Il presente testo è un semplice strumento di documentazione e non produce alcun effetto giuridico. Le istituzioni dell'Unione non assumono alcuna responsabilità per i suoi contenuti. Le versioni facenti fede degli atti pertinenti, compresi i loro preamboli, sono quelle pubblicate nella Gazzetta ufficiale dell'Unione europea e disponibili in EUR-Lex. Tali testi ufficiali sono direttamente accessibili attraverso i link inseriti nel presente documento

►**B** **REGOLAMENTO DI ESECUZIONE (UE) 2022/1860 DELLA COMMISSIONE**

del 10 giugno 2022

che stabilisce norme tecniche di attuazione per l'applicazione del regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme, i formati, la frequenza, i metodi e le modalità di segnalazione

(Testo rilevante ai fini del SEE)

(GU L 262 del 7.10.2022, pag. 68)

Rettificato da:

►**C1** Rettifica, GU L 304 del 24.11.2022, pag. 102 (2022/1860)

►**C2** Rettifica, GU L 125 dell'11.5.2023, pag. 59 (2022/1860)

▼B

REGOLAMENTO DI ESECUZIONE (UE) 2022/1860 DELLA COMMISSIONE

del 10 giugno 2022

che stabilisce norme tecniche di attuazione per l'applicazione del regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme, i formati, la frequenza, i metodi e le modalità di segnalazione

(Testo rilevante ai fini del SEE)

Articolo 1

Norme e formati relativi ai dati delle segnalazioni dei derivati

Le informazioni relative a un contratto derivato da segnalare a norma dell'articolo 9 del regolamento (UE) n. 648/2012 sono fornite secondo le norme e i formati indicati nelle tabelle 1, 2 e 3 dell'allegato del presente regolamento, in forma elettronica uniforme e leggibile da dispositivo elettronico e in un modello XML uniforme rispondente alla metodologia ISO 20022.

Articolo 2

Frequenza delle segnalazioni

1. Tutte le segnalazioni delle informazioni relative a un derivato di cui all'articolo 1 del regolamento delegato (UE) 2022/1855 della Commissione ([1]), sono presentate nell'ordine cronologico in cui si sono verificati gli eventi relativi alle informazioni da segnalare.

2. La controparte centrale, la controparte finanziaria o la controparte non finanziaria di cui all'articolo 10 del regolamento (UE) n. 648/2012 che è controparte di un derivato, o il soggetto responsabile della segnalazione, segnala ogni modifica delle informazioni relative ai dati sulle garanzie, quali risultano quotidianamente a fine giornata, nei campi da 1 a 29 della tabella 3 dell'allegato del regolamento delegato (UE) 2022/1855 con tipo di azione «Aggiornamento del margine» per quel derivato quando:

a) il derivato non è scaduto e non è stato oggetto di una segnalazione con tipo di azione «Cessazione», «Errore» o «Componente di posizione» di cui al campo 151 della tabella 2 dell'allegato; o

b) il derivato è stato oggetto di una segnalazione con tipo di azione «Ripristino» non seguita da un'altra segnalazione con tipo di azione «Cessazione» o «Errore» di cui al campo 151 della tabella 2 dell'allegato.

([1]) Regolamento delegato (UE) 2022/1855 della Commissione, del 10 giugno 2022, che integra il regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione che specificano le informazioni minime da segnalare al repertorio di dati sulle negoziazioni e il tipo di segnalazioni da utilizzare (cfr. pag. 1 della presente Gazzetta ufficiale).

▼B

3. La controparte di un derivato di cui al paragrafo 2, lettere a) e b), che è una controparte centrale, una controparte finanziaria o una controparte non finanziaria di cui all'articolo 10 del regolamento (UE) n. 648/2012 o il soggetto responsabile della segnalazione comunica la valutazione di fine giornata del contratto a prezzi correnti di mercato o in base ad un modello, quale risulta quotidianamente a fine giornata, nei campi da 21 a 25 della tabella 2 dell'allegato del regolamento delegato (UE) 2022/1855 con tipo di azione «Aggiornamento della valutazione», secondo la situazione a fine giornata.

Articolo 3

Identificazione delle controparti e degli altri soggetti

1. La segnalazione usa un codice LEI (*Legal Entity Identifier* — identificativo della persona giuridica) ISO 17442 per identificare:

a) l'intermediario;

b) la controparte centrale;

c) il partecipante diretto;

d) la controparte, se persona giuridica;

e) il soggetto che trasmette la segnalazione;

f) il soggetto responsabile della segnalazione;

g) il prestatore di servizi di riduzione del rischio post-negoziazione.

2. La controparte 1 di un derivato di cui al campo 4 della tabella 1 dell'allegato del regolamento delegato (UE) 2022/1855 e il soggetto responsabile della segnalazione provvedono a che i dati di riferimento relativi al rispettivo codice LEI ISO 17442 siano rinnovati alle condizioni di una delle unità operative locali accreditate del sistema LEI globale all'atto della segnalazione della conclusione o modifica di un contratto derivato ai sensi dell'articolo 9 del regolamento (UE) n. 648/2012.

Articolo 4

Direzione del derivato

1. Il lato della controparte del contratto derivato di cui ai campi da 17 a 19 della tabella 1 dell'allegato è determinato al momento della conclusione del derivato ►C1 conformemente ai paragrafi da 2 a 13 ◄.

2. Per le opzioni e le *swaption*, la controparte che detiene il diritto di esercitare l'opzione è identificata come acquirente e la controparte che vende l'opzione e riceve un premio è identificata come venditore.

3. Per i *forward* relativi a valute, la controparte 1 è identificata come ordinante o come destinatario per la gamba 1, e l'inverso per la gamba 2. La controparte 2 compila i campi 18 e 19 della tabella 1 con valori inversi rispetto a quelli della controparte 1.

▼B

4. Per gli *swap* relativi a valute caratterizzati da cambi multipli di valute, ogni controparte di entrambe le gambe dell'operazione è identificata come ordinante o come destinatario della gamba in base al cambio di valuta più prossimo alla data di scadenza.

5. Per i *forward* diversi dai *forward* relativi a valute e per i *future*, la controparte che acquista lo strumento è identificata come acquirente e la controparte che vende lo strumento è identificata come venditore.

6. Per i contratti finanziari differenziali e le scommesse su differenziale (*spreadbet*), la controparte che assume una posizione corta nel contratto è identificata come acquirente e la controparte che assume una posizione lunga nel contratto è identificata come venditore.

7. Per gli *swap* relativi a dividendi, la controparte che riceve l'importo equivalente dei dividendi distribuiti è identificata come acquirente e la controparte che paga tale importo è identificata come venditore.

8. Per gli *swap* relativi a titoli diversi dagli *swap* relativi a dividendi, la controparte 1 è identificata come ordinante o come destinatario per la gamba 1, e l'inverso per la gamba 2. La controparte 2 compila i campi 18 e 19 della tabella 1 con valori inversi rispetto a quelli della controparte 1.

9. Per gli *swap* relativi a tassi d'interesse o indici di inflazione, compresi gli *swap* valutari, la controparte 1 è identificata come ordinante o come destinatario per la gamba 1, e l'inverso per la gamba 2. La controparte 2 compila i campi 18 e 19 della tabella 1 con valori inversi rispetto a quelli della controparte 1.

10. Ad eccezione delle opzioni e delle *swaption*, per gli strumenti derivati per il trasferimento del rischio di credito la controparte che acquista la protezione è identificata come acquirente e la controparte che vende la protezione è identificata come venditore.

11. Per gli *swap* relativi a merci, la controparte 1 è identificata come ordinante o come destinatario per la gamba 1, e l'inverso per la gamba 2. La controparte 2 compila i campi 18 e 19 della tabella 1 con valori inversi rispetto a quelli della controparte 1.

12. Per i contratti sui tassi a termine del tipo *forward-rate agreement*, la controparte 1 è identificata come ordinante o come destinatario per la gamba 1, e l'inverso per la gamba 2. La controparte 2 compila i campi 18 e 19 della tabella 1 con valori inversi rispetto a quelli della controparte 1.

13. Per i derivati relativi a varianza, volatilità e correlazione, la controparte che trae profitto da un aumento del prezzo del sottostante è identificata come acquirente e la controparte che trae profitto da una diminuzione del prezzo del sottostante è identificata come venditore.

▼B

Articolo 5

Costituzione di garanzia

La controparte segnalante identifica il tipo di costituzione di garanzia del contratto derivato o del portafoglio di derivati di cui al campo 11 della tabella 3 dell'allegato come segue:

a) «senza garanzia», se tra le controparti non vi è accordo di garanzia o se il contratto di garanzia tra le controparti stabilisce che queste non costituiscano né margine iniziale né margine di variazione in relazione al derivato o al portafoglio di derivati;

b) «con garanzia parziale: solo controparte 1», se il contratto di garanzia tra le controparti stabilisce che la controparte segnalante costituisca regolarmente solo i margini di variazione e che l'altra controparte non costituisca alcun margine in relazione al derivato o al portafoglio di derivati;

c) «con garanzia parziale: solo controparte 2», se il contratto di garanzia tra le controparti stabilisce che l'altra controparte costituisca regolarmente solo il margine di variazione e che la controparte segnalante non costituisca alcun margine in relazione al derivato o al portafoglio di derivati;

d) «con garanzia parziale», se il contratto di garanzia tra le controparti stabilisce che entrambe le controparti costituiscano regolarmente solo il margine di variazione in relazione al derivato o al portafoglio di derivati;

e) «con garanzia unilaterale: solo controparte 1», se il contratto di garanzia tra le controparti stabilisce che la controparte segnalante costituisca il margine iniziale e costituisca regolarmente i margini di variazione e che l'altra controparte non costituisca alcun margine in relazione al derivato o al portafoglio di derivati;

f) «con garanzia unilaterale: solo controparte 2», se il contratto di garanzia tra le controparti stabilisce che l'altra controparte costituisca il margine iniziale e costituisca regolarmente i margini di variazione e che la controparte segnalante non costituisca alcun margine in relazione al derivato o al portafoglio di derivati;

g) «con garanzia parziale/unilaterale: controparte 1», se il contratto di garanzia tra le controparti stabilisce che la controparte segnalante costituisca il margine iniziale e costituisca regolarmente il margine di variazione e che l'altra controparte costituisca regolarmente solo il margine di variazione in relazione al derivato o al portafoglio di derivati;

h) «con garanzia parziale/unilaterale: controparte 2», se il contratto di garanzia tra le controparti stabilisce che l'altra controparte costituisca il margine iniziale e costituisca regolarmente il margine di variazione e che la controparte segnalante costituisca regolarmente solo il margine di variazione in relazione al derivato o al portafoglio di derivati;

▼B

i) «pienamente garantito», se il contratto di garanzia tra le controparti stabilisce che entrambe le controparti costituiscano il margine iniziale e costituiscano regolarmente i margini di variazione in relazione al derivato o al portafoglio di derivati.

Articolo 6

Specifica, identificazione e classificazione dei derivati

1. Nella segnalazione il derivato è indicato con riferimento al tipo di contratto e alla classe di attività conformemente ai campi 10 e 11 della tabella 2 dell'allegato.

Nella segnalazione è indicata la classe di attività a cui il derivato si avvicina maggiormente laddove i derivati non appartengano a una delle classi di derivati di cui al campo 11 della tabella 2 dell'allegato. Entrambe le controparti specificano la stessa classe di attività.

2. Il derivato è identificato nel campo 7 della tabella 2 dell'allegato con un codice ISIN (*International Securities Identification Number*, numero internazionale di identificazione dei titoli) secondo ISO 6166 se:

a) è ammesso alla negoziazione o negoziato in una sede di negoziazione, oppure

b) è negoziato in un internalizzatore sistematico e il suo sottostante è ammesso alla negoziazione o negoziato in una sede di negoziazione ovvero è un indice o un paniere composto di strumenti negoziati in una sede di negoziazione.

3. Il derivato diverso da quello di cui al paragrafo 2 è identificato nel campo 8 della tabella 2 dell'allegato con un codice UPI (*Unique Product Identifier*, identificativo unico del prodotto) secondo ISO 4914.

4. La controparte segnalante classifica il derivato nel campo 9 della tabella 2 dell'allegato con un codice CFI (*Classification of Financial Instrument*, classificazione degli strumenti finanziari) secondo ISO 10962.

Articolo 7

Identificativo unico dell'operazione

1. Le controparti segnalano i derivati con l'identificativo unico dell'operazione (*Unique Trade Identifier*, UTI) generato in conformità dei paragrafi 2, 3 e 5.

2. Il derivato, segnalato a livello di operazione o di posizione, è identificato con un UTI secondo ISO 23897 nel campo 1 della tabella 2 dell'allegato. L'UTI è composto dal codice LEI del soggetto che lo ha generato, seguito da un codice contenente fino a 32 caratteri che è unico a livello del soggetto generatore.

3. Le controparti determinano il soggetto responsabile della generazione dell'UTI come segue:

▼B

a) per i derivati compensati diversi dai derivati tra due CCP, l'UTI è generato nel punto di compensazione dalla CCP per il partecipante diretto. Il partecipante diretto genera un UTI diverso per la sua controparte per l'operazione in cui la CCP non è una controparte;

b) per i derivati eseguiti a livello centrale ma non compensati a livello centrale, l'UTI è generato dalla sede di esecuzione per il suo partecipante;

c) per i derivati diversi da quelli di cui alle lettere a) e b), se una delle due controparti è soggetta agli obblighi di segnalazione in un paese terzo, l'UTI è generato secondo le norme della giurisdizione della controparte che è tenuta ad adempiere agli obblighi di segnalazione per prima.

Quando la controparte soggetta all'obbligo di segnalazione a norma dell'articolo 9 del regolamento (UE) n. 648/2012 deve adempiere per prima agli obblighi di segnalazione, il soggetto responsabile della generazione dell'UTI è stabilito come segue:

i) per i derivati confermati a livello centrale mediante mezzo elettronico, è la piattaforma di conferma dell'operazione nel punto di conferma;

ii) per tutti gli altri derivati, le controparti concordano il soggetto responsabile della generazione dell'UTI. In caso di mancato accordo tra le controparti, è responsabile della generazione la controparte il cui codice LEI risulta essere il primo ordinando gli identificativi delle controparti con i caratteri dell'identificativo invertiti.

Quando l'applicabile normativa del paese terzo prevede lo stesso termine di segnalazione di quello applicabile alla controparte soggetta all'obbligo di segnalazione a norma dell'articolo 9 del regolamento (UE) n. 648/2012, in conformità dell'articolo 9, paragrafo 1, primo comma, del regolamento (UE) n. 648/2012, le controparti si accordano sul soggetto responsabile della generazione dell'UTI.

In caso di mancato accordo tra le controparti, se il derivato è stato confermato a livello centrale mediante mezzo elettronico l'UTI è generato dalla piattaforma di conferma dell'operazione nel punto di conferma.

Se la piattaforma di conferma dell'operazione non è in grado di generare l'UTI nel punto di conferma e le informazioni sul derivato devono essere segnalate a un unico repertorio di dati sulle negoziazioni, tale repertorio di dati è responsabile della generazione dell'UTI.

Se il repertorio di dati sulle negoziazioni a cui sono state segnalate le informazioni relative al derivato non è in grado di generare l'UTI, è responsabile della generazione la controparte il cui codice LEI risulta essere il primo ordinando gli identificativi delle controparti con i caratteri invertiti;

▼B

d) per i derivati diversi da quelli di cui alle lettere a), b) e c) confermati a livello centrale mediante mezzo elettronico, l'UTI è generato dalla piattaforma di conferma dell'operazione nel punto di conferma;

e) per tutti i derivati diversi da quelli di cui alle lettere da a) a d), si applica quanto segue:

i) per i derivati conclusi tra controparti finanziarie e controparti non finanziarie, l'UTI è generato dalle controparti finanziarie;

ii) per i derivati conclusi tra controparti non finanziarie che superano la soglia di compensazione e controparti non finanziarie che non superano la soglia di compensazione, l'UTI è generato dalle controparti non finanziarie che superano la soglia di compensazione;

iii) per tutti i derivati diversi da quelli di cui ai punti i) e ii), le controparti concordano il soggetto responsabile della generazione dell'UTI. In caso di mancato accordo tra le controparti, è responsabile della generazione la controparte il cui codice LEI risulta essere il primo ordinando gli identificativi delle controparti con i caratteri dell'identificativo invertiti.

4. La controparte che genera l'UTI lo comunica all'altra controparte in modo tempestivo e non oltre le ore 10:00 UTC del giorno lavorativo successivo alla data di conclusione del derivato.

5. Nonostante il paragrafo 3, la generazione dell'UTI può essere delegata a un soggetto diverso da quello determinato conformemente al paragrafo 3. Il soggetto che genera l'UTI soddisfa gli obblighi di cui ai paragrafi 2 e 4.

Articolo 8

Segnalazione delle modifiche del codice LEI e aggiornamento del codice di identificazione al codice LEI

1. Se la controparte identificata a norma dell'articolo 3 nella segnalazione di un derivato subisce un evento di ristrutturazione aziendale che comporta la modifica del suo codice LEI, tale controparte o la controparte cui si riferisce il nuovo codice LEI, ovvero il soggetto responsabile della segnalazione per conto di una delle due controparti a norma dell'articolo 9, paragrafi da 1 *bis* a 1 *quinquies*, del regolamento (UE) n. 648/2012, o il soggetto cui una delle controparti ha delegato la segnalazione a norma dell'articolo 9, paragrafo 1 *septies*, del regolamento (UE) n. 648/2012, notifica la modifica al repertorio di dati sulle negoziazioni al quale la controparte che ha subito l'evento di ristrutturazione aziendale ha segnalato i derivati e richiede l'aggiornamento del codice LEI nei derivati di cui all'articolo 2, paragrafo 2, lettere a) e b), alla data dell'evento di ristrutturazione aziendale che comporta la modifica del codice LEI o nei contratti segnalati dopo tale data.

▼B

2. Ove possibile, la richiesta di aggiornamento dell'identificativo nei derivati di cui all'articolo 2, paragrafo 2, lettere a) e b), è presentata almeno 30 giorni di calendario prima dell'evento di ristrutturazione aziendale che comporta la modifica del codice LEI. Il soggetto di cui al paragrafo 1 impossibilitato a fornire l'informazione al repertorio di dati sulle negoziazioni 30 giorni di calendario prima dell'evento di ristrutturazione aziendale che comporta la modifica del codice LEI gliela notifica non appena possibile.

3. La richiesta di cui al paragrafo 1 comprende almeno quanto segue:

a) il codice LEI di ciascuna delle controparti che partecipano all'evento di ristrutturazione aziendale;

b) il codice LEI della nuova controparte;

c) la data in cui ha o ha avuto luogo la modifica del codice LEI;

d) gli UTI degli specifici derivati nel caso in cui l'evento di ristrutturazione aziendale riguardi soltanto un sottoinsieme di derivati di cui all'articolo 2, paragrafo 2, lettere a) e b);

e) prove del fatto che l'evento di ristrutturazione aziendale ha avuto o avrà luogo, fatte salve le disposizioni relative alla comunicazione al pubblico di informazioni privilegiate di cui all'articolo 17 del regolamento (UE) n. 596/2014.

4. La controparte che notifica per errore a un repertorio di dati sulle negoziazioni una modifica del codice LEI segue la procedura per richiederne l'aggiornamento in conformità dei paragrafi 1, 2 e 3.

5. Se una controparte precedentemente identificata con un identificativo diverso dal codice LEI ottiene un codice LEI, si applicano le procedure di cui ai paragrafi 1, 2 e 3.

6. Se la modifica del LEI riguarda una controparte stabilita in un paese terzo, la sua controparte segnalante stabilita nell'Unione o il soggetto responsabile della segnalazione a norma dell'articolo 9, paragrafi da 1 *bis* a 1 *quinquies*, del regolamento (UE) n. 648/2012 o il soggetto al quale la controparte segnalante stabilita nell'Unione ha delegato la segnalazione avvia la procedura di cui ai paragrafi 1, 2 e 3.

7. Se una controparte stabilita in un paese terzo precedentemente identificata con un identificativo diverso dal codice LEI ottiene un codice LEI, ogni controparte segnalante stabilita nell'Unione interessata da tale cambiamento o il soggetto responsabile della segnalazione a norma dell'articolo 9, paragrafi da 1 *bis* a 1 *quinquies*, del regolamento (UE) n. 648/2012 o il soggetto al quale la controparte segnalante stabilita nell'Unione ha delegato la segnalazione richiede al proprio repertorio di dati sulle negoziazioni l'aggiornamento dell'identificativo della controparte stabilita in un paese terzo.

▼B

8. Se la modifica del codice LEI riguarda un soggetto di cui all'articolo 3, paragrafo 1, lettera a), b), c), e) o g), che non è una controparte del derivato, la controparte 1 o il soggetto responsabile della segnalazione conferma al repertorio di dati sulle negoziazioni gli UTI dei derivati di cui all'articolo 2, paragrafo 2, lettere a) e b). Se la controparte 1 e il soggetto responsabile della segnalazione non confermano al repertorio di dati sulle negoziazioni gli UTI dei derivati di cui all'articolo 2, paragrafo 2, lettere a) e b), interessati dalla modifica del codice LEI, la controparte 1 o il soggetto responsabile della segnalazione aggiorna il codice LEI del soggetto interessato in tutte le segnalazioni relative ai derivati di cui all'articolo 2, paragrafo 2, lettere a) e b), inviando una segnalazione con tipo di azione «Modifica».

Articolo 9

Metodi e modalità di segnalazione

1. Il soggetto responsabile della segnalazione notifica alla propria autorità competente e, se diversa, all'autorità competente della controparte segnalante, i seguenti casi:

a) segnalazione errata causata da problemi dei sistemi di segnalazione che potrebbero interessare un numero cospicuo di segnalazioni;

b) ostacolo alla segnalazione che impedisce al soggetto che trasmette la segnalazione di inviare le segnalazioni a un repertorio di dati sulle negoziazioni entro il termine di cui all'articolo 9, paragrafo 1, del regolamento (UE) n. 648/2012;

c) problema significativo che determina errori di segnalazione che non causerebbero il rifiuto da parte di un repertorio di dati sulle negoziazioni conformemente al regolamento delegato (UE) 2022/1858 della Commissione ([2]).

Il soggetto responsabile della segnalazione notifica prontamente tutti questi casi non appena ne viene a conoscenza.

La notifica indica almeno il tipo di errore o omissione, la data dell'evento, l'ambito di segnalazione interessato, le ragioni degli errori o delle omissioni, le misure adottate per risolvere il problema e la tempistica per la soluzione del problema e le correzioni.

2. La controparte finanziaria che ha l'esclusiva responsabilità, inclusa la responsabilità giuridica, della segnalazione dei dati relativi ai contratti derivati OTC per conto di una controparte non finanziaria a norma dell'articolo 9, paragrafo 1 *bis*, del regolamento (UE) n. 648/2012 predispone quanto segue:

([2]) Regolamento delegato (UE) 2022/1858 della Commissione, del 10 giugno 2022, che integra il regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione che specificano le procedure per la riconciliazione dei dati tra i repertori di dati sulle negoziazioni e le procedure che i repertori di dati sulle negoziazioni devono applicare per verificare che la controparte segnalante o il soggetto che trasmette la segnalazione rispettino gli obblighi di segnalazione e per verificare la completezza e la correttezza dei dati segnalati (cfr. pag. 46 della presente Gazzetta ufficiale).

▼B

a) disposizioni affinché la controparte non finanziaria comunichi tempestivamente le seguenti informazioni sui contratti derivati OTC che non si può ragionevolmente ritenere che la controparte finanziaria possieda, e quando risultano sconosciute a tale controparte finanziaria:

   i) identificativo dell'intermediario, come indicato nel campo 15 della tabella 1 dell'allegato;

   ii) partecipante diretto, come indicato nel campo 16 della tabella 1 dell'allegato;

   iii) collegamento diretto a attività commerciali o finanziamenti di tesoreria, come indicato nel campo 20 della tabella 1 dell'allegato;

b) disposizioni per la comunicazione tempestiva alla controparte finanziaria da parte della controparte non finanziaria di qualsiasi modifica degli obblighi giuridici che le incombono ai sensi dell'articolo 10, paragrafo 1, del regolamento (UE) n. 648/2012;

c) disposizioni per il debito rinnovo da parte della controparte non finanziaria del suo codice LEI alle condizioni di una delle unità operative locali accreditate del sistema LEI globale;

d) disposizioni per la notifica tempestiva da parte della controparte non finanziaria alla controparte finanziaria della decisione di iniziare o cessare la segnalazione delle informazioni relative ai contratti derivati OTC conclusi con la controparte finanziaria. Tali disposizioni garantiscono almeno che la notifica sia effettuata per iscritto o con mezzo elettronico equivalente almeno 10 giorni lavorativi prima della data in cui la controparte non finanziaria intende iniziare o cessare la segnalazione.

3. Le controparti, i soggetti responsabili della segnalazione e i soggetti che presentano le segnalazioni, a seconda dei casi, mettono in atto disposizioni per garantire che sia preso in considerazione il riscontro sulle mancate riconciliazioni dato ai sensi dell'articolo 3 del regolamento delegato (UE) 2022/1858.

▼C2

Articolo 10

Data entro la quale i contratti derivati devono essere segnalati

La controparte di un derivato che al 29 aprile 2024 soddisfa le condizioni di cui all'articolo 2, paragrafo 2, lettera a) o b), o il soggetto responsabile della segnalazione comunica tutte le informazioni relative al derivato richieste in conformità dell'allegato trasmettendo una segnalazione con tipo di evento «Aggiornamento» entro 180 giorni di calendario a decorrere dal 29 aprile 2024, a meno che non abbia trasmesso per il derivato una segnalazione con tipo di azione «Modifica» o «Correzione» entro lo stesso periodo.

▼B

Articolo 11

Abrogazione

Il regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012 è abrogato.

I riferimenti al regolamento abrogato si intendono fatti al presente regolamento.

Articolo 12

Entrata in vigore e applicazione

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

Esso si applica a decorrere dal 29 aprile 2024.

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

▼B

ALLEGATO

Tabella 1

	Sezione	Campo	Formato
1	Parti del derivato	Data e ora della segnalazione	Data nel formato ISO 8601 con ora secondo tempo universale coordinato (UTC) AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ
2	Parti del derivato	Identificativo del soggetto che trasmette la segnalazione	Codice LEI (*Legal Entity Identifier* — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici contenuto nei dati relativi al codice LEI pubblicato dalla Global LEI Foundation.
3	Parti del derivato	Soggetto responsabile della segnalazione	Codice LEI (*Legal Entity Identifier* — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici contenuto nei dati relativi al codice LEI pubblicato dalla Global LEI Foundation. Il codice LEI deve essere rinnovato debitamente alle condizioni di una delle unità operative locali accreditate del sistema globale LEI.
4	Parti del derivato	Controparte 1 (controparte segnalante)	Codice LEI (*Legal Entity Identifier* — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici contenuto nei dati relativi al codice LEI pubblicato dalla Global LEI Foundation. Il codice LEI deve essere rinnovato debitamente alle condizioni di una delle unità operative locali accreditate del sistema globale LEI.
5	Parti del derivato	Natura della controparte 1	F = controparte finanziaria N = controparte non finanziaria C = controparte centrale O = altro
6	Parti del derivato	Settore di attività della controparte 1	Tassonomia delle controparti finanziarie: «INVF» — impresa di investimento autorizzata ai sensi della direttiva 2014/65/UE del Parlamento europeo e del Consiglio ([1]); «CDTI» — ente creditizio autorizzato ai sensi della direttiva 2013/36/UE del Parlamento europeo e del Consiglio ([2]); «INUN» — impresa di assicurazione o impresa di riassicurazione autorizzata ai sensi della direttiva 2009/138/CE del Parlamento europeo e del Consiglio ([3]); «UCIT» — OICVM e, se del caso, la sua società di gestione, autorizzati ai sensi della direttiva 2009/65/CE del Parlamento europeo e del Consiglio ([4]), tranne se l'OICVM è stato creato esclusivamente per servire uno o più piani di acquisto azioni per i dipendenti; «ORPI» — ente pensionistico aziendale o professionale (EPAP), quale definito all'articolo 6, punto 1), della direttiva (UE) 2016/2341 del Parlamento europeo e del Consiglio ([5]);

▼B

	Sezione	Campo	Formato
			«AIFD» — fondo di investimento alternativo (FIA), quale definito all'articolo 4, paragrafo 1, lettera a), della direttiva 2011/61/UE del Parlamento europeo e del Consiglio ([6]), che sia stabilito nell'Unione o gestito da un gestore di fondi di investimento alternativi (GEFIA) autorizzato o registrato ai sensi di tale direttiva, a meno che il FIA sia stato creato esclusivamente per servire uno o più piani di acquisto azioni per i dipendenti o sia una società veicolo di cartolarizzazione di cui all'articolo 2, paragrafo 3, lettera g), della direttiva 2011/61/UE, e, se del caso, il suo GEFIA stabilito nell'Unione; «CSDS» — depositario centrale di titoli autorizzato ai sensi del regolamento (UE) n. 909/2014 del Parlamento europeo e del Consiglio ([7]); Tassonomia delle controparti non finanziarie. Le categorie seguenti corrispondono alle principali sezioni della classificazione NACE quale definita dal regolamento (CE) n. 1893/2006 del Parlamento europeo e del Consiglio ([8]): «A» — agricoltura, silvicoltura e pesca; «B» — attività estrattiva; «C» — attività manifatturiere; «D» — fornitura di energia elettrica, gas, vapore e aria condizionata; «E» — fornitura di acqua; reti fognarie, attività di trattamento dei rifiuti e risanamento; «F» — costruzioni; «G» — commercio all'ingrosso e al dettaglio; riparazione di autoveicoli e motocicli; «H» — trasporto e magazzinaggio; «I» — servizi di alloggio e di ristorazione; «J» — servizi di informazione e comunicazione; «K» — attività finanziarie e assicurative; «L» — attività immobiliari; «M» — attività professionali, scientifiche e tecniche; «N» — attività amministrative e di servizi di supporto; «O» — amministrazione pubblica e difesa; assicurazione sociale obbligatoria; «P» — istruzione; «Q» — sanità e assistenza sociale; «R» — attività artistiche, di intrattenimento e divertimento; «S» — altre attività di servizi;

▼B

	Sezione	Campo	Formato
			«T» — attività di famiglie e convivenze come datori di lavoro per personale domestico; produzione di beni e di servizi indifferenziati per uso proprio da parte di famiglie e convivenze; «U» — attività di organizzazioni e organismi extraterritoriali. Se è indicata più di un'attività, elencare i codici nell'ordine di importanza relativa delle attività corrispondenti. Lasciare in bianco in caso di controparti centrali (CCP) e altri tipi di controparti di cui all'articolo 1, paragrafo 5, del regolamento (UE) n. 648/2012 ([9]).
7	Parti del derivato	Soglia di compensazione della controparte 1	Valore booleano: TRUE = al di sopra della soglia FALSE = al di sotto della soglia
8	Parti del derivato	Tipo di identificativo della controparte 2	Valore booleano: — TRUE — FALSE, per le persone fisiche che agiscono come privati non ammessi a ricevere il codice LEI secondo la dichiarazione del comitato di sorveglianza sulla regolamentazione (*Regulatory Oversight Committee*, ROC) relativa ai soggetti che agiscono a titolo professionale, del 20 settembre 2015 (la «dichiarazione ROC»).
9	Parti del derivato	Controparte 2	— Codice LEI (*Legal Entity Identifier* — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici contenuto nei dati relativi al codice LEI pubblicato dalla Global LEI Foundation o codice di massimo 72 caratteri alfanumerici per le persone fisiche che agiscono come privati non ammessi a ricevere il codice LEI secondo la dichiarazione ROC. Il codice che identifica una persona fisica è composto dal LEI della controparte 1 seguito da un identificativo unico assegnato e mantenuto coerentemente dalla controparte 1 per tale persona fisica (o tali persone) a fini di segnalazione regolamentare.
10	Parti del derivato	Paese della controparte 2	Codice paese ISO 3166 di 2 caratteri.
11	Parti del derivato	Natura della controparte 2	F = controparte finanziaria N = controparte non finanziaria C = controparte centrale O = altro

▼B

	Sezione	Campo	Formato
12	Parti del derivato	Settore di attività della controparte 2	Tassonomia delle controparti finanziarie: «INVF» — impresa di investimento autorizzata ai sensi della direttiva 2014/65/UE; «CDTI» — ente creditizio autorizzato ai sensi della direttiva 2013/36/UE; «INUN» — impresa di assicurazione o impresa di riassicurazione autorizzata ai sensi della direttiva 2009/138/CE; «UCIT» — OICVM e, se del caso, la sua società di gestione, autorizzati ai sensi della direttiva 2009/65/CE, tranne se l'OICVM è stato creato esclusivamente per servire uno o più piani di acquisto azioni per i dipendenti; «ORPI» — ente pensionistico aziendale o professionale (EPAP), quale definito all'articolo 6, punto 1), della direttiva (UE) 2016/2341; «AIFD» — fondo di investimento alternativo (FIA), quale definito all'articolo 4, paragrafo 1, lettera a), della direttiva 2011/61/UE, che sia stabilito nell'Unione o gestito da un gestore di fondi di investimento alternativi (GEFIA) autorizzato o registrato ai sensi di tale direttiva, a meno che il FIA sia stato creato esclusivamente per servire uno o più piani di acquisto azioni per i dipendenti o sia una società veicolo di cartolarizzazione di cui all'articolo 2, paragrafo 3, lettera g), della direttiva 2011/61/UE e, se del caso, il suo GEFIA stabilito nell'Unione; «CSDS» — depositario centrale di titoli autorizzato ai sensi del regolamento (UE) n. 909/2014; Tassonomia delle controparti non finanziarie. Le categorie seguenti corrispondono alle principali sezioni della classificazione NACE, quale definita dal regolamento (CE) n. 1893/2006: «A» — agricoltura, silvicoltura e pesca; «B» — attività estrattiva; «C» — attività manifatturiere; «D» — fornitura di energia elettrica, gas, vapore e aria condizionata; «E» — fornitura di acqua; reti fognarie, attività di trattamento dei rifiuti e risanamento; «F» — costruzioni; «G» — commercio all'ingrosso e al dettaglio; riparazione di autoveicoli e motocicli; «H» — trasporto e magazzinaggio; «I» — servizi di alloggio e di ristorazione; «J» — servizi di informazione e comunicazione; «K» — attività finanziarie e assicurative;

▼B

	Sezione	Campo	Formato
			«L» — attività immobiliari; «M» — attività professionali, scientifiche e tecniche; «N» — attività amministrative e di servizi di supporto; «O» — amministrazione pubblica e difesa; assicurazione sociale obbligatoria; «P» — istruzione; «Q» — sanità e assistenza sociale; «R» — attività artistiche, di intrattenimento e divertimento; «S» — altre attività di servizi; «T» — attività di famiglie e convivenze come datori di lavoro per personale domestico; produzione di beni e di servizi indifferenziati per uso proprio da parte di famiglie e convivenze; «U» — attività di organizzazioni e organismi extraterritoriali. Se è indicata più di un'attività, elencare i codici nell'ordine di importanza relativa delle attività corrispondenti. Lasciare in bianco in caso di controparti centrali (CCP) e altri tipi di controparti di cui all'articolo 1, paragrafo 5, del regolamento (UE) n. 648/2012.
13	Parti del derivato	Soglia di compensazione della controparte 2	Valore booleano: TRUE = al di sopra della soglia FALSE = al di sotto della soglia
14	Parti del derivato	Obblighi di segnalazione della controparte 2	Valore booleano: — TRUE, se la controparte 2 è soggetta all'obbligo di segnalazione — FALSE, se la controparte 2 non è soggetta all'obbligo di segnalazione
15	Parti del derivato	Identificativo dell'intermediario	Codice LEI (*Legal Entity Identifier* — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici contenuto nei dati relativi al codice LEI pubblicato dalla Global LEI Foundation.
16	Parti del derivato	Partecipante diretto	Codice LEI (*Legal Entity Identifier* — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici contenuto nei dati relativi al codice LEI pubblicato dalla Global LEI Foundation.
17	Parti del derivato	Direzione	4 caratteri alfabetici: BYER = acquirente SLLR = venditore Compilato conformemente all'articolo 4 del presente regolamento

▼B

	Sezione	Campo	Formato
18	Parti del derivato	Direzione della gamba 1	4 caratteri alfabetici: MAKE = ordinante TAKE = destinatario Compilato conformemente all'articolo 4 del presente regolamento
19	Parti del derivato	Direzione della gamba 2	4 caratteri alfabetici: MAKE = ordinante TAKE = destinatario Compilato conformemente all'articolo 4 del presente regolamento
20	Parti del derivato	Direttamente collegato ad attività commerciali o di finanziamento di tesoreria	Valore booleano: TRUE = sì FALSE = no

([1]) Direttiva 2014/65/UE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 15 maggio 2014, relativa ai mercati degli strumenti finanziari e che modifica la direttiva 2002/92/CE e la direttiva 2011/61/UE (GU L 173 del 12.6.2014, pag. 349).
([2]) Direttiva 2013/36/UE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 26 giugno 2013, sull'accesso all'attività degli enti creditizi e sulla vigilanza prudenziale sugli enti creditizi e sulle imprese di investimento, che modifica la direttiva 2002/87/CE e abroga le direttive 2006/48/CE e 2006/49/CE (GU L 176 del 27.6.2013, pag. 338).
([3]) Direttiva 2009/138/CE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 25 novembre 2009, in materia di accesso ed esercizio delle attività di assicurazione e di riassicurazione (solvibilità II) (GU L 335 del 17.12.2009, pag. 1).
([4]) Direttiva 2009/65/CE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 13 luglio 2009, concernente il coordinamento delle disposizioni legislative, regolamentari e amministrative in materia di taluni organismi d'investimento collettivo in valori mobiliari (OICVM) (GU L 302 del 17.11.2009, pag. 32).
([5]) Direttiva (UE) 2016/2341 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 14 dicembre 2016, relativa alle attività e alla vigilanza degli enti pensionistici aziendali o professionali (EPAP) (GU L 354 del 23.12.2016, pag. 37).
([6]) Direttiva 2011/61/UE del Parlamento europeo e del Consiglio, dell'8 giugno 2011, sui gestori di fondi di investimento alternativi, che modifica le direttive 2003/41/CE e 2009/65/CE e i regolamenti (CE) n. 1060/2009 e (UE) n. 1095/2010 (GU L 174 dell'1.7.2011, pag. 1).
([7]) Regolamento (UE) n. 909/2014 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 23 luglio 2014, relativo al miglioramento del regolamento titoli nell'Unione europea e ai depositari centrali di titoli e recante modifica delle direttive 98/26/CE e 2014/65/UE e del regolamento (UE) n. 236/2012 (GU L 257 del 28.8.2014, pag. 1).
([8]) 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).
([9]) 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).

Tabella 2

	Sezione	Campo	Formato
1	Sezione 2 a — identificativi e collegamenti	UTI	UTI ISO 23897. Fino a 52 caratteri alfanumerici, sono ammessi solo i caratteri alfabetici maiuscoli A-Z e le cifre 0-9.
2	Sezione 2 a — identificativi e collegamenti	Numero di tracciamento della segnalazione	Campo alfanumerico di massimo 52 caratteri.
3	Sezione 2 a — identificativi e collegamenti	UTI precedente (per relazioni uno-a-uno e uno-a-molti tra operazioni)	Fino a 52 caratteri alfanumerici, sono ammessi solo i caratteri alfabetici maiuscoli A-Z e le cifre 0-9.

▼B

	Sezione	Campo	Formato
4	Sezione 2 a — identificativi e collegamenti	UTI della posizione successiva	Fino a 52 caratteri alfanumerici, sono ammessi solo i caratteri alfabetici maiuscoli A-Z e le cifre 0-9.
5	Sezione 2 a — identificativi e collegamenti	Identificativo di riduzione del rischio post-negoziazione (PTRR)	Fino a 52 caratteri alfanumerici, sono ammessi solo i caratteri alfabetici maiuscoli A-Z e le cifre 0-9. I primi 20 caratteri rappresentano il codice LEI del fornitore di compressione.
6	Sezione 2 a — identificativi e collegamenti	Identificativo del pacchetto	Fino a 35 caratteri alfanumerici.
7	Sezione 2 b — informazioni sul contratto	Codice internazionale di identificazione dei titoli (ISIN)	ISIN secondo ISO 6166, codice di 12 caratteri alfanumerici.
8	Sezione 2 b — informazioni sul contratto	Identificativo unico del prodotto (UPI)	UPI secondo ISO 4914, codice di 12 caratteri alfanumerici.
9	Sezione 2 b — informazioni sul contratto	Classificazione del prodotto	CFI secondo ISO 10962, codice di 6 caratteri alfabetici.
10	Sezione 2 b — informazioni sul contratto	Tipo di contratto	CFDS = contratti finanziari differenziali FRAS = contratti sui tassi a termine del tipo *forward rate agreement* FUTR = *future* FORW = *forward* OPTN = opzione SPDB = scommesse su differenziale SWAP = *swap* SWPT = *swaption* OTHR = altro
11	Sezione 2 b — informazioni sul contratto	Classe di attività	COMM = materie prime e quote di emissione CRDT = crediti CURR = valute EQUI = azioni INTR = tassi di interesse
12	Sezione 2 b — informazioni sul contratto	Derivato basato su criptoattività	Valore booleano: — TRUE — per i derivati basati su criptoattività — FALSE — per gli altri derivati
13	Sezione 2 b — informazioni sul contratto	Tipo di identificazione del sottostante	1 carattere alfabetico: I = ISIN B = paniere X = indice

▼B

	Sezione	Campo	Formato
14	Sezione 2 b — informazioni sul contratto	Identificazione del sottostante	Per il tipo I di identificazione del sottostante: ISIN secondo ISO 6166, codice di 12 caratteri alfanumerici. Per il tipo X di identificazione del sottostante: ISIN secondo ISO 6166, se disponibile, codice di 12 caratteri alfanumerici.
15	Sezione 2 b — informazioni sul contratto	Indicatore dell'indice sottostante	Indicazione dell'indice a tasso variabile 4 caratteri alfabetici: ESTR = €STR SONA = SONIA SOFR = SOFR EONA = EONIA EONS = EONIA SWAP (*swap* sull'EONIA) EURI = EURIBOR EUUS = EURODOLLAR EUCH = EuroSwiss GCFR = GCF REPO ISDA = ISDAFIX LIBI = LIBID LIBO = LIBOR MAAA = Muni AAA PFAN = Pfandbriefe TIBO = TIBOR STBO = STIBOR BBSW = BBSW JIBA = JIBAR BUBO = BUBOR CDOR = CDOR CIBO = CIBOR MOSP = MOSPRIM NIBO = NIBOR PRBO = PRIBOR TLBO = TELBOR WIBO = WIBOR TREA = *Treasury* (Tesoro) SWAP = SWAP FUSW = Future SWAP (*swap* su future) EFFR = *Effective Federal Funds Rate* OBFR = *Overnight Bank Funding Rate* CZNA = CZEONIA
16	Sezione 2 b — informazioni sul contratto	Nome dell'indice sottostante	Fino a 50 caratteri alfanumerici. Sono ammessi caratteri speciali se fanno parte del nome completo dell'indice.

▼B

	Sezione	Campo	Formato
17	Sezione 2 b — informazioni sul contratto	Codice del paniere personalizzato	Fino a 72 caratteri alfanumerici composti dal codice LEI del soggetto responsabile della strutturazione del paniere seguito da un massimo di 52 caratteri alfanumerici.
18	Sezione 2 b — informazioni sul contratto	Identificativo dei componenti del paniere	Per il tipo B di identificazione del sottostante: identificazione di tutti i singoli componenti mediante ISIN secondo ISO 6166.
19	Sezione 2 b — informazioni sul contratto	Valuta di regolamento 1	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
20	Sezione 2 b — informazioni sul contratto	Valuta di regolamento 2	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
21	Sezione 2 c — valutazione	Importo della valutazione	Valore positivo e negativo fino a un massimo di 25 caratteri numerici compresi al massimo 5 decimali. Se il valore ha più di cinque cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.
22	Sezione 2 c — valutazione	Valuta della valutazione	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
23	Sezione 2 c — valutazione	Data e ora della valutazione	Data nel formato ISO 8601 con ora secondo UTC AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ
24	Sezione 2 c — valutazione	Metodo di valutazione	4 caratteri alfabetici: MTMA = ai prezzi correnti di mercato MTMO = in base ad un modello CCPV = valutazione della CCP
25	Sezione 2 c — valutazione	Delta	Fino a un massimo di 25 caratteri numerici compresi al massimo 5 decimali. Se il valore ha più di cinque cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. È ammesso qualsiasi valore tra – 1 e 1 (inclusi – 1 e 1).
26	Sezione 2 d — garanzie	Indicatore della garanzia per portafoglio	Valore booleano: TRUE = garanzia costituita su un portafoglio FALSE = non parte di un portafoglio
27	Sezione 2 d — garanzie	Codice della garanzia per portafoglio	Fino a 52 caratteri alfanumerici Non sono ammessi caratteri speciali
28	Sezione 2 e — attenuazione del rischio/segnalazione	Data e ora della conferma	Data nel formato ISO 8601 con ora secondo UTC AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ

▼B

	Sezione	Campo	Formato
29	Sezione 2 e — attenuazione del rischio/segnalazione	Confermato	4 caratteri alfabetici: — NCNF = non confermato — ECNF = per via elettronica — YCNF = per via non elettronica
30	Sezione 2 f — compensazione	Obbligo di compensazione	TRUE = il contratto appartiene a una classe di derivati OTC dichiarata soggetta all'obbligo di compensazione ed entrambe le controparti del contratto sono soggette all'obbligo di compensazione FALSE = il contratto appartiene a una classe di derivati OTC dichiarata soggetta all'obbligo di compensazione ma una controparte del contratto o entrambe non sono soggette all'obbligo di compensazione o valore «UKWN» — il contratto non appartiene a una classe di derivati OTC dichiarata soggetta all'obbligo di compensazione
31	Sezione 2 f — compensazione	Compensato	1 carattere alfabetico: Y= sì, compensazione avvenuta a livello centrale, per operazioni beta e gamma. N= no, compensazione non avvenuta a livello centrale.
32	Sezione 2 f — compensazione	Data e ora della compensazione	Data nel formato ISO 8601 con ora secondo UTC AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ
33	Sezione 2 f — compensazione	Controparte centrale	Codice LEI (*Legal Entity Identifier* — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici contenuto nei dati relativi al codice LEI pubblicato dalla Global LEI Foundation.
34	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Tipo di accordo quadro	4 caratteri alfabetici: «ISDA» — ISDA «CDEA» — *FIA-ISDA Cleared Derivatives Execution Agreement* «EUMA» — *European Master Agreement* «FPCA» — *FOA Professional Client Agreement* «FMAT» — FBF Master Agreement relativo alle operazioni su strumenti finanziari forward «DERV» — Deutscher Rahmenvertrag für Finanztermingeschäfte (DRV) «CMOP» — Contrato Marco de Operaciones Financieras «CHMA» — Swiss Master Agreement «IDMA» — Islamic Derivative Master Agreement «EFMA» — EFET Master Agreement

▼B

	Sezione	Campo	Formato
			«GMRA» — GMRA «GMSL» — GMSLA «BIAG» — accordo bilaterale oppure «OTHR» (altro) se il tipo di accordo quadro non figura nel precedente elenco
35	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Altro tipo di accordo quadro	Fino a 50 caratteri alfanumerici.
36	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Versione dell'accordo quadro	Data nel formato ISO 8601 (AAAA)
37	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Infragruppo	Valore booleano: TRUE = contratto concluso nel quadro di un'operazione infragruppo FALSE = contratto non concluso nel quadro di un'operazione infragruppo
38	Sezione 2 g — dati sull'operazione	PTRR	Valore booleano: TRUE = il contratto deriva da un evento PTRR FALSE = il contratto non deriva da un evento PTRR
39	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Tipo di tecnica PTRR	4 caratteri alfabetici: «PWOS» — compressione del portafoglio senza prestatore di servizi terzo «PWAS» — compressione del portafoglio con prestatore di servizi terzo o con CCP «PRBM» — ribilanciamento del portafoglio/gestione del margine «OTHR» — Altro
40	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Prestatore di servizi PTRR	Codice LEI (*Legal Entity Identifier* — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici contenuto nei dati relativi al codice LEI pubblicato dalla Global LEI Foundation.
41	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Sede di esecuzione	Codice identificativo del mercato (*Market Identifier Code* — MIC) secondo ISO 10383 di 4 caratteri alfanumerici
42	Sezione 2 c — dati sull'operazione	Data e ora di esecuzione	Data nel formato ISO 8601 con ora secondo UTC AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ
43	Sezione 2 c — dati sull'operazione	Data effettiva	Data nel formato UTC secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
44	Sezione 2 c — dati sull'operazione	Data di scadenza	Data nel formato UTC secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)

▼B

	Sezione	Campo	Formato
45	Sezione 2 c — dati sull'operazione	Data di cessazione anticipata	Data nel formato UTC secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
46	Sezione 2 c — dati sull'operazione	Data finale di regolamento contrattuale	Data nel formato UTC secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
47	Sezione 2 c — dati sull'operazione	Tipo di consegna	4 caratteri alfabetici: CASH = contante PHYS = fisica OPTL = facoltativo per la controparte o quando stabilito da terzi
48	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Prezzo	— Se il prezzo è espresso come valore monetario — qualsiasi valore fino a un massimo di 18 caratteri numerici compresi al massimo 13 decimali. Se il valore ha più di 13 cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. — Se il prezzo è espresso come percentuale — qualsiasi valore fino a un massimo di 11 caratteri numerici compresi al massimo 10 decimali espresso come percentuale (ad es. 2.57 invece di 2.57 %). Se il valore ha più di 10 cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.
49	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Valuta del prezzo	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
	I campi da 50 a 52 sono ripetibili e sono compilati nel caso di derivati per cui sono disponibili tabelle di prezzo.		
50	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Data effettiva non rettificata del prezzo	Data nel formato UTC secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
51	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Data finale non rettificata del prezzo	Data nel formato UTC secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
52	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Prezzo in essere tra la data effettiva non rettificata e la data finale.	— Se il prezzo è espresso come valore monetario — qualsiasi valore fino a un massimo di 18 caratteri numerici compresi al massimo 13 decimali. Se il valore ha più di 13 cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore.

▼B

	Sezione	Campo	Formato
			— Se il prezzo è espresso come percentuale — qualsiasi valore fino a un massimo di 11 caratteri numerici compresi al massimo 10 decimali espresso come percentuale (ad es. 2.57 invece di 2.57 %). Se il valore ha più di 10 cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.
53	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Prezzo dell'operazione a pacchetto	— Se il prezzo dell'operazione a pacchetto è espresso come valore monetario — qualsiasi valore fino a un massimo di 18 caratteri numerici compresi al massimo 13 decimali. Se il valore ha più di 13 cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. — Se l'operazione a pacchetto è espressa come percentuale — qualsiasi valore fino a un massimo di 11 caratteri numerici compresi al massimo 10 decimali espresso come percentuale (ad es. 2.57 invece di 2.57 %) Se il valore ha più di 10 cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.
54	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Valuta del prezzo dell'operazione a pacchetto	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
55	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Importo nozionale della gamba 1	Qualsiasi valore superiore o uguale a zero fino a un massimo di 25 caratteri numerici compresi al massimo 5 decimali. Se il valore ha più di cinque cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
56	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Valuta nozionale 1	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
	I campi da 57 a 59 sono ripetibili e sono compilati nel caso di derivati per cui sono disponibili tabelle di importi nozionali		

▼B

	Sezione	Campo	Formato
57	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Data effettiva dell'importo nozionale della gamba 1	Data nel formato UTC secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
58	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Data finale dell'importo nozionale della gamba 1	Data nel formato UTC secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
59	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Importo nozionale in essere alla data effettiva associata della gamba 1	Qualsiasi valore superiore o uguale a zero fino a un massimo di 25 caratteri numerici compresi al massimo 5 decimali. Se il valore ha più di cinque cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
60	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Quantitativo nozionale totale della gamba 1	Qualsiasi valore superiore o uguale a zero fino a un massimo di 25 caratteri numerici compresi al massimo 5 decimali. Se il valore ha più di cinque cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
	I campi da 61 a 63 sono ripetibili e sono compilati nel caso di derivati per cui sono disponibili tabelle di quantitativi nozionali		
61	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Data effettiva del quantitativo nozionale della gamba 1	Data nel formato UTC secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
62	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Data finale del quantitativo nozionale della gamba 1	Data nel formato UTC secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
63	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Quantitativo nozionale in essere alla data effettiva associata della gamba 1	Qualsiasi valore superiore o uguale a zero fino a un massimo di 25 caratteri numerici compresi al massimo 5 decimali. Se il valore ha più di cinque cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.

▼B

	Sezione	Campo	Formato
64	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Importo nozionale della gamba 2	Qualsiasi valore superiore o uguale a zero fino a un massimo di 25 caratteri numerici compresi al massimo 5 decimali. Se il valore ha più di cinque cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
65	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Valuta nozionale 2	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
	I campi da 66 a 68 sono ripetibili e sono compilati nel caso di derivati per cui sono disponibili tabelle di importi nozionali		
66	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Data effettiva dell'importo nozionale della gamba 2	Data nel formato UTC secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
67	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Data finale dell'importo nozionale della gamba 2	Data nel formato UTC secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
68	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Importo nozionale in essere alla data effettiva associata della gamba 2	Qualsiasi valore superiore o uguale a zero fino a un massimo di 25 caratteri numerici compresi al massimo 5 decimali. Se il valore ha più di cinque cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
69	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Quantitativo nozionale totale della gamba 2	Qualsiasi valore superiore o uguale a zero fino a un massimo di 25 caratteri numerici compresi al massimo 5 decimali. Se il valore ha più di cinque cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
	I campi da 70 a 72 sono ripetibili e sono compilati nel caso di derivati per cui sono disponibili tabelle di quantitativi nozionali		

▼B

	Sezione	Campo	Formato
70	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Data effettiva del quantitativo nozionale della gamba 2	Data nel formato UTC secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
71	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Data finale del quantitativo nozionale della gamba 2	Data nel formato UTC secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
72	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Quantitativo nozionale in essere alla data effettiva associata della gamba 2	Qualsiasi valore superiore o uguale a zero fino a un massimo di 25 caratteri numerici compresi al massimo 5 decimali. Se il valore ha più di cinque cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
	La sezione dei campi da 73 a 78 è ripetibile		
73	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Tipo altro pagamento	4 caratteri alfabetici: UFRO = pagamento anticipato, ossia il pagamento iniziale effettuato da una delle controparti per portare un'operazione al *fair value* o per qualsiasi altra ragione che può determinare un'operazione fuori mercato UWIN = liquidazione o cessazione completa, cioè il pagamento finale effettuato quando un'operazione è liquidata prima della sua data finale; pagamenti che possono risultare a causa della completa cessazione dell'operazione o delle operazioni su derivati PEXH = *Principal Exchange*, ossia scambio dei valori nozionali per gli *swap* valutari
74	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Importo altro pagamento	Fino a un massimo di 25 caratteri numerici compresi al massimo 5 decimali. Se il valore ha più di cinque cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. È ammesso qualsiasi valore superiore o uguale a zero.
75	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Valuta altro pagamento	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
76	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Data altro pagamento	Data nel formato UTC secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)

▼B

	Sezione	Campo	Formato
77	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Ordinante altro pagamento	— Codice LEI (*Legal Entity Identifier* — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici contenuto nei dati relativi al codice LEI pubblicato dalla Global LEI Foundation o codice di massimo 72 caratteri alfanumerici per le persone fisiche che agiscono come privati non ammessi a ricevere il codice LEI secondo la dichiarazione ROC. Il codice che identifica una persona fisica è composto dal LEI della controparte 1 seguito da un identificativo unico assegnato e mantenuto coerentemente dalla controparte 1 per tale persona fisica (o tali persone) a fini di segnalazione regolamentare.
78	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Destinatario altro pagamento	— Codice LEI (*Legal Entity Identifier* — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici contenuto nei dati relativi al codice LEI pubblicato dalla Global LEI Foundation o codice di massimo 72 caratteri alfanumerici per le persone fisiche che agiscono come privati non ammessi a ricevere il codice LEI secondo la dichiarazione ROC. Il codice che identifica una persona fisica è composto dal LEI della controparte 1 seguito da un identificativo unico assegnato e mantenuto coerentemente dalla controparte 1 per tale persona fisica (o tali persone) a fini di segnalazione regolamentare.
79	Sezione 2 h — tassi di interesse	Tasso fisso della gamba 1 o cedola	Valori positivi e negativi fino a un massimo di 11 caratteri numerici compresi al massimo 10 decimali espressi come percentuale (ad es. 2.57 invece di 2.57 %) Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.
80	Sezione 2 h — tassi di interesse	Convenzione sul conteggio dei giorni del tasso fisso o della cedola della gamba 1	4 caratteri alfanumerici: A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA A009 = Actual365LorActuActubasisRule A010 = ActualActualAFB A011 = IC30360ICMAor30360basicrule

▼B

	Sezione	Campo	Formato
			A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 A014 = Actual365NL A015 = ActualActualUltimo A016 = IC30EPlus360 A017 = Actual364 A018 = Business252 A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = descrizione
81	Sezione 2 h — tassi di interesse	Periodo di frequenza del pagamento per il tasso fisso o la cedola della gamba 1	4 caratteri alfabetici: DAIL = giornaliera WEEK = settimanale MNTH = mensile YEAR = annuale ADHO = ad hoc, si applica quando i pagamenti sono irregolari EXPI = pagamento a termine
82	Sezione 2 h — tassi di interesse	Moltiplicatore del periodo di frequenza del pagamento per il tasso fisso o la cedola della gamba 1	Qualsiasi numero intero maggiore o uguale a zero fino a 3 caratteri numerici.
83	Sezione 2 h — tassi di interesse	Identificativo del tasso variabile della gamba 1	Se il tasso variabile ha un ISIN, il codice ISIN per quel tasso.
84	Sezione 2 h — tassi di interesse	Indicatore del tasso variabile della gamba 1	Indicazione dell'indice a tasso variabile 4 caratteri alfabetici: ESTR = €STR SONA = SONIA SOFR = SOFR EONA = EONIA EONS = EONIA SWAP (*swap* sull'EONIA) EURI = EURIBOR EUUS = EURODOLLAR EUCH = EuroSwiss GCFR = GCF REPO ISDA = ISDAFIX LIBI = LIBID LIBO = LIBOR MAAA = Muni AAA PFAN = Pfandbriefe

▼B

	Sezione	Campo	Formato
			TIBO = TIBOR STBO = STIBOR BBSW = BBSW JIBA = JIBAR BUBO = BUBOR CDOR = CDOR CIBO = CIBOR MOSP = MOSPRIM NIBO = NIBOR PRBO = PRIBOR TLBO = TELBOR WIBO = WIBOR TREA = *Treasury* (Tesoro) SWAP = SWAP FUSW = Future SWAP (*swap* su future) EFFR = *Effective Federal Funds Rate* OBFR = *Overnight Bank Funding Rate* CZNA = CZEONIA
85	Sezione 2 h — tassi di interesse	Nome del tasso variabile della gamba 1	Fino a 50 caratteri alfanumerici. Sono ammessi caratteri speciali se fanno parte del nome completo dell'indice.
86	Sezione 2 h — tassi di interesse	Convenzione sul conteggio dei giorni del tasso variabile della gamba 1	4 caratteri alfanumerici: A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA A009 = Actual365LorActuActubasisRule A010 = ActualActualAFB A011 = IC30360ICMAor30360basicrule A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 A014 = Actual365NL A015 = ActualActualUltimo A016 = IC30EPlus360 A017 = Actual364

▼B

	Sezione	Campo	Formato
			A018 = Business252 A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = descrizione
87	Sezione 2 h — tassi di interesse	Periodo di frequenza del pagamento per il tasso variabile della gamba 1	4 caratteri alfabetici: DAIL = giornaliera WEEK = settimanale MNTH = mensile YEAR = annuale ADHO = ad hoc, si applica quando i pagamenti sono irregolari EXPI = pagamento a termine
88	Sezione 2 h — tassi di interesse	Moltiplicatore del periodo di frequenza del pagamento per il tasso variabile della gamba 1	Qualsiasi numero intero maggiore o uguale a zero fino a 3 caratteri numerici.
89	Sezione 2 h — tassi di interesse	Periodo di riferimento del tasso variabile della gamba 1 — periodo	4 caratteri alfabetici: DAIL = giornaliera WEEK = settimanale MNTH = mensile YEAR = annuale ADHO = ad hoc, si applica quando i pagamenti sono irregolari EXPI = pagamento a termine
90	Sezione 2 h — tassi di interesse	Periodo di riferimento del tasso variabile della gamba 1 — moltiplicatore	Qualsiasi numero intero maggiore o uguale a zero fino a 3 caratteri numerici.
91	Sezione 2 h — tassi di interesse	Periodo di frequenza di revisione del tasso variabile della gamba 1	4 caratteri alfabetici: DAIL = giornaliera WEEK = settimanale MNTH = mensile YEAR = annuale ADHO = ad hoc, si applica quando i pagamenti sono irregolari EXPI = pagamento a termine
92	Sezione 2 h — tassi di interesse	Moltiplicatore frequenza di revisione del tasso variabile della gamba 1	Qualsiasi numero intero maggiore o uguale a zero fino a 3 caratteri numerici.

▼B

	Sezione	Campo	Formato
93	Sezione 2 h — tassi di interesse	Differenziale della gamba 1	— Se il differenziale è espresso come importo monetario — qualsiasi valore fino a un massimo di 18 caratteri numerici compresi al massimo 13 decimali. — Se il differenziale è espresso come percentuale — qualsiasi valore fino a un massimo di 11 caratteri numerici compresi al massimo 10 decimali espresso come percentuale (ad es. 2.57 invece di 2.57 %). — Se il differenziale è espresso come punti base — qualsiasi numero intero fino a un massimo di 5 caratteri numerici espresso in punti base (ad es. 257 invece di 2.57 %).
94	Sezione 2 h — tassi di interesse	Valuta del differenziale della gamba 1	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
95	Sezione 2 h — tassi di interesse	Tasso fisso della gamba 2	Valori positivi e negativi fino a un massimo di 11 caratteri numerici compresi al massimo 10 decimali espressi come percentuale (ad es. 2.57 invece di 2.57 %) Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.
96	Sezione 2 h — tassi di interesse	Convenzione sul conteggio dei giorni del tasso fisso della gamba 2	4 caratteri alfanumerici: A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA A009 = Actual365LorActuActubasisRule A010 = ActualActualAFB A011 = IC30360ICMAor30360basicrule A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 A014 = Actual365NL A015 = ActualActualUltimo A016 = IC30EPlus360 A017 = Actual364 A018 = Business252 A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = descrizione

▼B

	Sezione	Campo	Formato
97	Sezione 2 h — tassi di interesse	Periodo di frequenza del pagamento del tasso fisso della gamba 2	4 caratteri alfabetici: DAIL = giornaliera WEEK = settimanale MNTH = mensile YEAR = annuale ADHO = ad hoc, si applica quando i pagamenti sono irregolari EXPI = pagamento a termine
98	Sezione 2 h — tassi di interesse	Moltiplicatore del periodo di frequenza del pagamento del tasso fisso della gamba 2	Qualsiasi numero intero maggiore o uguale a zero fino a 3 caratteri numerici.
99	Sezione 2 h — tassi di interesse	Identificativo del tasso variabile della gamba 2	Se il tasso variabile ha un ISIN, il codice ISIN per quel tasso.
100	Sezione 2 h — tassi di interesse	Indicatore del tasso variabile della gamba 2	Indicazione dell'indice a tasso variabile 4 caratteri alfabetici: ESTR = €STR SONA = SONIA SOFR = SOFR EONA = EONIA EONS = EONIA SWAP (*swap* sull'EONIA) EURI = EURIBOR EUUS = EURODOLLAR EUCH = EuroSwiss GCFR = GCF REPO ISDA = ISDAFIX LIBI = LIBID LIBO = LIBOR MAAA = Muni AAA PFAN = Pfandbriefe TIBO = TIBOR STBO = STIBOR BBSW = BBSW JIBA = JIBAR BUBO = BUBOR CDOR = CDOR CIBO = CIBOR MOSP = MOSPRIM NIBO = NIBOR PRBO = PRIBOR TLBO = TELBOR

▼B

	Sezione	Campo	Formato
			WIBO = WIBOR TREA = *Treasury* (Tesoro) SWAP = SWAP FUSW = Future SWAP (*swap* su future) EFFR = *Effective Federal Funds Rate* OBFR = *Overnight Bank Funding Rate* CZNA = CZEONIA
101	Sezione 2 h — tassi di interesse	Nome del tasso variabile della gamba 2	Fino a 50 caratteri alfanumerici. Sono ammessi caratteri speciali se fanno parte del nome completo dell'indice.
102	Sezione 2 h — tassi di interesse	Convenzione sul conteggio dei giorni del tasso variabile della gamba 2	4 caratteri alfanumerici: A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA A009 = Actual365LorActuActubasisRule A010 = ActualActualAFB A011 = IC30360ICMAor30360basicrule A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 A014 = Actual365NL A015 = ActualActualUltimo A016 = IC30EPlus360 A017 = Actual364 A018 = Business252 A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = descrizione
103	Sezione 2 h — tassi di interesse	Periodo di frequenza del pagamento per il tasso variabile della gamba 2	4 caratteri alfabetici: DAIL = giornaliera WEEK = settimanale MNTH = mensile YEAR = annuale ADHO = ad hoc, si applica quando i pagamenti sono irregolari EXPI = pagamento a termine

▼B

	Sezione	Campo	Formato
104	Sezione 2 h — tassi di interesse	Moltiplicatore del periodo di frequenza del pagamento per il tasso variabile della gamba 2	Qualsiasi numero intero maggiore o uguale a zero fino a 3 caratteri numerici.
105	Sezione 2 h — tassi di interesse	Periodo di riferimento del tasso variabile della gamba 2 — periodo	4 caratteri alfabetici: DAIL = giornaliera WEEK = settimanale MNTH = mensile YEAR = annuale ADHO = ad hoc, si applica quando i pagamenti sono irregolari EXPI = pagamento a termine
106	Sezione 2 h — tassi di interesse	Periodo di riferimento del tasso variabile della gamba 2 — moltiplicatore	Qualsiasi numero intero maggiore o uguale a zero fino a 3 caratteri numerici.
107	Sezione 2 h — tassi di interesse	Periodo di frequenza di revisione del tasso variabile della gamba 2	4 caratteri alfabetici: DAIL = giornaliera WEEK = settimanale MNTH = mensile YEAR = annuale ADHO = ad hoc, si applica quando i pagamenti sono irregolari EXPI = pagamento a termine
108	Sezione 2 h — tassi di interesse	Moltiplicatore frequenza di revisione del tasso variabile della gamba 2	Qualsiasi numero intero maggiore o uguale a zero fino a 3 caratteri numerici.
109	Sezione 2 h — tassi di interesse	Differenziale della gamba 2	— Se il differenziale è espresso come importo monetario — qualsiasi valore fino a un massimo di 18 caratteri numerici compresi al massimo 13 decimali. — Se il differenziale è espresso come percentuale — qualsiasi valore fino a un massimo di 11 caratteri numerici compresi al massimo 10 decimali espresso come percentuale (ad es. 2.57 invece di 2.57 %). — Se il differenziale è espresso come punti base — qualsiasi numero intero fino a un massimo di 5 caratteri numerici espresso in punti base (ad es. 257 invece di 2.57 %).
110	Sezione 2 h — tassi di interesse	Valuta del differenziale della gamba 2	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici

▼B

	Sezione	Campo	Formato
111	Sezione 2 h — tassi di interesse	Differenziale dell'operazione a pacchetto	— Se il prezzo dell'operazione a pacchetto è espresso come importo monetario — valore positivo e negativo fino a un massimo di 18 caratteri numerici compresi al massimo 13 decimali. Se il valore ha più di 13 cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. — Se il differenziale dell'operazione a pacchetto è espresso come percentuale — valore positivo e negativo fino a un massimo di 11 caratteri numerici compresi al massimo 10 decimali (ad es. 2.57 invece di 2.57 %). Se il valore ha più di 10 cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. — Se il differenziale dell'operazione a pacchetto è espresso come punti base — qualsiasi numero intero fino a un massimo di 5 caratteri numerici espresso in punti base (ad es. 257 invece di 2.57 %). Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.
112	Sezione 2 h — tassi di interesse	Valuta del differenziale dell'operazione a pacchetto	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
113	Sezione 2 i — tassi di cambio	Tasso di cambio 1	Qualsiasi valore superiore a zero fino a un massimo di 18 cifre compresi al massimo 13 decimali. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
114	Sezione 2 i — tassi di cambio	Tasso di cambio a termine	Qualsiasi valore superiore a zero fino a un massimo di 18 cifre compresi al massimo 13 decimali. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
115	Sezione 2 i — tassi di cambio	Base del tasso di cambio	7 caratteri che rappresentano due codici valuta ISO 4217 separati da «/» senza limitare l'ordine della coppia di valute. Il primo codice valuta indica la valuta unitaria; il secondo codice valuta indica la valuta della quotazione.
116	Sezione 2 j — materie prime e quote di emissione (informazioni generali)	Categoria di prodotti	Sono ammessi solo i valori della colonna «Categoria di prodotti» secondo la tabella della classificazione dei derivati su merci.
117	Sezione 2 j — materie prime e quote di emissione (informazioni generali)	Sottocategoria di prodotti	Sono ammessi solo i valori della colonna «Sottocategoria di prodotti» secondo la tabella della classificazione dei derivati su merci.

▼B

	Sezione	Campo	Formato
118	Sezione 2 j — materie prime e quote di emissione (informazioni generali)	Ulteriore sottocategoria di prodotti	Sono ammessi solo i valori della colonna «Ulteriore sottocategoria di prodotti» secondo la tabella della classificazione dei derivati su merci.
119	Sezione 2 k — materie prime e quote di emissione (energia)	Punto o zona di consegna	Codice EIC alfanumerico di 16 caratteri Campo ripetibile
120	Sezione 2 k — materie prime e quote di emissione (energia)	Punto di interconnessione	Codice EIC alfanumerico di 16 caratteri
121	Sezione 2 k — materie prime e quote di emissione (energia)	Tipo di carico	BSLD = carico di base PKLD = carico di picco OFFP = carico normale HABH = ora/blocco orario SHPD = profilato GASD = giorno gas OTHR = altro
	La sezione dei campi da 122 a 131 è ripetibile.		
122	Sezione 2 k — materie prime e quote di emissione (energia)	Ora di inizio dell'intervallo di consegna	hh:mm:ssZ
123	Sezione 2 k — materie prime e quote di emissione (energia)	Ora di fine dell'intervallo di consegna	hh:mm:ssZ
124	Sezione 2 k — materie prime e quote di emissione (energia)	Data di inizio della consegna	Data nel formato ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
125	Sezione 2 k — materie prime e quote di emissione (energia)	Data di fine della consegna	Data nel formato ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
126	Sezione 2 k — materie prime e quote di emissione (energia)	Durata	MNUT = minuti HOUR = ora DASD = giorno WEEK = settimana MNTH = mese QURT = trimestre SEAS = stagione YEAR = anno OTHR = altro

▼B

	Sezione	Campo	Formato
127	Sezione 2 k — materie prime e quote di emissione (energia)	Giorni della settimana	WDAY = giorni feriali WEND = fine settimana MOND = lunedì TUED = martedì WEDD = mercoledì THUD = giovedì FRID = venerdì SATD = sabato SUND = domenica XBHL = esclusi i giorni festivi IBHL = compresi i giorni festivi Sono consentiti valori multipli
128	Sezione 2 k — materie prime e quote di emissione (energia)	Capacità di consegna	Fino a 20 caratteri numerici inclusi decimali. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.
129	Sezione 2 k — materie prime e quote di emissione (energia)	Unità di quantità	KWAT = KW KWHH = KWh/ora KWHD = KWh/giorno MWAT = MW MWHH = MWh/ora MWHD = MWh/giorno GWAT = GW GWHH = GWh/ora GWHD = GWh/giorno THMD = Therm/giorno KTMD = Ktherm/giorno MTMD = Mtherm/giorno CMPD = cm/giorno MCMD = mcm/giorno BTUD = Btu/giorno MBTD = MMBtu/giorno MJDD = MJ/giorno HMJD = 100MJ/giorno MMJD = MMJ/giorno GJDD = GJ/giorno
130	Sezione 2 k — materie prime e quote di emissione (energia)	Prezzo per quantità per intervallo di tempo	Fino a 20 caratteri numerici inclusi decimali. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.

▼B

	Sezione	Campo	Formato
131	Sezione 2 k — materie prime e quote di emissione (energia)	Valuta del prezzo per quantità per intervallo di tempo	Codice valuta ISO 4217 a 3 caratteri alfabetici
132	Sezione 2 l — opzioni	Tipo di opzione	4 caratteri alfabetici: PUTO = *put* CALL = *call* OTHR = se non è possibile stabilire se si tratta di *call* o di *put*
133	Sezione 2 l — opzioni	Stile dell'opzione	4 caratteri alfabetici: AMER = americano BERM = bermudiano EURO = europeo
134	Sezione 2 l — opzioni	Prezzo *strike*	— Se il prezzo *strike* è espresso come importo monetario: qualsiasi valore fino a un massimo di 18 caratteri numerici compresi al massimo 13 decimali (ad es. 6,39 USD, espresso come 6.39), per le opzioni su azioni, le opzioni su merci, le opzioni in valuta estera e prodotti simili. Se il valore ha più di 13 cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. — Se il prezzo *strike* è espresso in percentuale: qualsiasi valore fino a un massimo di 11 caratteri numerici compresi al massimo 10 decimali espresso in percentuale (ad esempio 2.1 invece di 2.1 %), per le opzioni su tassi di interesse, le *swaption* su tassi di interesse e su crediti il cui prezzo è espresso come differenziale e prodotti simili. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.
	I campi da 135 a 137 sono ripetibili e sono compilati nel caso di derivati per cui sono disponibili tabelle di prezzo *strike*.		
135	Sezione 2 l — opzioni	Data effettiva del prezzo *strike*	Data nel formato UTC secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
136	Sezione 2 l — opzioni	Data finale del prezzo *strike*	Data nel formato UTC secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)

▼B

	Sezione	Campo	Formato
137	Sezione 2 1 — opzioni	Prezzo *strike* in essere alla data effettiva associata	— Se il prezzo *strike* è espresso come importo monetario: qualsiasi valore fino a un massimo di 18 caratteri numerici compresi al massimo 13 decimali (ad es. 6,39 USD, espresso come 6.39), per le opzioni su azioni, le opzioni su merci, le opzioni in valuta estera e prodotti simili. Se il valore ha più di 13 cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. — Se il prezzo *strike* è espresso in percentuale: qualsiasi valore fino a un massimo di 11 caratteri numerici compresi al massimo 10 decimali espresso in percentuale (ad esempio 2.1 invece di 2.1 %), per le opzioni su tassi di interesse, le *swaption* su tassi di interesse e su crediti il cui prezzo è espresso come differenziale e prodotti simili. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.
138	Sezione 2 1 — opzioni	Valuta/coppia di valute del prezzo *strike*	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici; o per le opzioni in valuta estera: 7 caratteri che rappresentano due codici valuta ISO 4217 separati da «/» senza limitare l'ordine della coppia di valute. Il primo codice valuta indica la valuta di base; il secondo codice valuta indica la valuta della quotazione.
139	Sezione 2 1 — opzioni	Importo premio opzione	Qualsiasi valore superiore o uguale a zero fino a un massimo di 25 caratteri numerici compresi al massimo 5 decimali. Se il valore ha più di cinque cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
140	Sezione 2 1 — opzioni	Valuta premio opzione	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
141	Sezione 2 1 — opzioni	Data di pagamento premio opzione	Data nel formato UTC secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
142	Sezione 2 i — opzioni	Data di scadenza del sottostante	Data nel formato UTC secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)

▼B

	Sezione	Campo	Formato
143	Sezione 2 m — derivati su crediti	Rango	4 caratteri alfabetici: SNDB = senior, ad esempio debito senior non garantito (societario/finanziario), debito sovrano in valuta estera (governo), SBOD = subordinato, ad esempio debito subordinato o debito di classe 2 inferiore (*lower tier* 2) (banche), debito subordinato junior o debito di classe 2 superiore (*upper tier* 2) (banche), OTHR = altro, ad esempio azioni privilegiate o capitale di classe 1 (banche) o altri derivati su crediti
144	Sezione 2 m — derivati su crediti	Soggetto di riferimento	Codice paese secondo ISO 3166 di 2 caratteri o Codice paese secondo ISO 3166-2 di 2 caratteri seguito da trattino «-» e da un massimo di 3 caratteri alfanumerici per il codice di suddivisione del paese o Codice LEI (*Legal Entity Identifier* — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
145	Sezione 2 m — derivati su crediti	Serie	Campo con numero intero di massimo 5 cifre
146	Sezione 2 m — derivati su crediti	Versione	Campo con numero intero di massimo 5 cifre
147	Sezione 2 m — derivati su crediti	Fattore dell'indice	Qualsiasi valore fino a un massimo di 11 caratteri numerici compresi al massimo 10 decimali espresso come frazione decimale (ad es. 0.05 invece di 5 %) tra 0 e 1 (compresi 0 e 1). Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
148	Sezione 2 m — derivati su crediti	Segmento	Valore booleano: TRUE = segmentato FALSE = non segmentato
149	Sezione 2 m — derivati su crediti	Punto di attacco indice Credit Derivative Swap (CDS)	Qualsiasi valore fino a un massimo di 11 caratteri numerici compresi al massimo 10 decimali espresso come frazione decimale (ad es. 0.05 invece di 5 %) tra 0 e 1 (compresi 0 e 1). Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
150	Sezione 2 m — derivati su crediti	Punto di distacco indice CDS	Qualsiasi valore fino a un massimo di 11 caratteri numerici compresi al massimo 10 decimali espresso come frazione decimale (ad es. 0.05 invece di 5 %) tra 0 e 1 (compresi 0 e 1). Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.

▼B

	Sezione	Campo	Formato
151	Sezione 2 n — modifiche del derivato	Tipo di azione	4 caratteri alfabetici: NEWT = nuovo MODI = modifica CORR = correzione TERM = cessazione EROR = errore REVI = ripristino VALU = valutazione POSC = componente di posizione
152	Sezione 2 n — modifiche del derivato	Tipo di evento	4 caratteri alfabetici: TRAD = operazione NOVA = subentro COMP = PTRR ETRM = cessazione anticipata CLRG = compensazione EXER = esercizio ALOC = allocazione CREV = evento di credito CORP = evento aziendale INCP = inclusione nella posizione UPDT = aggiornamento
153	Sezione 2 n — modifiche del derivato	Data dell'evento	Data nel formato UTC secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
154	Sezione 2 n — modifiche del derivato	Livello	4 caratteri alfabetici: TCTN = operazione PSTN = posizione

Tabella 3

	Sezione	Campo	Formato
1	Parti del derivato	Data e ora della segnalazione	Data nel formato ISO 8601 con ora secondo tempo universale coordinato (UTC) AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ
2	Parti del derivato	Identificativo del soggetto che trasmette la segnalazione	Codice LEI (*Legal Entity Identifier* — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici contenuto nei dati relativi al codice LEI pubblicato dalla Global LEI Foundation.
3	Parti del derivato	Soggetto responsabile della segnalazione	Codice LEI (*Legal Entity Identifier* — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici contenuto nei dati relativi al codice LEI pubblicato dalla Global LEI Foundation. Il codice LEI deve essere rinnovato debitamente alle condizioni di una delle unità operative locali accreditate del sistema globale LEI.

▼B

	Sezione	Campo	Formato
4	Parti del derivato	Controparte 1 (controparte segnalante)	Codice LEI (*Legal Entity Identifier* — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici contenuto nei dati relativi al codice LEI pubblicato dalla Global LEI Foundation. Il codice LEI deve essere rinnovato debitamente alle condizioni di una delle unità operative locali accreditate del sistema globale LEI.
5	Parti del derivato	Tipo di identificativo della controparte 2	Valore booleano: — TRUE — FALSE, per le persone fisiche che agiscono come privati non ammessi a ricevere il codice LEI secondo la dichiarazione ROC.
6	Parti del derivato	Controparte 2	— Codice LEI (*Legal Entity Identifier* — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici contenuto nei dati relativi al codice LEI pubblicato dalla Global LEI Foundation o codice di massimo 72 caratteri alfanumerici per le persone fisiche che agiscono come privati non ammessi a ricevere il codice LEI secondo la dichiarazione ROC. Il codice che identifica una persona fisica è composto dal LEI della controparte 1 seguito da un identificativo unico assegnato e mantenuto coerentemente dalla controparte 1 per tale persona fisica (o tali persone) a fini di segnalazione regolamentare.
7	Garanzie	Data e ora della garanzia	Data nel formato ISO 8601 con ora secondo UTC AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ
8	Garanzie	Indicatore della garanzia per portafoglio	Valore booleano: TRUE = garanzia costituita su un portafoglio FALSE = non parte di un portafoglio
9	Garanzie	Codice della garanzia per portafoglio	Fino a 52 caratteri alfanumerici Non sono ammessi caratteri speciali
10	Garanzie	UTI	Fino a 52 caratteri alfanumerici, sono ammessi solo i caratteri alfabetici maiuscoli A-Z e le cifre 0-9.
11	Garanzie	Categoria di costituzione di garanzia	4 caratteri alfabetici: UNCL = senza garanzia PRC1 = con garanzia parziale: solo controparte 1 PRC2 = con garanzia parziale: solo controparte 2 PRCL = con garanzia parziale OWC1 = con garanzia unilaterale: solo controparte 1

▼B

	Sezione	Campo	Formato
			OWC2 = con garanzia unilaterale: solo controparte 2 OWP1 = con garanzia parziale/unilaterale: controparte 1 OWP2 = con garanzia parziale/unilaterale: controparte 2 FLCL = pienamente garantito Compilato conformemente all'articolo 5 del presente regolamento
12	Garanzie	Margine iniziale costituito dalla controparte 1 (pre-scarto di garanzia)	Qualsiasi valore superiore o uguale a zero fino a un massimo di 25 caratteri numerici compresi al massimo 5 decimali. Se il valore ha più di cinque cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
13	Garanzie	Margine iniziale costituito dalla controparte 1 (post-scarto di garanzia)	Qualsiasi valore superiore o uguale a zero fino a un massimo di 25 caratteri numerici compresi al massimo 5 decimali. Se il valore ha più di cinque cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
14	Garanzie	Valuta del margine iniziale costituito	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
15	Garanzie	Margine di variazione costituito dalla controparte 1 (pre-scarto di garanzia)	Qualsiasi valore superiore o uguale a zero fino a un massimo di 25 caratteri numerici compresi al massimo 5 decimali. Se il valore ha più di cinque cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
16	Garanzie	Margine di variazione costituito dalla controparte 1 (post-scarto di garanzia)	Qualsiasi valore superiore o uguale a zero fino a un massimo di 25 caratteri numerici compresi al massimo 5 decimali. Se il valore ha più di cinque cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
17	Garanzie	Valuta dei margini di variazione costituiti	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici

▼B

	Sezione	Campo	Formato
18	Garanzie	Garanzia costituita in eccesso dalla controparte 1	Qualsiasi valore superiore o uguale a zero fino a un massimo di 25 caratteri numerici compresi al massimo 5 decimali. Se il valore ha più di cinque cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
19	Garanzie	Valuta della garanzia costituita in eccesso	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
20	Garanzie	Margine iniziale raccolto dalla controparte 1 (pre-scarto di garanzia)	Qualsiasi valore superiore o uguale a zero fino a un massimo di 25 caratteri numerici compresi al massimo 5 decimali. Se il valore ha più di cinque cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
21	Garanzie	Margine iniziale raccolto dalla controparte 1 (post-scarto di garanzia)	Qualsiasi valore superiore o uguale a zero fino a un massimo di 25 caratteri numerici compresi al massimo 5 decimali. Se il valore ha più di cinque cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
22	Garanzie	Valuta del margine iniziale raccolto	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
23	Garanzie	Margine di variazione raccolto dalla controparte 1 (pre-scarto di garanzia)	Qualsiasi valore superiore o uguale a zero fino a un massimo di 25 caratteri numerici compresi al massimo 5 decimali. Se il valore ha più di cinque cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
24	Garanzie	Margine di variazione raccolto dalla controparte 1 (post-scarto di garanzia)	Qualsiasi valore superiore o uguale a zero fino a un massimo di 25 caratteri numerici compresi al massimo 5 decimali. Se il valore ha più di cinque cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.

▼B

	Sezione	Campo	Formato
25	Garanzie	Valuta del margine di variazione raccolto	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
26	Garanzie	Garanzia raccolta in eccesso dalla controparte 1	Qualsiasi valore superiore o uguale a zero fino a un massimo di 25 caratteri numerici compresi al massimo 5 decimali. Se il valore ha più di cinque cifre decimali, le controparti segnalanti arrotondano allo 0,5 superiore. Il segno decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
27	Garanzie	Valuta della garanzia raccolta in eccesso	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
28	Garanzie	Tipo di azione	«MARU» — aggiornamento del margine «CORR» — correzione
29	Garanzie	Data dell'evento	Data nel formato UTC secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)

Tabella 4

Classificazione delle merci

Categoria di prodotti	Sottocategoria di prodotti	Ulteriore sottocategoria di prodotti
«AGRI» — Agricoli	«GROS» — Cereali e semi oleosi	«FWHT» — Frumento da foraggio «SOYB» — Soia «CORN» — Granturco «RPSD» — Colza «RICE» — Riso «OTHR» — Altro
	«SOFT» — Softs	«CCOA» — Cacao «ROBU» — Caffè Robusta «WHSG» — Zucchero bianco «BRWN» — Zucchero grezzo «OTHR» — Altro
	«POTA» — Patate	
	«OOLI» — Olio di oliva	«LAMP» — «Lampante» «OTHR» — Altro
	«DIRY» — Prodotti lattiero-caseari	
	«FRST» — Silvicoltura	

▼B

Categoria di prodotti	Sottocategoria di prodotti	Ulteriore sottocategoria di prodotti
	«SEAF» — Prodotti ittici	
	«LSTK» — Bestiame	
	«GRIN» — Cereali	«MWHT» — Frumento da panificazione «OTHR» — Altro
	«OTHR» — Altro	
«NRGY» — Energia	«ELEC» — Energia elettrica	«BSLD» — Carico di base «FITR» — Diritti di trasmissione finanziari «PKLD» — Carico di punta «OFFP» — Orario normale «OTHR» — Altro
	«NGAS» — Gas naturale	«GASP» — GASPOOL «LNGG» — GNL «NBPG» — NBP «NCGG» — NCG «TTFG» — TTF «OTHR» — Altro
	«OILP» — Petrolio	«BAKK» — Bakken «BDSL» — Biodiesel «BRNT» — Brent «BRNX» — Brent NX «CNDA» — Canadese «COND» — Condensato «DSEL» — Diesel «DUBA» — Dubai «ESPO» — ESPO «ETHA» — Etanolo «FUEL» — Combustibile «FOIL» — Olio combustibile «GOIL» — Gasolio «GSLN» — Benzina «HEAT» — Gasolio da riscaldamento «JTFL» — JET Fuel «KERO» — Kerosene «LLSO» — Light Louisiana Sweet (LLS) «MARS» — Mars «NAPH» — Nafta «NGLO» — GNL «TAPI» — Tapis «URAL» — Urali «WTIO» — WTI «OTHR» — Altro

▼B

Categoria di prodotti	Sottocategoria di prodotti	Ulteriore sottocategoria di prodotti
	«COAL» — Carbone «INRG» — Interenergia «RNNG» — Energie rinnovabili «LGHT» — Benzina leggera di prima distillazione «DIST» — Distillati «OTHR» — Altro	
«ENVR» — Ambientali	«EMIS» — Emissioni	«CERE» — CER «ERUE» — ERU «EUAE» — quote di emissione EUA «EUAA» — quote di emissione EUA nel settore aereo «OTHR» — Altro
	«WTHR» — Meteo «CRBR» — Associati al carbonio «OTHR» — Altro	
«FRGT» — Carico	«WETF» — Umido	«TNKR» — Navi cisterna «OTHR» — Altro
	«DRYF» — Secco	«DBCR» — Portarinfuse «OTHR» — Altro
	«CSHP» — Portacontainer	
	«OTHR» — Altro	
«FRTL» — Concimi	«AMMO» — Ammoniaca «DAPH» — Fosfato di diammonio (DAP) «PTSH» — Potassa «SLPH» — Zolfo «UREA» — Urea «UAAN» — Nitrato di ammonio e urea (UAN) «OTHR» — Altro	
«INDP» — Prodotti industriali	«CSTR» — Costruzioni «MFTG» — Manifatturieri	
«METL» — Metalli	«NPRM» — Non preziosi	«ALUM» — Alluminio «ALUA» — Lega di alluminio «CBLT» — Cobalto «COPR» — Rame «IRON» — Minerale di ferro

▼B

Categoria di prodotti	Sottocategoria di prodotti	Ulteriore sottocategoria di prodotti
		«LEAD» — Piombo «MOLY» — Molibdeno «NASC» — NASAAC «NICK» — Nichel «STEL» — Acciaio «TINN» — Stagno «ZINC» — Zinco «OTHR» — Altro
	«PRME» — Preziosi	«GOLD» — Oro «SLVR» — Argento «PTNM» — Platino «PLDM» — Palladio «OTHR» — Altro
«MCEX» — Esotici multi-merci		
«PAPR» — Carta	«CBRD» — Cartone grezzo ondulato «NSPT» — Carta da giornale «PULP» — Polpa «RCVP» — Carta di recupero «OTHR» — Altro	
«POLY» — Polipropilene	«PLST» — Plastica «OTHR» — Altro	
«INFL» — Inflazione		
«OEST» — Statistiche economiche ufficiali		
«OTHC» — Altri derivati C10 secondo la definizione della tabella 10.1 dell'allegato III del regolamento delegato (UE) 2017/583 della Commissione ([1])		
«OTHR» — Altro		

([1]) Regolamento delegato (UE) 2017/583 della Commissione, del 14 luglio 2016, che integra il regolamento (UE) n. 600/2014 del Parlamento europeo e del Consiglio sui mercati degli strumenti finanziari per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione sugli obblighi di trasparenza a carico delle sedi di negoziazione e delle imprese di investimento in relazione a obbligazioni, strumenti finanziari strutturati, quote di emissione e derivati (GU L 87 del 31.3.2017, pag. 229).