originario dell'esposizione sottostante | {ALPHANUM-1000} |
| CREL5 | Nuovo identificativo dell'esposizione sottostante | {ALPHANUM-1000} |
| CREL6 | Data limite dei dati | {DATEFORMAT} |
| CREL7 | Data di aggiunta all'aggregato | {DATEFORMAT} |
| CREL8 | Data della ristrutturazione | {DATEFORMAT} |
| CREL9 | Data di riacquisto | {DATEFORMAT} |
| CREL10 | Data della sostituzione | {DATEFORMAT} |
| CREL11 | Data di riscatto | {DATEFORMAT} |
| CREL12 | Regione geografica — debitore | {NUTS} |
| CREL13 | Classificazione delle regioni geografiche | {YEAR} |
| CREL14 | Regime speciale | {ALPHANUM-10000} |
| CREL15 | Data di creazione | {DATEFORMAT} |
| CREL16 | Data di inizio dell'ammortamento | {DATEFORMAT} |
| CREL17 | Data di scadenza alla data della cartolarizzazione | {DATEFORMAT} |
| CREL18 | Data di scadenza | {DATEFORMAT} |
| CREL19 | Durata originaria | {INTEGER-9999} |
| CREL20 | Durata dell'opzione di proroga | {INTEGER-9999} |
| CREL21 | Natura dell'opzione di proroga | {LIST} |
| CREL22 | Valuta di denominazione | {CURRENCYCODE_3} |
| CREL23 | Saldo corrente del capitale | {MONETARY} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|--|----------------|
| CREL24 | Saldo originario del capitale | {MONETARY} |
| CREL25 | Saldo originario del capitale alla data della cartolarizzazione | {MONETARY} |
| CREL26 | Saldo della linea impegnata non utilizzata dell'esposizione sottostante | {MONETARY} |
| CREL27 | Totale di altri importi in essere | {MONETARY} |
| CREL28 | Prezzo di acquisto | {PERCENTAGE} |
| CREL29 | Ultima data di utilizzo | {DATEFORMAT} |
| CREL30 | Finalità | {LIST} |
| CREL31 | Struttura | {LIST} |
| CREL32 | Cascata A-B dei pagamenti degli interessi pre esecuzione | {LIST} |
| CREL33 | Cascata A-B dei pagamenti del capitale pre esecuzione | {LIST} |
| CREL34 | Allocazione dei pagamenti di capitale al prestito senior | {PERCENTAGE} |
| CREL35 | Tipo di cascata dei pagamenti | {LIST} |
| CREL36 | Prezzo di acquisto dell'esposizione sottostante in stato di default | {PERCENTAGE} |
| CREL37 | Sono possibili pagamenti per sanare la situazione? | {LIST} |
| CREL38 | Restrizioni sulla vendita del prestito subordinato? | {Y/N} |
| CREL39 | Detentore del prestito subordinato affiliato al cedente? | {Y/N} |
| CREL40 | Detentore del prestito subordinato controlla il processo di risoluzione | {Y/N} |
| CREL41 | Il mancato pagamento dei crediti di rango prioritario configura un default dell'esposizione sottostante? | {Y/N} |
| CREL42 | Il mancato pagamento di esposizioni sottostanti dello stesso rango configura un default del bene immobile? | {Y/N} |
| CREL43 | Consenso del detentore dell'obbligazione | {Y/N} |
| CREL44 | Riunione programmata dei detentori delle obbligazioni | {DATEFORMAT} |
| CREL45 | Sindacata | {Y/N} |
| CREL46 | Partecipazione della SSPE | {LIST} |
| CREL47 | Conseguenze in caso di violazione delle covenants finanziarie | {LIST} |
| CREL48 | Penali per mancata presentazione delle informazioni finanziarie | {Y/N} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|--|------------------|
| CREL49 | Rivalsa | {Y/N} |
| CREL50 | Rivalsa — su terzi | {Y/N} |
| CREL51 | Norma di gestione (servicing) | {Y/N} |
| CREL52 | Importi detenuti come deposito a garanzia | {MONETARY} |
| CREL53 | Incasso di depositi a garanzia | {Y/N} |
| CREL54 | Incasso di altre riserve | {Y/N} |
| CREL55 | Evento attivatore del deposito a garanzia | {LIST} |
| CREL56 | Importi del deposito a garanzia/riserve obiettivo | {MONETARY} |
| CREL57 | Condizioni di svincolo del deposito a garanzia | {ALPHANUM-1000} |
| CREL58 | Condizioni di utilizzo della riserva di liquidità | {LIST} |
| CREL59 | Valuta del conto del deposito a garanzia | {CURRENCYCODE_3} |
| CREL60 | Valuta di pagamento del deposito a garanzia | {CURRENCYCODE_3} |
| CREL61 | Saldo totale delle riserve | {MONETARY} |
| CREL62 | Valuta del saldo delle riserve | {CURRENCYCODE_3} |
| CREL63 | Evento attivatore del deposito a garanzia si è verificato | {Y/N} |
| CREL64 | Importi aggiunti al deposito a garanzia nel periodo corrente | {MONETARY} |
| CREL65 | Entrate | {MONETARY} |
| CREL66 | Spese operative alla data della cartolarizzazione | {MONETARY} |
| CREL67 | Spese in conto capitale alla data della cartolarizzazione | {MONETARY} |
| CREL68 | Valuta del bilancio | {CURRENCYCODE_3} |
| CREL69 | Violazione da parte del debitore dell'obbligo di comunicazione | {Y/N} |
| CREL70 | Metodo del coefficiente di copertura del servizio del debito | {LIST} |
| CREL71 | Indicatore del coefficiente di copertura del servizio del debito alla data della cartolarizzazione | {LIST} |
| CREL72 | Indicatore più recente del coefficiente di copertura del servizio del debito | {LIST} |
| CREL73 | Coefficiente di copertura del servizio del debito alla data della cartolarizzazione | {PERCENTAGE} |
| CREL74 | Coefficiente di copertura del servizio del debito corrente | {PERCENTAGE} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|---|------------------|
| CREL75 | Rapporto prestito/valore originario | {PERCENTAGE} |
| CREL76 | Rapporto prestito/valore corrente | {PERCENTAGE} |
| CREL77 | Coefficiente di copertura degli interessi alla data della cartolarizzazione | {PERCENTAGE} |
| CREL78 | Coefficiente di copertura degli interessi corrente | {PERCENTAGE} |
| CREL79 | Metodo per il coefficiente di copertura degli interessi | {LIST} |
| CREL80 | Numero di beni immobili alla data della cartolarizzazione | {INTEGER-9999} |
| CREL81 | Numero di beni immobili alla data limite dei dati | {INTEGER-9999} |
| CREL82 | Beni immobili costituiti in garanzia dell'esposizione sottostante | {ALPHANUM-1000} |
| CREL83 | Valore del portafoglio di beni immobili alla data della cartolarizzazione | {MONETARY} |
| CREL84 | Valuta della valutazione del portafoglio di beni immobili alla data della cartolarizzazione | {CURRENCYCODE_3} |
| CREL85 | Stato dei beni immobili | {LIST} |
| CREL86 | Data della valutazione alla data della cartolarizzazione | {DATEFORMAT} |
| CREL87 | Tipo di ammortamento | {LIST} |
| CREL88 | Data di fine del periodo di grazia per il capitale | {DATEFORMAT} |
| CREL89 | Giorni di grazia autorizzati | {INTEGER-9999} |
| CREL90 | Frequenza del pagamento del capitale programmato | {LIST} |
| CREL91 | Frequenza del pagamento degli interessi programmato | {LIST} |
| CREL92 | Numero di pagamenti prima della cartolarizzazione | {INTEGER-9999} |
| CREL93 | Descrizione delle condizioni di rimborso anticipato | {ALPHANUM-100} |
| CREL94 | Data di fine del divieto di rimborso anticipato | {DATEFORMAT} |
| CREL95 | Data di fine del mantenimento del rendimento | {DATEFORMAT} |
| CREL96 | Penale di rimborso anticipato | {MONETARY} |
| CREL97 | Data di fine della penale di rimborso anticipato | {DATEFORMAT} |
| CREL98 | Incassi di capitale non programmati | {MONETARY} |
| CREL99 | Data della liquidazione/del rimborso anticipato | {DATEFORMAT} |
| CREL100 | Codice della liquidazione/del rimborso anticipato | {LIST} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|--|----------------|
| CREL101 | Interessi percepiti in più/in meno per rimborso anticipato | {MONETARY} |
| CREL102 | Data di pagamento | {DATEFORMAT} |
| CREL103 | Prossima data dell'adeguamento del pagamento | {DATEFORMAT} |
| CREL104 | Prossima data di pagamento | {DATEFORMAT} |
| CREL105 | Pagamento dovuto | {MONETARY} |
| CREL106 | Tasso di interesse originario | {PERCENTAGE} |
| CREL107 | Tasso di interesse alla data della cartolarizzazione | {PERCENTAGE} |
| CREL108 | Prima data dell'adeguamento del pagamento | {DATEFORMAT} |
| CREL109 | Tipo di tasso di interesse | {LIST} |
| CREL110 | Tasso di interesse corrente | {PERCENTAGE} |
| CREL111 | Indice del tasso di interesse corrente | {LIST} |
| CREL112 | Durata dell'indice del tasso di interesse corrente | {LIST} |
| CREL113 | Margine sul tasso di interesse corrente | {PERCENTAGE} |
| CREL114 | Intervallo di ricalcolo del tasso di interesse | {INTEGER-9999} |
| CREL115 | Tasso corrente dell'indice | {PERCENTAGE} |
| CREL116 | Data di determinazione dell'indice | {DATEFORMAT} |
| CREL117 | Incremento per arrotondamento | {PERCENTAGE} |
| CREL118 | Tasso di interesse massimo | {PERCENTAGE} |
| CREL119 | Tasso di interesse minimo | {PERCENTAGE} |
| CREL120 | Tasso di interesse corrente di default | {PERCENTAGE} |
| CREL121 | Interessi composti autorizzati | {Y/N} |
| CREL122 | Convenzione sul conteggio dei giorni | {LIST} |
| CREL123 | Totale dovuto del capitale e degli interessi programmati | {MONETARY} |
| CREL124 | Totale pagato del capitale e degli interessi programmati | {MONETARY} |
| CREL125 | Ammortamento negativo | {MONETARY} |
| CREL126 | Interessi differiti | {MONETARY} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|---|----------------|
| CREL127 | Totale degli importi di capitale e di interessi in essere percepiti in meno | {MONETARY} |
| CREL128 | Ultima data di arretrato | {DATEFORMAT} |
| CREL129 | Saldo degli arretrati | {MONETARY} |
| CREL130 | Numero di giorni di arretrato | {INTEGER-9999} |
| CREL131 | Motivo del default o dell'esecuzione forzata | {LIST} |
| CREL132 | Importo del default | {MONETARY} |
| CREL133 | Data del default | {DATEFORMAT} |
| CREL134 | Arretrati sugli interessi | {Y/N} |
| CREL135 | Interessi effettivi di default | {MONETARY} |
| CREL136 | Situazione del conto | {LIST} |
| CREL137 | Perdite allocate | {MONETARY} |
| CREL138 | Proventi netti ricevuti alla liquidazione | {MONETARY} |
| CREL139 | Spese di liquidazione | {MONETARY} |
| CREL140 | Tempi previsti per i recuperi | {INTEGER-9999} |
| CREL141 | Recuperi cumulativi | {MONETARY} |
| CREL142 | Data di inizio dell'esecuzione | {DATEFORMAT} |
| CREL143 | Codice della strategia di risoluzione | {LIST} |
| CREL144 | Modifica | {LIST} |
| CREL145 | Stato della gestione (servicing) speciale | {Y/N} |
| CREL146 | Data del trasferimento più recente ad un gestore speciale | {DATEFORMAT} |
| CREL147 | Data di ritorno più recente al gestore principale | {DATEFORMAT} |
| CREL148 | Non recuperabilità accertata | {Y/N} |
| CREL149 | Violazione delle convenants/evento attivatore | {LIST} |
| CREL150 | Data della violazione | {DATEFORMAT} |
| CREL151 | Data in cui è stata sanata la violazione | {DATEFORMAT} |
| CREL152 | Codice dell'elenco di controllo del gestore | {WATCHLIST} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|---|-----------------|
| CREL153 | Data dell'elenco di controllo del gestore | {DATEFORMAT} |
| CREL154 | Fornitore dello swap su tassi di interesse | {ALPHANUM-1000} |
| CREL155 | Identificativo del soggetto giuridico del fornitore dello swap su tassi di interesse | {LEI} |
| CREL156 | Data di scadenza dello swap su tassi di interesse | {DATEFORMAT} |
| CREL157 | Nozionale dello swap su tassi di interesse | {MONETARY} |
| CREL158 | Fornitore dello swap su valute | {ALPHANUM-1000} |
| CREL159 | Identificativo del soggetto giuridico del fornitore dello swap su valute | {LEI} |
| CREL160 | Data di scadenza dello swap su valute | {DATEFORMAT} |
| CREL161 | Nozionale dello swap su valute | {MONETARY} |
| CREL162 | Tasso di cambio per lo swap | {PERCENTAGE} |
| CREL163 | Fornitore di altro swap | {ALPHANUM-1000} |
| CREL164 | Identificativo del soggetto giuridico del fornitore di altro swap | {LEI} |
| CREL165 | Debitore deve pagare spese di interruzione sullo swap | {LIST} |
| CREL166 | Evento che determina la cessazione totale o parziale dello swap per il periodo corrente | {LIST} |
| CREL167 | Pagamento periodico netto effettuato da fornitore dello swap | {MONETARY} |
| CREL168 | Costi di interruzione dello swap dovuti al fornitore dello swap per l'esposizione sottostante | {MONETARY} |
| CREL169 | Importo inferiore al dovuto dei costi di interruzione dello swap | {MONETARY} |
| CREL170 | Costi di interruzione dovuti dalla controparte dello swap | {MONETARY} |
| CREL171 | Prossima data di ricalcolo dello swap | {DATEFORMAT} |
| CREL172 | Promotore | {ALPHANUM-100} |
| CREL173 | Identificativo del soggetto giuridico della banca agente della sindacazione | {LEI} |
| CREL174 | Identificativo del soggetto giuridico del gestore (servicer) | {LEI} |
| CREL175 | Nome del gestore (servicer) | {ALPHANUM-100} |
| CREL176 | Nome del cedente | {ALPHANUM-100} |
| CREL177 | Identificativo del soggetto giuridico del cedente | {LEI} |
| CREL178 | Paese di stabilimento del cedente | {COUNTRYCODE_2} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|---|-----------------|
| CREL179 | Nome del prestatore originario | {ALPHANUM-100} |
| CREL180 | Identificativo del soggetto giuridico del prestatore originario | {LEI} |
| CREL181 | Paese di stabilimento del prestatore originario | {COUNTRYCODE_2} |

Sezione relativa alle informazioni sulla garanzia reale

| | | |
|---------------|---|-----------------|
| CREC1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| CREC2 | Identificativo dell'esposizione sottostante | {ALPHANUM-1000} |
| CREC3 | Identificativo originario della garanzia reale | {ALPHANUM-1000} |
| CREC4 | Nuovo identificativo della garanzia reale | {ALPHANUM-1000} |
| CREC5 | Tipo di garanzia reale | {LIST} |
| CREC6 | Nome del bene immobile | {ALPHANUM-100} |
| CREC7 | Indirizzo del bene immobile | {ALPHANUM-1000} |
| CREC8 | Regione geografica — garanzia reale | {NUTS} |
| CREC9 | Codice postale del bene immobile | {ALPHANUM-100} |
| CREC10 | Privilegio | {INTEGER-9999} |
| CREC11 | Stato del bene immobile | {LIST} |
| CREC12 | Tipo di bene immobile | {LIST} |
| CREC13 | Forma del titolo di proprietà | {LIST} |
| CREC14 | Data della valutazione corrente | {DATEFORMAT} |
| CREC15 | Importo della valutazione corrente | {MONETARY} |
| CREC16 | Metodo della valutazione corrente | {LIST} |
| CREC17 | Base della valutazione corrente | {LIST} |
| CREC18 | Metodo della valutazione originaria | {LIST} |
| CREC19 | Data della cartolarizzazione della garanzia reale | {DATEFORMAT} |
| CREC20 | Percentuale dell'esposizione sottostante allocata alla data della cartolarizzazione | {PERCENTAGE} |
| CREC21 | Percentuale attuale dell'esposizione sottostante allocata | {PERCENTAGE} |
| CREC22 | Valutazione alla cartolarizzazione | {MONETARY} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|--|---------------------|
| CREC23 | Nome del valutatore alla cartolarizzazione | {ALPHANUM-100} |
| CREC24 | Data della valutazione alla cartolarizzazione | {DATEFORMAT} |
| CREC25 | Anno di costruzione | {YEAR} |
| CREC26 | Anno di ultima ristrutturazione | {YEAR} |
| CREC27 | Numero di unità | {INTEGER-999999999} |
| CREC28 | Metri quadri netti | {INTEGER-999999999} |
| CREC29 | Superficie non residenziale | {INTEGER-999999999} |
| CREC30 | Superficie residenziale | {INTEGER-999999999} |
| CREC31 | Superficie calpestabile validata | {Y/N} |
| CREC32 | Occupazione alla data | {DATEFORMAT} |
| CREC33 | Occupazione economica alla cartolarizzazione | {PERCENTAGE} |
| CREC34 | Occupazione fisica alla cartolarizzazione | {PERCENTAGE} |
| CREC35 | Valore del possesso del bene libero da occupazione alla data della cartolarizzazione | {MONETARY} |
| CREC36 | Data dei dati finanziari alla cartolarizzazione | {DATEFORMAT} |
| CREC37 | Reddito operativo netto alla cartolarizzazione | {MONETARY} |
| CREC38 | Data di inizio dei dati finanziari più recenti | {DATEFORMAT} |
| CREC39 | Data di fine dei dati finanziari più recenti | {DATEFORMAT} |
| CREC40 | Entrate più recenti | {MONETARY} |
| CREC41 | Spese operative più recenti | {MONETARY} |
| CREC42 | Spesa in conto capitale più recente | {MONETARY} |
| CREC43 | Canone di locazione del terreno da pagare | {MONETARY} |
| CREC44 | Durata media ponderata dei contratti di locazione | {INTEGER-9999} |
| CREC45 | Scadenza della locazione del bene immobile | {DATEFORMAT} |
| CREC46 | Reddito contrattuale annuo da locazione | {MONETARY} |
| CREC47 | Reddito in scadenza tra 1-12 mesi | {PERCENTAGE} |
| CREC48 | Reddito in scadenza tra 13-24 mesi | {PERCENTAGE} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|------------------------------------|----------------|
| CREC49 | Reddito in scadenza tra 25-36 mesi | {PERCENTAGE} |
| CREC50 | Reddito in scadenza tra 37-48 mesi | {PERCENTAGE} |
| CREC51 | Reddito in scadenza tra 49+ mesi | {PERCENTAGE} |

Sezione relativa alle informazioni sul locatario

| | | |
|--------------|---|------------------|
| CRET1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| CRET2 | Identificativo dell'esposizione sottostante | {ALPHANUM-1000} |
| CRET3 | Identificativo della garanzia reale | {ALPHANUM-1000} |
| CRET4 | Identificativo del locatario | {ALPHANUM-1000} |
| CRET5 | Nome del locatario | {ALPHANUM-100} |
| CRET6 | Codice NACE del settore | {NACE} |
| CRET7 | Data di scadenza del contratto di locazione | {DATEFORMAT} |
| CRET8 | Canone di locazione da pagare | {MONETARY} |
| CRET9 | Valuta del canone di locazione | {CURRENCYCODE_3} |

ALLEGATO IV

Modello per le esposizioni sottostanti — Imprese

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|---|--|------------------|
| Sezione relativa alle informazioni sulle esposizioni sottostanti | | |
| CRPL1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| CRPL2 | Identificativo originario dell'esposizione sottostante | {ALPHANUM-1000} |
| CRPL3 | Nuovo identificativo dell'esposizione sottostante | {ALPHANUM-1000} |
| CRPL4 | Identificativo originario del debitore | {ALPHANUM-1000} |
| CRPL5 | Nuovo identificativo del debitore | {ALPHANUM-1000} |
| CRPL6 | Data limite dei dati | {DATEFORMAT} |
| CRPL7 | Data di aggiunta all'aggregato | {DATEFORMAT} |
| CRPL8 | Data di riacquisto | {DATEFORMAT} |
| CRPL9 | Data di riscatto | {DATEFORMAT} |
| CRPL10 | Regione geografica — debitore | {NUTS} |
| CRPL11 | Classificazione delle regioni geografiche | {YEAR} |
| CRPL12 | Debitore di affidabilità creditizia deteriorata | {Y/N} |
| CRPL13 | Tipo di cliente | {LIST} |
| CRPL14 | Codice NACE del settore | {NACE} |
| CRPL15 | Segmento Basilea III del debitore | {LIST} |
| CRPL16 | Dimensione dell'impresa | {LIST} |
| CRPL17 | Entrate | {MONETARY} |
| CRPL18 | Debito totale | {MONETARY} |
| CRPL19 | EBITDA | {MONETARY} |
| CRPL20 | Valore dell'impresa | {MONETARY} |
| CRPL21 | Flussi di cassa liberi | {MONETARY} |
| CRPL22 | Data dei dati finanziari | {DATEFORMAT} |
| CRPL23 | Valuta del bilancio | {CURRENCYCODE_3} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|---|------------------|
| CRPL24 | Tipo di debito | {LIST} |
| CRPL25 | Crediti cartolarizzati | {LIST} |
| CRPL26 | Numero internazionale di identificazione dei titoli | {ISIN} |
| CRPL27 | Rango | {LIST} |
| CRPL28 | Sindacata | {Y/N} |
| CRPL29 | Operazione con leva finanziaria | {Y/N} |
| CRPL30 | Gestita del gestore di CLO | {Y/N} |
| CRPL31 | Pagamento in natura | {Y/N} |
| CRPL32 | Regime speciale | {ALPHANUM-10000} |
| CRPL33 | Data di creazione | {DATEFORMAT} |
| CRPL34 | Data di scadenza | {DATEFORMAT} |
| CRPL35 | Canale di creazione | {LIST} |
| CRPL36 | Finalità | {LIST} |
| CRPL37 | Valuta di denominazione | {CURRENCYCODE_3} |
| CRPL38 | Saldo originario del capitale | {MONETARY} |
| CRPL39 | Saldo corrente del capitale | {MONETARY} |
| CRPL40 | Saldi del capitale di rango prioritario | {MONETARY} |
| CRPL41 | Valore di mercato | {MONETARY} |
| CRPL42 | Limite del credito totale | {MONETARY} |
| CRPL43 | Prezzo di acquisto | {PERCENTAGE} |
| CRPL44 | Data di opzione di vendita | {DATEFORMAT} |
| CRPL45 | Pezzo di esercizio dell'opzione di vendita | {MONETARY} |
| CRPL46 | Tipo di ammortamento | {LIST} |
| CRPL47 | Data di fine del periodo di grazia per il capitale | {DATEFORMAT} |
| CRPL48 | Frequenza del pagamento del capitale programmato | {LIST} |
| CRPL49 | Frequenza del pagamento degli interessi programmato | {LIST} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|--|----------------|
| CRPL50 | Pagamento dovuto | {MONETARY} |
| CRPL51 | Importo della maxi rata finale | {MONETARY} |
| CRPL52 | Tipo di tasso di interesse | {LIST} |
| CRPL53 | Tasso di interesse corrente | {PERCENTAGE} |
| CRPL54 | Indice del tasso di interesse corrente | {LIST} |
| CRPL55 | Durata dell'indice del tasso di interesse corrente | {LIST} |
| CRPL56 | Margine sul tasso di interesse corrente | {PERCENTAGE} |
| CRPL57 | Intervallo di ricalcolo del tasso di interesse | {INTEGER-9999} |
| CRPL58 | Tasso di interesse massimo | {PERCENTAGE} |
| CRPL59 | Tasso di interesse minimo | {PERCENTAGE} |
| CRPL60 | Margine alla revisione 1 | {PERCENTAGE} |
| CRPL61 | Data 1 di revisione dell'interesse | {DATEFORMAT} |
| CRPL62 | Margine alla revisione 2 | {PERCENTAGE} |
| CRPL63 | Data 2 di revisione dell'interesse | {DATEFORMAT} |
| CRPL64 | Margine alla revisione 3 | {PERCENTAGE} |
| CRPL65 | Data 3 di revisione dell'interesse | {DATEFORMAT} |
| CRPL66 | Indice del tasso di interesse rivisto | {LIST} |
| CRPL67 | Durata dell'indice del tasso di interesse rivisto | {LIST} |
| CRPL68 | Numero di pagamenti prima della cartolarizzazione | {INTEGER-9999} |
| CRPL69 | Percentuale di rimborsi anticipati consentiti per anno | {PERCENTAGE} |
| CRPL70 | Data di fine del divieto di rimborso anticipato | {DATEFORMAT} |
| CRPL71 | Penale di rimborso anticipato | {MONETARY} |
| CRPL72 | Data di fine della penale di rimborso anticipato | {DATEFORMAT} |
| CRPL73 | Data del rimborso anticipato | {DATEFORMAT} |
| CRPL74 | Rimborsi anticipati cumulati | {MONETARY} |
| CRPL75 | Data della ristrutturazione | {DATEFORMAT} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|--|-----------------|
| CRPL76 | Ultima data di arretrato | {DATEFORMAT} |
| CRPL77 | Saldo degli arretrati | {MONETARY} |
| CRPL78 | Numero di giorni di arretrato | {INTEGER-9999} |
| CRPL79 | Situazione del conto | {LIST} |
| CRPL80 | Motivo del default o dell'esecuzione forzata | {LIST} |
| CRPL81 | Importo del default | {MONETARY} |
| CRPL82 | Data del default | {DATEFORMAT} |
| CRPL83 | Perdite allocate | {MONETARY} |
| CRPL84 | Recuperi cumulativi | {MONETARY} |
| CRPL85 | Fonte del recupero | {LIST} |
| CRPL86 | Rivalsa | {Y/N} |
| CRPL87 | Importo in deposito | {MONETARY} |
| CRPL88 | Nozionale dello swap su tassi di interesse | {MONETARY} |
| CRPL89 | Identificativo del soggetto giuridico del fornitore dello swap su tassi di interesse | {LEI} |
| CRPL90 | Fornitore dello swap su tassi di interesse | {ALPHANUM-1000} |
| CRPL91 | Data di scadenza dello swap su tassi di interesse | {DATEFORMAT} |
| CRPL92 | Nozionale dello swap su valute | {MONETARY} |
| CRPL93 | Identificativo del soggetto giuridico del fornitore dello swap su valute | {LEI} |
| CRPL94 | Fornitore dello swap su valute | {ALPHANUM-1000} |
| CRPL95 | Data di scadenza dello swap su valute | {DATEFORMAT} |
| CRPL96 | Nome del prestatore originario | {ALPHANUM-100} |
| CRPL97 | Identificativo del soggetto giuridico del prestatore originario | {LEI} |
| CRPL98 | Paese di stabilimento del prestatore originario | {COUNTRYCODE_2} |
| CRPL99 | Nome del cedente | {ALPHANUM-100} |
| CRPL100 | Identificativo del soggetto giuridico del cedente | {LEI} |
| CRPL101 | Paese di stabilimento del cedente | {COUNTRYCODE_2} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|--|--|------------------|
| Sezione relativa alle informazioni sulla garanzia reale | | |
| CRPC1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| CRPC2 | Identificativo dell'esposizione sottostante | {ALPHANUM-1000} |
| CRPC3 | Identificativo originario della garanzia reale | {ALPHANUM-1000} |
| CRPC4 | Nuovo identificativo della garanzia reale | {ALPHANUM-1000} |
| CRPC5 | Regione geografica — garanzia reale | {NUTS} |
| CRPC6 | Tipo di garanzia | {LIST} |
| CRPC7 | Tipo di gravame | {LIST} |
| CRPC8 | Privilegio | {INTEGER-9999} |
| CRPC9 | Tipo di garanzia reale | {LIST} |
| CRPC10 | Importo della valutazione corrente | {MONETARY} |
| CRPC11 | Metodo della valutazione corrente | {LIST} |
| CRPC12 | Data della valutazione corrente | {DATEFORMAT} |
| CRPC13 | Importo della valutazione originaria | {MONETARY} |
| CRPC14 | Metodo della valutazione originaria | {LIST} |
| CRPC15 | Data della valutazione originaria | {DATEFORMAT} |
| CRPC16 | Data della vendita | {DATEFORMAT} |
| CRPC17 | Prezzo di vendita | {MONETARY} |
| CRPC18 | Valuta della garanzia reale | {CURRENCYCODE_3} |
| CRPC19 | Paese del garante | {COUNTRYCODE_2} |
| CRPC20 | Sottosettore SEC del garante | {ESA} |

ALLEGATO V

Modello per e esposizioni sottostanti — Automobili

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|---|--|------------------|
| Sezione relativa alle informazioni sulle esposizioni sottostanti | | |
| AUTL1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| AUTL2 | Identificativo originario dell'esposizione sottostante | {ALPHANUM-1000} |
| AUTL3 | Nuovo identificativo dell'esposizione sottostante | {ALPHANUM-1000} |
| AUTL4 | Identificativo originario del debitore | {ALPHANUM-1000} |
| AUTL5 | Nuovo identificativo del debitore | {ALPHANUM-1000} |
| AUTL6 | Data limite dei dati | {DATEFORMAT} |
| AUTL7 | Data di aggiunta all'aggregato | {DATEFORMAT} |
| AUTL8 | Data di riacquisto | {DATEFORMAT} |
| AUTL9 | Data di riscatto | {DATEFORMAT} |
| AUTL10 | Regione geografica — debitore | {NUTS} |
| AUTL11 | Classificazione delle regioni geografiche | {YEAR} |
| AUTL12 | Situazione occupazionale | {LIST} |
| AUTL13 | Debitore di affidabilità creditizia deteriorata | {Y/N} |
| AUTL14 | Tipologia giuridica del debitore | {LIST} |
| AUTL15 | Tipo di cliente | {LIST} |
| AUTL16 | Reddito principale | {MONETARY} |
| AUTL17 | Tipo di reddito principale | {LIST} |
| AUTL18 | Valuta del reddito principale | {CURRENCYCODE_3} |
| AUTL19 | Verifica del reddito principale | {LIST} |
| AUTL20 | Entrate | {MONETARY} |
| AUTL21 | Valuta del bilancio | {CURRENCYCODE_3} |
| AUTL22 | Regime speciale | {ALPHANUM-10000} |
| AUTL23 | Tipo di prodotto | {LIST} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|--|------------------|
| AUTL24 | Data di creazione | {DATEFORMAT} |
| AUTL25 | Data di scadenza | {DATEFORMAT} |
| AUTL26 | Durata originaria | {INTEGER-9999} |
| AUTL27 | Canale di creazione | {LIST} |
| AUTL28 | Valuta di denominazione | {CURRENCYCODE_3} |
| AUTL29 | Saldo originario del capitale | {MONETARY} |
| AUTL30 | Saldo corrente del capitale | {MONETARY} |
| AUTL31 | Prezzo di acquisto | {PERCENTAGE} |
| AUTL32 | Tipo di ammortamento | {LIST} |
| AUTL33 | Data di fine del periodo di grazia per il capitale | {DATEFORMAT} |
| AUTL34 | Frequenza del pagamento del capitale programmato | {LIST} |
| AUTL35 | Frequenza del pagamento degli interessi programmato | {LIST} |
| AUTL36 | Metodo di pagamento | {LIST} |
| AUTL37 | Pagamento dovuto | {MONETARY} |
| AUTL38 | Importo della maxi rata finale | {MONETARY} |
| AUTL39 | Importo dell'acconto | {MONETARY} |
| AUTL40 | Tasso di interesse corrente | {PERCENTAGE} |
| AUTL41 | Indice del tasso di interesse corrente | {LIST} |
| AUTL42 | Durata dell'indice del tasso di interesse corrente | {LIST} |
| AUTL43 | Margine sul tasso di interesse corrente | {PERCENTAGE} |
| AUTL44 | Intervallo di ricalcolo del tasso di interesse | {INTEGER-9999} |
| AUTL45 | Tasso di interesse massimo | {PERCENTAGE} |
| AUTL46 | Tasso di interesse minimo | {PERCENTAGE} |
| AUTL47 | Numero di pagamenti prima della cartolarizzazione | {INTEGER-9999} |
| AUTL48 | Percentuale di rimborsi anticipati consentiti per anno | {PERCENTAGE} |
| AUTL49 | Penale di rimborso anticipato | {MONETARY} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|---|----------------|
| AUTL50 | Data di fine della penale di rimborso anticipato | {DATEFORMAT} |
| AUTL51 | Data del rimborso anticipato | {DATEFORMAT} |
| AUTL52 | Rimborsi anticipati cumulati | {MONETARY} |
| AUTL53 | Costruttore | {ALPHANUM-100} |
| AUTL54 | Modello | {ALPHANUM-100} |
| AUTL55 | Anno di immatricolazione | {YEAR} |
| AUTL56 | Nuovo o usato | {LIST} |
| AUTL57 | Valore della certificazione energetica | {LIST} |
| AUTL58 | Nome del fornitore della certificazione energetica | {ALPHANUM-100} |
| AUTL59 | Rapporto prestito/valore originario | {PERCENTAGE} |
| AUTL60 | Importo della valutazione originaria | {MONETARY} |
| AUTL61 | Valore residuale originario del veicolo | {MONETARY} |
| AUTL62 | Prezzo dell'opzione di acquisto | {MONETARY} |
| AUTL63 | Valore residuale cartolarizzato | {MONETARY} |
| AUTL64 | Valore residuale aggiornato del veicolo | {MONETARY} |
| AUTL65 | Data della valutazione residuale aggiornata del veicolo | {DATEFORMAT} |
| AUTL66 | Data della ristrutturazione | {DATEFORMAT} |
| AUTL67 | Ultima data di arretrato | {DATEFORMAT} |
| AUTL68 | Saldo degli arretrati | {MONETARY} |
| AUTL69 | Numero di giorni di arretrato | {INTEGER-9999} |
| AUTL70 | Situazione del conto | {LIST} |
| AUTL71 | Motivo del default o dell'esecuzione forzata | {LIST} |
| AUTL72 | Importo del default | {MONETARY} |
| AUTL73 | Data del default | {DATEFORMAT} |
| AUTL74 | Perdite allocate | {MONETARY} |
| AUTL75 | Perdite sul valore residuale | {MONETARY} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|---|-----------------|
| AUTL76 | Recuperi cumulativi | {MONETARY} |
| AUTL77 | Prezzo di vendita | {MONETARY} |
| AUTL78 | Importo in deposito | {MONETARY} |
| AUTL79 | Nome del prestatore originario | {ALPHANUM-100} |
| AUTL80 | Identificativo del soggetto giuridico del prestatore originario | {LEI} |
| AUTL81 | Paese di stabilimento del prestatore originario | {COUNTRYCODE_2} |
| AUTL82 | Nome del cedente | {ALPHANUM-100} |
| AUTL83 | Identificativo del soggetto giuridico del cedente | {LEI} |
| AUTL84 | Paese di stabilimento del cedente | {COUNTRYCODE_2} |

ALLEGATO VI

Modello per le esposizioni sottostanti — Consumatori

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|---|--|------------------|
| Sezione relativa alle informazioni sulle esposizioni sottostanti | | |
| CMRL1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| CMRL2 | Identificativo originario dell'esposizione sottostante | {ALPHANUM-1000} |
| CMRL3 | Nuovo identificativo dell'esposizione sottostante | {ALPHANUM-1000} |
| CMRL4 | Identificativo originario del debitore | {ALPHANUM-1000} |
| CMRL5 | Nuovo identificativo del debitore | {ALPHANUM-1000} |
| CMRL6 | Data limite dei dati | {DATEFORMAT} |
| CMRL7 | Data di aggiunta all'aggregato | {DATEFORMAT} |
| CMRL8 | Data di riacquisto | {DATEFORMAT} |
| CMRL9 | Data di riscatto | {DATEFORMAT} |
| CMRL10 | Regione geografica — debitore | {NUTS} |
| CMRL11 | Classificazione delle regioni geografiche | {YEAR} |
| CMRL12 | Situazione occupazionale | {LIST} |
| CMRL13 | Debitore di affidabilità creditizia deteriorata | {Y/N} |
| CMRL14 | Tipo di cliente | {LIST} |
| CMRL15 | Reddito principale | {MONETARY} |
| CMRL16 | Tipo di reddito principale | {LIST} |
| CMRL17 | Valuta del reddito principale | {CURRENCYCODE_3} |
| CMRL18 | Verifica del reddito principale | {LIST} |
| CMRL19 | Garantita da stipendio/pensione | {Y/N} |
| CMRL20 | Regime speciale | {ALPHANUM-10000} |
| CMRL21 | Data di creazione | {DATEFORMAT} |
| CMRL22 | Data di scadenza | {DATEFORMAT} |
| CMRL23 | Durata originaria | {INTEGER-9999} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|--|------------------|
| CMRL24 | Canale di creazione | {LIST} |
| CMRL25 | Finalità | {LIST} |
| CMRL26 | Valuta di denominazione | {CURRENCYCODE_3} |
| CMRL27 | Saldo originario del capitale | {MONETARY} |
| CMRL28 | Saldo corrente del capitale | {MONETARY} |
| CMRL29 | Limite del credito totale | {MONETARY} |
| CMRL30 | Data di fine del periodo di rotatività | {DATEFORMAT} |
| CMRL31 | Prezzo di acquisto | {PERCENTAGE} |
| CMRL32 | Tipo di ammortamento | {LIST} |
| CMRL33 | Data di fine del periodo di grazia per il capitale | {DATEFORMAT} |
| CMRL34 | Frequenza del pagamento del capitale programmato | {LIST} |
| CMRL35 | Frequenza del pagamento degli interessi programmato | {LIST} |
| CMRL36 | Pagamento dovuto | {MONETARY} |
| CMRL37 | Tasso di interesse corrente | {PERCENTAGE} |
| CMRL38 | Indice del tasso di interesse corrente | {LIST} |
| CMRL39 | Durata dell'indice del tasso di interesse corrente | {LIST} |
| CMRL40 | Margine sul tasso di interesse corrente | {PERCENTAGE} |
| CMRL41 | Intervallo di ricalcolo del tasso di interesse | {INTEGER-9999} |
| CMRL42 | Tasso di interesse massimo | {PERCENTAGE} |
| CMRL43 | Tasso di interesse minimo | {PERCENTAGE} |
| CMRL44 | Numero di pagamenti prima della cartolarizzazione | {INTEGER-9999} |
| CMRL45 | Percentuale di rimborsi anticipati consentiti per anno | {PERCENTAGE} |
| CMRL46 | Data di fine del divieto di rimborso anticipato | {DATEFORMAT} |
| CMRL47 | Penale di rimborso anticipato | {MONETARY} |
| CMRL48 | Data di fine della penale di rimborso anticipato | {DATEFORMAT} |
| CMRL49 | Data del rimborso anticipato | {DATEFORMAT} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|---|-----------------|
| CMRL50 | Rimborsi anticipati cumulati | {MONETARY} |
| CMRL51 | Data della ristrutturazione | {DATEFORMAT} |
| CMRL52 | Ultima data di arretrato | {DATEFORMAT} |
| CMRL53 | Saldo degli arretrati | {MONETARY} |
| CMRL54 | Numero di giorni di arretrato | {INTEGER-9999} |
| CMRL55 | Situazione del conto | {LIST} |
| CMRL56 | Motivo del default o dell'esecuzione forzata | {LIST} |
| CMRL57 | Importo del default | {MONETARY} |
| CMRL58 | Data del default | {DATEFORMAT} |
| CMRL59 | Perdite allocate | {MONETARY} |
| CMRL60 | Recuperi cumulativi | {MONETARY} |
| CMRL61 | Importo in deposito | {MONETARY} |
| CMRL62 | Nome del prestatore originario | {ALPHANUM-100} |
| CMRL63 | Identificativo del soggetto giuridico del prestatore originario | {LEI} |
| CMRL64 | Paese di stabilimento del prestatore originario | {COUNTRYCODE_2} |
| CMRL65 | Nome del cedente | {ALPHANUM-100} |
| CMRL66 | Identificativo del soggetto giuridico del cedente | {LEI} |
| CMRL67 | Paese di stabilimento del cedente | {COUNTRYCODE_2} |
| CMRL68 | Valore della certificazione energetica | {LIST} |
| CMRL69 | Nome del fornitore della certificazione energetica | {ALPHANUM-100} |

ALLEGATO VII

Modello per le esposizioni sottostanti — Carte di credito

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|---|--|------------------|
| Sezione relativa alle informazioni sulle esposizioni sottostanti | | |
| CCDL1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| CCDL2 | Identificativo originario dell'esposizione sottostante | {ALPHANUM-1000} |
| CCDL3 | Nuovo identificativo dell'esposizione sottostante | {ALPHANUM-1000} |
| CCDL4 | Identificativo originario del debitore | {ALPHANUM-1000} |
| CCDL5 | Nuovo identificativo del debitore | {ALPHANUM-1000} |
| CCDL6 | Data limite dei dati | {DATEFORMAT} |
| CCDL7 | Data di aggiunta all'aggregato | {DATEFORMAT} |
| CCDL8 | Data di riacquisto | {DATEFORMAT} |
| CCDL9 | Regione geografica — debitore | {NUTS} |
| CCDL10 | Classificazione delle regioni geografiche | {YEAR} |
| CCDL11 | Situazione occupazionale | {LIST} |
| CCDL12 | Debitore di affidabilità creditizia deteriorata | {Y/N} |
| CCDL13 | Tipo di cliente | {LIST} |
| CCDL14 | Reddito principale | {MONETARY} |
| CCDL15 | Tipo di reddito principale | {LIST} |
| CCDL16 | Valuta del reddito principale | {CURRENCYCODE_3} |
| CCDL17 | Verifica del reddito principale | {LIST} |
| CCDL18 | Regime speciale | {ALPHANUM-10000} |
| CCDL19 | Data di creazione | {DATEFORMAT} |
| CCDL20 | Canale di creazione | {LIST} |
| CCDL21 | Valuta di denominazione | {CURRENCYCODE_3} |
| CCDL22 | Saldo corrente del capitale | {MONETARY} |
| CCDL23 | Limite del credito totale | {MONETARY} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|---|-----------------|
| CCDL24 | Prezzo di acquisto | {PERCENTAGE} |
| CCDL25 | Data di fine del periodo di grazia per il capitale | {DATEFORMAT} |
| CCDL26 | Frequenza del pagamento del capitale programmato | {LIST} |
| CCDL27 | Frequenza del pagamento degli interessi programmato | {LIST} |
| CCDL28 | Pagamento dovuto | {MONETARY} |
| CCDL29 | Tasso di interesse corrente | {PERCENTAGE} |
| CCDL30 | Indice del tasso di interesse corrente | {LIST} |
| CCDL31 | Durata dell'indice del tasso di interesse corrente | {LIST} |
| CCDL32 | Numero di pagamenti prima della cartolarizzazione | {INTEGER-9999} |
| CCDL33 | Data della ristrutturazione | {DATEFORMAT} |
| CCDL34 | Ultima data di arretrato | {DATEFORMAT} |
| CCDL35 | Numero di giorni di arretrato | {INTEGER-9999} |
| CCDL36 | Saldo degli arretrati | {MONETARY} |
| CCDL37 | Situazione del conto | {LIST} |
| CCDL38 | Motivo del default o dell'esecuzione forzata | {LIST} |
| CCDL39 | Importo del default | {MONETARY} |
| CCDL40 | Data del default | {DATEFORMAT} |
| CCDL41 | Recuperi cumulativi | {MONETARY} |
| CCDL42 | Nome del prestatore originario | {ALPHANUM-100} |
| CCDL43 | Identificativo del soggetto giuridico del prestatore originario | {LEI} |
| CCDL44 | Paese di stabilimento del prestatore originario | {COUNTRYCODE_2} |
| CCDL45 | Nome del cedente | {ALPHANUM-100} |
| CCDL46 | Identificativo del soggetto giuridico del cedente | {LEI} |
| CCDL47 | Paese di stabilimento del cedente | {COUNTRYCODE_2} |

ALLEGATO VIII

Modello per le esposizioni sottostanti — Leasing

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|---|--|------------------|
| Sezione relativa alle informazioni sulle esposizioni sottostanti | | |
| LESL1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| LESL2 | Identificativo originario dell'esposizione sottostante | {ALPHANUM-1000} |
| LESL3 | Nuovo identificativo dell'esposizione sottostante | {ALPHANUM-1000} |
| LESL4 | Identificativo originario del debitore | {ALPHANUM-1000} |
| LESL5 | Nuovo identificativo del debitore | {ALPHANUM-1000} |
| LESL6 | Data limite dei dati | {DATEFORMAT} |
| LESL7 | Data di aggiunta all'aggregato | {DATEFORMAT} |
| LESL8 | Data di riacquisto | {DATEFORMAT} |
| LESL9 | Data di riscatto | {DATEFORMAT} |
| LESL10 | Regione geografica — debitore | {NUTS} |
| LESL11 | Classificazione delle regioni geografiche | {YEAR} |
| LESL12 | Debitore di affidabilità creditizia deteriorata | {Y/N} |
| LESL13 | Segmento Basilea III del debitore | {LIST} |
| LESL14 | Tipo di cliente | {LIST} |
| LESL15 | Codice NACE del settore | {NACE} |
| LESL16 | Dimensione dell'impresa | {LIST} |
| LESL17 | Entrate | {MONETARY} |
| LESL18 | Valuta del bilancio | {CURRENCYCODE_3} |
| LESL19 | Tipo di prodotto | {LIST} |
| LESL20 | Sindacata | {Y/N} |
| LESL21 | Regime speciale | {ALPHANUM-10000} |
| LESL22 | Data di creazione | {DATEFORMAT} |
| LESL23 | Data di scadenza | {DATEFORMAT} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|--|------------------|
| LESL24 | Durata originaria | {INTEGER-9999} |
| LESL25 | Canale di creazione | {LIST} |
| LESL26 | Valuta di denominazione | {CURRENCYCODE_3} |
| LESL27 | Saldo originario del capitale | {MONETARY} |
| LESL28 | Saldo corrente del capitale | {MONETARY} |
| LESL29 | Prezzo di acquisto | {PERCENTAGE} |
| LESL30 | Valore residuale cartolarizzato | {MONETARY} |
| LESL31 | Tipo di ammortamento | {LIST} |
| LESL32 | Data di fine del periodo di grazia per il capitale | {DATEFORMAT} |
| LESL33 | Frequenza del pagamento del capitale programmato | {LIST} |
| LESL34 | Frequenza del pagamento degli interessi programmato | {LIST} |
| LESL35 | Pagamento dovuto | {MONETARY} |
| LESL36 | Tasso di interesse corrente | {PERCENTAGE} |
| LESL37 | Indice del tasso di interesse corrente | {LIST} |
| LESL38 | Durata dell'indice del tasso di interesse corrente | {LIST} |
| LESL39 | Margine sul tasso di interesse corrente | {PERCENTAGE} |
| LESL40 | Intervallo di ricalcolo del tasso di interesse | {INTEGER-9999} |
| LESL41 | Tasso di interesse massimo | {PERCENTAGE} |
| LESL42 | Tasso di interesse minimo | {PERCENTAGE} |
| LESL43 | Numero di pagamenti prima della cartolarizzazione | {INTEGER-9999} |
| LESL44 | Percentuale di rimborsi anticipati consentiti per anno | {PERCENTAGE} |
| LESL45 | Data di fine del divieto di rimborso anticipato | {DATEFORMAT} |
| LESL46 | Penale di rimborso anticipato | {MONETARY} |
| LESL47 | Data di fine della penale di rimborso anticipato | {DATEFORMAT} |
| LESL48 | Data del rimborso anticipato | {DATEFORMAT} |
| LESL49 | Rimborsi anticipati cumulati | {MONETARY} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|--|----------------|
| LESL50 | Prezzo dell'opzione di acquisto | {MONETARY} |
| LESL51 | Importo dell'acconto | {MONETARY} |
| LESL52 | Valore residuale corrente dell'attività | {MONETARY} |
| LESL53 | Data della ristrutturazione | {DATEFORMAT} |
| LESL54 | Ultima data di arretrato | {DATEFORMAT} |
| LESL55 | Saldo degli arretrati | {MONETARY} |
| LESL56 | Numero di giorni di arretrato | {INTEGER-9999} |
| LESL57 | Situazione del conto | {LIST} |
| LESL58 | Motivo del default o dell'esecuzione forzata | {LIST} |
| LESL59 | Importo del default | {MONETARY} |
| LESL60 | Data del default | {DATEFORMAT} |
| LESL61 | Perdite allocate | {MONETARY} |
| LESL62 | Recuperi cumulativi | {MONETARY} |
| LESL63 | Fonte del recupero | {LIST} |
| LESL64 | Importo in deposito | {MONETARY} |
| LESL65 | Regione geografica — garanzia reale | {NUTS} |
| LESL66 | Costruttore | {ALPHANUM-100} |
| LESL67 | Modello | {ALPHANUM-100} |
| LESL68 | Anno di fabbricazione/costruzione | {YEAR} |
| LESL69 | Nuovo o usato | {LIST} |
| LESL70 | Valore residuale originario dell'attività | {MONETARY} |
| LESL71 | Tipo di garanzia reale | {LIST} |
| LESL72 | Importo della valutazione originaria | {MONETARY} |
| LESL73 | Metodo della valutazione originaria | {LIST} |
| LESL74 | Data della valutazione originaria | {DATEFORMAT} |
| LESL75 | Importo della valutazione corrente | {MONETARY} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|---|-----------------|
| LESL76 | Metodo della valutazione corrente | {LIST} |
| LESL77 | Data della valutazione corrente | {DATEFORMAT} |
| LESL78 | Numero di oggetti in leasing | {INTEGER-9999} |
| LESL79 | Nome del prestatore originario | {ALPHANUM-100} |
| LESL80 | Identificativo del soggetto giuridico del prestatore originario | {LEI} |
| LESL81 | Paese di stabilimento del prestatore originario | {COUNTRYCODE_2} |
| LESL82 | Nome del cedente | {ALPHANUM-100} |
| LESL83 | Identificativo del soggetto giuridico del cedente | {LEI} |
| LESL84 | Paese di stabilimento del cedente | {COUNTRYCODE_2} |

ALLEGATO IX

Modello per le esposizioni sottostanti — Attività esoteriche

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|---|--|------------------|
| Sezione relativa alle informazioni sulle esposizioni sottostanti | | |
| ESTL1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| ESTL2 | Identificativo originario dell'esposizione sottostante | {ALPHANUM-1000} |
| ESTL3 | Nuovo identificativo dell'esposizione sottostante | {ALPHANUM-1000} |
| ESTL4 | Identificativo originario del debitore | {ALPHANUM-1000} |
| ESTL5 | Nuovo identificativo del debitore | {ALPHANUM-1000} |
| ESTL6 | Data limite dei dati | {DATEFORMAT} |
| ESTL7 | Data di aggiunta all'aggregato | {DATEFORMAT} |
| ESTL8 | Data di riacquisto | {DATEFORMAT} |
| ESTL9 | Data di riscatto | {DATEFORMAT} |
| ESTL10 | Descrizione | {ALPHANUM-1000} |
| ESTL11 | Regione geografica — debitore | {NUTS} |
| ESTL12 | Classificazione delle regioni geografiche | {YEAR} |
| ESTL13 | Situazione occupazionale | {LIST} |
| ESTL14 | Debitore di affidabilità creditizia deteriorata | {Y/N} |
| ESTL15 | Tipologia giuridica del debitore | {LIST} |
| ESTL16 | Codice NACE del settore | {NACE} |
| ESTL17 | Reddito principale | {MONETARY} |
| ESTL18 | Tipo di reddito principale | {LIST} |
| ESTL19 | Valuta del reddito principale | {CURRENCYCODE_3} |
| ESTL20 | Verifica del reddito principale | {LIST} |
| ESTL21 | Entrate | {MONETARY} |
| ESTL22 | Valuta del bilancio | {CURRENCYCODE_3} |
| ESTL23 | Numero internazionale di identificazione dei titoli | {ISIN} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|--|------------------|
| ESTL24 | Data di creazione | {DATEFORMAT} |
| ESTL25 | Data di scadenza | {DATEFORMAT} |
| ESTL26 | Valuta di denominazione | {CURRENCYCODE_3} |
| ESTL27 | Saldo originario del capitale | {MONETARY} |
| ESTL28 | Saldo corrente del capitale | {MONETARY} |
| ESTL29 | Limite del credito totale | {MONETARY} |
| ESTL30 | Prezzo di acquisto | {PERCENTAGE} |
| ESTL31 | Tipo di ammortamento | {LIST} |
| ESTL32 | Data di fine del periodo di grazia per il capitale | {DATEFORMAT} |
| ESTL33 | Frequenza del pagamento del capitale programmato | {LIST} |
| ESTL34 | Frequenza del pagamento degli interessi programmato | {LIST} |
| ESTL35 | Pagamento dovuto | {MONETARY} |
| ESTL36 | Rapporto tra debito e reddito | {PERCENTAGE} |
| ESTL37 | Importo della maxi rata finale | {MONETARY} |
| ESTL38 | Intervallo di ricalcolo del tasso di interesse | {INTEGER-9999} |
| ESTL39 | Tasso di interesse corrente | {PERCENTAGE} |
| ESTL40 | Indice del tasso di interesse corrente | {LIST} |
| ESTL41 | Durata dell'indice del tasso di interesse corrente | {LIST} |
| ESTL42 | Margine sul tasso di interesse corrente | {PERCENTAGE} |
| ESTL43 | Tasso di interesse massimo | {PERCENTAGE} |
| ESTL44 | Tasso di interesse minimo | {PERCENTAGE} |
| ESTL45 | Numero di pagamenti prima della cartolarizzazione | {INTEGER-9999} |
| ESTL46 | Percentuale di rimborsi anticipati consentiti per anno | {PERCENTAGE} |
| ESTL47 | Data di fine del divieto di rimborso anticipato | {DATEFORMAT} |
| ESTL48 | Penale di rimborso anticipato | {MONETARY} |
| ESTL49 | Data di fine della penale di rimborso anticipato | {DATEFORMAT} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|------------------|---|-----------------|
| ESTL50 | Data del rimborso anticipato | {DATEFORMAT} |
| ESTL51 | Rimborsi anticipati cumulati | {MONETARY} |
| ESTL52 | Ultima data di arretrato | {DATEFORMAT} |
| ESTL53 | Saldo degli arretrati | {MONETARY} |
| ESTL54 | Numero di giorni di arretrato | {INTEGER-9999} |
| ESTL55 | Situazione del conto | {LIST} |
| ESTL56 | Motivo del default o dell'esecuzione forzata | {LIST} |
| ESTL57 | Importo del default | {MONETARY} |
| ESTL58 | Data del default | {DATEFORMAT} |
| ESTL59 | Perdite allocate | {MONETARY} |
| ESTL60 | Recuperi cumulativi | {MONETARY} |
| ESTL61 | Nome del cedente | {ALPHANUM-100} |
| ESTL62 | Identificativo del soggetto giuridico del cedente | {LEI} |
| ESTL63 | Paese di stabilimento del cedente | {COUNTRYCODE_2} |
| ESTL64 | Nome del prestatore originario | {ALPHANUM-100} |
| ESTL65 | Identificativo del soggetto giuridico del prestatore originario | {LEI} |
| ESTL66 | Paese di stabilimento del prestatore originario | {COUNTRYCODE_2} |

Sezione relativa alle informazioni sulla garanzia reale

| | | |
|-------|--|-----------------|
| ESTC1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| ESTC2 | Identificativo dell'esposizione sottostante | {ALPHANUM-1000} |
| ESTC3 | Identificativo originario della garanzia reale | {ALPHANUM-1000} |
| ESTC4 | Nuovo identificativo della garanzia reale | {ALPHANUM-1000} |
| ESTC5 | Regione geografica — garanzia reale | {NUTS} |
| ESTC6 | Tipo di garanzia | {LIST} |
| ESTC7 | Tipo di gravame | {LIST} |
| ESTC8 | Privilegio | {INTEGER-9999} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|--------------------------------------|------------------|
| ESTC9 | Tipo di garanzia reale | {LIST} |
| ESTC10 | Importo della valutazione corrente | {MONETARY} |
| ESTC11 | Metodo della valutazione corrente | {LIST} |
| ESTC12 | Data della valutazione corrente | {DATEFORMAT} |
| ESTC13 | Rapporto prestito/valore corrente | {PERCENTAGE} |
| ESTC14 | Importo della valutazione originaria | {MONETARY} |
| ESTC15 | Metodo della valutazione originaria | {LIST} |
| ESTC16 | Data della valutazione originaria | {DATEFORMAT} |
| ESTC17 | Rapporto prestito/valore originario | {PERCENTAGE} |
| ESTC18 | Data della vendita | {DATEFORMAT} |
| ESTC19 | Prezzo di vendita | {MONETARY} |
| ESTC20 | Valuta della garanzia reale | {CURRENCYCODE_3} |

ALLEGATO X

Modello per le esposizioni sottostanti — Supplemento per le esposizioni deteriorate

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|---|--|-----------------|
| Sezione relativa alle informazioni sulle esposizioni sottostanti | | |
| NPEL1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| NPEL2 | Identificativo originario dell'esposizione sottostante | {ALPHANUM-1000} |
| NPEL3 | Nuovo identificativo dell'esposizione sottostante | {ALPHANUM-1000} |
| NPEL4 | Identificativo originario del debitore | {ALPHANUM-1000} |
| NPEL5 | Nuovo identificativo del debitore | {ALPHANUM-1000} |
| NPEL6 | Data limite dei dati | {DATEFORMAT} |
| NPEL7 | In curatela fallimentare | {Y/N} |
| NPEL8 | Data dell'ultimo contatto | {DATEFORMAT} |
| NPEL9 | Deceduto | {Y/N} |
| NPEL10 | Status giuridico | {LIST} |
| NPEL11 | Tipo di procedimento giuridico | {LIST} |
| NPEL12 | Nome del procedimento giuridico | {ALPHANUM-1000} |
| NPEL13 | Azioni legali completate | {ALPHANUM-1000} |
| NPEL14 | Data di avvio del procedimento giuridico in corso | {DATEFORMAT} |
| NPEL15 | Data di nomina del curatore fallimentare | {DATEFORMAT} |
| NPEL16 | Numero di sentenze non passate in giudicato | {INTEGER-9999} |
| NPEL17 | Numero di sentenze passate in giudicato | {INTEGER-9999} |
| NPEL18 | Data di emissione del precetto | {DATEFORMAT} |
| NPEL19 | Data di emissione della lettera di riserva di diritti | {DATEFORMAT} |
| NPEL20 | Foro competente | {COUNTRYCODE_2} |
| NPEL21 | Data di ottenimento dell'ordinanza di sfratto | {DATEFORMAT} |
| NPEL22 | Osservazioni su procedimenti relativi ad altre liti | {ALPHANUM-1000} |
| NPEL23 | Legge applicabile | {COUNTRYCODE_2} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|------------------|--|-----------------|
| NPEL24 | Descrizione del rimborso su misura | {ALPHANUM-1000} |
| NPEL25 | Data di inizio del periodo di soli interessi | {DATEFORMAT} |
| NPEL26 | Data di fine del periodo di soli interessi | {DATEFORMAT} |
| NPEL27 | Data di inizio del periodo a tasso fisso corrente | {DATEFORMAT} |
| NPEL28 | Data di fine del periodo a tasso fisso corrente | {DATEFORMAT} |
| NPEL29 | Tasso di interesse rivedibile corrente | {PERCENTAGE} |
| NPEL30 | Data dell'ultimo pagamento | {DATEFORMAT} |
| NPEL31 | Quota sindacata | {PERCENTAGE} |
| NPEL32 | Avvio del Mortgage Arrears Resolution Process (processo di risoluzione degli arretrati sul mutuo) (MARP) | {DATEFORMAT} |
| NPEL33 | Stadio del MARP | {LIST} |
| NPEL34 | Livello degli incassi esterni | {Y/N} |
| NPEL35 | Piano di ammortamento | {Y/N} |
| NPEL36 | Livello di tolleranza | {Y/N} |
| NPEL37 | Data della prima tolleranza | {DATEFORMAT} |
| NPEL38 | Numero di tolleranze storiche | {INTEGER-9999} |
| NPEL39 | Remissione del capitale | {MONETARY} |
| NPEL40 | Data di remissione del capitale | {DATEFORMAT} |
| NPEL41 | Data di fine della tolleranza | {DATEFORMAT} |
| NPEL42 | Importo del rimborso oggetto di tolleranza | {MONETARY} |

Sezione relativa alle informazioni sulla garanzia reale

| | | |
|-------|--|-----------------|
| NPEC1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| NPEC2 | Identificativo dell'esposizione sottostante | {ALPHANUM-1000} |
| NPEC3 | Identificativo originario della garanzia reale | {ALPHANUM-1000} |
| NPEC4 | Nuovo identificativo della garanzia reale | {ALPHANUM-1000} |
| NPEC5 | IVA da pagare | {PERCENTAGE} |
| NPEC6 | Percentuale completata | {PERCENTAGE} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|------------------|--|-----------------|
| NPEC7 | Stadio dell'esecuzione | {Y/N} |
| NPEC8 | Stadio dell'esecuzione da parte di terzi | {Y/N} |
| NPEC9 | Importo del mutuo assegnato | {MONETARY} |
| NPEC10 | Esposizione sottostante di rango superiore | {MONETARY} |
| NPEC11 | Descrizione dell'esecuzione | {ALPHANUM-1000} |
| NPEC12 | Importo della perizia giudiziaria | {MONETARY} |
| NPEC13 | Data della perizia giudiziaria | {DATEFORMAT} |
| NPEC14 | Prezzo di messa sul mercato | {MONETARY} |
| NPEC15 | Prezzo di offerta | {MONETARY} |
| NPEC16 | Data di preparazione del bene immobile per la vendita | {DATEFORMAT} |
| NPEC17 | Data della messa sul mercato del bene immobile | {DATEFORMAT} |
| NPEC18 | Data dell'offerta sul mercato | {DATEFORMAT} |
| NPEC19 | Data concordata per la vendita | {DATEFORMAT} |
| NPEC20 | Data del contratto | {DATEFORMAT} |
| NPEC21 | Data della prima asta | {DATEFORMAT} |
| NPEC22 | Prezzo di riserva dell'asta giudiziaria per la prima asta | {MONETARY} |
| NPEC23 | Data della successiva asta | {DATEFORMAT} |
| NPEC24 | Prezzo di riserva dell'asta giudiziaria per la successiva asta | {MONETARY} |
| NPEC25 | Data dell'ultima asta | {DATEFORMAT} |
| NPEC26 | Prezzo di riserva dell'asta giudiziaria per l'ultima asta | {MONETARY} |
| NPEC27 | Numero di aste non andate a buon fine | {INTEGER-9999} |

Sezione relativa alle informazioni sugli incassi storici

| | | |
|-------------|---|-----------------|
| NPEH1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| NPEH2 | Identificativo dell'esposizione sottostante | {ALPHANUM-1000} |
| NPEH[3-38] | Saldo legale non pagato al mese n | {MONETARY} |
| NPEH[39-74] | Cronologia dei saldi in arretrato al mese n | {MONETARY} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|---|----------------|
| NPEH[75-110] | Cronologia dei rimborsi — non dalle vendite di garanzie reali al mese n | {MONETARY} |
| NPEH[111-146] | Cronologia dei rimborsi — dalle vendite di garanzie reali al mese n | {MONETARY} |

ALLEGATO XI

Modello per le esposizioni sottostanti — Commercial paper garantiti da attività

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|---|--|---------------------|
| Sezione relativa alle informazioni sulle esposizioni sottostanti | | |
| IVAL1 | Identificativo unico — programma ABCP | {ALPHANUM-28} |
| IVAL2 | Identificativo unico — operazione ABCP | {ALPHANUM-36} |
| IVAL3 | Identificativo originario dell'esposizione sottostante | {ALPHANUM-1000} |
| IVAL4 | Nuovo identificativo dell'esposizione sottostante | {ALPHANUM-1000} |
| IVAL5 | Tipo di esposizione sottostante | {LIST} |
| IVAL6 | Data limite dei dati | {DATEFORMAT} |
| IVAL7 | Regione geografica — massima concentrazione delle esposizioni 1 | {NUTS} |
| IVAL8 | Regione geografica — massima concentrazione delle esposizioni 2 | {NUTS} |
| IVAL9 | Regione geografica — massima concentrazione delle esposizioni 3 | {NUTS} |
| IVAL10 | Classificazione delle regioni geografiche | {YEAR} |
| IVAL11 | Saldo corrente del capitale | {MONETARY} |
| IVAL12 | Numero di esposizioni sottostanti | {INTEGER-999999999} |
| IVAL13 | Esposizioni in EUR | {MONETARY} |
| IVAL14 | Esposizioni in GBP | {MONETARY} |
| IVAL15 | Esposizioni in USD | {MONETARY} |
| IVAL16 | Altre esposizioni | {MONETARY} |
| IVAL17 | Durata residua massima | {INTEGER-9999} |
| IVAL18 | Durata residua media | {INTEGER-9999} |
| IVAL19 | Rapporto prestito/valore corrente | {PERCENTAGE} |
| IVAL20 | Rapporto tra debito e reddito | {PERCENTAGE} |
| IVAL21 | Tipo di ammortamento | {MONETARY} |
| IVAL22 | Frequenza del pagamento del capitale programmato superiore ad un mese | {MONETARY} |
| IVAL23 | Frequenza del pagamento degli interessi programmato superiore ad un mese | {MONETARY} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|--|----------------|
| IVAL24 | Crediti a tasso variabile | {MONETARY} |
| IVAL25 | Importo finanziato | {MONETARY} |
| IVAL26 | Diluizioni | {MONETARY} |
| IVAL27 | Esposizioni riacquistate | {MONETARY} |
| IVAL28 | Esposizioni in stato di default o deteriorate alla data della cartolarizzazione | {MONETARY} |
| IVAL29 | Esposizioni in stato di default | {MONETARY} |
| IVAL30 | Esposizioni in stato di default secondo CRR | {MONETARY} |
| IVAL31 | Importi lordi stornati dall'attivo nel periodo | {MONETARY} |
| IVAL32 | Arretrati 1-29 giorni | {PERCENTAGE} |
| IVAL33 | Arretrati 30-59 giorni | {PERCENTAGE} |
| IVAL34 | Arretrati 60-89 giorni | {PERCENTAGE} |
| IVAL35 | Arretrati 90-119 giorni | {PERCENTAGE} |
| IVAL36 | Arretrati 120-149 giorni | {PERCENTAGE} |
| IVAL37 | Arretrati 150-179 giorni | {PERCENTAGE} |
| IVAL38 | Arretrati +180 giorni | {PERCENTAGE} |
| IVAL39 | Esposizioni ristrutturare | {PERCENTAGE} |
| IVAL40 | Esposizioni ristrutturate (0-1 anno prima del trasferimento) | {MONETARY} |
| IVAL41 | Esposizioni ristrutturate (1-3 anni prima del trasferimento) | {MONETARY} |
| IVAL42 | Esposizioni ristrutturate (> 3 anni prima del trasferimento) | {MONETARY} |
| IVAL43 | Esposizioni ristrutturate (tasso di interesse) | {MONETARY} |
| IVAL44 | Esposizioni ristrutturate (piano di rimborso) | {MONETARY} |
| IVAL45 | Esposizioni ristrutturate (scadenza) | {MONETARY} |
| IVAL46 | Esposizioni ristrutturate (0-1 anno prima del trasferimento e senza nuovi arretrati) | {MONETARY} |
| IVAL47 | Esposizioni ristrutturate (senza nuovi arretrati) | {MONETARY} |
| IVAL48 | Esposizioni ristrutturate (nuovi arretrati) | {MONETARY} |
| IVAL49 | Esposizioni ristrutturate (altro) | {MONETARY} |

ALLEGATO XII

Modello per la comunicazione agli investitori — Cartolarizzazione non abcp

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|---|--|----------------|
| Sezione relativa alle informazioni sulla cartolarizzazione | | |
| IVSS1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| IVSS2 | Data limite dei dati | {DATEFORMAT} |
| IVSS3 | Nome della cartolarizzazione | {ALPHANUM-100} |
| IVSS4 | Identificativo del soggetto segnalante | {ALPHANUM-100} |
| IVSS5 | Persona di contatto presso il soggetto segnalante | {ALPHANUM-256} |
| IVSS6 | Telefono della persona di contatto presso il soggetto segnalante | {TELEPHONE} |
| IVSS7 | E-mail: della persona di contatto presso il soggetto segnalante | {ALPHANUM-256} |
| IVSS8 | Metodo di mantenimento del rischio | {LIST} |
| IVSS9 | Soggetto che mantiene il rischio | {LIST} |
| IVSS10 | Tipo di esposizione sottostante | {LIST} |
| IVSS11 | Metodo di trasferimento del rischio | {Y/N} |
| IVSS12 | Misure/rapporti di attivazione | {Y/N} |
| IVSS13 | Data di fine del periodo di rotatività/accumulo (ramp-up) | {DATEFORMAT} |
| IVSS14 | Recuperi di capitale nel periodo | {MONETARY} |
| IVSS15 | Recuperi di interessi nel periodo | {MONETARY} |
| IVSS16 | Incassi di capitale nel periodo | {MONETARY} |
| IVSS17 | Incassi di interessi nel periodo | {MONETARY} |
| IVSS18 | Utilizzi della linea di liquidità | {Y/N} |
| IVSS19 | Excess spread della cartolarizzazione | {MONETARY} |
| IVSS20 | Meccanismo di intrappolamento dell'excess spread | {Y/N} |
| IVSS21 | Eccesso di garanzia corrente | {PERCENTAGE} |
| IVSS22 | Tasso costante di rimborso anticipato annualizzato | {PERCENTAGE} |
| IVSS23 | Diluizioni | {MONETARY} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|------------------|---|--------------|
| IVSS24 | Importi lordi stornati dall'attivo nel periodo | {MONETARY} |
| IVSS25 | Esposizioni riacquistate | {MONETARY} |
| IVSS26 | Esposizioni ristrutturare | {MONETARY} |
| IVSS27 | Tasso costante di default annualizzato | {PERCENTAGE} |
| IVSS28 | Esposizioni in stato di default | {MONETARY} |
| IVSS29 | Esposizioni in stato di default secondo CRR | {MONETARY} |
| IVSS30 | Metodo di ponderazione del rischio | {LIST} |
| IVSS31 | Probabilità di default del debitore nell'intervallo [0,00 %, 0,10 %] | {PERCENTAGE} |
| IVSS32 | Probabilità di default del debitore nell'intervallo [0,10 %, 0,25 %] | {PERCENTAGE} |
| IVSS33 | Probabilità di default del debitore nell'intervallo [0,25 %, 1,00 %] | {PERCENTAGE} |
| IVSS34 | Probabilità di default del debitore nell'intervallo [1,00 %, 7,50 %] | {PERCENTAGE} |
| IVSS35 | Probabilità di default del debitore nell'intervallo [7,50 %, 20,00 %] | {PERCENTAGE} |
| IVSS36 | Probabilità di default del debitore nell'intervallo [20,00 %, 100,00 %] | {PERCENTAGE} |
| IVSS37 | Stima interna della banca della perdita in caso di default (Loss Given Default) | {PERCENTAGE} |
| IVSS38 | Arretrati 1-29 giorni | {PERCENTAGE} |
| IVSS39 | Arretrati 30-59 giorni | {PERCENTAGE} |
| IVSS40 | Arretrati 60-89 giorni | {PERCENTAGE} |
| IVSS41 | Arretrati 90-119 giorni | {PERCENTAGE} |
| IVSS42 | Arretrati 120-149 giorni | {PERCENTAGE} |
| IVSS43 | Arretrati 150-179 giorni | {PERCENTAGE} |
| IVSS44 | Arretrati +180 giorni | {PERCENTAGE} |

Sezione relativa alle informazioni su prove/eventi/valori di attivazione

| | | |
|-------|---|-------------------|
| IVSR1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| IVSR2 | Identificativo originario di prova/evento/valore di attivazione | {ALPHANUM-1000} |
| IVSR3 | Nuovo identificativo di prova/evento/valore di attivazione | {ALPHANUM-1000} |
| IVSR4 | Descrizione | {ALPHANUM-100000} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|------------------------------|----------------|
| IVSR5 | Livello di soglia | {NUMERIC} |
| IVSR6 | Valore effettivo | {NUMERIC} |
| IVSR7 | Status | {Y/N} |
| IVSR8 | Periodo per sanare | {INTEGER-9999} |
| IVSR9 | Frequenza di calcolo | {INTEGER-9999} |
| IVSR10 | Conseguenze della violazione | {LIST} |

Sezione relativa alle informazioni sui flussi di cassa

| | | |
|--------------|--|-----------------|
| IVSF1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| IVSF2 | Identificativo originario dell'elemento di flusso di cassa | {ALPHANUM-1000} |
| IVSF3 | Nuovo identificativo dell'elemento di flusso di cassa | {ALPHANUM-1000} |
| IVSF4 | Elemento di flusso di cassa | {ALPHANUM-1000} |
| IVSF5 | Importo pagato durante il periodo | {MONETARY} |
| IVSF6 | Fondi disponibili dopo | {MONETARY} |

ALLEGATO XIII

Modello per la comunicazione agli investitori — Cartolarizzazione abcp

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|---|--|-----------------|
| Sezione relativa alle informazioni sul programma | | |
| IVAS1 | Identificativo unico — programma ABCP | {ALPHANUM-28} |
| IVAS2 | Data limite dei dati | {DATEFORMAT} |
| IVAS3 | Identificativo del soggetto segnalante | {ALPHANUM-100} |
| IVAS4 | Persona di contatto presso il soggetto segnalante | {ALPHANUM-256} |
| IVAS5 | Telefono della persona di contatto presso il soggetto segnalante | {TELEPHONE} |
| IVAS6 | E-mail: della persona di contatto presso il soggetto segnalante | {ALPHANUM-256} |
| IVAS7 | Misure/rapporti di attivazione | {Y/N} |
| IVAS8 | Esposizioni non conformi | {MONETARY} |
| IVAS9 | Vita media ponderata | {INTEGER-9999} |
| IVAS10 | Metodo di mantenimento del rischio | {LIST} |
| IVAS11 | Soggetto che mantiene il rischio | {LIST} |
| Sezione relativa alle informazioni sull'operazione | | |
| IVAN1 | Identificativo unico — programma ABCP | {ALPHANUM-28} |
| IVAN2 | Identificativo unico — operazione ABCP | {ALPHANUM-36} |
| IVAN3 | Data limite dei dati | {DATEFORMAT} |
| IVAN4 | Codice NACE del settore | {NACE} |
| IVAN5 | Metodo di mantenimento del rischio | {LIST} |
| IVAN6 | Soggetto che mantiene il rischio | {LIST} |
| IVAN7 | Vita media ponderata | {INTEGER-9999} |
| Sezione relativa alle informazioni su prove/eventi/valori di attivazione | | |
| IVAR1 | Identificativo unico — operazione ABCP | {ALPHANUM-36} |
| IVAR2 | Identificativo originario di prova/evento/valore di attivazione | {ALPHANUM-1000} |
| IVAR3 | Nuovo identificativo di prova/evento/valore di attivazione | {ALPHANUM-1000} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|------------------------------|-------------------|
| IVAR4 | Descrizione | {ALPHANUM-100000} |
| IVAR5 | Status | {Y/N} |
| IVAR6 | Conseguenze della violazione | {LIST} |

ALLEGATO XIV

Modello per le informazioni privilegiate o gli eventi significativi — Cartolarizzazione non abcp

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|---|---|---------------------|
| Sezione relativa alle informazioni sulla cartolarizzazione | | |
| SESS1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| SESS2 | Data limite dei dati | {DATEFORMAT} |
| SESS3 | Non più STS | {Y/N} |
| SESS4 | Provvedimenti correttivi | {Y/N} |
| SESS5 | Provvedimenti amministrativi | {Y/N} |
| SESS6 | Modifica rilevante dei documenti riguardanti l'operazione | {ALPHANUM-1000000} |
| SESS7 | Perfezionamento della vendita | {Y/N} |
| SESS8 | Tipo di cascata dei pagamenti attuale | {LIST} |
| SESS9 | Tipo di master trust | {LIST} |
| SESS10 | Valore della SSPE | {MONETARY} |
| SESS11 | Valore del capitale della SSPE | {MONETARY} |
| SESS12 | Numero di conti della SSPE | {INTEGER-999999999} |
| SESS13 | Saldo del capitale delle obbligazioni | {MONETARY} |
| SESS14 | Quota del venditore | {PERCENTAGE} |
| SESS15 | Quota di finanziamento | {PERCENTAGE} |
| SESS16 | Entrate allocate alla serie | {MONETARY} |
| SESS17 | Indice di riferimento dello swap su tassi di interesse | {LIST} |
| SESS18 | Data di scadenza dello swap su tassi di interesse | {DATEFORMAT} |
| SESS19 | Nozionale dello swap su tassi di interesse | {MONETARY} |
| SESS20 | Valuta del pagatore dello swap su valute | {CURRENCYCODE_3} |
| SESS21 | Valuta del ricevente dello swap su valute | {CURRENCYCODE_3} |
| SESS22 | Tasso di cambio per lo swap su valute | {PERCENTAGE} |
| SESS23 | Data di scadenza dello swap su valute | {DATEFORMAT} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|------------------|--------------------------------|------------|
| SESS24 | Nozionale dello swap su valute | {MONETARY} |

Sezione relativa alle informazioni su segmento/obbligazione

| | | |
|--------|---|------------------|
| SEST1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| SEST2 | Identificativo originario del segmento | {ALPHANUM-1000} |
| SEST3 | Nuovo identificativo del segmento | {ALPHANUM-1000} |
| SEST4 | Numero internazionale di identificazione dei titoli | {ISIN} |
| SEST5 | Nome del segmento | {ALPHANUM-100} |
| SEST6 | Tipo di segmento/obbligazione | {LIST} |
| SEST7 | Valuta | {CURRENCYCODE_3} |
| SEST8 | Saldo originario del capitale | {MONETARY} |
| SEST9 | Saldo corrente del capitale | {MONETARY} |
| SEST10 | Frequenza del pagamento degli interessi | {LIST} |
| SEST11 | Data di pagamento degli interessi | {DATEFORMAT} |
| SEST12 | Data di pagamento del capitale | {DATEFORMAT} |
| SEST13 | Cedola corrente | {PERCENTAGE} |
| SEST14 | Margine/spread sul tasso di interesse corrente | {PERCENTAGE} |
| SEST15 | Cedola minima | {PERCENTAGE} |
| SEST16 | Cedola massima | {PERCENTAGE} |
| SEST17 | Valore della cedola step-up/step down | {PERCENTAGE} |
| SEST18 | Data della cedola step-up/step down | {DATEFORMAT} |
| SEST19 | Convenzione sui giorni lavorativi | {LIST} |
| SEST20 | Indice del tasso di interesse corrente | {LIST} |
| SEST21 | Durata dell'indice del tasso di interesse corrente | {LIST} |
| SEST22 | Data di emissione | {DATEFORMAT} |
| SEST23 | Data di esborso | {DATEFORMAT} |
| SEST24 | Scadenza legale | {DATEFORMAT} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|------------------|---|-----------------|
| SEST25 | Clausola di proroga | {LIST} |
| SEST26 | Prossima data di riacquisto | {DATEFORMAT} |
| SEST27 | Soglia dell'opzione clean-up call | {ALPHANUM-1000} |
| SEST28 | Prossima data dell'opzione di vendita | {DATEFORMAT} |
| SEST29 | Convenzione sul conteggio dei giorni | {LIST} |
| SEST30 | Convenzione di regolamento | {LIST} |
| SEST31 | Punto di attacco corrente | {PERCENTAGE} |
| SEST32 | Punto di attacco originario | {PERCENTAGE} |
| SEST33 | Supporto di credito corrente | {PERCENTAGE} |
| SEST34 | Supporto di credito originario | {PERCENTAGE} |
| SEST35 | Formula del supporto di credito | {ALPHANUM-1000} |
| SEST36 | Segmenti pari passu | {ISIN} |
| SEST37 | Segmenti senior | {ISIN} |
| SEST38 | Saldo in essere nel Principal Deficiency Ledger | {MONETARY} |
| SEST39 | Identificativo del soggetto giuridico del garante | {LEI} |
| SEST40 | Nome del garante | {ALPHANUM-1000} |
| SEST41 | Sottosettore SEC del garante | {ESA} |
| SEST42 | Tipo di protezione | {LIST} |

Sezione relativa alle informazioni sul conto

| | | |
|-------|-------------------------------------|-----------------|
| SESA1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| SESA2 | Identificativo originario del conto | {ALPHANUM-1000} |
| SESA3 | Nuovo identificativo del conto | {ALPHANUM-1000} |
| SESA4 | Tipo di conto | {LIST} |
| SESA5 | Saldo obiettivo del conto | {MONETARY} |
| SESA6 | Saldo effettivo del conto | {MONETARY} |
| SESA7 | Ammortamento del conto | {Y/N} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|------------------|----------------|---------|
|------------------|----------------|---------|

Sezione relativa alle informazioni sulla controparte

| | | |
|-------|--|-------------------|
| SESP1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| SESP2 | Identificativo del soggetto giuridico della controparte | {LEI} |
| SESP3 | Nome della controparte | {ALPHANUM-100} |
| SESP4 | Tipo di controparte | {LIST} |
| SESP5 | Paese di stabilimento della controparte | {COUNTRYCODE_2} |
| SESP6 | Soglia di rating della controparte | {ALPHANUM-100000} |
| SESP7 | Rating della controparte | {ALPHANUM-100000} |
| SESP8 | Identificativo del soggetto giuridico della fonte del rating della controparte | {LEI} |
| SESP9 | Nome della fonte del rating della controparte | {ALPHANUM-100} |

Sezione relativa alle informazioni sulla cartolarizzazione di CLO

| | | |
|--------|--|---------------|
| SESC1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| SESC2 | Data di fine del periodo in cui non è possibile esercitare l'opzione di riacquisto | {DATEFORMAT} |
| SESC3 | Tipo di CLO | {LIST} |
| SESC4 | Periodo corrente | {LIST} |
| SESC5 | Data di inizio del periodo corrente | {DATEFORMAT} |
| SESC6 | Data di fine del periodo corrente | {DATEFORMAT} |
| SESC7 | Limite di concentrazione | {PERCENTAGE} |
| SESC8 | Restrizioni — scadenza legale | {PERCENTAGE} |
| SESC9 | Restrizioni — esposizioni subordinate | {PERCENTAGE} |
| SESC10 | Restrizioni — esposizioni deteriorate | {PERCENTAGE} |
| SESC11 | Restrizioni — esposizioni con pagamento in natura | {PERCENTAGE} |
| SESC12 | Restrizioni — esposizioni a cedola zero | {PERCENTAGE} |
| SESC13 | Restrizioni — esposizioni in strumenti di capitale | {PERCENTAGE} |
| SESC14 | Restrizioni — esposizioni su partecipazioni | {PERCENTAGE} |
| SESC15 | Restrizioni — operazioni discrezionali di vendita | {PERCENTAGE} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|------------------|--|----------------|
| SESC16 | Operazioni discrezionali di vendita | {MONETARY} |
| SESC17 | Reinvestimenti | {MONETARY} |
| SESC18 | Restrizioni — supporto di credito | {Y/N} |
| SESC19 | Restrizioni — quotazioni | {Y/N} |
| SESC20 | Restrizioni — operazioni | {Y/N} |
| SESC21 | Restrizioni — emissioni | {Y/N} |
| SESC22 | Restrizioni — riscatti | {Y/N} |
| SESC23 | Restrizioni — rifinanziamento | {Y/N} |
| SESC24 | Restrizioni — remunerazione delle obbligazioni | {Y/N} |
| SESC25 | Restrizioni — protezione del credito | {Y/N} |
| SESC26 | Periodi di liquidazione della garanzia reale | {INTEGER-9999} |
| SESC27 | Liquidazione della garanzia reale — rinuncia | {Y/N} |

Sezione relativa alle informazioni sul gestore di CLO

| | | |
|--------|--|-----------------|
| SESL1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| SESL2 | Identificativo del soggetto giuridico del gestore di CLO | {LEI} |
| SESL3 | Nome del gestore | {ALPHANUM-1000} |
| SESL4 | Data di stabilimento | {DATEFORMAT} |
| SESL5 | Data di registrazione | {DATEFORMAT} |
| SESL6 | Dipendenti | {INTEGER-9999} |
| SESL7 | Dipendenti — CLO | {INTEGER-9999} |
| SESL8 | Dipendenti — risoluzione | {INTEGER-9999} |
| SESL9 | AUM | {MONETARY} |
| SESL10 | Attività in gestione — prestiti con leva finanziaria | {MONETARY} |
| SESL11 | Attività in gestione — CLOs | {MONETARY} |
| SESL12 | Attività in gestione — UE | {MONETARY} |
| SESL13 | Attività in gestione — CLO dell'UE | {MONETARY} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|------------------|---|----------------|
| SESL14 | Numero di CLO dell'UE | {INTEGER-9999} |
| SESL15 | Capitale | {MONETARY} |
| SESL16 | Capitale — mantenimento del rischio | {MONETARY} |
| SESL17 | Tempi di regolamento | {INTEGER-9999} |
| SESL18 | Frequenza della determinazione del prezzo | {INTEGER-9999} |
| SESL19 | Tasso di default — 1 anno | {PERCENTAGE} |
| SESL20 | Tasso di default — 5 anni | {PERCENTAGE} |
| SESL21 | Tasso di default — 10 anni | {PERCENTAGE} |

Sezione relativa alle informazioni sulla copertura sintetica

| | | |
|--------|--|------------------|
| SESV1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| SESV2 | Identificativo dello strumento di protezione | {ALPHANUM-1000} |
| SESV3 | Tipo di protezione | {LIST} |
| SESV4 | Numero internazionale di identificazione dei titoli della protezione | {ISIN} |
| SESV5 | Nome del fornitore della protezione | {ALPHANUM-100} |
| SESV6 | Identificativo del soggetto giuridico del fornitore della protezione | {LEI} |
| SESV7 | Soggetto pubblico con ponderazione del rischio pari a zero | {Y/N} |
| SESV8 | Legge applicabile | {COUNTRYCODE_2} |
| SESV9 | Accordo quadro ISDA (ISDA Master Agreement) | {LIST} |
| SESV10 | Eventi di default e di risoluzione | {LIST} |
| SESV11 | Tipo di cartolarizzazione sintetica | {Y/N} |
| SESV12 | Valuta della protezione | {CURRENCYCODE_3} |
| SESV13 | Nozionale corrente della protezione | {MONETARY} |
| SESV14 | Nozionale massimo della protezione | {MONETARY} |
| SESV15 | Punto di attacco della protezione | {PERCENTAGE} |
| SESV16 | Punto di distacco della protezione | {PERCENTAGE} |
| SESV17 | Numero internazionale di identificazione dei titoli delle obbligazioni coperte | {ISIN} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|---|----------------|
| SESV18 | Copertura della protezione | {LIST} |
| SESV19 | Data di fine della protezione | {DATEFORMAT} |
| SESV20 | Soglia di rilevanza | {Y/N} |
| SESV21 | Condizioni per l'effettuazione dei pagamenti | {LIST} |
| SESV22 | Possibili pagamenti di rettifica | {Y/N} |
| SESV23 | Durata del periodo di risoluzione | {INTEGER-9999} |
| SESV24 | Obbligazione di rimborso | {Y/N} |
| SESV25 | Garanzia reale sostituibile | {Y/N} |
| SESV26 | Requisito in materia di copertura della garanzia reale | {PERCENTAGE} |
| SESV27 | Margine iniziale della garanzia reale | {MONETARY} |
| SESV28 | Termine di consegna della garanzia reale | {INTEGER-9999} |
| SESV29 | Regolamento | {LIST} |
| SESV30 | Data di scadenza massima permessa | {DATEFORMAT} |
| SESV31 | Indice corrente per i pagamenti all'acquirente della protezione | {LIST} |
| SESV32 | Durata dell'indice corrente per i pagamenti all'acquirente della protezione | {LIST} |
| SESV33 | Frequenza di ricalcolo dei pagamenti all'acquirente della protezione | {LIST} |
| SESV34 | Margine sul tasso di interesse corrente per i pagamenti all'acquirente della protezione | {PERCENTAGE} |
| SESV35 | Tasso di interesse corrente per i pagamenti all'acquirente della protezione | {PERCENTAGE} |
| SESV36 | Indice corrente per i pagamenti al venditore della protezione | {LIST} |
| SESV37 | Durata dell'indice corrente per i pagamenti al venditore della protezione | {LIST} |
| SESV38 | Frequenza di ricalcolo dei pagamenti al venditore della protezione | {LIST} |
| SESV39 | Margine sul tasso di interesse corrente per i pagamenti al venditore della protezione | {PERCENTAGE} |
| SESV40 | Tasso di interesse corrente per i pagamenti al venditore della protezione | {PERCENTAGE} |
| SESV41 | Excess spread come supporto | {Y/N} |
| SESV42 | Definizione di excess spread | {Y/N} |
| SESV43 | Status corrente della protezione | {LIST} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|------------------|---|------------|
| SESV44 | Fallimento è evento creditizio | {Y/N} |
| SESV45 | Mancato pagamento è evento creditizio | {Y/N} |
| SESV46 | Ristrutturazione è evento creditizio | {Y/N} |
| SESV47 | Evento creditizio | {Y/N} |
| SESV48 | Pagamenti cumulati all'acquirente della protezione | {MONETARY} |
| SESV49 | Pagamenti di rettifica cumulati all'acquirente della protezione | {MONETARY} |
| SESV50 | Pagamenti cumulati al venditore della protezione | {MONETARY} |
| SESV51 | Pagamenti di rettifica cumulati al venditore della protezione | {MONETARY} |
| SESV52 | Importo nel Synthetic Excess Spread Ledger | {MONETARY} |

Sezione relativa alle informazioni sull'emittente della garanzia reale

| | | |
|--------|---|------------------|
| SESI1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| SESI2 | Identificativo dello strumento di protezione | {ALPHANUM-1000} |
| SESI3 | Identificativo originario dello strumento di garanzia reale | {ALPHANUM-1000} |
| SESI4 | Nuovo identificativo della garanzia reale | {ALPHANUM-1000} |
| SESI5 | Numero internazionale di identificazione dei titoli dello strumento di garanzia reale | {ISIN} |
| SESI6 | Tipo di strumento di garanzia reale | {LIST} |
| SESI7 | Sottosettore SEC dell'emittente della garanzia reale | {ESA} |
| SESI8 | Identificativo del soggetto giuridico dell'emittente della garanzia reale | {LEI} |
| SESI9 | Emittente della garanzia reale affiliato del cedente? | {Y/N} |
| SESI10 | Saldo in essere corrente | {MONETARY} |
| SESI11 | Valuta dello strumento | {CURRENCYCODE_3} |
| SESI12 | Data di scadenza | {DATEFORMAT} |
| SESI13 | Scarto di garanzia | {PERCENTAGE} |
| SESI14 | Indice del tasso di interesse corrente | {LIST} |
| SESI15 | Durata dell'indice del tasso di interesse corrente | {LIST} |
| SESI16 | Tasso di interesse corrente sui depositi in contante | {PERCENTAGE} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|--|----------------|
| SESI17 | Nome della controparte del contratto di vendita con patto di riacquisto | {ALPHANUM-100} |
| SESI18 | Identificativo del soggetto giuridico della controparte del contratto di vendita con patto di riacquisto | {LEI} |
| SESI19 | Data di scadenza del contratto di vendita con patto di riacquisto | {DATEFORMAT} |

Sezione relativa a tutte le altre informazioni

| | | |
|--------------|--|-----------------|
| SESO1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| SESO2 | Numero di linea di ogni altra informazione | {INTEGER-9999} |
| SESO3 | Ogni altra informazione | {ALPHANUM-1000} |

ALLEGATO XV

Modello per le informazioni privilegiate o gli eventi significativi — Cartolarizzazione abcp

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|---|---|-------------------|
| Sezione relativa alle informazioni sul programma | | |
| SEAS1 | Identificativo unico — programma ABCP | {ALPHANUM-28} |
| SEAS2 | Data limite dei dati | {DATEFORMAT} |
| SEAS3 | Non più STS | {Y/N} |
| SEAS4 | Provvedimenti correttivi | {Y/N} |
| SEAS5 | Provvedimenti amministrativi | {Y/N} |
| SEAS6 | Modifica rilevante dei documenti riguardanti l'operazione | {ALPHANUM-100000} |
| SEAS7 | Legge applicabile | {COUNTRYCODE_2} |
| SEAS8 | Durata della linea di liquidità | {INTEGER-9999} |
| SEAS9 | Copertura della linea di liquidità | {PERCENTAGE} |
| SEAS10 | Intervallo di copertura della linea di liquidità | {INTEGER-9999} |
| SEAS11 | Data di scadenza della linea di liquidità | {DATEFORMAT} |
| SEAS12 | Utilizzi della linea di liquidità | {Y/N} |
| SEAS13 | Emissione totale | {MONETARY} |
| SEAS14 | Emissione massima | {MONETARY} |
| Sezione relativa alle informazioni sull'operazione | | |
| SEAR1 | Identificativo unico — programma ABCP | {ALPHANUM-28} |
| SEAR2 | Identificativo unico — operazione ABCP | {ALPHANUM-36} |
| SEAR3 | Numero di programmi che finanziano l'operazione | {INTEGER-9999} |
| SEAR4 | Non più STS | {Y/N} |
| SEAR5 | Cedente cliente del promotore del programma | {Y/N} |
| SEAR6 | Diritti di garanzia concessi | {Y/N} |
| SEAR7 | Entrate | {MONETARY} |
| SEAR8 | Spese di esercizio | {MONETARY} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|--|------------------|
| SEAR9 | Attività correnti | {MONETARY} |
| SEAR10 | Disponibilità liquide | {MONETARY} |
| SEAR11 | Titoli negoziabili | {MONETARY} |
| SEAR12 | Crediti | {MONETARY} |
| SEAR13 | Passività correnti | {MONETARY} |
| SEAR14 | Debito totale | {MONETARY} |
| SEAR15 | Capitale proprio totale | {MONETARY} |
| SEAR16 | Valuta del bilancio | {CURRENCYCODE_3} |
| SEAR17 | Promotore fornisce supporto all'operazione | {LIST} |
| SEAR18 | Tipo di supporto del promotore | {Y/N} |
| SEAR19 | Durata della linea di liquidità | {INTEGER-9999} |
| SEAR20 | Importo utilizzato della linea di liquidità | {MONETARY} |
| SEAR21 | Copertura della linea di liquidità | {PERCENTAGE} |
| SEAR22 | Intervallo di copertura della linea di liquidità | {INTEGER-9999} |
| SEAR23 | Tipo di linea di liquidità | {LIST} |
| SEAR24 | Data di scadenza del contratto di vendita con patto di riacquisto della linea di liquidità | {DATEFORMAT} |
| SEAR25 | Valuta della linea di liquidità | {CURRENCYCODE_3} |
| SEAR26 | Data di scadenza della linea di liquidità | {DATEFORMAT} |
| SEAR27 | Nome del fornitore della linea di liquidità | {ALPHANUM-100} |
| SEAR28 | Identificativo del soggetto giuridico del fornitore della linea di liquidità | {LEI} |
| SEAR29 | Eccesso di garanzia/interesse subordinato | {PERCENTAGE} |
| SEAR30 | Excess spread dell'operazione | {MONETARY} |
| SEAR31 | Nome del fornitore della lettera di credito | {ALPHANUM-100} |
| SEAR32 | Identificativo del soggetto giuridico del fornitore della lettera di credito | {LEI} |
| SEAR33 | Valuta della lettera di credito | {CURRENCYCODE_3} |
| SEAR34 | Protezione massima della lettera di credito | {PERCENTAGE} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|-------------------------|---|------------------|
| SEAR35 | Nome del garante | {ALPHANUM-100} |
| SEAR36 | Identificativo del soggetto giuridico del garante | {LEI} |
| SEAR37 | Copertura massima della garanzia | {MONETARY} |
| SEAR38 | Valuta della garanzia | {CURRENCYCODE_3} |
| SEAR39 | Data di scadenza della garanzia | {DATEFORMAT} |
| SEAR40 | Tipo di trasferimento dei crediti | {LIST} |
| SEAR41 | Data di scadenza del contratto di vendita con patto di riacquisto | {DATEFORMAT} |
| SEAR42 | Importo acquistato | {MONETARY} |
| SEAR43 | Limite massimo di finanziamento | {MONETARY} |
| SEAR44 | Indice di riferimento dello swap su tassi di interesse | {LIST} |
| SEAR45 | Data di scadenza dello swap su tassi di interesse | {DATEFORMAT} |
| SEAR46 | Nozionale dello swap su tassi di interesse | {MONETARY} |
| SEAR47 | Valuta del pagatore dello swap su valute | {CURRENCYCODE_3} |
| SEAR48 | Valuta del ricevente dello swap su valute | {CURRENCYCODE_3} |
| SEAR49 | Tasso di cambio per lo swap su valute | {PERCENTAGE} |
| SEAR50 | Data di scadenza dello swap su valute | {DATEFORMAT} |
| SEAR51 | Nozionale dello swap su valute | {MONETARY} |

Sezione relativa alle informazioni su segmento/obbligazione

| | | |
|--------------|---|------------------|
| SEAT1 | Identificativo unico — programma ABCP | {ALPHANUM-28} |
| SEAT2 | Identificativo originario dell'obbligazione | {ALPHANUM-1000} |
| SEAT3 | Nuovo identificativo dell'obbligazione | {ALPHANUM-1000} |
| SEAT4 | Numero internazionale di identificazione dei titoli | {ISIN} |
| SEAT5 | Tipo di segmento/obbligazione | {LIST} |
| SEAT6 | Data di emissione | {DATEFORMAT} |
| SEAT7 | Scadenza legale | {DATEFORMAT} |
| SEAT8 | Valuta | {CURRENCYCODE_3} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|------------------|--|-----------------|
| SEAT9 | Saldo corrente del capitale | {MONETARY} |
| SEAT10 | Cedola corrente | {PERCENTAGE} |
| SEAT11 | Indice del tasso di interesse corrente | {LIST} |
| SEAT12 | Durata dell'indice del tasso di interesse corrente | {LIST} |
| SEAT13 | Frequenza del pagamento degli interessi | {LIST} |
| SEAT14 | Supporto di credito corrente | {PERCENTAGE} |
| SEAT15 | Formula del supporto di credito | {ALPHANUM-1000} |

Sezione relativa alle informazioni sul conto

| | | |
|-------|--|-----------------|
| SEAA1 | Identificativo unico — operazione ABCP | {ALPHANUM-36} |
| SEAA2 | Identificativo originario del conto | {ALPHANUM-1000} |
| SEAA3 | Nuovo identificativo del conto | {ALPHANUM-1000} |
| SEAA4 | Tipo di conto | {LIST} |
| SEAA5 | Saldo obiettivo del conto | {MONETARY} |
| SEAA6 | Saldo effettivo del conto | {MONETARY} |
| SEAA7 | Ammortamento del conto | {Y/N} |

Sezione relativa alle informazioni sulla controparte

| | | |
|-------|--|-------------------|
| SEAP1 | Identificativo unico — operazione ABCP | {ALPHANUM-36} |
| SEAP2 | Identificativo del soggetto giuridico della controparte | {LEI} |
| SEAP3 | Nome della controparte | {ALPHANUM-100} |
| SEAP4 | Tipo di controparte | {LIST} |
| SEAP5 | Paese di stabilimento della controparte | {COUNTRYCODE_2} |
| SEAP6 | Soglia di rating della controparte | {ALPHANUM-100000} |
| SEAP7 | Rating della controparte | {ALPHANUM-100000} |
| SEAP8 | Identificativo del soggetto giuridico della fonte del rating della controparte | {LEI} |
| SEAP9 | Nome della fonte del rating della controparte | {ALPHANUM-100} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | FORMATO |
|---|--|-----------------|
| Sezione relativa a tutte le altre informazioni | | |
| SEAO1 | Identificativo unico | {ALPHANUM-28} |
| SEAO2 | Numero di linea di ogni altra informazione | {INTEGER-9999} |
| SEAO3 | Ogni altra informazione | {ALPHANUM-1000} |