

# **Operazioni dell'Eurosistema. Specifiche per gli Operatori**

**2022.1**

## Sommario

INTRODUZIONE.....	5
A. OPERAZIONI DI MERCATO APERTO .....	6
1. DESCRIZIONE DEI MESSAGGI VIA RNI.....	6
1.1 ASTA TELEMATICA .....	6
1.2 SPUNTA TELEMATICA .....	7
2. PRESUPPOSTI PER L'UTILIZZO DEI MESSAGGI RNI.....	8
3. CONTROLLI EFFETTUATI SUI MESSAGGI RNI .....	9
4. SPECIFICHE TECNICHE DEI MESSAGGI RNI.....	10
4.1 MESSAGGIO 6E0: ANNUNCIO OPERAZIONE PUBBLICA.....	10
4.1.1. TRACCIATO .....	10
4.1.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E0.....	12
5.2 MESSAGGIO 6E1: PARTECIPAZIONE ALL'ASTA .....	16
5.2.1 TRACCIATO.....	16
5.2.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E1 .....	17
5.2.3 VARIAZIONE DELLE PARTECIPAZIONI.....	19
5.2.4 ANNULLAMENTO DELLE PARTECIPAZIONI .....	20
5.2.5 RILIEVI SEGNALATI SUL MESSAGGIO 6E1 A FRONTE DEI CONTROLLI.....	21
5.3 MESSAGGIO 6E2: CONFERMA RICEZIONE PARTECIPAZIONE .....	22
5.3.1 TRACCIATO.....	22
5.3.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E2 .....	23
5.4 MESSAGGIO 6E3: COMUNICAZIONE RISULTATI DI ASTA .....	24
5.4.1 TRACCIATO.....	24
5.4.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E3.....	25
5.5 MESSAGGIO 6E6: COMUNICAZIONE DI ANNULLAMENTO ASTA.....	27
5.5.1 TRACCIATO.....	27
5.5.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E6.....	28
5.6 MESSAGGIO 6E7: DATI ESEGUITO PER LA SPUNTA .....	29
5.6.1 TRACCIATO.....	29
5.6.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E7 .....	31
5.7 MESSAGGIO 6E8: ACCETTAZIONE DATI ESEGUITO.....	36

5.7.1	TRACCIATO.....	36
5.7.2	GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E8 .....	37
5.7.3	RILIEVI SEGNALATI SUL MESSAGGIO 6E8 A FRONTE DEI CONTROLLI.....	38
5.8	MESSAGGIO 6E9: CONFERMA RICEZIONE ACCETTAZIONE DATI ESEGUITO.....	39
5.8.1	TRACCIATO.....	39
5.8.2	GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E9.....	40
B.	RICHIESTE DI RIMBORSO ANTICIPATO VOLONTARIO SU OPERAZIONI DI RIFINANZIAMENTO A PIU' LUNGO TERMINE .....	41
1.	DESCRIZIONE DEI MESSAGGI VIA RNI .....	41
1.1	PROCEDURA TELEMATICA .....	41
1.2	SPUNTA TELEMATICA .....	42
1.2.1	DESCRIZIONE DEI MESSAGGI 6E7 PER RIMBORSO .....	42
1.2.2	REGOLAMENTO .....	43
2.	MESSAGGIO 6E0: ANNUNCIO .....	44
2.1	TRACCIATO.....	44
2.2	GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E0 .....	46
3.	MESSAGGIO 6E1: RICHIESTA DI RIMBORSO .....	49
3.1	TRACCIATO.....	49
3.2	GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E1 .....	50
3.3	VARIAZIONE DELLA RICHIESTA .....	52
3.4	ANNULLAMENTO DELLA RICHIESTA .....	52
3.5	RILIEVI SEGNALATI SUL MESSAGGIO 6E1 A FRONTE DEI CONTROLLI.....	52
4	MESSAGGIO 6E2: CONFERMA RICEZIONE RICHIESTA .....	53
4.1	TRACCIATO.....	53
4.2	GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E2 .....	54
5	MESSAGGIO 6E7: DATI ESEGUITO PER LA SPUNTA DI RICHIESTA DI RIMBORSO .....	55
6	MESSAGGIO 6E8: ACCETTAZIONE DATI ESEGUITO PER RICHIESTA DI RIMBORSO .....	55
7	MESSAGGIO 6E9: CONFERMA RICEZIONE ACCETTAZIONE DATI ESEGUITO PER RICHIESTA DI RIMBORSO.....	55
C.	CRITTOGRAFIA E AUTENTICAZIONE.....	56
1.	CRITTOGRAFIA .....	56
2.	AUTENTICAZIONE .....	58
3.	ESEMPI.....	59
D.	OPERAZIONI DI ANTICIPAZIONE DI DOLLARI STATUNITENSIS.....	60
1.	DESCRIZIONE DEI MESSAGGI VIA RNI.....	60
1.1	ASTA TELEMATICA .....	60

2.	SPECIFICHE TECNICHE DEI MESSAGGI RNI.....	62
2.1	MESSAGGIO 6E0: ANNUNCIO OPERAZIONE PUBBLICA.....	62
2.1.1	TRACCIATO.....	62
2.1.2	GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E0.....	64
2.2	MESSAGGIO 6E1: PARTECIPAZIONE ALL'ASTA .....	68
2.2.1	TRACCIATO.....	68
2.2.2	GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E1.....	69
2.2.3	VARIAZIONE DELLE PARTECIPAZIONI.....	71
2.2.4	ANNULLAMENTO DELLE PARTECIPAZIONI .....	72
2.2.5	RILIEVI SEGNALATI SUL MESSAGGIO 6E1 A FRONTE DEI CONTROLLI .....	73
2.3	MESSAGGIO 6E2: CONFERMA RICEZIONE PARTECIPAZIONE .....	74
2.4	MESSAGGIO 6E3: COMUNICAZIONE RISULTATI DI ASTA.....	76
2.5	MESSAGGIO 6E6: COMUNICAZIONE DI ANNULLAMENTO ASTA.....	79
E.	MESSAGGI "AD HOC" PER PROGRAMMI TLTRO.....	81
1.	MESSAGGIO 6E0 PER LA COMUNICAZIONE DEI LIMITI DI FINANZIAMENTO E DI OFFERTA TLTRO-III.....	81
1.1	DESCRIZIONE.....	81
2.	MESSAGGIO 6E3 AD HOC PER LA COMUNICAZIONE DEI DATI RELATIVI AI TASSI DI INTERESSE TLTRO-III..	84
2.1	DESCRIZIONE.....	84
2.2	TRACCIATO.....	85
2.3	GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E3 AD HOC .....	86
3.	MESSAGGIO 6E3 AD HOC PER LA COMUNICAZIONE DEI TASSI DI INTERESSE DEFINITIVI .....	92
3.1	DESCRIZIONE.....	92
3.2	TRACCIATO.....	94
3.3	GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E3 AD HOC .....	95

# INTRODUZIONE

## ASPETTI DI CARATTERE GENERALE

Il presente documento costituisce il riferimento tecnico per lo scambio di messaggistica via Rete nazionale interbancaria (di seguito RNI) tra la Banca d'Italia e le controparti in relazione alle operazioni di mercato aperto (di seguito OMA), alle operazioni di rimborso anticipato e alle operazioni di anticipazione di dollari statunitensi (USD).

L'adesione alla RNI è un requisito obbligatorio stabilito dalla Banca d'Italia, *inter alia*, per l'acquisizione da parte di un intermediario bancario dello *status* di controparte di OMA.

È previsto che, nei casi di indisponibilità dell'applicativo della controparte e/o dei sistemi della Banca d'Italia e/o dei normali sistemi di comunicazione, la controparte possa ricorrere alle procedure di contingency secondo le modalità illustrate nel Guida operativa alle operazioni di politica monetaria dell'Eurosistema (di seguito Guida OPM).

## A. OPERAZIONI DI MERCATO APERTO

### 1. DESCRIZIONE DEI MESSAGGI VIA RNI

Il capitolo si articola in una sezione relativa allo svolgimento dell'asta e la seconda alla spunta dei conteggi.

#### 1.1 ASTA TELEMATICA

TIPO MSG	DESCRIZIONE	MITTENTE	NOTE
6E0	Annuncio asta	BI	
6E1	Partecipazione all'asta	OPER	Deve essere ricevuto dalla Banca entro l'orario indicato nel messaggio 6E0.
6E2	Conferma ricezione della partecipazione	BI	Viene inviato automaticamente dalla Banca a fronte della ricezione di ciascun messaggio 6E1 privo di rilievi.
6E3	Comunicazione risultati di asta	BI	Viene inviato dalla Banca a tutti i partecipanti all'asta.
6E6	Comunicazione di annullamento asta	BI	Viene inviato per segnalare l'avvenuto annullamento dell'operazione di mercato aperto da parte della BCE.

La Banca d'Italia comunica agli operatori che possono partecipare all'asta le caratteristiche dell'operazione per mezzo del **messaggio 6E0**; le stesse informazioni, possono essere anche diffuse dalla BCE e dalla Banca d'Italia attraverso i rispettivi siti Internet.

Per partecipare all'asta l'operatore invia un **messaggio 6E1**, crittografato e strutturato per contenere un massimo di 10 partecipazioni (parametro e relativo importo).

Tali messaggi devono pervenire al Centro Applicativo Banca d'Italia (di seguito CABI) entro l'orario comunicato in precedenza nel messaggio 6E0 (IDC 6G5), altrimenti sono restituiti al mittente in categoria applicativa RE01. Gli operatori possono inviare più di un messaggio 6E1 per ciascuna asta, sostituendo così le partecipazioni eventualmente formulate in precedenza.

Per ciascun messaggio 6E1 ricevuto e privo di errori sia formali che sostanziali, il CABI provvede a inviare al mittente un **messaggio 6E2** di conferma dell'avvenuta ricezione. Viceversa, il messaggio 6E1 con rilievi viene restituito al mittente in categoria applicativa RE01.

Dopo la comunicazione dei parametri di assegnazione da parte della BCE, la Banca d'Italia invia a ciascun operatore partecipante il **messaggio 6E3** contenente l'eventuale importo assegnato in asta. In maggior dettaglio tale messaggio conterrà l'importo assegnato con riferimento a ciascuno dei parametri indicati nella richiesta di partecipazione, ovvero un importo assegnato pari a zero per le offerte non assegnatarie.

Nel caso la BCE decida di annullare un'operazione pubblica, l'applicativo di gestione delle aste della Banca d'Italia invia un messaggio **6E6** alle controparti che inizialmente hanno ricevuto il messaggio 6E0 di annuncio.

## 1.2 SPUNTA TELEMATICA

TIPO MSG	DESCRIZIONE	MITTENTE	NOTE
6E7	Dati eseguito per la spunta	BI	Segnala alle controparti i conteggi effettuati dalla BI per i contratti stipulati.
6E8	Accettazione dati eseguito	OPER	Inviato dalle controparti a seguito della ricezione di un messaggio 6E7, per segnalare se il conteggio è accettato o ritenuto errato, ove richiesto.
6E9	Conferma ricezione dell'accettazione dati eseguito	BI	Inviato dalla BI per notificare la ricezione del messaggio 6E8.

Lo scambio dei messaggi per la spunta è effettuato tra la Banca d'Italia e le controparti risultate assegnatarie nelle operazioni di mercato aperto.

Il **messaggio 6E7** contiene l'evidenza dei conteggi effettuati per i contratti generati relativi sia a partecipazioni ad operazioni di mercato aperto sia ad operazioni bilaterali; ove richiesto, se l'operatore accetta quanto comunicato invia alla Banca d'Italia il relativo **messaggio 6E8** di accettazione.

Per ciascun messaggio 6E8 ricevuto e privo di errori, il CABI provvede a restituire al mittente il **messaggio 6E9** di avvenuta ricezione.

La spunta telematica è utilizzata anche per i contratti che non sono stati originati da partecipazioni ad operazioni in asta.

Non è richiesta la conferma via RNI delle controparti per i 6E7 inviati dalla Banca d'Italia al fine di notificare gli importi a scadenza determinati sulla base dei parametri indicizzati.

## 2. PRESUPPOSTI PER L'UTILIZZO DEI MESSAGGI RNI

L'utilizzo dei messaggi presuppone l'adesione alla Rete Nazionale Interbancaria e la specifica richiesta alla Banca d'Italia. I messaggi, articolati secondo i tracciati che seguono, verranno scambiati con il CABI attraverso il Servizio di "Message-Switching".

L'Applicazione Bancaria per lo scambio dei messaggi è:

01000BI00600 - in ambiente di Produzione;

01000BI006xx - in ambiente di Collaudo, ove xx identifica l'ambiente elaborativo che sarà specificato dalla Banca d'Italia in appositi documenti.

Le Categorie Applicative sono:

BI00 - per i messaggi privi di anomalie;

RE01 - per i messaggi contenenti segnalazioni d'errore.

Allo scopo di assicurare l'integrità e la riservatezza necessarie, alcuni messaggi si avvalgono delle funzioni di crittografia e/o autenticazione applicativa dei dati. Tali funzioni si basano sull'utilizzo delle chiavi bilaterali aziendali già in uso per le applicazioni del CABI

È pertanto necessario che, prima dello scambio di messaggi con l'applicazione che gestisce le operazioni di mercato aperto le banche che non interloquiscono con la Banca d'Italia per altre applicazioni, chiedano lo scambio delle chiavi bilaterali sia di autenticazione sia di crittografia. Le aziende che sono già in possesso delle chiavi devono comunque confermare i nominativi dei responsabili della loro gestione ovvero comunicare i nuovi nominativi qualora debbano essere variati.



### 3. CONTROLLI EFFETTUATI SUI MESSAGGI RNI

I campi di tipo non numerico (b, x, a) devono essere impostati con allineamento dei caratteri significativi a sinistra e, se a lunghezza fissa, con riempimento di spazi a destra.

I campi di tipo numerico (n) devono essere impostati con allineamento dei caratteri significativi a destra e, se a lunghezza fissa, con riempimento di zeri a sinistra.

Sui messaggi in ricezione viene effettuato un controllo sia formale che sostanziale.

In presenza di errori, la Banca d'Italia provvede a restituire al mittente il messaggio ricevuto (nell'identica struttura e relativi contenuti) con categoria applicativa RE01, aggiungendo alla fine del medesimo messaggio l'IDC 098, secondo il seguente standard di segnalazione degli errori adottato in Rete Interbancaria:

1° spezzone – 098:\*\*\* MESSAGGIO ERRATO \*\*\*

2° spezzone – 098:XXX – NNN/XXX – NNN/... (max 5 volte)

dove:

XXX = codice IDC errato

NNN = codice sintetico errore.

In presenza di messaggi contenenti più di cinque errori, il quinto campo del secondo spezzone viene valorizzato con i codici fissi "999 – 999".

## 4. SPECIFICHE TECNICHE DEI MESSAGGI RNI

### 4.1 MESSAGGIO 6E0: ANNUNCIO OPERAZIONE PUBBLICA

#### 4.1.1. TRACCIATO

TIPO MESSAGGIO: 6E0

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE:

01000BI006YY (1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA:

XXXXXBI006YY (1)

O / F 2)	A / C 3)	IDC	DESCRIZIONE	FORMATO
O		01	Tipo messaggio	"3"b
O		040	Mittente (abi/cab/uff)	"5"n("/5"n/"2"b)
O		050	Destinatario (abi/cab/uff)	"5"n("/5"n/"2"b)
O		020	CRO	"11"n
O		D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	"8"n
O		601	Ora di riferimento (hhmmss)	"6"n
O		6G0	Identificativo operazione	
			Anno	"4"n
			Codice	/"4"n
O		6G1	Tipo operazione	
			Nome operazione	"2"a
			Tipo transazione	/"2"a
			Tipo operazione	/"2"a
			Tipo quotazione	(/"1"a)
			Operazione pubblica	/"1"a
			Tipo asta	/"2"a
			Metodo di assegnazione	/"2"a

O / F 2)	A / C 3)	IDC	DESCRIZIONE	FORMATO
O		6G2	Caratteristiche operazione Data di effettuazione (ggmmaaaa) Numero massimo partecip. Per ctp Importo offerto Importo min. di partecipazione Taglio incrementale di partecip. Importo max. di partecipazione Importo minimo assegnabile Segno parametro Valore parametro	"8"n /"2"n (/15n) (/15n) (/15n) (/15n) (/15n) (/15n) /"1"x /"9"n
O		6G3	Data partenza (ggmmaaaa)	"8"n
F		6G4	Data scadenza (ggmmaaaa)	"8"n
O		6G5	CUT OFF presentazione offerte	"6"n

- XXXXX = Codice A.B.I. YY = identificativo di ambiente (00 per la produzione).
- può assumere i valori:

**O** se il campo è obbligatorio

**F** se il campo è facoltativo

- contiene indicazioni sulle funzioni di sicurezza cui eventualmente è sottoposto il campo; può assumere valori:

**A** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo

**C** se il campo è crittografato

**AC** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo ed è crittografato

#### **4.1.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E0**

##### **IDC 01 – TIPO MESSAGGIO**

Assume il valore 6E0.

##### **IDC 040 – MITTENTE**

Identificativo della Banca d'Italia (01000).

##### **IDC 050 – DESTINATARIO**

Identificativo dell'operatore destinatario.

##### **IDC 020 – CRO**

Codice di riferimento del messaggio, assegnato dal mittente.

##### **IDC D31 – DATA DI RIFERIMENTO**

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

##### **IDC 601 – ORA DI RIFERIMENTO**

Ora di invio del messaggio nel formato hhmmss.

##### **IDC 6G0 – IDENTIFICATIVO OPERAZIONE**

E' l'identificativo dell'operazione di mercato aperto assegnato dalla BCE e da citare in tutti i messaggi relativi all'operazione stessa.

E' composto dai seguenti sottocampi:

“anno”: anno dell'operazione;

“codice operazione”: codice progressivo univoco nell'ambito dell'anno.

## IDC 6G1 – TIPO OPERAZIONE

Descrive le caratteristiche dell'operazione ed è composto dai seguenti campi: "nome operazione" può assumere i valori:

MR      *Main refinancing operation* (operazioni principali di rifinanziamento)  
LT      *Longer-term refinancing operation* (operazioni di rifinanziamento a più lungo termine)

OT      *Other operation* (altre operazioni)

"tipo transazione" può assumere i valori:

RT      *Reverse Transaction* (operazioni temporanee)  
FD      *Fixed Term Deposits* (raccolta di depositi a termine)  
DC      *Debt Certificates* (emissione di Certificati di debito)

"tipo operazione" può assumere i valori:

LA      *Liquidity absorbing* (operazioni di impiego)  
LP      *Liquidity providing* (operazioni di finanziamento)

"tipo quotazione" può assumere i valori:

P      *Price* (prezzo)

R      *Rate* (tasso)

"operazione pubblica" può assumere i valori:

Y      Operazione pubblica

N      Operazione non pubblica

"tipo asta" può assumere i valori:

FR      *Fixed rate tender* (asta a riparto)

VR      *Variable rate tender* (asta a tasso/prezzo variabile)

"metodo di assegnazione", significativo solo in caso di aste di tipo VR, può assumere i valori:

SR      *Single rate* (asta marginale)

MR      *Multiple rate* (asta competitiva)

## **IDC 6G2 – CARATTERISTICHE OPERAZIONE**

Descrive le caratteristiche dell'operazione di mercato aperto oggetto dell'annuncio. E' composto dai seguenti campi:

“data di effettuazione”

è la data di svolgimento dell'operazione nel formato ggmmaaaa.

“numero massimo partecip. per ctp”

è il numero massimo di partecipazioni (valori diversi del parametro con i relativi importi) esprimibili da un operatore per l'asta.

“importo offerto”

è l'importo offerto nell'operazione espresso in centesimi di euro.

“importo minimo di partecipazione”

è l'importo minimo, espresso in centesimi di euro, con il quale ciascun operatore può partecipare all'asta per singolo tasso di partecipazione.

“taglio incrementale di partecipazione”

è l'importo, espresso in centesimi di euro, di cui devono essere multipli gli incrementi della partecipazione rispetto all'importo minimo.

“importo massimo di partecipazione”

è l'importo massimo, espresso in centesimi di euro, con il quale ciascun operatore può complessivamente partecipare all'asta.

“importo minimo assegnabile”

è l'importo minimo, espresso in centesimi di euro, che la BCE può assegnare a ciascuna partecipazione assegnataria.

“segno parametro”

è il segno relativo al parametro, assume valore '+' per esprimere valori parametro pari a 0 o positivi, assume il valore '-' per esprimere valori parametro negativi.

“valore parametro”

è il valore limite o fisso a seconda del tipo asta; le prime tre cifre rappresentano la parte intera, mentre le ultime sei rappresentano la parte decimale. Può assumere valore 0.

## **IDC 6G3 – DATA PARTENZA**

Riporta la data in cui deve essere effettuato il regolamento dell'operazione a pronti o, nel caso di operazioni di categoria definitiva, l'unica operazione del contratto.

Il campo ha il formato ggmmaaaa.

## **IDC 6G4 – DATA SCADENZA**

Per i contratti temporanei riporta la data in cui deve essere effettuato il regolamento dell'operazione a termine.

Nel caso di emissione di certificati di debito indica la data di scadenza del certificato.

Il campo ha il formato ggmmaaaa.

## **IDC 6G5 – CUT-OFF PRESENTAZIONE OFFERTE**

### **CUT-OFF PRESENTAZIONE OFFERTE PER OPERAZIONI DI ASTA (ESCLUSE T- LTRO)**

Riporta l'orario utile (cut-off) entro e non oltre il quale devono pervenire al CABI i messaggi di partecipazione delle controparti, nel formato hhmmss. L'orario è relativo al giorno di effettuazione dell'asta (IDC 6G2, campo "data di effettuazione"). I messaggi pervenuti oltre tale orario sono restituiti al mittente con segnalazione di errore.

### **CUT-OFF PRESENTAZIONE OFFERTE PER OPERAZIONI MIRATE DI RIFINANZIAMENTO A PIU' LUNGO TERMINE (T-LTRO)**

Riporta l'orario utile (cut-off) entro e non oltre il quale devono pervenire al CABI i messaggi di partecipazione delle controparti, nel formato hhmmss. L'orario è relativo al giorno precedente l'effettuazione dell'asta (IDC 6G2, campo "data di effettuazione"). I messaggi pervenuti oltre tale orario sono restituiti al mittente con segnalazione di errore.

## 5.2 MESSAGGIO 6E1: PARTECIPAZIONE ALL'ASTA

### 5.2.1 TRACCIATO

TIPO MESSAGGIO: 6E1

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE:

XXXXXXBI006YY(1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA:

01000BI006YY(1)

O / F (2)	A / C (3)	IDC	DESCRIZIONE	FORMATO
O	AC	01	Tipo messaggio	"3"b
O		040	Mittente (abi/cab/uff)	"5"n("/5"n/"2"b)
O		050	Destinatario (abi/cab/uff)	"5"n("/5"n/"2"b)
O		020	CRO	"11"n
O		D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	"8"n
O		601	Ora di riferimento (hhmmss)	"6"n
F		010	Cifra di controllo	"5"n
F		012	MAC	"10"x
O		6G0	Identificativo operazione	
			Anno	"4"n
			Codice operazione	/"4"n
O		6G6	Partecipazioni	10 occorrenze
			Segno parametro	"1"x
			Valore parametro	/"9"n
			Importo	/"15"n
O		6GG	Nominativo di riferimento	"15"x
O		6GI	Sede centrale (Head office)	"15"x

(1) XXXXX = Codice A.B.I. YY = identificativo di ambiente (00 per la produzione).

(2) può assumere i valori:

**O** se il campo è obbligatorio

**F** se il campo è facoltativo

(3) contiene indicazioni sulle funzioni di sicurezza cui eventualmente è sottoposto il campo; può assumere valori:

**A** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo

**C** se il campo è crittografato

**AC** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo ed è crittografato



## 5.2.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E1

### **IDC 01 – TIPO MESSAGGIO**

Assume il valore 6E1.

### **IDC 040 – MITTENTE**

Identificativo del mittente.

### **IDC 050 – DESTINATARIO**

Identificativo della Banca d'Italia.

### **IDC 020 – CRO**

Codice di riferimento del messaggio assegnato dal mittente.

### **IDC D31 – DATA DI RIFERIMENTO**

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

### **IDC 601 – ORA DI RIFERIMENTO**

Ora di invio del messaggio nel formato hhmmss.

### **IDC 010 – CIFRA DI CONTROLLO**

Codice di controllo calcolato sulla base di un algoritmo e di una chiave bilaterale scambiata tra MITTENTE e DESTINATARIO; deve essere presente se manca l'IDC 012, deve essere assente se presente l'IDC 012.

### **IDC 012 – MAC**

Codice di controllo calcolato dall'applicazione SMTS. I primi otto caratteri contengono l'autenticatore zonato, gli altri due caratteri la versione delle chiavi di autenticazione e di cifratura. Deve essere presente se manca l'IDC 010, deve essere assente se presente l'IDC 010.

### **IDC 6G0 – IDENTIFICATIVO OPERAZIONE**

E' l'identificativo dell'operazione di mercato aperto comunicato con il messaggio 6E0 – IDC 6G0.

## **IDC 6G6 – PARTECIPAZIONI**

Questo IDC è definito obbligatorio e deve essere valorizzato in tutte le occorrenze in quanto soggetto a crittografia.

Dal punto di vista dei contenuti è tuttavia significativo solo nelle occorrenze che contengono i dati di partecipazione all'asta.

Per la descrizione delle modalità con le quali l'IDC deve essere sottoposto al processo di crittografia e di autenticazione si rimanda al capitolo "A.6. CRITTOGRAFIA E AUTENTICAZIONE".

L'IDC si articola nei sottocampi:

- "segno parametro"

è il segno relativo al parametro, assume valore '+' per esprimere valori parametro pari a 0 o positivi, assume il valore '-' per esprimere valori parametro negativi.

- "valore parametro"

indica il valore offerto dall'operatore per partecipare all'asta; le prime tre cifre rappresentano la parte intera, mentre le ultime sei rappresentano la parte decimale. Nel caso in cui esprima un tasso di interesse, l'operatore dovrà valorizzare con cifre significative solo i primi due campi decimali.

Nel caso di operazioni con tecnica "a riparto" deve essere impostato con il tasso contenuto nell'annuncio o valorizzato con caratteri "zero".

- "importo"

è l'importo, espresso in centesimi di euro, richiesto dall'operatore per il parametro associato. Deve essere pari all'"importo minimo" o all'"importo minimo" più un multiplo del "taglio incrementale". Il totale degli importi per ciascun tasso deve essere inferiore all'"importo massimo di partecipazione" eventualmente comunicato nel relativo sottocampo dell'IDC 6G2 del messaggio 6E0 di annuncio operazione pubblica.

## **IDC 6GG – NOMINATIVO DI RIFERIMENTO**

Contiene il nominativo di riferimento dell'operatore con cui il personale della Banca d'Italia deve mettersi in contatto in caso di necessità.

## **IDC 6GI – SEDE CENTRALE (HEAD OFFICE)**

Contiene l'identificativo della capogruppo, se l'operatore fa parte di un gruppo bancario, o della casa madre, se l'operatore è una filiale di banca estera.

Il campo dovrà essere valorizzato con caratteri alfabetici e numerici. La prima posizione dovrà contenere un carattere valido.

### 5.2.3 VARIAZIONE DELLE PARTECIPAZIONI

Il contenuto degli **IDC D31** e **601** è utilizzato per consentire la variazione delle partecipazioni. La data/ora di riferimento del messaggio pervenuto viene confrontata con la data/ora delle partecipazioni dell'operatore eventualmente già memorizzate: se la data/ora del messaggio appena ricevuto è maggiore del dato memorizzato, le partecipazioni comunicate con il nuovo messaggio sostituiscono quelle in base dati; in caso contrario il messaggio è rispedito in categoria RE01 con il codice di errore 533.

Esempio:

per una certa asta un operatore ha trasmesso un messaggio 6E1 così valorizzato:

- IDC D31: "31031999"
- IDC 601: "113100"
- IDC 6G6: tre tassi e relativi importi:

tasso 1	+7,25	importo	100.000 euro
tasso 2	+7,15	importo	250.000 euro
tasso 3	+6,75	importo	1.125.000 euro

I tre tassi e gli importi sono memorizzati in base dati con la relativa data/ora di riferimento (31031999, 113100).

Successivamente, dallo stesso operatore perviene al CABI un nuovo messaggio 6E1 per la medesima asta, con il seguente contenuto:

- IDC D31: "31031999"
- IDC 601: "115025"
- IDC 6G6: due tassi e relativi importi:

tasso 1	+7,25	importo	100.000 euro
tasso 2	+7,00	importo	350.000 euro

Poiché la data/ora di riferimento del nuovo messaggio è maggiore della data/ora di riferimento delle partecipazioni già in base dati (31031999, 113100), si interpreta il nuovo messaggio come un messaggio di variazione delle partecipazioni già pervenute: le partecipazioni dell'operatore già presenti in base dati sono cancellate e al loro posto sono memorizzati i nuovi tassi e importi, con la relativa nuova data/ora di riferimento.

Se il nuovo messaggio 6E1 pervenuto al CABI dall'operatore avesse avuto il seguente contenuto:

- IDC D31: "31031999"
- IDC 601: "112702"
- IDC 6G6: due tassi e relativi importi:

tasso 1	+7,25	importo	100.000 euro
tasso 2	+7,00	importo	350.000 euro

ed essendo la data/ora di riferimento del nuovo messaggio non maggiore della data/ora di riferimento delle partecipazioni già in base dati (31031999, 113100), il nuovo messaggio sarebbe stato ritenuto errato (codice errore 533) e sarebbe stato rispedito al mittente in categoria RE01.

#### **5.2.4 ANNULLAMENTO DELLE PARTECIPAZIONI**

L'operatore che intenda annullare le partecipazioni comunicate precedentemente invierà un messaggio 6E1 di variazione (cfr. paragrafo precedente) con i sottocampi "valore parametro" e "importo" dell'IDC 6G6 impostati a zero.

### **5.2.5 RILIEVI SEGNALATI SUL MESSAGGIO 6E1 A FRONTE DEI CONTROLLI**

- 500 - Mittente non abilitato
- 501 - Messaggio non autenticato correttamente
- 502 - Data di riferimento del messaggio errata
- 503 - Ora di riferimento errata
- 504 - Identificativo operazione di mercato aperto errato
- 505 - Importo errato o incongruente con quello/i indicato/i nel messaggio 6E0
- 506 - Parametro errato o non multiplo del frazionamento minimo ammesso del parametro
- 508 - Numero partecipazioni superiore al massimo ammesso
- 509 - Applicazione non disponibile
- 512 - Messaggio giunto dopo il cut-off
- 528 - Messaggio giunto dopo un intervento manuale
- 529 - Messaggio non decrittografato correttamente
- 533 - Data/ora di riferimento del messaggio inferiore a quella del messaggio precedentemente pervenuto

### 5.3 MESSAGGIO 6E2: CONFERMA RICEZIONE PARTECIPAZIONE

#### 5.3.1 TRACCIATO

TIPO MESSAGGIO: 6E2

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE:

01000BI006YY(1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA:

XXXXXXBI006YY(1)

<b>O / F (2)</b>	<b>A / C (3)</b>	<b>IDC</b>	<b>DESCRIZIONE</b>	<b>FORMATO</b>
O		01	Tipo messaggio	"3"b
O		040	Mittente (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		050	Destinatario (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		020	CRO	"11"n
O		022	CRO originario	16x
O		D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	"8"n
O		601	Ora di riferimento (hhmmss)	"6"n
O		6G0	Identificativo operazione	
			Anno	"4"n
			Codice operazione	/"4"n

(1) XXXXX = Codice A.B.I. YY = identificativo di ambiente (00 per la produzione).

(2) può assumere i valori:

**O** se il campo è obbligatorio

**F** se il campo è facoltativo

(3) contiene indicazioni sulle funzioni di sicurezza cui eventualmente è sottoposto il campo; può assumere valori:

**A** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo

**C** se il campo è crittografato

**AC** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo ed è crittografato

### 5.3.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E2

#### **IDC 01 – TIPO MESSAGGIO**

Assume il valore 6E2.

#### **IDC 040 – MITTENTE**

Identificativo della Banca d'Italia.

#### **IDC 050 – DESTINATARIO**

Identificativo del destinatario.

#### **IDC 020 – CRO**

Codice di riferimento del messaggio assegnato dal mittente.

#### **IDC 022 – CRO ORIGINARIO**

Riporta il contenuto dell'IDC 020 del messaggio 6E1 cui si riferisce:  
vengono valorizzati i primi 11 caratteri di sinistra, secondo gli standard SIA.

#### **IDC D31 – DATA DI RIFERIMENTO**

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

#### **IDC 601 – ORA DI RIFERIMENTO**

Ora di invio del messaggio nel formato hhmmss.

#### **IDC 6G0 – IDENTIFICATIVO OPERAZIONE**

E' l'identificativo dell'operazione di mercato aperto comunicato con il messaggio 6E0 – IDC 6G0.

## 5.4 MESSAGGIO 6E3: COMUNICAZIONE RISULTATI DI ASTA

### 5.4.1 TRACCIATO

TIPO MESSAGGIO: 6E3

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE:

01000BI006YY (1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA:

XXXXXXBI006YY (1)

O / F (2)	A / C (3)	IDC	DESCRIZIONE	FORMATO
O		01	Tipo messaggio	"3"b
O		040	Mittente (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		050	Destinatario (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		020	CRO	"11"n
O		D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	"8"n
O		601	Ora di riferimento (hhmmss)	"6"n
F		010	Cifra di controllo	"5"n
F		012	MAC	"10"x
O		6G0	Identificativo operazione	
			Anno	"4"n
			Codice operazione	/"4"n
O		022	CRO originario	16x
O	AC	6G9	Risultati di asta	10 occorrenze
			Segno parametro	"1"x
			Valore parametro	/"9"n
			Importo assegnato	/"15"n

(1) XXXXX = Codice A.B.I. YY = identificativo di ambiente (00 per la produzione).

(2) può assumere i valori:

**O** se il campo è obbligatorio

**F** se il campo è facoltativo

(3) contiene indicazioni sulle funzioni di sicurezza cui eventualmente è sottoposto il campo; può assumere valori:

**A** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo

**C** se il campo è crittografato

**AC** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo ed è crittografato



## **5.4.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E3**

### **IDC 01 - TIPO MESSAGGIO**

Assume il valore 6E3.

### **IDC 040 - MITTENTE**

Identificativo della Banca d'Italia.

### **IDC 050 - DESTINATARIO**

Identificativo del destinatario.

### **IDC 020 - CRO**

Codice di riferimento del messaggio assegnato dal mittente.

### **IDC D31 - DATA DI RIFERIMENTO**

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

### **IDC 601 - ORA DI RIFERIMENTO**

Ora di invio del messaggio nel formato hhmmss.

### **IDC 010 - CIFRA DI CONTROLLO**

Codice di controllo calcolato sulla base di un algoritmo e di una chiave bilaterale scambiata tra mittente e destinatario; deve essere presente se manca l'IDC 012, deve essere assente se presente l'IDC 012.

### **IDC 012 - MAC**

Codice di controllo calcolato dall'applicazione SMTS. I primi otto caratteri contengono l'autenticatore zonato, gli altri due caratteri la versione delle chiavi di autenticazione e di cifratura. Deve essere presente se manca l'IDC 010, deve essere assente se presente l'IDC 010.

### **IDC 6G0 - IDENTIFICATIVO OPERAZIONE**

E' l'identificativo dell'operazione di mercato aperto comunicato con il messaggio 6E0 - IDC 6G0.

## IDC 022 - CRO ORIGINARIO

Riporta il contenuto dell'IDC 020 dell'ultimo messaggio 6E1 accettato: vengono valorizzati i primi 11 caratteri di sinistra, secondo gli standard SIA.

Se la partecipazione all'asta non è pervenuta via RNI è valorizzato con 11 caratteri "zero".

## IDC 6G9 - RISULTATI DI ASTA

Contiene l'importo assegnato per ciascuno dei parametri richiesti. In caso di mancata assegnazione l'importo è valorizzato con zero. Si compone dei seguenti sottocampi:

"segno parametro"

è il segno relativo al parametro, assume valore '+' per esprimere valori parametro pari a 0 o positivi, assume il valore '-' per esprimere valori parametro negativi.

"valore parametro"

è il valore richiesto nel messaggio 6E1; le prime tre cifre rappresentano la parte intera, mentre le ultime sei rappresentano la parte decimale.

"importo assegnato"

importo assegnato espresso in centesimi di euro; in caso di mancata assegnazione è valorizzato con zero.

In caso di aste marginali il "valore parametro" è impostato con il valore del parametro marginale determinato per l'asta (un solo valore indipendentemente dal numero dei parametri comunicati dall'operatore); il valore dell'"importo assegnato" è impostato con il valore dell'importo assegnato effettivamente all'operatore (un solo valore minore o uguale alla somma degli importi comunicati dall'operatore).

Per esempio, in caso di asta marginale di finanziamento per la quale sia stato trasmesso un messaggio di partecipazione con 3 tassi e relativi importi:

tasso 1	+7,25	importo	100.000 euro
tasso 2	+7,15	importo	250.000 euro
tasso 3	+6,75	importo	1.125.000 euro

Se il tasso marginale dell'asta risulta essere 6,5, l'IDC sarà impostato con i seguenti valori:

tasso 1	+6,5	importo	1.475.000 euro
---------	------	---------	----------------

Per la descrizione delle modalità con le quali l'IDC deve essere sottoposto al processo di crittografia e di autenticazione si rimanda al capitolo "CRITTOGRAFIA E AUTENTICAZIONE".

## 5.5 MESSAGGIO 6E6: COMUNICAZIONE DI ANNULLAMENTO ASTA

### 5.5.1 TRACCIATO

TIPO MESSAGGIO: 6E6

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE: 01000BI006YY(1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA: XXXXXBI006YY(1)

<b>O / F (2)</b>	<b>A / C (3)</b>	<b>IDC</b>	<b>DESCRIZIONE</b>	<b>FORMATO</b>
O		01	Tipo messaggio	"3"b
O		040	Mittente (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		050	Destinatario (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		020	CRO	"11"n
O		D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	"8"n
O		601	Ora di riferimento (hhmmss)	"6"n
O		6G0	Identificativo operazione	
			Anno	"4"n
			Codice operazione	/"4"n

(1) XXXXX = Codice A.B.I. YY = identificativo di ambiente (00 per la produzione).

(2) può assumere i valori:

**O** se il campo è obbligatorio

**F** se il campo è facoltativo

(3) contiene indicazioni sulle funzioni di sicurezza cui eventualmente è sottoposto il campo; può assumere valori:

**A** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo

**C** se il campo è crittografato

**AC** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo ed è crittografato

## **5.5.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E6**

Il messaggio viene inviato alle controparti partecipanti per segnalare l'avvenuto annullamento di una determinata operazione di mercato aperto.

### **IDC 01 - TIPO MESSAGGIO**

Assume il valore 6E6.

### **IDC 040 - MITTENTE**

Identificativo della Banca d'Italia.

### **IDC 050 – DESTINATARIO**

Identificativo del destinatario.

### **IDC 020 - CRO**

Codice di riferimento del messaggio assegnato dal mittente.

### **IDC D31 - DATA DI RIFERIMENTO**

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

### **IDC 601 - ORA DI RIFERIMENTO**

Ora di invio del messaggio nel formato hhmmss.

### **IDC 6G0 - IDENTIFICATIVO OPERAZIONE**

E' l'identificativo dell'operazione di mercato aperto comunicato con il messaggio 6E0 - IDC 6G0.

## 5.6 MESSAGGIO 6E7: DATI ESEGUITO PER LA SPUNTA

### 5.6.1 TRACCIATO

TIPO MESSAGGIO: 6E7

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE: 01000BI006YY (1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA: XXXXXBI006YY (1)

O / F (2)	A / C (3)	IDC	DESCRIZIONE	FORMATO
O		01	Tipo messaggio	"3"b
O		040	Mittente (abi/cab/uff)	"5"n("/5"n/"2"b)
O		050	Destinatario (abi/cab/uff)	"5"n("/5"n/"2"b)
O		020	CRO	"11"n
O		D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	"8"n
O		601	Ora di riferimento (hhmmss)	"6"n
F		012	MAC	"10"x
F		6G0	Identificativo operazione	
			Anno	"4"n
			Codice operazione	/"4"n
O	C	6GA	Dati operazione fiscale	
			Operazione fiscale	"7"n
			Operazione fiscale collegata	/"7"n
			Data regolamento (ggmmaaaa)	/"8"n
O	C	6GB	Informazioni per la spunta	6 occorrenze
			Riferimento per B.I.	"6"n
			Riferimento per B.I. originario	/"6"n
			Segno tasso	/"1"x
			Tasso operazione	/"9"n
			Codice titolo ISIN	/"12"b
			Capitale nominale	/"15"n
			Cambio	/"11"n
			Tipo prezzo di contrattazione	/"3"x
			Prezzo di contrattazione	/"12"n
			Tipo prezzo di conteggio	/"3"x
			Prezzo di conteggio	/"12"n
			Dietimi lordi	/"15"n

<b>O / F (2)</b>	<b>A / C (3)</b>	<b>IDC</b>	<b>DESCRIZIONE</b>	<b>FORMATO</b>
O		6GF	Controvalore Totale Imposta Tipo operazione Divisa Importo provvigioni Pagamento provvigioni Filiale regolamento Intermediario regolam.titoli Intermediario regolam. Contanti Concatenamento Progressivo messaggio Indicatore messaggio	/"15"n /"15"n /"15"n /"1"b /"3"x /"15"n /"1"b /"3"x /"6"n /"6"n "3"n /"1"a

(1) XXXXX = Codice A.B.I. YY = identificativo di ambiente (00 per la produzione).

(2) può assumere i valori:

**O** se il campo è obbligatorio

**F** se il campo è facoltativo

(3) contiene indicazioni sulle funzioni di sicurezza cui eventualmente è sottoposto il campo; può assumere valori:

**A** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo

**C** se il campo è crittografato

**AC** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo ed è crittografato

## **5.6.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E7**

Il messaggio viene inviato alle controparti per segnalare i dati dei conteggi relativi ai contratti stipulati.

Per ciascuna operazione fiscale viene inviato un singolo messaggio ovvero, se un solo messaggio non è sufficiente a contenere tutti i dati dell'operazione, un "treno" di messaggi tra loro concatenati.

### **IDC 01 - TIPO MESSAGGIO**

Assume il valore 6E7.

### **IDC 040 - MITTENTE**

Identificativo della Banca d'Italia.

### **IDC 050 - DESTINATARIO**

Identificativo del destinatario.

### **IDC 020 - CRO**

Codice di riferimento del messaggio assegnato dal mittente.

### **IDC D31 - DATA DI RIFERIMENTO**

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

### **IDC 601 - ORA DI RIFERIMENTO**

Ora di invio del messaggio nel formato hhmmss.

### **IDC 012 - MAC**

Codice di controllo calcolato dall'applicazione SMTS. I primi otto caratteri contengono l'autenticatore zonato, gli altri due caratteri la versione delle chiavi di autenticazione e di cifratura. Deve essere presente se si utilizza come sistema di sicurezza SMTS.

### **IDC 6G0 - IDENTIFICATIVO OPERAZIONE**

E' l'identificativo dell'operazione di mercato aperto, comunicato con il messaggio 6E0, dalla quale sono stati originati i contratti da spuntare.

## **IDC 6GA - DATI OPERAZIONE FISCALE**

Contiene alcune informazioni sull'operazione fiscale in spunta. E' composto dai seguenti sottocampi:

“operazione fiscale”

numero progressivo assegnato all'operazione fiscale dalla Banca d'Italia.

“operazione fiscale collegata”

identificativo dell'operazione fiscale collegata a quella di cui si inviano i dati; valorizzato solo per il rientro di operazioni pronti contro termine (negli altri casi è impostato a zero).

“data regolamento”.

data di regolamento dell'operazione fiscale, che coincide con la data di regolamento di tutti i contratti che la costituiscono.

## **IDC 6GB - INFORMAZIONI PER LA SPUNTA**

Si compone dei seguenti sottocampi:

“riferimento per B.I.”

è il codice di Prima Nota attribuito dalla Banca d'Italia al movimento.

“riferimento per B.I. originario”

è il codice di Prima Nota attribuito dalla Banca d'Italia al movimento originario di cui si è effettuata la variazione. È impostato solo nel caso di movimenti relativi ad operazioni a termine, anticipate nella chiusura a seguito della richiesta di sostituzione dei titoli. Se non significativo è impostato a zero.

“segno tasso”.

è il segno relativo al tasso, assume valore ‘+’ per esprimere valori del tasso pari a 0 o positivi, assume il valore ‘-’ per esprimere valori parametro negativi.

“tasso operazione”.

è il tasso della operazione temporanea o del deposito a scadenza relativamente ai quali è stato generato il contratto. Il formato del campo è 3 interi e 6 decimali. Se non significativo ha valore zero.

“codice titolo ISIN”

è l'identificativo del titolo in formato ISIN. Per i contratti in *pooling* contiene un codice ISIN fittizio.

“capitale nominale”.

è il capitale nominale espresso nella divisa di denominazione del titolo. Il formato del campo è 15 interi e 2 decimali anche per i titoli espressi in lire, per i quali i centesimi sono impostati a zero. Per i contratti in *pooling* contiene l'importo assegnato.



“cambio”.

è il tasso di cambio della divisa di denominazione del titolo rispetto all'euro. Il formato del campo è 4 interi e 7 decimali. Per i contratti in *pooling* assume il valore 00010000000.

“tipo prezzo di contrattazione”

è il tipo di prezzo con il quale il titolo è stato contrattato. Può assumere i valori:

PSE	prezzo secco
PTL	prezzo tel-quel lordo
PTN	prezzo tel-quel netto
RCL	rendimento composto lordo
RCN	rendimento composto netto
RSL	rendimento semplice lordo
RSN	rendimento semplice netto

Per i contratti in *pooling* assume valore PSE

“prezzo di contrattazione”

è il prezzo di mercato del titolo contrattato, comprensivo del margine iniziale e dello scarto di garanzia, se richiesto dal tipo di operazione.

Per i contratti in *pooling* assume valore 100

“tipo prezzo di conteggio”

è il tipo di prezzo utilizzato nei conteggi del contratto. Può assumere i valori:

PSE	prezzo secco
PTL	prezzo tel-quel lordo
PTN	prezzo tel-quel netto

Per i contratti in *pooling* assume valore PSE

“prezzo di conteggio”

è il prezzo utilizzato nei conteggi del contratto, comprensivo del margine iniziale e dello scarto di garanzia, se richiesto dal tipo di operazione.

Per i contratti in *pooling* non esiste il prezzo di conteggio; il campo è utilizzato per contenere il fattore che, applicato al valore contenuto nel campo “capitale nominale”, consente di ottenere il flusso di contante del movimento.

“dietimi lordi”

è l'importo dei dietimi lordi. Il formato del campo è 15 interi e 2 decimali. Per i contratti *pooling* assume valore 0000000000000000

“controvalore”

è il controvalore del contratto. Il formato del campo è 15 interi e 2 decimali.

Per i contratti in *pooling* contiene il flusso di contante del movimento espresso in centesimi di euro.

#### “totale”

è il flusso di contante del movimento espresso in centesimi di euro. Comprende, se presenti: provvigioni, dietimi/interessi, ritenute fiscali. Il formato del campo è 15 interi e 2 decimali.

#### “imposta”

contiene la ritenuta fiscale per i titoli tassati secondo il regime precedente il Decreto Legislativo n.239/1996, ovvero la somma dell'imposta sostitutiva sullo scarto e sulla cedola per i titoli tassati secondo il regime introdotto dal decreto. Il formato del campo è 15 interi e 2 decimali.

#### “tipo operazione”

indica il tipo di operazione cui si riferiscono i dati del messaggio. Può assumere i valori:

- P operazione a pronti
- T operazione a termine
- D operazioni definitive

#### “divisa”

contiene la divisa in cui sono espressi gli importi, fatta eccezione per il capitale nominale che è espresso nella divisa di denominazione del titolo; la divisa è espressa nello standard ISO e sarà normalmente l'euro.

#### “importo provvigioni”

contiene l'importo delle provvigioni. Non utilizzato per le aste effettuate nell'ambito del SEBC. Il formato del campo è 15 interi e 2 decimali.

#### “pagamento provvigioni”

contiene l'indicazione della parte cui compete il pagamento delle provvigioni (non previste per le aste della BCE). Può assumere valori:

- B se il pagamento è a carico della Banca d'Italia
- C se il pagamento è a carico della controparte
- N non prevista alcuna provvigione

#### “filiale regolamento”

filiale della Banca d'Italia in cui verrà regolato il contratto (parte titoli e parte contanti).

#### “intermediario regolamento titoli”

identificativo dell'eventuale intermediario prescelto per il regolamento della parte titoli. Se si tratta del 6E7 inviato all'intermediario, il campo riporta il codice della controparte per cui il soggetto svolge la funzione di intermediario regolamento titoli.

Nella modalità “pooling” assume valore 000000.

#### “intermediario regolamento contanti”

identificativo dell'eventuale intermediario prescelto per il regolamento della parte contanti. Se si tratta del 6E7 inviato all'intermediario, il campo riporta il codice della controparte per cui il soggetto svolge la funzione di intermediario regolamento contanti.

## **IDC 6GF - CONCATENAMENTO**

Questo campo è sempre presente e indica la sequenza dei messaggi nell'ambito di un "treno" di messaggi.

L'IDC contiene i seguenti sottocampi:

"progressivo messaggio"

Contiene il numero progressivo del messaggio nell'ambito del treno di appartenenza; assume quindi i valori 1, 2, 3, ... n.

"indicatore messaggio" contiene uno dei seguenti valori:

F	nel primo messaggio
I	nei messaggi intermedi
L	nell'ultimo messaggio.

Nel caso di un solo messaggio l'IDC 6GF assume il valore "1L"; nel caso di più messaggi, ad esempio 3, assume rispettivamente i valori "1F", "2I", "3L".

Per la descrizione delle modalità con le quali gli IDC 6GA e 6GB devono essere sottoposti al processo di crittografia si rimanda al Capitolo "CRITTOGRAFIA E AUTENTICAZIONE".

## 5.7 MESSAGGIO 6E8: ACCETTAZIONE DATI ESEGUITO

### 5.7.1 TRACCIATO

TIPO MESSAGGIO: 6E8

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE:

XXXXXXBI006YY (1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA:

01000BI006YY (1)

<b>O / F (2)</b>	<b>A / C (3)</b>	<b>IDC</b>	<b>DESCRIZIONE</b>	<b>FORMATO</b>
O		01	Tipo messaggio	"3"b
O		040	Mittente (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		050	Destinatario (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		020	CRO	"1"n
O		D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	"8"n
O		601	Ora di riferimento (hhmmss)	"6"n
O		6GC	Esito spunta	
			Operazione fiscale	"7"n
			Conferma dati per spunta	/"2"a

(1) XXXXX = Codice A.B.I. YY = identificativo di ambiente (00 per la produzione).

(2) può assumere i valori:

**O** se il campo è obbligatorio

**F** se il campo è facoltativo

(3) – contiene indicazioni sulle funzioni di sicurezza cui eventualmente è sottoposto il campo; può assumere valori:

**A** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo

**C** se il campo è crittografato

**AC** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo ed è crittografato

## **5.7.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E8**

Deve essere inviato dalle controparti un solo messaggio 6E8 a fronte dei dati di ciascuna operazione fiscale trasmessi dalla Banca d'Italia con uno o più di messaggi 6E7.

### **IDC 01 – TIPO MESSAGGIO**

Assume il valore 6E8.

### **IDC 040 – MITTENTE**

Identificativo del mittente.

### **IDC 050 – DESTINATARIO**

Identificativo della Banca d'Italia.

### **IDC 020 – CRO**

Codice di riferimento del messaggio assegnato dal mittente.

### **IDC D31 – DATA DI RIFERIMENTO**

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

### **IDC 601 – ORA DI RIFERIMENTO**

Ora di invio del messaggio nel formato hhmmss.

### **IDC 6GC – ESITO SPUNTA**

E' composto dai seguenti sottocampi

“operazione fiscale”

è l'identificativo dell'operazione fiscale per la quale si invia l'esito del controllo; deve riportare il valore contenuto nell'omonimo sottocampo dell'IDC 6GA del messaggio 6E7.

“conferma dati per spunta” può assumere i valori:

SI      se i dati per la spunta sono corretti

NO      se i dati per la spunta non risultano corretti; in questo caso occorre contattare immediatamente la Banca d'Italia per segnalare le anomalie riscontrate.

### **5.7.3 RILIEVI SEGNALATI SUL MESSAGGIO 6E8 A FRONTE DEI CONTROLLI**

- 500 - Mittente non abilitato
- 502 - Data di riferimento del messaggio errata
- 503 - Ora di riferimento errata
- 509 - Applicazione non disponibile
- 513 - Identificativo operazione fiscale non trovato oppure operazione fiscale non spuntabile;
- 514 - Conferma dati per spunta errata (diversa da SI/NO)

## 5.8 MESSAGGIO 6E9: CONFERMA RICEZIONE ACCETTAZIONE DATI ESEGUITO

### 5.8.1 TRACCIATO

TIPO MESSAGGIO: 6E9

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE: 01000BI006YY(1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA: XXXXXBI006YY(1)

<b>O / F (2)</b>	<b>A / C (3)</b>	<b>IDC</b>	<b>DESCRIZIONE</b>	<b>FORMATO</b>
O		01	Tipo messaggio	"3"b
O		040	Mittente (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		050	Destinatario (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		020	CRO	"11"n
O		022	CRO originario	16x
O		D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	"8"n
O		601	Ora di riferimento (hhmmss)	"6"n

(1) XXXXX = Codice A.B.I. YY = identificativo di ambiente (00 per la produzione).

(2) può assumere i valori:

**O** se il campo è obbligatorio

**F** se il campo è facoltativo

(3) - contiene indicazioni sulle funzioni di sicurezza cui eventualmente è sottoposto il campo; può assumere valori:

**A** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo

**C** se il campo è crittografato

**AC** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo ed è crittografato

### **5.8.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E9**

Il messaggio viene utilizzato per confermare la ricezione del messaggio 6E8 di accettazione dati eseguito.

#### **IDC 01 - TIPO MESSAGGIO**

Assume il valore 6E9.

#### **IDC 040 - MITTENTE**

Identificativo della Banca d'Italia.

#### **IDC 050 - DESTINATARIO**

Identificativo del destinatario.

#### **IDC 020 - CRO**

Codice di riferimento del messaggio assegnato dal mittente.

#### **IDC 022 - CRO ORIGINARIO**

Riporta il contenuto dell'IDC 020 del messaggio 6E8 cui si riferisce: vengono valorizzati i primi 11 caratteri di sinistra, secondo gli standard SIA.

#### **IDC D31 - DATA DI RIFERIMENTO**

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

#### **IDC 601 - ORA DI RIFERIMENTO**

Ora di invio del messaggio nel formato hhmmss.



## B. RICHIESTE DI RIMBORSO ANTICIPATO VOLONTARIO SU OPERAZIONI DI RIFINANZIAMENTO A PIU' LUNGO TERMINE

### 1. DESCRIZIONE DEI MESSAGGI VIA RNI

Il capitolo si articola in una sezione relativa alle richieste di rimborso anticipato volontario e in una seconda relativa alla spunta dei conteggi.

#### 1.1 PROCEDURA TELEMATICA

TIPO MSG	DESCRIZIONE	MITTENTE	NOTE
6E0	Apertura della finestra di rimborso	BI	
6E1	Richiesta di rimborso	OPER	Deve essere ricevuto entro l'orario indicato nel messaggio 6E0.
6E2	Conferma di corretta ricezione	BI	Viene inviato a fronte della ricezione di ciascun messaggio 6E1 formalmente corretto.

La Banca d'Italia comunica l'avvio dell'apertura della finestra temporale per l'invio delle richieste di rimborso volontario anticipato tramite **messaggio 6E0** nei giorni precedenti la scadenza stabilita dall'Eurosistema per la presentazione di tali richieste. La comunicazione verrà inviata alle sole controparti aventi un finanziamento residuo sulla LTRO per cui è possibile presentare richieste di rimborso.

In caso sia possibile rimborsare più di un'operazione nella medesima data, viene inviato un 6E0 per ciascuna operazione.

Per presentare alla Banca d'Italia una richiesta di rimborso, l'operatore invia un **messaggio 6E1**, crittografato, strutturato per contenere un'unica richiesta di rimborso.

Tale messaggio deve pervenire al CABI entro l'orario comunicato nel messaggio 6E0 (*cut-off* - IDC 6G5), altrimenti viene restituito al mittente in categoria applicativa RE01. Gli operatori possono inviare più di un messaggio 6E1 per ciascuna operazione da rimborsare, entro l'orario di *cut-off*, che andranno a sostituire/annullare le richieste di rimborso eventualmente formulate in precedenza.

Per ciascun messaggio 6E1 ricevuto e privo di errori formali, il CABI provvede a inviare al mittente un **messaggio 6E2** di conferma dell'avvenuta ricezione. Viceversa, il messaggio 6E1 con rilievi viene restituito al mittente in categoria applicativa RE01.

## 1.2 SPUNTA TELEMATICA

TIPO MSG	DESCRIZIONE	MITTENTE	NOTE
6E7	Dati eseguito per la spunta	BI	Segnala alle controparti i conteggi effettuati dalla BI per l'annullamento dei contratti originari e la partenza dei nuovi
6E8	Accettazione dati eseguito	OPER	Inviato dalle controparti a seguito della ricezione di ciascun messaggio 6E7, per segnalare se il conteggio è accettato o ritenuto errato.
6E9	Conferma ricezione dell'accettazione dati eseguito	BI	Inviato dalla BI per notificare la ricezione del messaggio 6E8.

Lo scambio dei messaggi RNI per la spunta è effettuato, entro il giorno del regolamento<sup>4</sup> di ciascun rimborso, tra la Banca d'Italia e tutte le controparti che abbiano presentato richieste.

I **messaggi 6E7** (per maggior dettaglio vedi paragrafo seguente) contengono l'evidenza dei conteggi effettuati relativamente ai rimborsi. Se l'operatore accetta quanto comunicato via messaggi 6E7, invia alla Banca d'Italia i relativi **messaggi 6E8** di accettazione. Per ciascun **messaggio 6E8** ricevuto e privo di errori, il CABI provvede a restituire al mittente un **messaggio 6E9** di avvenuta ricezione.

### 1.2.1 DESCRIZIONE DEI MESSAGGI 6E7 PER RIMBORSO

Nel caso di **rimborso totale**, le controparti potranno ricevere fino a 2 messaggi 6E7:

- il primo conterrà i dati relativi all'avvio dell'operazione originaria con l'importo del finanziamento iniziale (o il "montante residuo"<sup>5</sup> nel caso di precedente/i rimborso/i) e l'indicazione della nuova data di regolamento a termine (coincidente con la data di regolamento del rimborso anticipato);
- il secondo conterrà i dati relativi al montante maturato alla nuova data di regolamento a termine (coincidente con la data di regolamento del rimborso anticipato), calcolato sulla base del tasso originario d'asta nel caso di asta a tasso predefinito o sulla base del tasso definitivo nel caso di asta a tasso indicizzato.

<sup>4</sup> Di norma i messaggi 6E7 vengono inviati il giorno lavorativo precedente a quello di regolamento del rimborso.

<sup>5</sup> Nel caso in cui la controparte abbia già esercitato l'opzione di rimborso in una data precedente, il "montante residuo" esposto nel messaggio è pari all'importo nominale del finanziamento residuo dopo il precedente rimborso comprensivo degli interessi maturati fino al precedente rimborso.

Nel caso di **rimborso parziale**, le controparti potranno ricevere fino a 4 messaggi

6E7:

- c. il primo conterrà i dati relativi all'avvio dell'operazione originaria con l'importo del finanziamento iniziale (o il "montante residuo"<sup>6</sup>, nel caso di precedente/i rimborso/i) e l'indicazione della nuova data di regolamento a termine (coincidente con la data di regolamento del rimborso anticipato);
- d. il secondo conterrà i dati relativi al montante maturato alla data di regolamento del rimborso anticipato, calcolato sulla base del tasso originario dell'asta applicato all'importo di cui al punto precedente nel caso di asta a tasso predefinito o sulla base del tasso definitivo nel caso di asta a tasso indicizzato;
- e. il terzo riporterà l'importo residuo del finanziamento inclusi gli interessi maturati dalla data di regolamento dell'asta alla data di regolamento del rimborso anticipato; la data a pronti coinciderà con la data di regolamento del rimborso anticipato e la data a termine con la data termine dell'asta originaria;
- f. il quarto messaggio riporterà i dati relativi al montante da regolare alla data termine dell'asta originaria, calcolato sulla base del tasso originario dell'asta nel caso di asta a tasso predefinito o sulla base del tasso definitivo nel caso di asta a tasso indicizzato;

Come effetto netto, la controparte - alla data di regolamento del rimborso - dovrà rimborsare l'importo nominale indicato nella richiesta comprensivo degli interessi maturati dalla data di regolamento a pronti dell'asta fino alla data di regolamento del rimborso.

La controparte per ogni messaggio 6E7 ricevuto risponderà con un messaggio di spunta 6E8, a cui seguirà la conferma della Banca d'Italia con messaggio 6E9.

Si precisa che, ai sensi dell'art. 7 del Contratto quadro per le operazioni di mercato aperto, le controparti "spuntano" gli importi da regolare, tenendo presente che i tassi indicati nel messaggio 6E7 (rappresentati su 6 posizioni decimali) sono solo indicativi.

### 1.2.2 REGOLAMENTO

Il rimborso verrà regolato nelle date indicate dall'Eurosistema. Di norma tale data è stabilita in coincidenza con la giornata di regolamento di un'operazione di rifinanziamento principale.

Gli importi che la Banca d'Italia invierà alle fasi di regolamento terranno conto di tutte le eventuali partecipazioni di ciascuna controparte ad altre operazioni di mercato aperto con data di regolamento nella stessa giornata.

---

<sup>6</sup> Cfr. nota 3.

## 2. MESSAGGIO 6E0: ANNUNCIO

### 2.1 TRACCIATO

Il formato dei campi è descritto nel paragrafo 5.1.1 del capitolo A.

TIPO MESSAGGIO: 6E0

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE: 01000BI006YY (1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA: XXXXXBI006YY (1)

IDC	Descrizione	Valorizzazione
1	Tipo messaggio	6E0
40	Mittente (abi/cab/uff)	01000
50	Destinatario (abi/cab/uff)	
20	CRO	
D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	
601	Ora di riferimento (hhmmss)	
6G0	Identificativo operazione	
	Anno	
	Codice	
6G1	Tipo operazione	
	Nome operazione	"ER"
	Tipo transazione	"ER"
	Tipo operazione	"LA
	Tipo quotazione	R
	Operazione pubblica	N
	Tipo asta	FR
	Metodo di assegnazione	SR
6G2	Caratteristiche operazione	
	Data di effettuazione (ggmmaaaa)	
	Numero massimo partecip. per ctp	1
	progressivo OPB	
	Importo min. di partecipazione	1 milione euro (in cc)
	Taglio incrementale di partecip.	10 mila euro (in cc)
	Importo max. di rimborso	Capitale originario o residuo dall'ultimo rimborso
	Importo minimo assegnabile	1 milione euro (in cc)

	Segno parametro	Segno del tasso originario operazione
	Valore parametro	Tasso originario dell'operazione
6G3	Data partenza (ggmmaaaa)	
6G4	Data scadenza (ggmmaaaa)	( <i>blank – non valorizzato</i> )
6G5	CUT OFF presentazione offerte (hhmmss)	"6"n

## **2.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E0**

### **IDC 01 – TIPO MESSAGGIO**

Assume il valore 6E0.

### **IDC 040 – MITTENTE**

Identificativo della Banca d'Italia (01000).

### **IDC 050 – DESTINATARIO**

Identificativo dell'operatore destinatario.

### **IDC 020 – CRO**

Codice di riferimento del messaggio, assegnato dal mittente.

### **IDC D31 – DATA DI RIFERIMENTO**

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

### **IDC 601 – ORA DI RIFERIMENTO**

Ora di invio del messaggio nel formato hhmmss.

### **IDC 6G0 – IDENTIFICATIVO OPERAZIONE**

E' l'identificativo del rimborso assegnato dalla BCE e da citare in tutti i messaggi relativi all'operazione stessa.

E' composto dai seguenti sottocampi:

“anno”: anno del rimborso;

“codice operazione”: codice progressivo univoco nell'ambito dell'anno.

## IDC 6G1 – TIPO OPERAZIONE

Descrive le caratteristiche del rimborso ed è composto dai seguenti campi:

**“nome operazione”** assume il valore:

ER *Early repayment* (rimborso anticipato)

**“tipo transazione”** assume il valore:

ER *Early repayment* (rimborso anticipato)

**“tipo operazione”** assume il valore:

LA *Liquidity absorbing* (operazioni di impiego)

**“tipo quotazione”** assume il valore:

R	Rate (tasso)
---	--------------

**“operazione pubblica”** assume il valore:

N Operazione non pubblica (l'invio del messaggio 6E0 viene effettuato alle sole controparti partecipanti all'operazione LTRO originaria e con importo del finanziamento ancora in essere)

**“tipo asta”** assume il valore:

FR *Fixed rate tender* (asta a riparto)

**“metodo di assegnazione”** assume il valore

SR      *Single rate*

## IDC 6G2 – CARATTERISTICHE OPERAZIONE

Descrive le caratteristiche del rimborso.

E' composto dai seguenti campi:

**“data di effettuazione”**

è la data definita dall'Eurosistema entro cui deve essere inviata dall'operatore la richiesta di rimborso.

Il campo ha il formato qgmmaaaa.

**“numero massimo partecip. per ctp”**

è il numero massimo di richieste di rimborso (fisso e pari a 1)

**“progressivo operazione pubblica”**

è l'identificativo della operazione pubblica su cui si effettua il rimborso; contiene:

“anno”: anno dell'operazione pubblica

“codice operazione”: codice progressivo univoco nell’ambito dell’anno

**“importo minimo di partecipazione”**

è l'importo minimo, espresso in centesimi 7 di euro, con il quale ciascun operatore può presentare richiesta di rimborso (fisso e pari a 1 milione di euro, espresso in centesimi di euro).

**“taglio incrementale di partecipazione”**

è l'importo, espresso in centesimi di euro, di cui devono essere multipli gli incrementi della richiesta di rimborso rispetto all'importo minimo (fisso e pari a 10.000 euro, espresso

in centesimo di euro).

**“importo massimo di partecipazione”**

è l'importo massimo, espresso in centesimi di euro, per il quale ciascun operatore può richiedere di effettuare un rimborso e corrisponde all'ammontare ancora in essere per l'operazione LTRO originaria di riferimento.

**“importo minimo assegnabile”**

è pari all'“importo minimo di partecipazione” (fisso e pari a 1 milione di euro, espresso in centesimi di euro).

**“segno parametro”**

è il segno del parametro comunicato in sede di annuncio della LTRO originaria di riferimento; assume valore '+' per esprimere valori del tasso pari a 0 o positivi o il valore '-' per esprimere valori parametro negativi.

**“valore parametro”**

è il parametro comunicato in sede di annuncio della LTRO originaria di riferimento. Le prime tre cifre rappresentano la parte intera, mentre le ultime sei rappresentano la parte decimale. Può assumere il valore 0.

**IDC 6G3 – DATA PARTENZA**

Riporta la data in cui deve essere effettuato il regolamento del rimborso.  
Il campo ha il formato ggmmaaaa.

**IDC 6G4 – DATA SCADENZA**

(non valorizzato)

**IDC 6G5 – CUT-OFF PER LA PRESENTAZIONE DI RICHIESTE DI RIMBORSO**

Riporta l'orario utile (*cut-off*) entro e non oltre il quale devono pervenire al CABI i messaggi di richiesta di rimborso delle controparti, nel formato hhmmss.

L'orario è relativo al giorno di scadenza stabilito dall'Eurosistema (indicato nel campo IG2 – “data di effettuazione”).

I messaggi pervenuti oltre tale orario sono restituiti al mittente con segnalazione di errore.



### 3. MESSAGGIO 6E1: RICHIESTA DI RIMBORSO

#### 3.1 TRACCIATO

TIPO MESSAGGIO: 6E1

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE:

XXXXXXBI006YY(1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA:

01000BI006YY(1)

O / F (2)	A / C (3)	IDC	DESCRIZIONE	FORMATO
O		01	Tipo messaggio	"3"b
O		040	Mittente (abi/cab/uff)	"5"n(/"5"n/"2"b)
O		050	Destinatario (abi/cab/uff)	"5"n(/"5"n/"2"b)
O		020	CRO	"11"n
O		D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	"8"n
O		601	Ora di riferimento (hhmmss)	"6"n
F		010	Cifra di controllo	"5"n
F		012	MAC	"10"x
O		6G0	Identificativo operazione	
			Anno	"4"n
			Codice operazione	/"4"n
O	AC	6G6	Partecipazioni	10 occorrenze
			Segno parametro	"1"x
			Valore parametro	/"9"n
			Importo	/"15"n
O		6GG	Nominativo di riferimento	"15"x
O		6GI	Sede centrale (Head office)	"15"x

(1) XXXXX = Codice A.B.I. YY = identificativo di ambiente (00 per la produzione).

(2) può assumere i valori:

**O** se il campo è obbligatorio

**F** se il campo è facoltativo

(3) contiene indicazioni sulle funzioni di sicurezza cui eventualmente è sottoposto il campo; può assumere valori:

**A** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo

**C** se il campo è crittografato

**AC** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo ed è crittografato

## 3.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E1

### **IDC 01 – TIPO MESSAGGIO**

Assume il valore 6E1.

### **IDC 040 – MITTENTE**

Identificativo del mittente.

### **IDC 050 – DESTINATARIO**

Identificativo della Banca d'Italia.

### **IDC 020 – CRO**

Codice di riferimento del messaggio assegnato dal mittente.

### **IDC D31 – DATA DI RIFERIMENTO**

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

### **IDC 601 – ORA DI RIFERIMENTO**

Ora di invio del messaggio nel formato hhmmss.

### **IDC 010 – CIFRA DI CONTROLLO**

Codice di controllo calcolato sulla base di un algoritmo e di una chiave bilaterale scambiata tra MITTENTE e DESTINATARIO; deve essere presente se manca l'IDC 012, deve essere assente se presente l'IDC 012.

### **IDC 012 – MAC**

Codice di controllo calcolato dall'applicazione SMTS. I primi otto caratteri contengono l'autenticatore zonato, gli altri due caratteri la versione delle chiavi di autenticazione e di cifratura. Deve essere presente se manca l'IDC 010, deve essere assente se presente l'IDC 010.

### **IDC 6G0 – IDENTIFICATIVO OPERAZIONE**

E' l'identificativo dell'operazione di rimborso comunicato con il messaggio 6E0 – IDC 6G0.

## **IDC 6G6 – PARTECIPAZIONI**

Questo IDC è definito obbligatorio e deve essere valorizzato in tutte le occorrenze in quanto soggetto a crittografia

Dal punto di vista dei contenuti è tuttavia significativa solo una occorrenza, poiché la richiesta di ER è unica.

Per la descrizione delle modalità con le quali l'IDC deve essere sottoposto al processo di crittografia e di autenticazione si rimanda al Capitolo "CRITTOGRAFIA E AUTENTICAZIONE".

L'IDC si articola nei sottocampi:

- "segno parametro"

è il segno relativo al parametro, assume valore '+' per esprimere valori parametro pari a 0 o positivi, assume il valore '-' per esprimere valori parametro negativi.

- "valore parametro"

indica il valore offerto dall'operatore per partecipare all'asta; le prime tre cifre rappresentano la parte intera, mentre le ultime sei rappresentano la parte decimale. Nel caso in cui esprima un tasso di interesse, l'operatore dovrà valorizzare con cifre significative solo i primi due campi decimali.

Deve essere valorizzato con il valore parametro indicato nel 6E0, ma non ha alcun effetto sui conteggi inviati tramite 6E7.

- "importo"

è l'importo, espresso in centesimi di euro, richiesto dall'operatore per il parametro associato. Deve essere pari all'"importo minimo" o all'"importo minimo" più un multiplo del "taglio incrementale". Il totale degli importi per ciascun tasso deve essere inferiore o uguale all'"importo massimo di partecipazione" eventualmente comunicato nel relativo sottocampo dell'IDC 6G2 del messaggio 6E0 di annuncio del rimborso.

## **IDC 6GG – NOMINATIVO DI RIFERIMENTO**

Contiene il nominativo di riferimento dell'operatore con cui il personale della Banca d'Italia deve mettersi in contatto in caso di necessità.

## **IDC 6GI – SEDE CENTRALE (HEAD OFFICE)**

Contiene l'identificativo della capogruppo, se l'operatore fa parte di un gruppo bancario, o della casa madre, se l'operatore è una filiale di banca estera. Il campo dovrà essere valorizzato con caratteri alfabetici e numerici. La prima posizione dovrà contenere un carattere valido.

### **3.3 VARIAZIONE DELLA RICHIESTA**

Per la trasmissione della variazione di una richiesta di rimborso già trasmessa con precedente messaggio 6E1 cfr. Capitolo “Operazioni di mercato aperto”.

### **3.4 ANNULLAMENTO DELLA RICHIESTA**

Per la trasmissione dell’annullamento di una richiesta di rimborso già trasmessa con precedente messaggio 6E1 cfr. Capitolo “Operazioni di mercato aperto”.

### **3.5 RILIEVI SEGNALATI SUL MESSAGGIO 6E1 A FRONTE DEI CONTROLLI**

- 500 - Mittente non abilitato
- 501 - Messaggio non autenticato correttamente
- 502 - Data di riferimento del messaggio errata
- 503 - Ora di riferimento errata
- 504 - Identificativo operazione di richiesta errata
- 505 - Importo errato o incongruente con quello/i indicato/i nel messaggio 6E0
- 506 - Parametro errato o non multiplo del frazionamento minimo ammesso del parametro
- 508 - Numero partecipazioni superiore al massimo ammesso
- 509 - Applicazione non disponibile
- 512 - Messaggio giunto dopo il cut-off
- 528 - Messaggio giunto dopo un intervento manuale
- 529 - Messaggio non decrittografato correttamente
- 533 - Data/ora di riferimento del messaggio inferiore a quella del messaggio precedentemente pervenuto

## 4 MESSAGGIO 6E2: CONFERMA RICEZIONE RICHIESTA

### 4.1 TRACCIATO

TIPO MESSAGGIO: 6E2

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE:

01000BI006YY(1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA:

XXXXXBI006YY(1)

<b>O / F (2)</b>	<b>A / C (3)</b>	<b>IDC</b>	<b>DESCRIZIONE</b>	<b>FORMATO</b>
O		01	Tipo messaggio	"3"b
O		040	Mittente (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		050	Destinatario (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		020	CRO	"11"n
O		022	CRO originario	16x
O		D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	"8"n
O		601	Ora di riferimento (hhmmss)	"6"n
O		6G0	Identificativo operazione	
			Anno	"4"n
			Codice operazione ER	/"4"n

(4) XXXXX = Codice A.B.I. YY = identificativo di ambiente (00 per la produzione).

(5) può assumere i valori:

**O** se il campo è obbligatorio

**F** se il campo è facoltativo

(6) contiene indicazioni sulle funzioni di sicurezza cui eventualmente è sottoposto il campo; può assumere valori:

**A** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo

**C** se il campo è crittografato

**AC** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo ed è crittografato

## **4.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E2**

### **IDC 01 – TIPO MESSAGGIO**

Assume il valore 6E2.

### **IDC 040 – MITTENTE**

Identificativo della Banca d'Italia.

### **IDC 050 – DESTINATARIO**

Identificativo del destinatario.

### **IDC 020 – CRO**

Codice di riferimento del messaggio assegnato dal mittente.

### **IDC 022 – CRO ORIGINARIO**

Riporta il contenuto dell'IDC 020 del messaggio 6E1 cui si riferisce:  
vengono valorizzati i primi 11 caratteri di sinistra, secondo gli standard SIA.

### **IDC D31 – DATA DI RIFERIMENTO**

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

### **IDC 601 – ORA DI RIFERIMENTO**

Ora di invio del messaggio nel formato hhmmss.

### **IDC 6G0 – IDENTIFICATIVO OPERAZIONE**

E' l'identificativo del rimborso comunicato con il messaggio 6E0 – IDC 6G0.

## **5 MESSAGGIO 6E7: DATI ESEGUITO PER LA SPUNTA DI RICHIESTA DI RIMBORSO**

I messaggi 6E7 utilizzati per le richieste di rimborso hanno la stessa struttura dei messaggi 6E7 utilizzati per le operazioni di mercato aperto (cfr. Capitolo A).

## **6 MESSAGGIO 6E8: ACCETTAZIONE DATI ESEGUITO PER RICHIESTA DI RIMBORSO**

I messaggi 6E8 utilizzati per le richieste di rimborso hanno la stessa struttura dei messaggi 6E8 utilizzati per le operazioni di mercato aperto (cfr. Capitolo A).

## **7 MESSAGGIO 6E9: CONFERMA RICEZIONE ACCETTAZIONE DATI ESEGUITO PER RICHIESTA DI RIMBORSO**

I messaggi 6E9 utilizzati per le richieste di rimborso hanno la stessa struttura dei messaggi 6E9 utilizzati per le operazioni di mercato aperto (cfr. Capitolo A).

## C. CRITTOGRAFIA E AUTENTICAZIONE

Nei messaggi sottoposti a crittografia e autenticazione, i trattamenti sono applicati dal CABI nel seguente ordine:

- i messaggi in spedizione sono prima crittografati e quindi autenticati;
- i messaggi in ricezione sono prima sottoposti a verifica dell'autenticità e poi decrittografati.

La sequenza con la quale i singoli IDC ed i relativi sottocampi devono essere passati agli algoritmi di crittografia e autenticazione è quella con la quale gli stessi campi sono elencati nella descrizione dei messaggi.

Tutti i campi degli IDC sottoposti a crittografia e/o autenticazione sono di tipo obbligatorio e a lunghezza fissa.

### 1. CRITTOGRAFIA

La crittografia/decrittografia applicativa viene realizzata:

- tramite l'algoritmo BYCRIPT, le cui modalità tecnico-operative sono del tutto identiche a quelle già definite per la cifratura dei messaggi all'interno della RNI;
- tramite SMTS. In tal caso il messaggio riporta l'IDC 012 ("MAC End To End").

Nella composizione della stringa da crittografare o decrittografare, nell'ambito del singolo messaggio, valgono le seguenti regole:

- al processo di crittografia/decrittografia devono essere sottoposti i dati applicativi dei campi privi dei caratteri tipici della trasmissione via RNI (IDC, delimitatori, separatori tra sottocampi);
- la crittografia/decrittografia deve essere effettuata in unica soluzione. Pertanto la stringa va composta con tutti i campi che debbono essere sottoposti al processo in questione;
- nel caso di IDC con occorrenze, le occorrenze non utilizzate devono essere valorizzate con zeri.

Per quanto attiene alle chiavi bilaterali di crittografia, in ambiente di produzione, si richiama l'attenzione sulla sostituzione periodica delle stesse. Un aggiornamento non corretto ovvero non tempestivo determina infatti l'esclusione delle domande in sede d'asta. Si raccomanda, quindi, di effettuare la verifica delle nuove chiavi ogni qualvolta si procede alla sostituzione.

A tale scopo, dopo l'entrata in vigore delle nuove chiavi, è opportuno inviare un messaggio 6E1 di prova il cui contenuto informativo deve essere impostato con i seguenti valori:

IDC 6G0 - Identificativo operazione

Anno	impostato a	9999
Codice operazione	impostato a	9999

IDC 6G6 - Partecipazioni



Segno parametro	impostato a	+
Valore parametro	impostato a	999999999
Importo	impostato a	999999999999999

per tutte le 10 occorrenze

IDC 6GG - Nominativo di riferimento

impostato a	AAAAAAAAAAAAAAAA
-------------	------------------

IDC 6GI - Sede centrale (Head office)

impostato a	AAAAAAAAAAAAAAAA
-------------	------------------

Se la decrittografia è effettuata correttamente viene inviato dal centro applicativo un messaggio 6E2 di conferma ricezione della partecipazione; se si verificano errori il messaggio di prova 6E1 è rispedito al mittente in categoria RE01 con l'evidenza dell'errore riscontrato (codice errore 529 - Messaggio non decrittografato correttamente).

## 2. AUTENTICAZIONE

L'autenticazione applicativa viene realizzata:

- tramite l'algoritmo MODSIA, le cui modalità tecnico-operative sono del tutto identiche a quelle già definite per la cifratura dei messaggi all'interno della RNI; in tal caso il messaggio riporta l'IDC 010;
- tramite SMTS. In tal caso il messaggio riporta l'IDC 012 ("MAC End To End").

Durante la gestione transitoria dei due sistemi di sicurezza gli IDC 010 e 012 sono mutuamente esclusivi (solo uno dei due deve essere presente).

Per la composizione della stringa da autenticare, nell'ambito del singolo messaggio, valgono le seguenti regole:

- tutti i sottocampi devono riportare il carattere separatore "/";
- la stringa da autenticare deve sempre essere lunga 160 byte; se la sua lunghezza è minore deve essere completata con degli zeri fino alla lunghezza di 160 byte;
- nel caso di IDC con occorrenze, le occorrenze non utilizzate devono essere valorizzate con zeri;
- nel caso di IDC con occorrenze, si determina il numero di occorrenze da sottoporre al processo di autenticazione come il numero massimo intero di occorrenze la cui lunghezza complessiva sia minore o uguale a 160 byte; se la lunghezza è minore, la stringa da passare alla routine di autenticazione deve essere completata, fino alla lunghezza di 160 byte, con un filler composto da caratteri zero (es. se un IDC prevede 5 occorrenze lunghe 50 caratteri ciascuna, saranno passate al processo di autenticazione le prime 3 occorrenze, 150 caratteri, più un filler composto di 10 caratteri zero).

### 3. ESEMPI

Si riportano nel seguito alcuni esempi relativi alle modalità di passaggio dati alle routine di crittografia e autenticazione.

#### IDC 6G6 del messaggio 6E1

Si esamina il caso in cui siano impostati 3 tassi diversi con i relativi importi:

tasso 1	+7,250000	importo	100.000 euro
tasso 2	+7,151111	importo	250.000 euro
tasso 2	+6,752222	importo	1.125.000 euro

Il formato con cui questi dati sono passati alla routine di crittografia, tenendo conto che gli importi sui messaggi sono espressi in centesimi e che le occorrenze non utilizzate dell'IDC devono essere impostate a zero, è il seguente:

```
+0072500000000000010000000
+0071511110000000025000000
+0067522220000000112500000
+00000000000000000000000000 -+
..... | -> 7 occorrenze
+00000000000000000000000000 -+
```

Il formato con cui questi dati sono passati alla routine di autenticazione, tenendo conto che gli importi sui messaggi sono espressi in centesimi, è il seguente:

```
+ /007250000/000000010000000
+ /007151111/000000025000000
+ /006752222/000000112500000
+ /000000000/000000000000000
+ /000000000/000000000000000 (5 occorrenze da 27 caratteri, totale 135)
00000000000000000000000000 (filler 25 caratteri)
```

Gli ultimi 25 caratteri sono impostati a zero per completare, fino alla lunghezza di 160 byte, l'area di passaggio dati alla routine di autenticazione.

\*\*\*

## D. OPERAZIONI DI ANTICIPAZIONE DI DOLLARI STATUNITENSIS

### 1. DESCRIZIONE DEI MESSAGGI VIA RNI

Il capitolo descrive lo svolgimento dell'asta telematica relativa alle operazioni di anticipazione in dollari statunitensi (USD) fino alla fase di comunicazione dei risultati ai partecipanti.

A differenza delle operazioni di mercato aperto in euro descritte nella sezione A, le fasi successive relative ai conteggi e alla spunta sono effettuate attraverso canali diversi dalla RNI.

#### 1.1 ASTA TELEMATICA

TIPO MSG	DESCRIZIONE	MITTENTE	NOTE
6E0	Annuncio asta	BI	
6E1	Partecipazione all'asta	OPER	Deve essere ricevuto dalla Banca entro l'orario indicato nel messaggio 6E0.
6E2	Conferma ricezione della partecipazione	BI	Viene inviato dalla Banca a fronte della ricezione di ciascun messaggio 6E1 privo di rilievi.
6E3	Comunicazione risultati di asta	BI	Viene inviato dalla Banca a tutti i partecipanti all'asta.
6E6	Comunicazione di annullamento asta	BI	Viene inviato dalla Banca per segnalare l'avvenuto annullamento dell'operazione di anticipazione di USD da parte della BCE.

La Banca d'Italia comunica agli operatori che possono partecipare all'asta le caratteristiche dell'operazione per mezzo del **messaggio 6E0**; le stesse informazioni sono pubblicate dalla BCE e dalla Banca d'Italia sui rispettivi siti Internet.

Per partecipare all'asta l'operatore invia un **messaggio 6E1**, crittografato e strutturato per contenere una partecipazione contenente parametro e relativo importo.

Tale messaggio deve pervenire al Centro Applicativo Banca d'Italia (di seguito CABI) entro l'orario comunicato in precedenza nel messaggio 6E0 (IDC 6G5), altrimenti sono restituiti al mittente in categoria applicativa RE01. Gli operatori possono inviare più di un messaggio 6E1 per ciascuna asta, sostituendo così le partecipazioni eventualmente formulate in precedenza.

Per ciascun messaggio 6E1 ricevuto e privo di errori sia formali sia sostanziali, il CABI provvede a inviare al mittente un messaggio 6E2 di conferma dell'avvenuta ricezione. Viceversa, il messaggio 6E1 con rilievi viene restituito al mittente in categoria applicativa RE01.

Dopo la comunicazione dei parametri di assegnazione da parte della BCE, la Banca d'Italia invia a ciascun operatore partecipante il **messaggio 6E3** contenente l'eventuale

importo assegnato in asta. In maggior dettaglio tale messaggio conterrà l'importo assegnato con riferimento a ciascuno dei parametri indicati nella richiesta di partecipazione, ovvero un importo assegnato pari a zero per le offerte non assegnatarie.

Nel caso la BCE decida di annullare un'operazione pubblica, l'applicativo di gestione delle aste della Banca d'Italia invia un messaggio **6E6** alle controparti che inizialmente hanno ricevuto il messaggio 6E0 di annuncio.

## 2. SPECIFICHE TECNICHE DEI MESSAGGI RNI

### 2.1 MESSAGGIO 6E0: ANNUNCIO OPERAZIONE PUBBLICA

#### 2.1.1 TRACCIATO

TIPO MESSAGGIO: 6E0

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE:

01000BI006YY (1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA:

XXXXXBI006YY (1)

O / F 2)	A / C 3)	IDC	DESCRIZIONE	FORMATO
O		01	Tipo messaggio	"3"b
O		040	Mittente (abi/cab/uff)	"5"n("/5"n/"2"b)
O		050	Destinatario (abi/cab/uff)	"5"n("/5"n/"2"b)
O		020	CRO	"11"n
O		D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	"8"n
O		601	Ora di riferimento (hhmmss)	"6"n
O		6G0	Identificativo operazione	
			Anno	"4"n
			Codice	/"4"n
O		6G1	Tipo operazione	
			Nome operazione	"2"a
			Tipo transazione	/"2"a
			Tipo operazione	/"2"a
			Tipo quotazione	(/"1"a)
			Operazione pubblica	/"1"a
			Tipo asta	/"2"a
			Metodo di assegnazione	/"2"a

O / F 2)	A / C 3)	IDC	DESCRIZIONE	FORMATO
O		6G2	Caratteristiche operazione Data di effettuazione (ggmmaaaa) Numero massimo partecip. Per ctp Importo offerto Importo min. di partecipazione Taglio incrementale di partecip. Importo max. di partecipazione Importo minimo assegnabile Segno parametro Valore parametro	"8"n /"2"n (/15n) (/15n) (/15n) (/15n) (/15n) (/15n) /"1"x /"9"n
O		6G3	Data partenza (ggmmaaaa)	"8"n
F		6G4	Data scadenza (ggmmaaaa)	"8"n
O		6G5	CUT OFF presentazione offerte	"6"n

- XXXXX = Codice A.B.I. YY = identificativo di ambiente (00 per la produzione).
- può assumere i valori:

**O** se il campo è obbligatorio

**F** se il campo è facoltativo

- contiene indicazioni sulle funzioni di sicurezza cui eventualmente è sottoposto il campo; può assumere valori:

**A** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo

**C** se il campo è crittografato

**AC** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo ed è crittografato

## **2.1.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E0**

### **IDC 01 – TIPO MESSAGGIO**

Assume il valore 6E0.

### **IDC 040 – MITTENTE**

Identificativo della Banca d'Italia (01000).

### **IDC 050 – DESTINATARIO**

Identificativo dell'operatore destinatario.

### **IDC 020 – CRO**

Codice di riferimento del messaggio, assegnato dal mittente.

### **IDC D31 – DATA DI RIFERIMENTO**

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

### **IDC 601 – ORA DI RIFERIMENTO**

Ora di invio del messaggio nel formato hhmmss.

### **IDC 6G0 – IDENTIFICATIVO OPERAZIONE**

È l'identificativo dell'operazione di anticipazione di USD assegnato dalla BCE e da citare in tutti i messaggi relativi all'operazione stessa.

È composto dai seguenti sottocampi:

“anno”: anno dell'operazione;

“codice operazione”: codice progressivo univoco nell'ambito dell'anno.



## **IDC 6G1 – TIPO OPERAZIONE**

Descrive le caratteristiche dell'operazione ed è composto dai seguenti campi:

“nome operazione”:

US      *USD operation* (operazione di anticipazione in USD)

“tipo transazione”:

RT      *Reverse Transaction* (operazioni temporanee)

“tipo operazione”:

LP      *Liquidity providing* (operazioni di finanziamento)

“tipo quotazione”:

non impostato

“operazione pubblica”:

Y      Operazione pubblica

“tipo asta”:

FR      *Fixed rate tender* (asta a riparto)

“metodo di assegnazione”:

SR      *Single rate* (asta marginale)

## **IDC 6G2 – CARATTERISTICHE OPERAZIONE**

Descrive le caratteristiche dell'operazione di anticipazione di USD oggetto dell'annuncio. È composto dai seguenti campi:

“data di effettuazione”

è la data di svolgimento dell'operazione nel formato ggmmaaaa.

“numero massimo partecip. per ctp”

è il numero massimo di partecipazioni (valori diversi del parametro con i relativi importi) esprimibili da un operatore per l'asta. Per le operazioni di anticipazione di USD è pari a “1”.

“importo offerto”

è il tasso di cambio (si compone di quindici caratteri; le prime sette sono pari a zero, le successive quattro rappresentano la parte intera e le ultime quattro la parte decimale).

“importo minimo di partecipazione”

è l'importo minimo, espresso in centesimi di dollaro statunitense, con il quale ciascun operatore può partecipare all'asta al tasso di interesse comunicato nel messaggio 6E0.

“taglio incrementale di partecipazione”

è l'importo, espresso in centesimi di dollaro statunitense, di cui devono essere multipli gli incrementi della partecipazione rispetto all'importo minimo.

“importo massimo di partecipazione”

è l'importo massimo, espresso in centesimi di dollaro statunitense, con il quale ciascun operatore può complessivamente partecipare all'asta.

“importo minimo assegnabile”

è l'importo minimo, espresso in centesimi di dollaro statunitense, che la BCE può assegnare a ciascuna partecipazione assegnataria.

“segno parametro”

è il segno relativo al parametro, assume valore ‘+’ per esprimere valori parametro pari a 0 o positivi, assume il valore ‘-’ per esprimere valori parametro negativi.

“valore parametro”

è il tasso di interesse; le prime tre cifre rappresentano la parte intera, mentre le ultime sei rappresentano la parte decimale. Può assumere valore 0.

## **IDC 6G3 – DATA PARTENZA**

Riporta la data in cui deve essere effettuato il regolamento dell'operazione a pronti o. Il campo ha il formato ggmmaaaa.

#### **IDC 6G4 – DATA SCADENZA**

Riporta la data in cui deve essere effettuato il regolamento dell'operazione a termine.

Il campo ha il formato ggmmaaaa.

#### **IDC 6G5 – CUT-OFF PRESENTAZIONE OFFERTE**

Riporta l'orario utile (cut-off) entro e non oltre il quale devono pervenire al CABI i messaggi di partecipazione delle controparti, nel formato hhmmss. L'orario è relativo al giorno di effettuazione dell'asta (IDC 6G2, campo "data di effettuazione"). I messaggi pervenuti oltre tale orario sono restituiti al mittente con segnalazione di errore.

## 2.2 MESSAGGIO 6E1: PARTECIPAZIONE ALL'ASTA

### 2.2.1 TRACCIATO

TIPO MESSAGGIO: 6E1

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE:

XXXXXXBI006YY(1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA:

01000BI006YY(1)

O / F (2)	A / C (3)	IDC	DESCRIZIONE	FORMATO
O		01	Tipo messaggio	"3"b
O		040	Mittente (abi/cab/uff)	"5"n("/5"n/"2"b)
O		050	Destinatario (abi/cab/uff)	"5"n("/5"n/"2"b)
O		020	CRO	"11"n
O		D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	"8"n
O		601	Ora di riferimento (hhmmss)	"6"n
F		010	Cifra di controllo	"5"n
F		012	MAC	"10"x
O		6G0	Identificativo operazione	
			Anno	"4"n
			Codice operazione	/"4"n
O	AC	6G6	Partecipazioni	10 occorrenza
			Segno parametro	"1"x
			Valore parametro	/"9"n
			Importo	/"15"n
O		6GG	Nominativo di riferimento	"15"x
O		6GI	Sede centrale (Head office)	"15"x

(1) XXXXX = Codice A.B.I. YY = identificativo di ambiente (00 per la produzione).

(2) può assumere i valori:

**O** se il campo è obbligatorio

**F** se il campo è facoltativo

(3) contiene indicazioni sulle funzioni di sicurezza cui eventualmente è sottoposto il campo; può assumere valori:

**A** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo

**C** se il campo è crittografato

**AC** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo ed è crittografato

## **2.2.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E1**

### **IDC 01 – TIPO MESSAGGIO**

Assume il valore 6E1.

### **IDC 040 – MITTENTE**

Identificativo del mittente.

### **IDC 050 – DESTINATARIO**

Identificativo della Banca d'Italia.

### **IDC 020 – CRO**

Codice di riferimento del messaggio assegnato dal mittente.

### **IDC D31 – DATA DI RIFERIMENTO**

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

### **IDC 601 – ORA DI RIFERIMENTO**

Ora di invio del messaggio nel formato hhmmss.

### **IDC 010 – CIFRA DI CONTROLLO**

Codice di controllo calcolato sulla base di un algoritmo e di una chiave bilaterale scambiata tra MITTENTE e DESTINATARIO; deve essere presente se manca l'IDC 012, deve essere assente se presente l'IDC 012.

### **IDC 012 – MAC**

Codice di controllo calcolato dall'applicazione SMTS. I primi otto caratteri contengono l'autenticatore zonato, gli altri due caratteri la versione delle chiavi di autenticazione e di cifratura. Deve essere presente se manca l'IDC 010, deve essere assente se presente l'IDC 010.

### **IDC 6G0 – IDENTIFICATIVO OPERAZIONE**

È l'identificativo dell'operazione comunicato con il messaggio 6E0 – IDC 6G0.

## **IDC 6G6 – PARTECIPAZIONI**

Questo IDC è definito obbligatorio e deve essere valorizzato in tutte le occorrenze in quanto soggetto a crittografia.

Dal punto di vista dei contenuti è tuttavia significativo solo nelle occorrenze che contengono i dati di partecipazione all'asta.

Per la descrizione delle modalità con le quali l'IDC deve essere sottoposto al processo di crittografia e di autenticazione si rimanda al capitolo "CRITTOGRAFIA E AUTENTICAZIONE".

L'IDC si articola nei sottocampi:

- "segno parametro"

è il segno relativo al parametro, assume valore '+' per esprimere valori parametro pari a 0 o positivi, assume il valore '-' per esprimere valori parametro negativi.

- "valore parametro"

indica il tasso di interesse; le prime tre cifre rappresentano la parte intera, mentre le ultime sei rappresentano la parte decimale.

Deve essere impostato con il tasso contenuto nell'annuncio o valorizzato con caratteri "zero". L'operatore dovrà valorizzare con cifre significative solo i primi due campi decimali.

- "importo"

è l'importo, espresso in centesimi di dollaro statunitense, richiesto dall'operatore. Deve essere pari all'"importo minimo" o all'"importo minimo" più un multiplo del "taglio incrementale". L'importo richiesto deve essere inferiore all'"importo massimo di partecipazione" eventualmente comunicato nel relativo sottocampo dell'IDC 6G2 del messaggio 6E0 di annuncio operazione pubblica.

## **IDC 6GG – NOMINATIVO DI RIFERIMENTO**

Contiene il nominativo di riferimento dell'operatore con cui il personale della Banca d'Italia deve mettersi in contatto in caso di necessità.

## **IDC 6GI – SEDE CENTRALE (HEAD OFFICE)**

Contiene l'identificativo della capogruppo, se l'operatore fa parte di un gruppo bancario, o della casa madre, se l'operatore è una filiale di banca estera.

Il campo dovrà essere valorizzato con caratteri alfabetici e numerici. La prima posizione dovrà contenere un carattere valido.

## 2.2.3 VARIAZIONE DELLE PARTECIPAZIONI

Il contenuto degli **IDC D31** e **601** è utilizzato per consentire la variazione della partecipazione. La data/ora di riferimento del messaggio pervenuto viene confrontata con la data/ora della partecipazione dell'operatore eventualmente già memorizzata: se la data/ora del messaggio appena ricevuto è maggiore del dato memorizzato, la partecipazione comunicata con il nuovo messaggio sostituisce quelle in base dati; in caso contrario il messaggio è rispedito in categoria RE01 con il codice di errore 533.

Esempio:

per una certa asta un operatore ha trasmesso un messaggio 6E1 così valorizzato:

- IDC D31: "31032021"
- IDC 601: "113100"
- IDC 6G6: tasso e relativo importo:  
tasso        +0,33                                importo    5.000.000 dollari statunitensi

Il tasso e l'importo sono memorizzati in base dati con la relativa data/ora di riferimento (31032021, 113100).

Successivamente, dallo stesso operatore perviene al CABI un nuovo messaggio 6E1 per la medesima asta, con il seguente contenuto:

- IDC D31: "31032021"
- IDC 601: "115025"
- IDC 6G6: tasso e relativo importo:  
tasso        +0,33                                importo    6.000.000 dollari statunitensi

Poiché la data/ora di riferimento del nuovo messaggio è maggiore della data/ora di riferimento della partecipazione già in base dati (31032021, 113100), si interpreta il nuovo messaggio come un messaggio di variazione delle partecipazioni già pervenute: la partecipazione dell'operatore già presente in base dati è cancellata e al suo posto è memorizzato il nuovo importo, con la relativa nuova data/ora di riferimento.

Se il nuovo messaggio 6E1 pervenuto al CABI dall'operatore avesse avuto il seguente contenuto:

- IDC D31: "31032021"
- IDC 601: "112702"
- IDC 6G6: due tasso e relativo importo:  
tasso        +0,33                                importo    7.000.000 euro dollari statunitensi

ed essendo la data/ora di riferimento del nuovo messaggio non maggiore della data/ora di riferimento delle partecipazioni già in base dati (31032021, 113100), il nuovo messaggio sarebbe stato ritenuto errato (codice errore 533) e sarebbe stato rispedito al mittente in categoria RE01.

#### **2.2.4 ANNULLAMENTO DELLE PARTECIPAZIONI**

L'operatore che intenda annullare le partecipazioni comunicate precedentemente invierà un messaggio 6E1 di variazione (cfr. paragrafo precedente) con i sottocampi "valore parametro" e "importo" dell'IDC 6G6 impostati a zero.



## **2.2.5 RILIEVI SEGNALATI SUL MESSAGGIO 6E1 A FRONTE DEI CONTROLLI**

- 500 - Mittente non abilitato
- 501 - Messaggio non autenticato correttamente
- 502 - Data di riferimento del messaggio errata
- 503 - Ora di riferimento errata
- 504 - Identificativo operazione errato
- 505 - Importo errato o incongruente con quello/i indicato/i nel messaggio 6E0
- 506 - Parametro errato o non multiplo del frazionamento minimo ammesso del parametro
- 508 - Numero partecipazioni superiore al massimo ammesso
- 509 - Applicazione non disponibile
- 512 - Messaggio giunto dopo il cut-off
- 528 - Messaggio giunto dopo un intervento manuale
- 529 - Messaggio non decrittografato correttamente
- 533 - Data/ora di riferimento del messaggio inferiore a quella del messaggio precedentemente pervenuto

## 2.3 MESSAGGIO 6E2: CONFERMA RICEZIONE PARTECIPAZIONE

### 2.3.1 TRACCIATO

TIPO MESSAGGIO: 6E2

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE: 01000BI006YY(1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA: XXXXXBI006YY(1)

<b>O / F (2)</b>	<b>A / C (3)</b>	<b>IDC</b>	<b>DESCRIZIONE</b>	<b>FORMATO</b>
O		01	Tipo messaggio	"3"b
O		040	Mittente (abi/cab/uff)	"5"n("/5"n/"2"b)
O		050	Destinatario (abi/cab/uff)	"5"n("/5"n/"2"b)
O		020	CRO	"11"n
O		022	CRO originario	16x
O		D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	"8"n
O		601	Ora di riferimento (hhmmss)	"6"n
O		6G0	Identificativo operazione	
			Anno	"4"n
			Codice operazione	/"4"n

(1) XXXXX = Codice A.B.I. YY = identificativo di ambiente (00 per la produzione).

(2) può assumere i valori:

**O** se il campo è obbligatorio

**F** se il campo è facoltativo

(3) contiene indicazioni sulle funzioni di sicurezza cui eventualmente è sottoposto il campo; può assumere valori:

**A** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo

**C** se il campo è crittografato

**AC** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo ed è crittografato

## **2.3.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E2**

### **IDC 01 – TIPO MESSAGGIO**

Assume il valore 6E2.

### **IDC 040 – MITTENTE**

Identificativo della Banca d'Italia.

### **IDC 050 – DESTINATARIO**

Identificativo del destinatario.

### **IDC 020 – CRO**

Codice di riferimento del messaggio assegnato dal mittente.

### **IDC 022 – CRO ORIGINARIO**

Riporta il contenuto dell'IDC 020 del messaggio 6E1 cui si riferisce: vengono valorizzati i primi 11 caratteri di sinistra, secondo gli standard SIA.

### **IDC D31 – DATA DI RIFERIMENTO**

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

### **IDC 601 – ORA DI RIFERIMENTO**

Ora di invio del messaggio nel formato hhmmss.

### **IDC 6G0 – IDENTIFICATIVO OPERAZIONE**

È l'identificativo dell'operazione di anticipazione di dollari statunitensi comunicato con il messaggio 6E0 – IDC 6G0.

## 2.4 MESSAGGIO 6E3: COMUNICAZIONE RISULTATI DI ASTA

### 2.4.1. TRACCIATO

TIPO MESSAGGIO: 6E3

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE:

01000BI006YY (1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA:

XXXXXXBI006YY (1)

O / F (2)	A / C (3)	IDC	DESCRIZIONE	FORMATO
O		01	Tipo messaggio	"3"b
O		040	Mittente (abi/cab/uff)	"5"n/"5"n/"2"b)
O		050	Destinatario (abi/cab/uff)	"5"n/"5"n/"2"b)
O		020	CRO	"11"n
O		D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	"8"n
O		601	Ora di riferimento (hhmmss)	"6"n
F		010	Cifra di controllo	"5"n
F		012	MAC	"10"x
O		6G0	Identificativo operazione	
			Anno	"4"n
			Codice operazione	/"4"n
O		022	CRO originario	16x
O	AC	6G9	Risultati di asta	10 occorrenze
			Segno parametro	"1"x
			Valore parametro	/"9"n
			Importo assegnato	/"15"n

(1) XXXXXX = Codice A.B.I. YY = identificativo di ambiente (00 per la produzione).

(2) può assumere i valori:

**O** se il campo è obbligatorio

**F** se il campo è facoltativo

(3) contiene indicazioni sulle funzioni di sicurezza cui eventualmente è sottoposto il campo; può assumere valori:

**A** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo

**C** se il campo è crittografato

**AC** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo ed è crittografato

## **2.4.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E3**

### **IDC 01 - TIPO MESSAGGIO**

Assume il valore 6E3.

### **IDC 040 - MITTENTE**

Identificativo della Banca d'Italia.

### **IDC 050 - DESTINATARIO**

Identificativo del destinatario.

### **IDC 020 - CRO**

Codice di riferimento del messaggio assegnato dal mittente.

### **IDC D31 - DATA DI RIFERIMENTO**

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

### **IDC 601 - ORA DI RIFERIMENTO**

Ora di invio del messaggio nel formato hhmmss.

### **IDC 010 - CIFRA DI CONTROLLO**

Codice di controllo calcolato sulla base di un algoritmo e di una chiave bilaterale scambiata tra mittente e destinatario; deve essere presente se manca l'IDC 012, deve essere assente se presente l'IDC 012.

### **IDC 012 - MAC**

Codice di controllo calcolato dall'applicazione SMTS. I primi otto caratteri contengono l'autenticatore zonato, gli altri due caratteri la versione delle chiavi di autenticazione e di cifratura. Deve essere presente se manca l'IDC 010, deve essere assente se presente l'IDC 010.

### **IDC 6G0 - IDENTIFICATIVO OPERAZIONE**

È l'identificativo dell'operazione di anticipazione di dollari statunitensi comunicato con il messaggio 6E0 - IDC 6G0.

## **IDC 022 - CRO ORIGINARIO**

Riporta il contenuto dell'IDC 020 dell'ultimo messaggio 6E1 accettato: vengono valorizzati i primi 11 caratteri di sinistra, secondo gli standard SIA.

Se la partecipazione all'asta non è pervenuta via RNI è valorizzato con 11 caratteri "zero".

## **IDC 6G9 - RISULTATI DI ASTA**

Contiene l'importo assegnato per il parametro comunicato. In caso di mancata assegnazione l'importo è valorizzato con zero. Si compone dei seguenti sottocampi:

"segno parametro"

è il segno relativo al parametro, assume valore '+' per esprimere valori parametro pari a 0 o positivi, assume il valore '-' per esprimere valori parametro negativi.

"valore parametro"

è il valore comunicato nel messaggio 6E0; le prime tre cifre rappresentano la parte intera, mentre le ultime sei rappresentano la parte decimale.

"importo assegnato"

importo assegnato espresso in centesimi di dollaro statunitense; in caso di mancata assegnazione è valorizzato con zero.

Per la descrizione delle modalità con le quali l'IDC deve essere sottoposto al processo di crittografia e di autenticazione si rimanda al capitolo "CRITTOGRAFIA E AUTENTICAZIONE".

## 2.5 MESSAGGIO 6E6: COMUNICAZIONE DI ANNULLAMENTO ASTA

### 2.5.1 TRACCIATO

TIPO MESSAGGIO: 6E6

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE: 01000BI006YY(1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA: XXXXXBI006YY(1)

<b>O / F (2)</b>	<b>A / C (3)</b>	<b>IDC</b>	<b>DESCRIZIONE</b>	<b>FORMATO</b>
O		01	Tipo messaggio	"3"b
O		040	Mittente (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		050	Destinatario (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		020	CRO	"11"n
O		D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	"8"n
O		601	Ora di riferimento (hhmmss)	"6"n
O		6G0	Identificativo operazione	
			Anno	"4"n
			Codice operazione	/"4"n

(1) XXXXX = Codice A.B.I. YY = identificativo di ambiente (00 per la produzione).

(2) può assumere i valori:

**O** se il campo è obbligatorio

**F** se il campo è facoltativo

(3) contiene indicazioni sulle funzioni di sicurezza cui eventualmente è sottoposto il campo; può assumere valori:

**A** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo

**C** se il campo è crittografato

**AC** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo ed è crittografato

## **2.5.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E6**

Il messaggio viene inviato alle controparti partecipanti per segnalare l'avvenuto annullamento di una determinata operazione di anticipazione di dollari statunitensi.

### **IDC 01 - TIPO MESSAGGIO**

Assume il valore 6E6.

### **IDC 040 - MITTENTE**

Identificativo della Banca d'Italia.

### **IDC 050 – DESTINATARIO**

Identificativo del destinatario.

### **IDC 020 - CRO**

Codice di riferimento del messaggio assegnato dal mittente.

### **IDC D31 - DATA DI RIFERIMENTO**

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

### **IDC 601 - ORA DI RIFERIMENTO**

Ora di invio del messaggio nel formato hhmmss.

### **IDC 6G0 - IDENTIFICATIVO OPERAZIONE**

È l'identificativo dell'operazione di anticipazione di dollari statunitensi comunicato con il messaggio 6E0 - IDC 6G0.



## E. MESSAGGI “AD HOC” PER PROGRAMMI TLTRO

Per le controparti abilitate alle operazioni mirate di rifinanziamento (programmi TLTRO) sono previste tre tipologie di messaggi RNI “ad hoc” per le comunicazioni concernenti, rispettivamente, i limiti di finanziamento e offerta, i dati relativi ai tassi di interesse e i tassi di interesse definitivi.

### 1. MESSAGGIO 6E0 PER LA COMUNICAZIONE DEI LIMITI DI FINANZIAMENTO E DI OFFERTA TLTRO-III

#### 1.1 DESCRIZIONE

Nel caso delle operazioni mirate di rifinanziamento a più lungo termine (TLTRO), le controparti abilitate allo specifico programma riceveranno dalla Banca d'Italia, prima dell'annuncio effettivo dell'operazione, i relativi limiti di finanziamento e di offerta attraverso un messaggio 6E0 ad-hoc.

Al fine di associare i limiti suddetti alla corretta operazione TLTRO, di cui al momento dell'invio del messaggio 6E0 ad-hoc non è ancora noto l'identificativo attribuito dalla BCE, il campo “Identificativo operazione” (6G0) utilizzato per la composizione del messaggio 6E0 ad-hoc sarà valorizzato con un codice fittizio reso noto dalla Banca d'Italia e indipendente rispetto al codice identificativo dell'operazione di asta.

Di seguito i codici di invio limiti (campo 6G0) associati alle operazioni TLTRO-III a partire da giugno 2021:

OPERAZIONE	TERMINI PER L'INVIO DEI LIMITI	CODICI DI INVIO LIMITI (campo 6G0)	DATA DI ANNUNCIO DELL'OPERAZIONE
Ottava TLTRO-III	14/06/2021	2021 9916	15/06/2021
Nona TLTRO-III	20/09/2021	2021 9917	21/09/2021
Decima TLTRO-III	13/12/2021	2021 9918	14/12/2021

Lo svolgimento delle fasi successive delle aste TLTRO (annuncio, invio partecipazioni, assegnazione e annullamento) segue lo stesso schema descritto nella sezione A, con l'eccezione di quanto previsto nei capitoli 2 e 3 della presente sezione.

\*\*\*

Si riporta di seguito il contenuto del messaggio 6E0 per la comunicazione dei limiti di offerta e di finanziamento:

O / F (2)	A / C (3)	IDC	DESCRIZIONE	FORMATO
O		6G0	Identificativo operazione Anno Codice	"4"n /"4"n
O		6G1	Tipo operazione Nome operazione Tipo transazione Tipo operazione Tipo quotazione Operazione pubblica Tipo asta Metodo di assegnazione	"2"a /"2"a /"2"a (/"1"a) /"1"a /"2"a /"2"a
O		6G2	Caratteristiche operazione Data di effettuazione (ggmmaaaa) Numero massimo partecip. per ctp Importo offerto Importo min. di partecipazione Taglio incrementale di partecip. Importo max. di partecipazione Importo minimo assegnabile Segno parametro Valore parametro	"8"n /"2"n (/15n) (/15n) (/15n) (/15n) (/15n) (/"1"x) /"9"n
O		6G3	Data partenza (ggmmaaaa)	"8"n
F		6G4	Data scadenza (ggmmaaaa)	"8"n
O		6G5	CUT OFF presentazione offerte	"6"n

## COMPILAZIONE DEI CAMPI

### IDC 6G0 (Identificativo operazione)

- "Anno"  
Anno di svolgimento dell'operazione
- "Codice"  
Il codice sarà composto dalle cifre "99XX", dove per XX si intende il numero dell'operazione TLTRO

### IDC 6G1 (Tipo operazione)

- "Nome operazione"  
CL (comunicazione limiti)
- "Tipo transazione"  
CL (comunicazione limiti)
- "Tipo operazione"  
CL (comunicazione limiti)

- “Tipo quotazione”  
L (limiti di offerta e di finanziamento)
- “Operazione pubblica”  
Y (si)
- “Tipo asta”  
CL (comunicazione limiti)
- “Metodo d’assegnazione”  
CL (comunicazione limiti)

#### **IDC 6G2 (Caratteristiche operazione)**

- Data di effettuazione (ggmmaaaa)  
Il campo contiene la data di annuncio dell’operazione
- “Numero massimo partecipazioni per controparti”  
1
- “Importo offerto”  
**Limite di finanziamento**
- “Importo minimo di partecipazione”  
non impostato
- “Taglio incrementale di partecipazione”  
non impostato
- “Importo massimo di partecipazione”  
**Limite di offerta per la relativa TLTRO III. espresso in euro**
- “Importo minimo assegnabile”  
non impostato
- “Valore parametro”  
Impostato e pari a zero

#### **IDC 6G3**

- “Data partenza”  
Il campo contiene la data di annuncio dell’operazione
- “Data scadenza”  
Non è obbligatoria e quindi non è impostata

#### **IDC 6G5**

- “CUT OFF presentazione offerte”

Il campo è alimentato con l’orario di creazione del messaggio.

## 2. MESSAGGIO 6E3 AD HOC PER LA COMUNICAZIONE DEI DATI RELATIVI AI TASSI DI INTERESSE TLTRO-III

### 2.1 DESCRIZIONE

Le controparti partecipanti al programma TLTRO-III riceveranno due comunicazioni concernenti i dati relativi ai tassi di interesse (prima e seconda comunicazione).

A tal fine saranno utilizzati due messaggi 6E3 distinti in base al campo “Identificativo operazione” (6G0). Tale campo sarà valorizzato con un codice fittizio, distinto per ciascuna delle due comunicazioni, reso noto dalla Banca d'Italia e indipendente rispetto al codice identificativo dell'operazione di asta. Gli identificativi non variano nel caso di comunicazione posticipata.

Di seguito gli identificativi (campo 6G0) associati a ciascuna comunicazione:

OPERAZIONE	TERMINI PER L'INVIO DELLA COMUNICAZIONE	CODICI COMUNICAZIONI (campo 6G0)
Prima comunicazione	10/09/2021	2021 8888
Prima comunicazione posticipata	01/10/2021	2021 8888
Seconda comunicazione	10/06/2022	2022 9999
Seconda comunicazione posticipata	01/07/2022	2022 9999

Il messaggio riporterà le seguenti informazioni:

- “NLB”, indica il livello di riferimento dei prestiti idonei netti per la valutazione dei periodi di riferimento speciale e speciale aggiuntivo. Rappresenta il valore di riferimento (almeno da eguagliare) dei prestiti netti idonei nel periodo di riferimento speciale (NL<sub>Special</sub>) e dei prestiti netti idonei nel periodo di riferimento speciale aggiuntivo (NL<sub>ADSpecial</sub>). Nella prima comunicazione è riportato il valore di riferimento di NL<sub>Special</sub>, nella seconda il valore di riferimento di NL<sub>ADSpecial</sub> (i due valori possono divergere in caso di eventi societari e/o modifiche alla composizione dei gruppi TLTRO verificatisi tra il 1° aprile 2021 e il 31 dicembre 2021);
- “EX”, indica la deviazione percentuale della somma dei prestiti netti idonei nel secondo periodo di riferimento e delle consistenze in essere dei prestiti idonei al 31 marzo 2019, rispetto al livello di riferimento delle consistenze in essere per il secondo periodo di riferimento;
- “NL<sub>Special</sub>” indica il livello dei prestiti netti idonei registrato dalla controparte nel periodo di riferimento speciale;
- “NL<sub>ADSpecial</sub>” indica il livello dei prestiti netti idonei registrato dalla controparte nel periodo di riferimento speciale aggiuntivo.

## 2.2 TRACCIATO

TIPO MESSAGGIO: 6E3

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE:

01000BI006YY (1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA:

XXXXXXBI006YY (1)

O / F (2)	A / C (3)	IDC	DESCRIZIONE	FORMATO
O		01	Tipo messaggio	"3"b
O		040	Mittente (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		050	Destinatario (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		020	CRO	"11"n
O		D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	"8"n
O		601	Ora di riferimento (hhmmss)	"6"n
F		010	Cifra di controllo	"5"n
F		012	MAC	"10"x
O		6G0	Identificativo operazione	
			Anno	"4"n
			Codice operazione	/"4"n
O		022	CRO originario	16x
O	AC	6G9	Risultati di asta	10 occorrenze
			Segno parametro	"1"x
			Valore parametro	/"9"n
			Importo assegnato	/"15"n

(1) XXXXX = Codice A.B.I. YY = identificativo di ambiente (00 per la produzione).

(2) può assumere i valori:

**O** se il campo è obbligatorio

**F** se il campo è facoltativo

(3) contiene indicazioni sulle funzioni di sicurezza cui eventualmente è sottoposto il campo; può assumere valori:

**A** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo

**C** se il campo è crittografato

**AC** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo ed è crittografato

## **2.3 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E3 AD HOC**

### **IDC 01 - TIPO MESSAGGIO**

Assume il valore 6E3.

### **IDC 040 - MITTENTE**

Identificativo della Banca d'Italia.

### **IDC 050 - DESTINATARIO**

Identificativo del destinatario.

### **IDC 020 - CRO**

Codice di riferimento del messaggio assegnato dal mittente.

### **IDC D31 - DATA DI RIFERIMENTO**

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

### **IDC 601 - ORA DI RIFERIMENTO**

Ora di invio del messaggio nel formato hhmmss.

### **IDC 010 - CIFRA DI CONTROLLO**

Codice di controllo calcolato sulla base di un algoritmo e di una chiave bilaterale scambiata tra mittente e destinatario; deve essere presente se manca l'IDC 012, deve essere assente se presente l'IDC 012.

### **IDC 012 - MAC**

Codice di controllo calcolato dall'applicazione SMTS. I primi otto caratteri contengono l'autenticatore zonato, gli altri due caratteri la versione delle chiavi di autenticazione e di cifratura. Deve essere presente se manca l'IDC 010, deve essere assente se presente l'IDC 010.

## **Prima comunicazione**

### **IDC 6G0 – IDENTIFICATIVO OPERAZIONE**

E' il codice che indica se il messaggio contiene le informazioni di cui alla prima o alla seconda comunicazione dei dati relativi ai tassi di interesse. Si compone dei seguenti sottocampi:

- “Anno”  
è sempre valorizzato con “2021”;
- “Codice”  
è sempre valorizzato con “8888”.

### **IDC 022 - CRO ORIGINARIO**

Non è significativo. E' impostato con tutti '0'.

### **IDC 6G9 - RISULTATI DI ASTA (1° occorrenza)**

La prima occorrenza del 6G9 indica l'“ABI di riferimento” ovvero il codice identificativo della banca alla quale si riferiscono le informazioni contenute nel messaggio. Nella prima comunicazione, in caso di eventi societari e/o variazione di gruppi TLTRO-III successivi al 31 marzo 2021, può essere diverso dal destinatario. Si compone dei seguenti sottocampi:

- “Segno parametro”  
non è significativo. E' impostato a '+';
- “Valore parametro”  
ABI della controparte cui i dati comunicati si riferiscono (con caratteri iniziali impostati a '0');
- “Importo assegnato”  
non è significativo. E' impostato con tutti '0'.

### **IDC 6G9 - RISULTATI DI ASTA (2° occorrenza)**

La seconda occorrenza del 6G9 indica il valore “NLB”. Si compone dei seguenti sottocampi:

- “Segno parametro”  
assume valore '+' se NLB è pari a 0 oppure '-' per valori negativi;
- “Valore parametro”  
non è significativo. E' impostato con tutti '0';
- “Importo assegnato”  
indica il valore assoluto del NLB in centesimi (con caratteri iniziali impostati a '0').

### **IDC 6G9 - RISULTATI DI ASTA (3° occorrenza)**

La terza occorrenza del 6G9 indica il valore “EX”. Si compone dei seguenti sottocampi:

- “Segno parametro”

assume valore ‘+’ se EX è pari o maggiore di 0 oppure ‘-’ per valori negativi. In caso di mancato invio dei dati necessari al computo di EX e/o della certificazione degli stessi dati da parte del revisore esterno (ovvero di invio con un ritardo superiore ai 14 giorni rispetto al termine indicato dalla normativa), è impostato a ‘+’;

- “Valore parametro”

indica i numeri interi del valore assoluto di EX (con caratteri iniziali impostati a ‘0’). In caso di mancato invio dei dati necessari al computo di EX e/o della certificazione degli stessi dati da parte del revisore esterno (ovvero di invio con un ritardo superiore ai 14 giorni rispetto al termine indicato dalla normativa), è valorizzato con tutti ‘9’ (tale valore fittizio indica “dato assente o non certificato”);

- “Importo assegnato”

indica i numeri decimali del valore assoluto di EX. In caso di mancato invio dei dati necessari al computo di EX e/o della certificazione degli stessi dati da parte del revisore esterno (ovvero di invio con un ritardo superiore ai 14 giorni rispetto al termine indicato dalla normativa), è valorizzato con tutti ‘9’ (tale valore fittizio indica “dato assente o non certificato”).

### **IDC 6G9 - RISULTATI DI ASTA (4° occorrenza)**

La quarta occorrenza del 6G9 indica il valore NL<sub>Special</sub>. Si compone dei seguenti sottocampi:

- “Segno parametro”

assume valore ‘+’ se NL<sub>Special</sub> è pari o maggiore di 0 oppure ‘-’ per valori negativi. In caso di mancato invio dei dati necessari al computo di NL<sub>Special</sub> e/o della certificazione degli stessi dati da parte del revisore esterno (ovvero di invio con un ritardo superiore ai 14 giorni rispetto al termine indicato dalla normativa), è impostato a ‘+’;

- “Valore parametro”

non è significativo. E’ impostato con tutti ‘0’;

- “Importo assegnato”

indica il valore assoluto di NL<sub>Special</sub> in centesimi (con caratteri iniziali impostati a ‘0’). In caso di mancato invio dei dati necessari al computo del NL<sub>Special</sub> e/o della certificazione degli stessi dati da parte del revisore esterno (ovvero di invio con un ritardo superiore ai 14 giorni rispetto al termine indicato dalla normativa), è valorizzato con tutti ‘9’ (tale valore fittizio indica “dato assente o non certificato”).



### **IDC 6G9 - RISULTATI DI ASTA (5° occorrenza)**

La quinta occorrenza del campo 6G9 nei messaggi 6E3 finalizzati alla comunicazione dei dati relativi ai tassi di interesse è dedicata al valore "NLADSpecial". Tale informazione è fornita alle controparti solo nella seconda comunicazione. Nella prima comunicazione, i relativi sottocampi sono impostati come segue:

- "segno parametro"  
non è significativo. E' impostato a '+'
- "valore parametro"  
non è significativo. E' impostato con tutti '0'.
- "importo assegnato"  
è valorizzato con tutti '8' (tale valore fittizio indica "dato non fornito nella prima comunicazione").

### **IDC 6G9 - RISULTATI DI ASTA (dalla 6° alla 10° occorrenza)**

Non sono significative. Tutti i campi sono impostati con tutti '0'.

## **Seconda comunicazione**

### **IDC 6G0 – IDENTIFICATIVO OPERAZIONE**

E' il codice che indica se il messaggio contiene le informazioni di cui alla prima o alla seconda comunicazione sui dati relativi ai tassi di interesse. Si compone dei seguenti sottocampi:

- "Anno"  
è sempre valorizzato con "2022";
- "Codice"  
è sempre valorizzato con "9999".

### **IDC 022 - CRO ORIGINARIO**

Non è significativo. E' impostato con tutti '0'.

### **IDC 6G9 - RISULTATI DI ASTA (1° occorrenza)**

La prima occorrenza del 6G9 indica l'"ABI di riferimento" ovvero il codice identificativo della banca alla quale si riferiscono le informazioni contenute nel messaggio. Si compone dei seguenti sottocampi:

- "Segno parametro"  
non è significativo. E' impostato '+';
- "Valore parametro"  
ABI della controparte cui i dati comunicati si riferiscono (con caratteri iniziali impostati a '0');

- “Importo assegnato”  
non è significativo. E' impostato con tutti '0'.

### **IDC 6G9 - RISULTATI DI ASTA (2° occorrenza)**

la seconda occorrenza del 6G9 indica il valore “NLB”. Si compone dei seguenti sottocampi:

- “segno parametro”  
assume valore '+' se NLB è pari a 0 oppure '-' per valori negativi;
- “valore parametro”  
non è significativo. E' impostato con tutti '0';
- “importo assegnato”  
indica il valore assoluto di NLB in centesimi (con caratteri iniziali impostati a '0').

### **IDC 6G9 - RISULTATI DI ASTA (3° occorrenza)**

La terza occorrenza del campo 6G9 nei messaggi 6E3 finalizzati alla comunicazione dei dati relativi ai tassi d'interesse è dedicata al valore “EX”. Tale informazione é fornita alle controparti solo nella prima comunicazione. Nella seconda comunicazione, i relativi sottocampi sono impostati come segue:

- “Segno parametro”  
non è significativo. E' impostato a '+';
- “Valore parametro”  
è valorizzato con tutti '8' (tale valore fittizio indica “dato non fornito nella seconda comunicazione”);
- “Importo assegnato”  
è valorizzato con tutti '8' (tale valore fittizio indica “dato non fornito nella seconda comunicazione”).

### **IDC 6G9 - RISULTATI DI ASTA (4° occorrenza)**

La quarta occorrenza del campo 6G9 nei messaggi 6E3 finalizzati alla comunicazione dei dati relativi ai tassi di interesse è dedicata al valore “NL<sub>Special</sub>”. Tale informazione é fornita alle controparti solo nella prima comunicazione. Nella seconda comunicazione, i relativi sottocampi sono impostati come segue:

- “Segno parametro”  
non è significativo. E' impostato a '+';
- “Valore parametro”  
non è significativo. E' impostato con tutti '0';

- “Importo assegnato”

è valorizzato con tutti ‘8’ (tale valore fittizio indica “dato non fornito nella seconda comunicazione”).

### **IDC 6G9 - RISULTATI DI ASTA (5° occorrenza)**

la quinta occorrenza del 6G9 indica il valore “NLADSpecial”. Si compone dei seguenti sottocampi:

- “segno parametro”

assume valore ‘+’ se NLADSpecial è pari o maggiore di 0 oppure ‘-’ per valori negativi. In caso di mancato invio dei dati necessari al computo di NLADSpecial e/o della certificazione degli stessi dati da parte del revisore esterno (ovvero di invio con un ritardo superiore ai 14 giorni rispetto al termine indicato dalla normativa), è impostato a ‘+’;

- “valore parametro”

non è significativo. E’ impostato con tutti ‘0’;

- “importo assegnato”

indica il valore assoluto di NLADSpecial in centesimi (con caratteri iniziali impostati a ‘0’). In caso di mancato invio dei dati necessari al computo di NLADSpecial e/o della certificazione degli stessi dati da parte del revisore esterno (ovvero di invio con un ritardo superiore ai 14 giorni rispetto al termine indicato dalla normativa), è valorizzato con tutti ‘9’ (tale valore fittizio indica “dato assente o non certificato”).

### **IDC 6G9 - RISULTATI DI ASTA (dalla 6° alla 10° occorrenza)**

Non sono significative. Tutti i campi sono impostati con tutti ‘0’.

### 3. MESSAGGIO 6E3 AD HOC PER LA COMUNICAZIONE DEI TASSI DI INTERESSE DEFINITIVI

#### 3.1 DESCRIZIONE

Per ciascuna operazione TLTRO-III, la Banca d'Italia comunica alle controparti con importi ancora in essere sulla specifica operazione, i tassi di interesse definitivi applicati ai rispettivi finanziamenti, 5 giorni prima della scadenza.

A tal fine è inviato un messaggio RNI 6E3 ad hoc distinto in base al campo "Identificativo operazione" (6G0). Tale campo è valorizzato con un codice fittizio, distinto per ciascuna operazione in scadenza, reso noto dalla Banca d'Italia e indipendente rispetto al codice identificativo dell'operazione d'asta.

Di seguito gli identificativi (campo 6G0) associati a ciascuna comunicazione:

OPERAZIONE IN SCADENZA	TERMINI PER LA COMUNICAZIONE DEI TASSI DEFINITIVI	CODICI COMUNICAZIONI (campo 6G0)
TLTRO-III.1	23/09/2022	2022 8801
TLTRO-III.2	16/12/2022	2022 8802
TLTRO-III.3	24/03/2023	2023 8803
TLTRO-III.4	23/06/2023	2023 8804
TLTRO-III.5	22/09/2023	2023 8805
TLTRO-III.6	15/12/2023	2023 8806
TLTRO-III.7	22/03/2024	2024 8807
TLTRO-III.8	21/06/2024	2024 8808
TLTRO-III.9	20/09/2024	2024 8809
TLTRO-III.10	13/12/2024	2024 8810

Il messaggio riporta le seguenti informazioni:

- "tasso definitivo", espresso come tasso percentuale annuo, arrotondato per difetto alla quarta cifra decimale;
- "capitale in scadenza", ammontare del finanziamento in essere alla data della scadenza.

Alle controparti che - a causa di eventi societari e/o modifiche alla composizione del proprio gruppo TLTRO-III verificatisi successivamente al 31 marzo 2021 - detengono più di

un finanziamento sull'operazione TLTRO-III in scadenza, è inviato un unico messaggio con i dati relativi a tutti i finanziamenti detenuti sull'operazione in scadenza.

### 3.2 TRACCIATO

TIPO MESSAGGIO: 6E3

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE:

01000BI006YY (1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA:

XXXXXXBI006YY (1)

O / F (2)	A / C (3)	IDC	DESCRIZIONE	FORMATO
O		01	Tipo messaggio	"3"b
O		040	Mittente (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		050	Destinatario (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		020	CRO	"11"n
O		D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	"8"n
O		601	Ora di riferimento (hhmmss)	"6"n
F		010	Cifra di controllo	"5"n
F		012	MAC	"10"x
O		6G0	Identificativo operazione	
			Anno	"4"n
			Codice operazione	/"4"n
O		022	CRO originario	16x
O	AC	6G9	Risultati di asta	10 occorrenze
			Segno parametro	"1"x
			Valore parametro	/"9"n
			Importo assegnato	/"15"n

(4) XXXXX = Codice A.B.I. YY = identificativo di ambiente (00 per la produzione).

(5) può assumere i valori:

**O** se il campo è obbligatorio

**F** se il campo è facoltativo

(6) contiene indicazioni sulle funzioni di sicurezza cui eventualmente è sottoposto il campo; può assumere valori:

**A** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo

**C** se il campo è crittografato

**AC** se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo ed è crittografato

### **3.3 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E3 AD HOC**

#### **IDC 01 - TIPO MESSAGGIO**

Assume il valore 6E3.

#### **IDC 040 - MITTENTE**

Identificativo della Banca d'Italia.

#### **IDC 050 - DESTINATARIO**

Identificativo del destinatario.

#### **IDC 020 - CRO**

Codice di riferimento del messaggio assegnato dal mittente.

#### **IDC D31 - DATA DI RIFERIMENTO**

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

#### **IDC 601 - ORA DI RIFERIMENTO**

Ora di invio del messaggio nel formato hhmmss.

#### **IDC 010 - CIFRA DI CONTROLLO**

Codice di controllo calcolato sulla base di un algoritmo e di una chiave bilaterale scambiata tra mittente e destinatario; deve essere presente se manca l'IDC 012, deve essere assente se presente l'IDC 012.

#### **IDC 012 - MAC**

Codice di controllo calcolato dall'applicazione SMTS. I primi otto caratteri contengono l'autenticatore zonato, gli altri due caratteri la versione delle chiavi di autenticazione e di cifratura. Deve essere presente se manca l'IDC 010, deve essere assente se presente l'IDC 010.

## **IDC 6G0 – IDENTIFICATIVO OPERAZIONE**

Il codice identifica l'operazione in scadenza cui si riferisce la comunicazione, sulla base della corrispondenza indicata nella tabella riportata nel paragrafo "Descrizione". Si compone dei sottocampi "Anno" e "Codice" come indicato nella suddetta tabella.

## **IDC 022 - CRO ORIGINARIO**

Non è significativo. E' impostato con tutti '0'.

## **IDC 6G9 - RISULTATI DI ASTA**

Riporta il tasso definitivo e il capitale a scadenza per ciascun finanziamento della controparte. Sono valorizzate tante occorrenze quanti sono i finanziamenti sull'operazione in scadenza detenuti dalla controparte. Si compone dei seguenti sottocampi:

- "Segno parametro"  
indica il segno del tasso definitivo del finanziamento. Assume valore '+' se il tasso definitivo è maggiore o uguale a "0" oppure '-' per valori negativi;
- "Valore parametro"  
Indica il valore assoluto del tasso definitivo arrotondato per difetto alla quarta cifra decimale. Le prime tre cifre indicano i numeri interi, le ultime 6 i decimali.
- "Importo assegnato"  
indica il valore del capitale in scadenza in centesimi di euro.