

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

(Testo rilevante ai fini del SEE)

LA COMMISSIONE EUROPEA,

visto il trattato sul funzionamento dell'Unione europea,

visto il 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 ⁽¹⁾, in particolare l'articolo 78, paragrafo 10,

considerando quanto segue:

- (1) Per garantire la qualità delle informazioni sui derivati segnalati loro, i repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero verificare l'identità dei soggetti che trasmettono le segnalazioni, l'integrità logica dell'ordine in cui le informazioni sui derivati sono segnalate e la completezza e la correttezza di tali informazioni.
- (2) Per lo stesso motivo, i repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero riconciliare le informazioni contenute nelle singole segnalazioni di derivati ricevute, qualora entrambe le controparti siano soggette all'obbligo di segnalazione. È opportuno precisare una procedura standardizzata per consentire ai repertori di riconciliare i dati in modo coerente e per ridurre il rischio di mancata riconciliazione di alcune informazioni sui derivati. Tuttavia è possibile che certe informazioni sui derivati non siano identiche a causa delle specificità dei sistemi tecnologici usati dai soggetti che trasmettono le segnalazioni. Occorre pertanto applicare alcune tolleranze per evitare che divergenze minori nelle informazioni segnalate sui derivati impediscano alle autorità di analizzare i dati con una certa sicurezza.
- (3) Inoltre, fatti salvi gli altri obblighi relativi alle informazioni sui derivati raccolte e registrate durante il processo di riconciliazione, i repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero garantire la riservatezza dei dati scambiati tra loro e messi a disposizione delle controparti segnalanti, dei soggetti responsabili della segnalazione e dei soggetti che trasmettono la segnalazione.
- (4) Quando si verifica un evento di ristrutturazione aziendale che comporta il cambiamento dell'identificativo della persona giuridica (*Legal Entity Identifier*, LEI) di una controparte, è necessario aggiornare le informazioni relative ai soggetti individuati nelle segnalazioni sui derivati. Per assicurare l'integrità di tali informazioni, che sono essenziali per il monitoraggio dei rischi sistemici per la stabilità finanziaria, è necessario che l'aggiornamento sia eseguito a livello centrale dai repertori di dati sulle negoziazioni. Per questo motivo, è opportuno stabilire una procedura per assicurare che i repertori di dati sulle negoziazioni possano aggiornare l'identificativo dei soggetti in modo centralizzato, assicurando così un processo efficiente, solido e tempestivo.
- (5) I soggetti che trasmettono le segnalazioni dovrebbero disporre di tempo sufficiente per adeguarsi agli obblighi di segnalazione, in particolare per impedire l'accumulo di operazioni non riconciliate immediatamente dopo l'entrata in vigore dell'obbligo di segnalazione. È pertanto opportuno che in un primo momento debba essere riconciliato solo un numero limitato di campi.

⁽¹⁾ GUL 201 del 27.7.2012, pag. 1.

- (6) I soggetti che trasmettono le segnalazioni e, se del caso, quelli responsabili delle segnalazioni dovrebbero essere in grado di monitorare il rispetto dei propri obblighi di segnalazione di cui al regolamento (UE) n. 648/2012. Dovrebbero pertanto avere la possibilità di accedere a determinate informazioni, su base giornaliera, in relazione a tali segnalazioni, incluso l'esito della verifica delle segnalazioni, anche nel caso di emissione di un avvertimento, e all'andamento della riconciliazione dei dati segnalati. È pertanto necessario specificare le informazioni che il repertorio di dati sulle negoziazioni dovrebbe mettere a disposizione di tali soggetti al termine di ogni giornata lavorativa.
- (7) Il presente regolamento si basa sui progetti di norme tecniche di regolamentazione che l'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati ha presentato alla Commissione.
- (8) L'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati ha consultato i membri del Sistema europeo di banche centrali e ha condotto consultazioni pubbliche aperte sui progetti di norme tecniche di regolamentazione su cui è basato il presente regolamento, ha analizzato i potenziali costi e benefici collegati e ha chiesto il parere del gruppo delle parti interessate nel settore degli strumenti finanziari e dei mercati istituito dall'articolo 37 del regolamento (UE) n. 1095/2010 del Parlamento europeo e del Consiglio ⁽²⁾.
- (9) Per permettere alle controparti e ai repertori di dati sulle negoziazioni di prendere tutte le misure necessarie per adattarsi ai nuovi obblighi, è opportuno posticipare di 18 mesi la data di applicazione del presente regolamento,

HA ADOTTATO IL PRESENTE REGOLAMENTO:

Articolo 1

Verifica dei derivati da parte dei repertori di dati sulle negoziazioni

1. Quando riceve una segnalazione di derivati, il repertorio di dati sulle negoziazioni verifica quanto segue:
 - a) l'identità del soggetto che trasmette la segnalazione di cui al campo 2 della tabella 1 e al campo 2 della tabella 3 dell'allegato del regolamento di esecuzione (UE) 2022/1860 della Commissione ⁽³⁾
 - b) che il modello XML utilizzato per segnalare un derivato sia conforme alla metodologia ISO 20022 ai sensi dell'articolo 1 del regolamento di esecuzione (UE) 2022/1860;
 - c) che il soggetto che trasmette la segnalazione, se diverso dal soggetto responsabile della segnalazione di cui al campo 3 della tabella 1 e al campo 3 della tabella 3 dell'allegato del regolamento di esecuzione (UE) 2022/1860, sia debitamente autorizzato ad effettuare la segnalazione per conto della controparte 1 o del soggetto responsabile della segnalazione, se diverso dalla controparte 1 di cui al campo 4 della tabella 1 e al campo 4 della tabella 3 dell'allegato del regolamento di esecuzione (UE) 2022/1860;
 - d) che lo stesso derivato non sia stato segnalato in precedenza;
 - e) che la segnalazione di un derivato con tipo di azione «Modifica» (Modification), «Aggiornamento del margine» (Margin Update), «Valutazione» (Valuation), «Correzione» (Correction), «Errore» (Error) o «Cessazione» (Terminate) si riferisca a un derivato segnalato precedentemente;
 - f) che la segnalazione di un derivato con tipo di azione «Modifica» (Modification) non si riferisca a un derivato che è stato segnalato come cancellato con tipo di azione «Errore» (Error) che non è stato successivamente segnalato con tipo di azione «Ripristino» (Revive);
 - g) che la segnalazione di un derivato non includa il tipo di azione «Nuovo» (New) con riferimento a un derivato segnalato in precedenza;

⁽²⁾ Regolamento (UE) n. 1095/2010 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 24 novembre 2010, che istituisce l'Autorità europea di vigilanza (Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati), modifica la decisione n. 716/2009/CE e abroga la decisione 2009/77/CE della Commissione (GU L 331 del 15.12.2010, pag. 84).

⁽³⁾ 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 (cfr. pag. 68 della presente Gazzetta ufficiale).

- h) che la segnalazione di un derivato non includa il tipo di azione «Componente di posizione» (Position component) con riferimento a un derivato segnalato in precedenza;
- i) che la segnalazione di un derivato non intenda modificare le informazioni del campo «Controparte 1» o «Controparte 2» in un derivato segnalato in precedenza;
- j) che la segnalazione di un derivato non intenda modificare un derivato esistente indicando una data effettiva successiva alla data di scadenza del derivato segnalata;
- k) che un derivato segnalato con tipo di azione «Ripristino» (Revive) si riferisca alla segnalazione di un derivato presentata in precedenza con tipo di azione «Errore» (Error) o «Cessazione» (Terminate) o a un derivato che è giunto a scadenza;
- l) la correttezza e la completezza della segnalazione del derivato.

2. Se la segnalazione di un derivato non soddisfa uno dei requisiti di cui al paragrafo 1, il repertorio di dati sulle negoziazioni la rifiuta, assegnandola a una delle rispettive categorie di cui alla tabella 1 dell'allegato.

3. Entro 60 minuti dal ricevimento della segnalazione di un derivato, il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce al soggetto che trasmette la segnalazione informazioni dettagliate sui risultati della verifica dei dati di cui al paragrafo 1. Il repertorio trasmette tali risultati in formato XML utilizzando un modello conforme alla metodologia ISO 20022. I risultati specificano i motivi del rifiuto della segnalazione di un derivato in conformità con la tabella 1 dell'allegato.

Articolo 2

Procedura di aggiornamento dell'identificativo della persona giuridica

1. Il repertorio di dati sulle negoziazioni al quale è indirizzata una richiesta ai sensi dell'articolo 8 del regolamento di esecuzione (UE) 2022/1860 identifica i derivati in essere di cui all'articolo 2, paragrafo 2, del regolamento di esecuzione (UE) 2022/1860 al momento dell'evento di ristrutturazione aziendale, laddove il soggetto è segnalato con l'identificativo utilizzato prima di tale evento nel campo «Controparte 1» o «Controparte 2», come indicato nella richiesta in questione. Esso procede alla sostituzione del vecchio identificativo con il nuovo identificativo della persona giuridica (*Legal Entity Identifier*, LEI) nelle segnalazioni relative a tutti quei derivati al momento dell'evento di cui all'articolo 8 del regolamento di esecuzione (UE) 2022/1860 riguardanti tale controparte. Il repertorio di dati sulle negoziazioni esegue la procedura di aggiornamento dell'identificativo al più tardi il giorno della ristrutturazione o entro 30 giorni di calendario dal ricevimento della richiesta se la segnalazione è avvenuta meno di 30 giorni di calendario prima della data dell'evento di ristrutturazione aziendale.

2. Il repertorio di dati sulle negoziazioni individua i derivati pertinenti di cui all'articolo 2, paragrafo 2, del regolamento di esecuzione (UE) 2022/1860 al momento dell'evento di ristrutturazione aziendale, laddove il soggetto è identificato con il vecchio identificativo in uno qualsiasi dei campi, e sostituisce tale identificativo con il nuovo codice LEI. Quando un evento di ristrutturazione aziendale riguarda un aggiornamento del LEI per campi diversi da «Controparte 1» o «Controparte 2», il repertorio di dati sulle negoziazioni esegue tale aggiornamento dei derivati pertinenti solo dopo una conferma tempestiva da parte della controparte 1 o del soggetto responsabile della segnalazione.

3. Il repertorio di dati sulle negoziazioni svolge le seguenti azioni:

- a) a seguito del ricevimento della conferma pertinente ai sensi del paragrafo 2, aggiorna il codice LEI a partire dalla data di cui al paragrafo 1;
- b) trasmette le seguenti informazioni il più presto possibile, e non oltre cinque giorni lavorativi dal ricevimento della notifica completa, a tutti gli altri repertori di dati sulle negoziazioni e alle controparti segnalanti, ai soggetti che trasmettono le segnalazioni, ai soggetti responsabili della segnalazione coinvolti nei contratti derivati interessati dall'aggiornamento del codice LEI e ai terzi cui è stato concesso l'accesso alle informazioni ai sensi dell'articolo 78, paragrafo 7, del regolamento (UE) n. 648/2012, a seconda dei casi:
 - i) il vecchio o i vecchi identificativi;
 - ii) il nuovo identificativo;
 - iii) la data a partire dalla quale è eseguito l'aggiornamento;
 - iv) in caso di eventi aziendali che riguardano un sottoinsieme dei derivati in essere alla data dell'evento, l'elenco degli identificativi unici dell'operazione (UTI) dei derivati interessati dall'aggiornamento del codice LEI;

- c) notifica, al più tardi il giorno lavorativo precedente la data di applicazione dell'aggiornamento, ai soggetti di cui all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012 che hanno accesso ai dati relativi ai derivati che sono stati aggiornati, mediante un file specifico in formato leggibile da dispositivo elettronico, le seguenti informazioni:
- i) il vecchio o i vecchi identificativi;
 - ii) il nuovo identificativo;
 - iii) la data a partire dalla quale è eseguito l'aggiornamento;
 - iv) in caso di eventi aziendali che riguardano un sottoinsieme dei derivati in essere alla data dell'evento, l'elenco degli UTI dei derivati interessati dall'aggiornamento del codice LEI;
- d) registra l'aggiornamento del LEI nel log di segnalazione.
4. Il repertorio di dati sulle negoziazioni non procede all'aggiornamento dei codici LEI segnalati per derivati diversi da quelli di cui all'articolo 2, paragrafo 2, del regolamento di esecuzione (UE) 2022/1860 al momento dell'evento aziendale.

Articolo 3

Riconciliazione dei dati da parte dei repertori di dati sulle negoziazioni

1. Il repertorio di dati sulle negoziazioni si adopera a riconciliare il derivato segnalato seguendo l'iter indicato al paragrafo 3, a condizione che siano soddisfatte tutte le seguenti condizioni:
- a) il repertorio ha completato le verifiche di cui all'articolo 1, paragrafi 1 e 2;
 - b) entrambe le controparti del derivato segnalato sono soggette all'obbligo di segnalazione di cui all'articolo 9 del regolamento (UE) n. 648/2012;
 - c) il repertorio non ha ricevuto per il derivato segnalato una segnalazione con tipo di azione «Errore» (Error), a meno che a tale segnalazione abbia fatto seguito una segnalazione con tipo di azione «Ripristino» (Revive).
2. Il repertorio di dati sulle negoziazioni predispone modalità atte a garantire la riservatezza dei dati quando scambia informazioni con altri repertori e quando fornisce informazioni alle controparti segnalanti, ai soggetti che trasmettono le segnalazioni, ai soggetti responsabili della segnalazione e ai terzi che hanno accesso alle informazioni ai sensi dell'articolo 78, paragrafo 7, del regolamento (UE) n. 648/2012 sui valori di tutti i campi oggetto di riconciliazione.
3. Se tutte le condizioni di cui al paragrafo 1 sono soddisfatte, il repertorio di dati sulle negoziazioni segue il seguente iter utilizzando l'ultimo valore segnalato per ciascun campo della tabella 2 dell'allegato al giorno lavorativo precedente:
- a) il repertorio che ha ricevuto la segnalazione di un derivato verifica se ha ricevuto una segnalazione corrispondente da o per conto dell'altra controparte;
 - b) se non ha ricevuto la segnalazione corrispondente di cui alla lettera a), il repertorio si adopera per identificare il repertorio che l'ha ricevuta comunicando a tutti i repertori registrati i valori dei seguenti campi del derivato segnalato: «Identificativo unico dell'operazione», «Controparte 1» e «Controparte 2»;
 - c) il repertorio che accerta che un altro repertorio ha ricevuto la segnalazione corrispondente di cui alla lettera a) scambia con esso le informazioni del derivato segnalato in formato XML, utilizzando un modello elaborato secondo la metodologia ISO 20022;

- d) il repertorio di dati sulle negoziazioni tratta un derivato segnalato come riconciliato se le informazioni sul derivato oggetto di riconciliazione corrispondono alle informazioni sul derivato corrispondente di cui alla lettera a) e conformemente ai limiti di tolleranza applicabili e alle relative date di applicazione di cui alla tabella 2 dell'allegato;
- e) per ogni operazione su derivati segnalata il repertorio assegna quindi valori alle categorie di riconciliazione della tabella 3 dell'allegato;
- f) il repertorio conclude le fasi di cui alle lettere da a) a e) quanto prima e non le intraprende dopo la mezzanotte UCT di un giorno lavorativo;
- g) il repertorio che non riesce a riconciliare il derivato segnalato si adopera a combinarne le informazioni il giorno lavorativo successivo. Il repertorio delle negoziazioni non si adopera più a riconciliare il derivato segnalato 30 giorni di calendario dopo che il derivato non è più in essere.

4. Al termine di ogni giorno lavorativo il repertorio di dati sulle negoziazioni conferma il numero totale di derivati abbinati e il numero di quelli riconciliati con ciascun repertorio con cui ha riconciliato i derivati. Il repertorio di dati sulle negoziazioni ha in atto procedure scritte per garantire la risoluzione di tutte le discrepanze individuate in tale processo.

5. Entro 60 minuti dalla conclusione del processo di riconciliazione di cui al paragrafo 3, lettera f), il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce ai soggetti che trasmettono le segnalazioni i risultati del processo di riconciliazione che ha eseguito sui derivati segnalati. Il repertorio trasmette tali risultati in formato XML utilizzando un modello elaborato secondo la metodologia ISO 20022, in cui inserisce informazioni sui campi che non sono stati oggetto di riconciliazione.

Articolo 4

Meccanismi di risposta a fine giornata

1. Per ogni giorno lavorativo, il repertorio di dati sulle negoziazioni mette a disposizione delle controparti segnalanti, dei soggetti che trasmettono le segnalazioni, dei soggetti responsabili della segnalazione e dei terzi cui è stato concesso l'accesso alle informazioni ai sensi dell'articolo 78, paragrafo 7, del regolamento (UE) n. 648/2012, a seconda dei casi, le seguenti informazioni sui derivati interessati, in formato XML utilizzando un modello elaborato secondo la metodologia ISO 20022:

- a) i derivati segnalati nel corso della giornata;
- b) la situazione più recente delle operazioni sui derivati in essere;
- c) le segnalazioni di derivati che sono state rifiutate nel corso della giornata;
- d) lo stato di riconciliazione di tutti i derivati segnalati che sono oggetto di riconciliazione ai sensi dell'articolo 3, paragrafo 1;
- e) i derivati in essere per i quali non è stata segnalata alcuna valutazione, o per i quali la valutazione che è stata segnalata risale a più di 14 giorni di calendario prima del giorno in cui è generata la segnalazione;
- f) i derivati in essere per i quali non sono state segnalate informazioni relative al margine, o per i quali le informazioni relative al margine che sono state segnalate risalgono a più di 14 giorni di calendario prima del giorno in cui è generata la segnalazione;
- g) i derivati che sono stati ricevuti in quel giorno con tipo di azione «Nuovo» (New), «Componente di posizione» (Position component), «Modifica» (Modification) o «Correzione» (Correction) e il cui importo nozionale è anomalo per quella classe di derivati.

2. Il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce tali informazioni al più tardi alle ore 6:00 UTC del giorno lavorativo successivo a quello cui si riferiscono le informazioni fornite al paragrafo 1.

*Articolo 5***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.

Fatto a Bruxelles, il 10 giugno 2022

Per la Commissione
La presidente
Ursula VON DER LEYEN

ALLEGATO

Tabella 1

Motivi di rifiuto della segnalazione di un derivato

Categoria di rifiuto	Motivo
Schema	— il derivato è stato rifiutato perché non conforme allo schema.
Autorizzazione	— il derivato è stato rifiutato perché il soggetto che ha trasmesso la segnalazione non è autorizzato a trasmetterla a nome della controparte segnalante o del soggetto responsabile della segnalazione.
Logica	— il derivato è stato rifiutato perché il tipo di azione non è a logica corretto.
Conformità	— il derivato è stato rifiutato perché non è conforme a una o più norme di convalida del contenuto.

Tabella 2

	Sezione	Campo	Tolleranza di riconciliazione	Data di inizio della riconciliazione
1	Parti del derivato	Data e ora della segnalazione	NA	NA
2	Parti del derivato	Identificativo del soggetto che trasmette la segnalazione	NA	NA
3	Parti del derivato	Soggetto responsabile della segnalazione	NA	NA
4	Parti del derivato	Controparte 1 (controparte segnalante)	Come il campo 9 di questa tabella	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
5	Parti del derivato	Natura della controparte 1	NA	NA
6	Parti del derivato	Settore di attività della controparte 1	NA	NA
7	Parti del derivato	Soglia di compensazione della controparte 1	NA	NA
8	Parti del derivato	Tipo di identificativo della controparte 2	NA	NA
9	Parti del derivato	Controparte 2	Come il campo 4 di questa tabella	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
10	Parti del derivato	Paese della controparte 2	NA	NA
11	Parti del derivato	Natura della controparte 2	NA	NA

	Sezione	Campo	Tolleranza di riconciliazione	Data di inizio della riconciliazione
12	Parti del derivato	Settore di attività della controparte 2	NA	NA
13	Parti del derivato	Soglia di compensazione della controparte 2	NA	NA
14	Parti del derivato	Obblighi di segnalazione della controparte 2	NA	NA
15	Parti del derivato	Identificativo dell'intermediario	NA	NA
16	Parti del derivato	Partecipante diretto	NA	NA
17	Parti del derivato	Direzione	Opposta	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
18	Parti del derivato	Direzione della gamba 1	Opposta	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
19	Parti del derivato	Direzione della gamba 2	Opposta	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
20	Parti del derivato	Direttamente collegato ad attività commerciali o di finanziamento di tesoreria	NA	NA
1	Sezione 2 a — identificativi e collegamenti	UTI	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
2	Sezione 2 a — identificativi e collegamenti	Numero di tracciamento della segnalazione	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
3	Sezione 2 a — identificativi e collegamenti	UTI precedente (per relazioni uno-a-uno e uno-a-molti tra operazioni)	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
4	Sezione 2 a — identificativi e collegamenti	UTI della posizione successiva	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
5	Sezione 2 a — identificativi e collegamenti	Identificativo di riduzione del rischio post-negoziato (PTRR)	NA	NA
6	Sezione 2 a — identificativi e collegamenti	Identificativo del pacchetto	NA	NA
7	Sezione 2 b — informazioni sul contratto	Codice internazionale di identificazione dei titoli (ISIN)	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
8	Sezione 2 b — informazioni sul contratto	Identificativo unico del prodotto (UPI)	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione

	Sezione	Campo	Tolleranza di riconciliazione	Data di inizio della riconciliazione
9	Sezione 2 b — informazioni sul contratto	Classificazione del prodotto	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
10	Sezione 2 b — informazioni sul contratto	Tipo di contratto	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
11	Sezione 2 b — informazioni sul contratto	Classe di attività	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
12	Sezione 2 b — informazioni sul contratto	Derivato basato su criptoattività	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
13	Sezione 2 b — informazioni sul contratto	Tipo di identificazione del sottostante	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
14	Sezione 2 b — informazioni sul contratto	Identificazione del sottostante	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
15	Sezione 2 b — informazioni sul contratto	Indicatore dell'indice sottostante	Si	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
16	Sezione 2 b — informazioni sul contratto	Nome dell'indice sottostante	Si	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
17	Sezione 2 b — informazioni sul contratto	Codice del paniere personalizzato	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
18	Sezione 2 b — informazioni sul contratto	Identificativo dei componenti del paniere	Si	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
19	Sezione 2 b — informazioni sul contratto	Valuta di regolamento 1	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
20	Sezione 2 b — informazioni sul contratto	Valuta di regolamento 2	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
21	Sezione 2 c — valutazione	Importo della valutazione	Si	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
22	Sezione 2 c — valutazione	Valuta della valutazione	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
23	Sezione 2 c — valutazione	Data e ora della valutazione	NA	NA

	Sezione	Campo	Tolleranza di riconciliazione	Data di inizio della riconciliazione
24	Sezione 2 c — valutazione	Metodo di valutazione	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
25	Sezione 2 c — valutazione	Delta	Si	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
26	Sezione 2 d — garanzie	Indicatore della garanzia per portafoglio	NA	NA
27	Sezione 2 d — garanzie	Codice della garanzia per portafoglio	NA	NA
28	Sezione 2 e — attenuazione del rischio/segnalazione	Data e ora della conferma	Si	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
29	Sezione 2 e — attenuazione del rischio/segnalazione	Confermato	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
30	Sezione 2 f — compensazione	Obbligo di compensazione	Si	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
31	Sezione 2 f — compensazione	Compensato	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
32	Sezione 2 f — compensazione	Data e ora della compensazione	Si	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
33	Sezione 2 f — compensazione	Controparte centrale	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
34	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Tipo di accordo quadro	Si	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
35	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Altro tipo di accordo quadro	NA	NA
36	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Versione dell'accordo quadro	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
37	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Infragruppo	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
38	Sezione 2 g — dati sull'operazione	PTRR	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
39	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Tipo di tecnica PTRR	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione

	Sezione	Campo	Tolleranza di riconciliazione	Data di inizio della riconciliazione
40	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Prestatore di servizi PTRR	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
41	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Sede di esecuzione	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
42	Sezione 2 c — dati sull'operazione	Data e ora di esecuzione	Si	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
43	Sezione 2 c — dati sull'operazione	Data effettiva	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
44	Sezione 2 c — dati sull'operazione	Data di scadenza	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
45	Sezione 2 c — dati sull'operazione	Data di cessazione anticipata	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
46	Sezione 2 c — dati sull'operazione	Data finale di regolamento contrattuale	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
47	Sezione 2 c — dati sull'operazione	Tipo di consegna	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
48	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Prezzo	Si	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
49	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Valuta del prezzo	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
50	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Data effettiva non rettificata del prezzo	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
51	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Data finale non rettificata del prezzo	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
52	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Prezzo in essere tra la data effettiva non rettificata e la data finale.	Si	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
53	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Prezzo dell'operazione a pacchetto	Si	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
54	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Valuta del prezzo dell'operazione a pacchetto	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione

	Sezione	Campo	Tolleranza di riconciliazione	Data di inizio della riconciliazione
55	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Importo nozionale della gamba 1	Si	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
56	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Valuta nozionale 1	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
57	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Data effettiva dell'importo nozionale della gamba 1	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
58	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Data finale dell'importo nozionale della gamba 1	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
59	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Importo nozionale in essere alla data effettiva associata della gamba 1	Si	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
60	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Quantitativo nozionale totale della gamba 1	Si	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
61	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Data effettiva del quantitativo nozionale della gamba 1	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
62	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Data finale del quantitativo nozionale della gamba 1	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
63	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Quantitativo nozionale in essere alla data effettiva associata della gamba 1	Si	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
64	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Importo nozionale della gamba 2	Si	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
65	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Valuta nozionale 2	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
66	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Data effettiva dell'importo nozionale della gamba 2	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
67	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Data finale dell'importo nozionale della gamba 2	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
68	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Importo nozionale in essere alla data effettiva associata della gamba 2	Si	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
69	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Quantitativo nozionale totale della gamba 2	Si	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
70	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Data effettiva del quantitativo nozionale della gamba 2	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
71	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Data finale del quantitativo nozionale della gamba 2	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione

	Sezione	Campo	Tolleranza di riconciliazione	Data di inizio della riconciliazione
72	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Quantitativo nozionale in essere alla data effettiva associata della gamba 2	Si	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
73	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Tipo altro pagamento	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
74	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Importo altro pagamento	Si	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
75	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Valuta altro pagamento	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
76	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Data altro pagamento	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
77	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Ordinante altro pagamento	Si	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
78	Sezione 2 g — dati sull'operazione	Destinatario altro pagamento	Si	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
79	Sezione 2 h — tassi di interesse	Tasso fisso della gamba 1 o cedola	Si	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
80	Sezione 2 h — tassi di interesse	Convenzione sul conteggio dei giorni del tasso fisso o della cedola della gamba 1	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
81	Sezione 2 h — tassi di interesse	Periodo di frequenza del pagamento per il tasso fisso o la cedola della gamba 1	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
82	Sezione 2 h — tassi di interesse	Moltiplicatore del periodo di frequenza del pagamento per il tasso fisso o la cedola della gamba 1	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
83	Sezione 2 h — tassi di interesse	Identificativo del tasso variabile della gamba 1	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
84	Sezione 2 h — tassi di interesse	Indicatore del tasso variabile della gamba 1	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
85	Sezione 2 h — tassi di interesse	Nome del tasso variabile della gamba 1	NA	NA
86	Sezione 2 h — tassi di interesse	Convenzione sul conteggio dei giorni del tasso variabile della gamba 1	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione

	Sezione	Campo	Tolleranza di riconciliazione	Data di inizio della riconciliazione
87	Sezione 2 h — tassi di interesse	Periodo di frequenza del pagamento per il tasso variabile della gamba 1	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
88	Sezione 2 h — tassi di interesse	Moltiplicatore del periodo di frequenza del pagamento per il tasso variabile della gamba 1	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
89	Sezione 2 h — tassi di interesse	Periodo di riferimento del tasso variabile della gamba 1 — periodo	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
90	Sezione 2 h — tassi di interesse	Periodo di riferimento del tasso variabile della gamba 1 — moltiplicatore	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
91	Sezione 2 h — tassi di interesse	Periodo di frequenza di revisione del tasso variabile della gamba 1	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
92	Sezione 2 h — tassi di interesse	Moltiplicatore frequenza di revisione del tasso variabile della gamba 1	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
93	Sezione 2 h — tassi di interesse	Differenziale della gamba 1	Sì	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
94	Sezione 2 h — tassi di interesse	Valuta del differenziale della gamba 1	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
95	Sezione 2 h — tassi di interesse	Tasso fisso della gamba 2	Sì	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
96	Sezione 2 h — tassi di interesse	Convenzione sul conteggio dei giorni del tasso fisso della gamba 2	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
97	Sezione 2 h — tassi di interesse	Periodo di frequenza del pagamento del tasso fisso della gamba 2	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
98	Sezione 2 h — tassi di interesse	Moltiplicatore del periodo di frequenza del pagamento del tasso fisso della gamba 2	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
99	Sezione 2 h — tassi di interesse	Identificativo del tasso variabile della gamba 2	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
100	Sezione 2 h — tassi di interesse	Indicatore del tasso variabile della gamba 2	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
101	Sezione 2 h — tassi di interesse	Nome del tasso variabile della gamba 2	NA	NA
102	Sezione 2 h — tassi di interesse	Convenzione sul conteggio dei giorni del tasso variabile della gamba 2	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
103	Sezione 2 h — tassi di interesse	Periodo di frequenza del pagamento per il tasso variabile della gamba 2	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione

	Sezione	Campo	Tolleranza di riconciliazione	Data di inizio della riconciliazione
104	Sezione 2 h — tassi di interesse	Moltiplicatore del periodo di frequenza del pagamento per il tasso variabile della gamba 2	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
105	Sezione 2 h — tassi di interesse	Periodo di riferimento del tasso variabile della gamba 2 — periodo	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
106	Sezione 2 h — tassi di interesse	Periodo di riferimento del tasso variabile della gamba 2 — moltiplicatore	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
107	Sezione 2 h — tassi di interesse	Periodo di frequenza di revisione del tasso variabile della gamba 2	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
108	Sezione 2 h — tassi di interesse	Moltiplicatore frequenza di revisione del tasso variabile della gamba 2	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
109	Sezione 2 h — tassi di interesse	Differenziale della gamba 2	Si	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
110	Sezione 2 h — tassi di interesse	Valuta del differenziale della gamba 2	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
111	Sezione 2 h — tassi di interesse	Differenziale dell'operazione a pacchetto	Si	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
112	Sezione 2 h — tassi di interesse	Valuta del differenziale dell'operazione a pacchetto	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
113	Sezione 2i — tassi di cambio	Tasso di cambio 1	Si	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
114	Sezione 2i — tassi di cambio	Tasso di cambio a termine	Si	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
115	Sezione 2i — tassi di cambio	Base del tasso di cambio	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
116	Sezione 2 j — materie prime e quote di emissione (informazioni generali)	Categoria di prodotti	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
117	Sezione 2 j — materie prime e quote di emissione (informazioni generali)	Sottocategoria di prodotti	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione

	Sezione	Campo	Tolleranza di riconciliazione	Data di inizio della riconciliazione
118	Sezione 2 j — materie prime e quote di emissione (informazioni generali)	Ulteriore sottocategoria di prodotti	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
119	Sezione 2 k — materie prime e quote di emissione (energia)	Punto o zona di consegna	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
120	Sezione 2 k — materie prime e quote di emissione (energia)	Punto di interconnessione	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
121	Sezione 2 k — materie prime e quote di emissione (energia)	Tipo di carico	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
122	Sezione 2 k — materie prime e quote di emissione (energia)	Ora di inizio dell'intervallo di consegna	Si	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
123	Sezione 2 k — materie prime e quote di emissione (energia)	Ora di fine dell'intervallo di consegna	Si	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
124	Sezione 2 k — materie prime e quote di emissione (energia)	Data di inizio della consegna	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
125	Sezione 2 k — materie prime e quote di emissione (energia)	Data di fine della consegna	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
126	Sezione 2 k — materie prime e quote di emissione (energia)	Durata	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
127	Sezione 2 k — materie prime e quote di emissione (energia)	Giorni della settimana	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
128	Sezione 2 k — materie prime e quote di emissione (energia)	Capacità di consegna	Si	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione

	Sezione	Campo	Tolleranza di riconciliazione	Data di inizio della riconciliazione
129	Sezione 2 k—materie prime e quote di emissione (energia)	Unità di quantità	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
130	Sezione 2 k—materie prime e quote di emissione (energia)	Prezzo per quantità per intervallo di tempo	Sì	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
131	Sezione 2 k—materie prime e quote di emissione (energia)	Valuta del prezzo per quantità per intervallo di tempo	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
132	Sezione 2 l—opzioni	Tipo di opzione	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
133	Sezione 2 l—opzioni	Stile dell'opzione	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
134	Sezione 2 l—opzioni	Prezzo <i>strike</i>	Sì	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
135	Sezione 2 l—opzioni	Data effettiva del prezzo <i>strike</i>	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
136	Sezione 2 l—opzioni	Data finale del prezzo <i>strike</i>	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
137	Sezione 2 l—opzioni	Prezzo <i>strike</i> in essere alla data effettiva associata	Sì	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
138	Sezione 2 l—opzioni	Valuta/coppia di valute del prezzo <i>strike</i>	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
139	Sezione 2 l—opzioni	Importo premio opzione	Sì	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
140	Sezione 2 l—opzioni	Valuta premio opzione	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
141	Sezione 2 l—opzioni	Data di pagamento premio opzione	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione

	Sezione	Campo	Tolleranza di riconciliazione	Data di inizio della riconciliazione
142	Sezione 2 i — opzioni	Data di scadenza del sottostante	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
143	Sezione 2 m — derivati su crediti	Rango	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
144	Sezione 2 m — derivati su crediti	Soggetto di riferimento	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
145	Sezione 2 m — derivati su crediti	Serie	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
146	Sezione 2 m — derivati su crediti	Versione	No	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
147	Sezione 2 m — derivati su crediti	Fattore dell'indice	Sì	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
148	Sezione 2 m — derivati su crediti	Segmento	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione
149	Sezione 2 m — derivati su crediti	Punto di attacco indice Credit Default Swap (CDS)	Sì	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
150	Sezione 2 m — derivati su crediti	Punto di distacco indice CDS	Sì	Due anni dalla data di inizio dell'obbligo di segnalazione
151	Sezione 2 n — modifiche del derivato	Tipo di azione	NA	NA
152	Sezione 2 n — modifiche del derivato	Tipo di evento	NA	NA
153	Sezione 2 n — modifiche del derivato	Data dell'evento	NA	NA
154	Sezione 2 n — modifiche del derivato	Livello	No	Data di inizio dell'obbligo di segnalazione

Tabella 3

Categoria di riconciliazione	Valori ammissibili
Obbligo di segnalazione per entrambe le controparti	Sì/No
Tipo di segnalazione	Unilaterale/Bilaterale
Abbinamento	Abbinata/Non abbinata
Riconciliazione	Riconciliata/Non riconciliata
Riconciliazione della valutazione	Riconciliata/Non riconciliata
Ripristinata	Sì/No
Ulteriori modifiche	Sì/No