

Obbligo di *Position reporting* alla Consob delle posizioni su derivati su merce, quote di emissioni e relativi derivati, ai sensi dell'articolo 58, MiFID II

Allegato tecnico

Trasmissione delle relazioni giornaliere. Istruzioni operative.

1. Tempistica per la trasmissione delle relazioni giornaliere

Le sedi di negoziazione devono inviare alla Consob i *report* (di seguito anche dette relazioni giornaliere), di cui all'articolo 58, comma 1, lettera b), della direttiva 2014/65/UE - MiFID II, a partire dal 3 gennaio 2018 entro le ore 22:00, ora centrale europea, del giorno feriale successivo a quello rispetto al quale si riferiscono le relazioni stesse.

Le imprese di investimento devono inviare le relazioni giornaliere di cui all'articolo 58, comma 2, MiFID II, a partire dal 3 gennaio 2018, entro le ore 22:00, ora centrale europea, del giorno feriale successivo a quello rispetto al quale si riferiscono le relazioni stesse.

2. Formato delle relazioni giornaliere

Le sedi di negoziazioni e i soggetti sopra indicati (di seguito, "soggetti esterni") devono trasmettere alla Consob le informazioni di cui alle riferite relazioni giornaliere in formato *XML*.

3. Requisiti del sistema e modalità di scambio

La Consob riceve direttamente dai soggetti esterni i *report* e provvede, a seguito di controlli di correttezza e congruenza, a fornire il *file* di *feedback* contenente le informazioni relative alle validazioni eseguite.

I *file* che i soggetti esterni trasmettono alla Consob e i relativi *feedback* che la Consob trasmette agli stessi, sono di tipo *XML* e sono scambiati con il protocollo *SFTP*.

4. Protocollo di comunicazione tra la Consob e i soggetti esterni

Il protocollo di scambio tra la Consob e i soggetti esterni prevede le funzionalità di seguito riportate:

- autenticazione finalizzata allo scambio dei *file*;
- invio da parte dei soggetti esterni dei *file* relativi alle scomposizioni giornaliere di cui all'articolo 58, comma 1, lettera b) e all'articolo 58, comma 2, MiFID;
- invio della Consob ai soggetti esterni dei *file* di *feedback* relativi ai *file* ricevuti.

5. Funzionalità del Sistema

E' istituito il sistema della Consob SIPR (Sistema Informatico *Position Reporting*) a supporto degli obblighi di *position reporting* in discorso. Il SIPR prevede le seguenti funzionalità:

- ricezione dei *file* delle riferite scomposizioni giornaliere da parte dei soggetti esterni;
- verifica della correttezza sintattica e semantica dei *file* ricevuti;
- invio ai soggetti esterni dei *file* di *feedback*;
- registrazione nel database dell'istituto dei dati oggetto del *report*, in caso di segnalazione corretta.

Si segnala che, in caso di *feedback* negativo, i soggetti esterni devono provvedere alla correzione e al nuovo invio del *report* nei termini sopra indicati.

6. Caratteristiche delle relazioni giornaliere

Di seguito sono indicate le caratteristiche dei campi previsti per le relazioni giornaliere in adempimento degli obblighi di cui all'articolo 58, comma 1, lettera b) e all'articolo 58, comma 2, MiFID.

6.1 Descrizione dei tipi di formato utilizzati per i campi

Tabella 1

Simboli utilizzati per i campi (cfr Tabella 1, Allegato II, Regolamento di esecuzione (UE) 2017/1093 della Commissione del 20 giugno 2017)

SIMBOLO	TIPO DI DATI	DEFINIZIONE
{ALPHANUM-n}	Fino a n caratteri alfanumerici.	Testo libero.
{DECIMAL-n/m}	Numero decimale fino a n cifre in totale, di cui fino a m possono essere decimali	Campo numerico per valori sia positivi sia negativi: — il simbolo del decimale è «.» (punto); — i numeri negativi sono preceduti dal segno «-» (meno). Ove applicabile, i valori sono arrotondati e non troncati.
{DATEFORMAT}	Formato della data secondo ISO 8601	Le date sono indicate con il formato seguente: AAAA-MM-GG.
{DATE_TIME_FORMAT}	Formato della data e dell'ora secondo ISO 8601	— Data e ora nel formato seguente: AAAA-MM-GGThh:mm:ss.dddddZ. — «AAAA» indica l'anno; — «MM» indica il mese;

		<ul style="list-style-type: none"> — «GG» indica il giorno; — «T» indica che va inserita la lettera «T»; — «hh» indica l'ora; — «mm» indica i minuti; — «ss.dddddd» indica i secondi e le frazioni di secondo; — «Z» indica l'ora UTC. <p>Le date e ore sono indicate al tempo universale coordinato (UTC).</p>
{ISIN}	12 caratteri alfanumerici	Codice ISIN secondo ISO 6166.
{LEI}	20 caratteri alfanumerici	Identificativo del soggetto giuridico secondo ISO 17442
{MIC}	4 caratteri alfanumerici	Identificativo del mercato secondo ISO 10383.
{NATIONAL_ID}	35 caratteri alfanumerici	L'identificativo di cui all'articolo 6 del regolamento delegato 2017/590 della Commissione ⁽¹⁾ relativo agli obblighi di segnalazione delle operazioni ai sensi dell'articolo 26 del regolamento (UE) n. 600/2014 del Parlamento europeo e del Consiglio ⁽²⁾ e all'allegato II dello stesso regolamento.
{INTEGER-n}	Numero intero fino a n cifre in totale	Campo numerico per valori interi sia positivi sia negativi.
<p>⁽¹⁾Regolamento delegato (UE) 2017/590 della Commissione, del 28 luglio 2016, che integra il regolamento (UE) n. 600/2014 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione relative alla segnalazione delle operazioni alle autorità competenti (GU L 87 del 31.3.2017, pag. 449).</p> <p>⁽²⁾ Regolamento (UE) n. 600/2014 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 15 maggio 2014, sui mercati degli strumenti finanziari e che modifica il regolamento (UE) n. 648/2012 (GU L 173 del 12.6.2014, pag. 84).</p>		

Tabella 2

Elenco dei campi (cfr Tabella 2, Allegato II, Regolamento di esecuzione (UE) 2017/1093 della Commissione del 20 giugno 2017)

CAMPO	DETTAGLI DA COMUNICARE	FORMATO
Data e ora di presentazione della relazione	Campo da compilare con la data e l'ora di presentazione della relazione.	{DATE_TIME_FORMAT}
Numero di riferimento della relazione	Campo da compilare con l'identificativo unico fornito dal notificatore, che identifica in modo univoco la relazione sia per il notificatore che per l'autorità competente che la riceve.	{ALPHANUM-52}
Data del giorno di negoziazione della posizione comunicata	Campo da compilare con la data in cui la posizione comunicata è detenuta al termine del giorno di negoziazione della sede di negoziazione pertinente.	{DATEFORMAT}
Status della relazione	Indica se si tratta di una relazione nuova oppure dell'annullamento o della modifica di una relazione presentata in precedenza. Se una relazione presentata in precedenza è annullata o modificata, è necessario inviare una relazione contenente tutti i dati della relazione originaria utilizzando il numero di riferimento della relazione originale, e indicare «CANC» nello «status della relazione». Per le modifiche è necessario inviare una nuova relazione contenente tutti i dati della relazione originaria e tutte le modifiche necessarie utilizzando il numero di riferimento della relazione originale, e indicare «AMND» nello «status della relazione».	«NEWT»=nuova «CANC»=annullamento «AMND»=modifica
Identificativo dell'entità che effettua la comunicazione	L'identificativo dell'impresa di investimento che effettua la comunicazione. Campo da compilare con il codice identificativo del soggetto giuridico (LEI) per le persone giuridiche o con il {NATIONAL_ID} per le persone fisiche che non hanno un codice LEI.	{LEI} o {NATIONAL_ID} — Persone fisiche
Identificativo del possessore della posizione	Campo da compilare con il codice identificativo del soggetto giuridico (LEI) per le persone giuridiche o con il {NATIONAL_ID} per le persone fisiche che non hanno un codice LEI. (Nota: se la posizione è detenuta come posizione propria dell'impresa che effettua la comunicazione, questo campo deve essere identico al campo «Identificativo dell'entità che effettua la comunicazione»).	LEI} o {NATIONAL_ID} — Persone fisiche
Indirizzo di posta elettronica del possessore	Indirizzo di posta elettronica per le notifiche relative alle posizioni.	{ALPHANUM-256}

della posizione		
Identificativo dell'entità madre capogruppo	Campo da compilare con il codice identificativo del soggetto giuridico (LEI) per le persone giuridiche o con il {NATIONAL_ID} per le persone fisiche che non hanno un codice LEI. Nota: questo campo può essere identico al campo «Identificativo dell'entità che effettua la comunicazione» o al campo «Identificativo del possessore della posizione» se l'entità madre capogruppo detiene le proprie posizioni o redige le proprie relazioni.	{LEI} o {NATIONAL_ID} — Persone fisiche
Indirizzo di posta elettronica dell'entità madre capogruppo	Indirizzo email per la corrispondenza relativa alle posizioni aggregate.	{ALPHANUM-256}
Status dell'impresa madre dell'organismo di investimento collettivo	Campo in cui indicare se il possessore della posizione è un organismo di investimento collettivo che prende decisioni in materia di investimenti in modo indipendente rispetto all'impresa madre, come stabilito all'articolo 4, paragrafo 2, del regolamento delegato (UE) 2017/591 della Commissione ⁽¹⁾	«TRUE»—il possessore della posizione è un organismo di investimento collettivo che prende decisioni in materia di investimenti in modo indipendente «FALSE»—il possessore della posizione non è un organismo di investimento collettivo che prende decisioni in materia di investimenti in modo indipendente
Codice di identificazione del contratto negoziato in sedi di negoziazione	Identificativo dello strumento derivato su merci, della quota di emissioni o dello strumento derivato sulla stessa. Cfr. il campo «Identificativo della sede di negoziazione» per il trattamento dei contratti OTC economicamente equivalenti ai contratti negoziati nelle sedi di negoziazione.	{ISIN}
Codice del prodotto della sede	Campo da compilare con un codice identificativo alfanumerico unico e univoco utilizzato dalla sede di negoziazione che raggruppa i contratti con scadenze e prezzi di esercizio diversi relativi allo stesso prodotto	{ALPHANUM-12}
Identificativo della sede di negoziazione	Campo da compilare con il MIC del segmento conforme all'ISO 10383 per le posizioni comunicate rispetto a contratti negoziati nella sede. Se il MIC del segmento non esiste, utilizzare il MIC operativo. Utilizzare il codice MIC «XXXX» per le posizioni negoziate fuori della sede in contratti OTC economicamente equivalenti. Utilizzare il codice	{MIC}

	MIC «XOFF» per i derivati quotati o le quote di emissioni negoziati fuori dai mercati regolamentati.	
Tipo di posizione	Campo in cui indicare se la posizione è in contratti finanziari a termine standardizzati («future»), in contratti di opzione, in quote di emissioni o in strumenti derivati sulle stesse, in strumenti derivati su merci definiti all'articolo 4, paragrafo 1, punto 44, lettera c), della direttiva 2014/65/UE del Parlamento europeo e del Consiglio ⁽²⁾ , o in qualsiasi altro tipo di contratto.	<p>«OPTN»—contratti di opzione, tra cui opzioni negoziabili separatamente sui tipi FUTR, SDRV o OTHR, esclusi i prodotti per i quali il carattere facoltativo è solo un elemento integrato</p> <p>«FUTR»—future</p> <p>«EMIS»—quote di emissioni e strumenti derivati sulle stesse</p> <p>«SDRV»—strumenti derivati su merci definiti all'articolo 4, paragrafo 1, punto 44, lettera c), della direttiva 2014/65/UE</p> <p>«OTHR»—ogni altro tipo di contratto</p>
Scadenza della posizione	Indicare se la scadenza del contratto che comprende la posizione oggetto della comunicazione riguarda il primo mese utile di scadenza (<i>spot month</i>) o tutti gli altri mesi. Nota: sono richieste relazioni distinte per i primi mesi utili di scadenza e tutti gli altri mesi.	<p>«SPOT»—primo mese utile di scadenza, comprendente tutte le posizioni di tipo EMIS e SRDV</p> <p>«OTHR»—tutti gli altri mesi</p>
Quantitativo della posizione	Campo da compilare con il quantitativo netto della posizione detenuto nello strumento derivato su merci, quote di emissioni o relativi derivati espressi in lotti, se i limiti di posizione sono espressi in lotti, o in unità del sottostante. Compilare il campo con un numero positivo per le posizioni lunghe e un numero negativo per le posizioni corte. Se la posizione è in strumenti derivati su merci definiti all'articolo 4, paragrafo 1, punto 44, lettera c), della direttiva 2014/65/UE, in questo campo deve essere riportato il numero di unità detenute.	{DECIMAL-15/2}
Notazione del quantitativo della posizione	Campo da compilare con le unità utilizzate per comunicare il quantitativo della posizione.	<p>«LOTS»—se il quantitativo della posizione è espresso in lotti</p> <p>{ALPHANUM-25}—la descrizione delle unità utilizzate se il quantitativo della posizione è espresso in unità del sottostante</p> <p>«UNIT»—se il quantitativo</p>

		della posizione è espresso in unità
Quantitativo della posizione equivalente delta	Se il tipo di posizione è «OPTN» o un'opzione su «EMIS», questo campo specifica il quantitativo equivalente delta della posizione indicata nel campo «quantitativo della posizione». Compilare il campo con un numero positivo per <i>long call</i> e <i>short put</i> e un numero negativo per <i>long put</i> e <i>short call</i> .	{DECIMAL-15/2}
Indicatore di posizione che riduce il rischio in relazione ad attività commerciali	Campo in cui indicare se la posizione riduce il rischio, conformemente all'articolo 7 del regolamento delegato (UE) 2017/591.	«TRUE»— la posizione riduce il rischio «FALSE»— la posizione non riduce il rischio
<p>⁽¹⁾Regolamento delegato (UE) 2017/591 della Commissione, del 1o dicembre 2016, che integra la direttiva 2014/65/UE del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione relative all'applicazione dei limiti di posizione agli strumenti derivati su merci (GU L 87 del 31.3.2017, pag. 479).</p> <p>⁽²⁾ Direttiva 2014/65/UE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 15 maggio 2014, relativa ai mercati degli strumenti finanziari e che modifica la direttiva 2002/92/CE e la direttiva 2011/61/UE (GU L 173 del 12.6.2014, pag. 349).</p>		

6.2 Descrizione dei campi del *file* che deve essere inviato alla Consob

Di seguito sono riportati le descrizioni dei campi al cui interno sono previste le seguenti sezioni:

- **Format:** Formato dei campi in accordo con le definizioni della tabella 1
- **XPath:** Posizione nello schema XSD
- **Definition:** Specifica cosa deve contenere un campo
- **Standard:** Lo standard da utilizzare per popolare il campo (se applicabile)
- **Validation:** Specifica le regole che devono essere applicate al campo (se esistono)
- **Note:** Informazioni aggiuntive sul campo

6.2.1 Data e ora di presentazione del *report*

Format	DateTimeFormat
Xpath	DlyRpt/ DateAndTimeOfReportSubmission
Definition	Campo da compilare con la data e l'ora di presentazione del la relazione.
Standard	urn:iso:std:iso:20022
Validation	
Note	documentation DateOfReportSubmission documentation

	Campo da compilare con la data e l'ora di presentazione della relazione.
--	--

6.2.2 Numero di riferimento del *report*

Format	Max52Text
Xpath	DlyRpt/ReportReferenceNumber
Definition	Campo da compilare con l'identificativo unico fornito dal notificatore, che identifica in modo univoco la relazione sia per il notificatore che per l'autorità competente che la riceve.
Standard	urn:iso:std:iso:20022
Validation	
Note	documentation ReportReferenceNumber documentation Campo da compilare con l'identificativo unico fornito dal notificatore, che identifica in modo univoco la relazione sia per il notificatore che per l'autorità competente che la riceve.

6.2.3 Data del giorno di negoziazione della posizione comunicata nel *report*

Format	DateFormat
Xpath	DlyRpt/DateOfTheTradingDayOfTheReportedPosition
Definition	Campo da compilare con la data in cui la posizione comunicata è detenuta al termine del giorno di negoziazione della sede di negoziazione pertinente.
Standard	urn:iso:std:iso:20022
Validation	
Note	documentation DateOfTheTradingDayOfTheReportedPosition documentation Campo da compilare con la data in cui la posizione comunicata è detenuta al termine del giorno di negoziazione della sede di negoziazione pertinente.

6.2.4 Status del *report*

Format	ReportStatus
Xpath	DlyRpt/ ReportStatus
Definition	Indica se si tratta di una relazione nuova oppure dell'annullamento o della modifica di una relazione presentata in precedenza. Se una relazione presentata in precedenza è annullata o modificata, è necessario inviare una relazione contenente tutti i dati della relazione originaria utilizzando il numero di riferimento della relazione originale, e indicare «CANC» nello «status della relazione». Per le modifiche è necessario inviare una nuova relazione contenente tutti i dati della relazione originaria e tutte le modifiche necessarie utilizzando il numero di riferimento della relazione originale, e indicare «AMND» nello «status della relazione».
Standard	urn:iso:std:iso:20022

Validation	
Note	<p>Documentation ReportStatus documentation</p> <p>Indica se si tratta di una relazione nuova oppure dell'annullamento o della modifica di una relazione presentata in precedenza. Se una relazione presentata in precedenza è annullata o modificata, è necessario inviare una relazione contenente tutti i dati della relazione originaria utilizzando il numero di riferimento della relazione originale, e indicare «CANC» nello «status della relazione». Per le modifiche è necessario inviare una nuova relazione contenente tutti i dati della relazione originaria e tutte le modifiche necessarie utilizzando il numero di riferimento della relazione originale, e indicare «AMND» nello «status della relazione».</p>

6.2.5 Identificativo dell'entità che effettua la comunicazione

Format	LeiNationalIdEntity
Xpath	DlyRpt/ReportingEntityId
Definition	L'identificativo dell'impresa di investimento che effettua la comunicazione. Campo da compilare con il codice identificativo del soggetto giuridico (LEI) per le persone giuridiche o con il {NATIONAL_ID} per le persone fisiche che non hanno un codice LEI.
Standard	urn:iso:std:iso:20022
Validation	
Note	<p>documentation ReportEntityId documentation</p> <p>L'identificativo dell'impresa di investimento che effettua la comunicazione. Campo da compilare con il codice identificativo del soggetto giuridico (LEI) per le persone giuridiche o con il {NATIONAL_ID} per le persone fisiche che non hanno un codice LEI.</p>

6.2.6 Identificativo del possessore della posizione

Format	LeiNationalIdEntity
Xpath	DlyRpt/PositionHolderId
Definition	Campo da compilare con il codice identificativo del soggetto giuridico (LEI) per le persone giuridiche o con il {NATIONAL_ID} per le persone fisiche che non hanno un codice LEI. (Nota: se la posizione è detenuta come posizione propria dell'impresa che effettua la comunicazione, questo campo deve essere identico al campo «Identificativo dell'entità che effettua la comunicazione»).
Standard	urn:iso:std:iso:20022
Validation	
Note	<p>documentation PositionHolderId documentation</p> <p>Campo da compilare con il codice identificativo del soggetto giuridico (LEI) per le persone giuridiche o con il {NATIONAL_ID} per le persone</p>

	fisiche che non hanno un codice LEI. (Nota: se la posizione è detenuta come posizione propria dell'impresa che effettua la comunicazione, questo campo deve essere identico al campo «Identificativo dell'entità che effettua la comunicazione»).
--	---

6.2.7 Indirizzo di posta elettronica del possessore della posizione

Format	Max256Text
Xpath	DlyRpt/EmailAddressOfPositionHolder
Definition	Indirizzo di posta elettronica per le notifiche relative alle posizioni.
Standard	urn:iso:std:iso:20022
Validation	
Note	documentation EmailAddressOfPositionHolder documentation Indirizzo di posta elettronica per le notifiche relative alle posizioni.

6.2.8 Identificativo dell'entità madre capogruppo

Format	LeiNationalIdEntity
Xpath	DlyRpt/UltimateParentEntityId
Definition	Campo da compilare con il codice identificativo del soggetto giuridico (LEI) per le persone giuridiche o con il {NATIONAL_ID} per le persone fisiche che non hanno un codice LEI. Nota: questo campo può essere identico al campo «Identificativo dell'entità che effettua la comunicazione» o al campo «Identificativo del possessore della posizione» se l'entità madre capogruppo detiene le proprie posizioni o redige le proprie relazioni.
Standard	urn:iso:std:iso:20022
Validation	
Note	documentation PositionHolderId documentation Campo da compilare con il codice identificativo del soggetto giuridico (LEI) per le persone giuridiche o con il {NATIONAL_ID} per le persone fisiche che non hanno un codice LEI. Nota: questo campo può essere identico al campo «Identificativo dell'entità che effettua la comunicazione» o al campo «Identificativo del possessore della posizione» se l'entità madre capogruppo detiene le proprie posizioni o redige le proprie relazioni.

6.2.9 Indirizzo di posta elettronica dell'entità madre capogruppo

Format	Max256Text
Xpath	DlyRpt/EmailAddressOfUltimateParentEntity
Definition	Indirizzo email per la corrispondenza relativa alle posizioni aggregate.
Standard	urn:iso:std:iso:20022

Validation	
Note	documentation EmailAddressOfUltimateParentEntity documentation Indirizzo email per la corrispondenza relativa alle posizioni aggregate.

6.2.10 Status dell'impresa madre dell'organismo di investimento collettivo

Format	Max12Text
Xpath	DlyRpt/ParentOfCollectiveInvestmentSchemeStatus
Definition	Campo in cui indicare se il possessore della posizione è un organismo di investimento collettivo che prende decisioni in materia di investimenti in modo indipendente rispetto all'impresa madre, come stabilito all'articolo 4, paragrafo 2, del regolamento delegato (UE) 2017/591 della Commissione
Standard	urn:iso:std:iso:20022
Validation	
Note	documentation ParentOfCollectiveInvestmentSchemeStatus documentation Campo in cui indicare se il possessore della posizione è un organismo di investimento collettivo che prende decisioni in materia di investimenti in modo indipendente rispetto all'impresa madre, come stabilito all'articolo 4, paragrafo 2, del regolamento delegato (UE) 2017/591 della Commissione

6.2.11 Codice di identificazione del contratto negoziato in sedi di negoziazione

Format	Max12Text
Xpath	DlyRpt/IdentificationCodeOfContractTradedOnTradingVenues
Definition	Identificativo dello strumento derivato su merci, della quota di emissioni o dello strumento derivato sulla stessa. Cfr. il campo «Identificativo della sede di negoziazione» per il trattamento dei contratti OTC economicamente equivalenti ai contratti negoziati nelle sedi di negoziazione.
Standard	urn:iso:std:iso:20022
Validation	
Note	documentation IdentificationCodeOfContractTradedOnTradingVenues documentation Identificativo dello strumento derivato su merci, della quota di emissioni o dello strumento derivato sulla stessa. Cfr. il campo «Identificativo della sede di negoziazione» per il trattamento dei contratti OTC economicamente equivalenti ai contratti negoziati nelle sedi di negoziazione.

6.2.12 Codice del prodotto della sede

Format	Max12Text
Xpath	DlyRpt/VenueProductCode

Definition	Campo da compilare con un codice identificativo alfanumerico unico e univoco utilizzato dalla sede di negoziazione che raggruppa i contratti con scadenze e prezzi di esercizio diversi relativi allo stesso prodotto.
Standard	urn:iso:std:iso:20022
Validation	
Note	documentation VenueProductCode documentation Campo da compilare con un codice identificativo alfanumerico unico e univoco utilizzato dalla sede di negoziazione che raggruppa i contratti con scadenze e prezzi di esercizio diversi relativi allo stesso prodotto.

6.2.13 Identificativo della sede di negoziazione

Format	MICIdentifier
Xpath	DlyRpt/ TradingVenueIdentifier
Definition	Campo da compilare con il MIC del segmento conforme all'ISO 10383 per le posizioni comunicate rispetto a contratti negoziati nella sede. Se il MIC del segmento non esiste, utilizzare il MIC operativo. Utilizzare il codice MIC «XXXX» per le posizioni negoziate fuori della sede in contratti OTC economicamente equivalenti. Utilizzare il codice MIC «XOFF» per i derivati quotati o le quote di emissioni negoziate fuori dai mercati regolamentati.
Standard	urn:iso:std:iso:20022
Validation	
Note	documentation CodiceConsob documentation Campo da compilare con il MIC del segmento conforme all'ISO 10383 per le posizioni comunicate rispetto a contratti negoziati nella sede. Se il MIC del segmento non esiste, utilizzare il MIC operativo. Utilizzare il codice MIC «XXXX» per le posizioni negoziate fuori della sede in contratti OTC economicamente equivalenti. Utilizzare il codice MIC «XOFF» per i derivati quotati o le quote di emissioni negoziate fuori dai mercati regolamentati.

6.2.14 Tipo di posizione

Format	PositionType
Xpath	DlyRpt/PositionType
Definition	Campo in cui indicare se la posizione è in contratti finanziari a termine standardizzati («future»), in contratti di opzione, in quote di emissioni o in strumenti derivati sulle stesse, in strumenti derivati su merci definiti all'articolo 4, paragrafo 1, punto 44, lettera c), della direttiva 2014/65/UE del Parlamento europeo e del Consiglio, o in qualsiasi altro tipo di contratto.

Standard	urn:iso:std:iso:20022
Validation	
Note	<p>documentation PositionType documentation</p> <p>Campo in cui indicare se la posizione è in contratti finanziari a termine standardizzati («future»), in contratti di opzione, in quote di emissioni o in strumenti derivati sulle stesse, in strumenti derivati su merci definiti all'articolo 4, paragrafo 1, punto 44, lettera c), della direttiva 2014/65/UE del Parlamento europeo e del Consiglio, o in qualsiasi altro tipo di contratto.</p>

6.2.15 Scadenza della posizione

Format	PositionMaturity
Xpath	DlyRpt/PositionMaturity
Definition	Indicare se la scadenza del contratto che comprende la posizione oggetto della comunicazione riguarda il primo mese utile di scadenza (<i>spot month</i>) o tutti gli altri mesi. Nota: sono richieste relazioni distinte per il primo mese utile di scadenza e tutti gli altri mesi.
Standard	urn:iso:std:iso:20022
Validation	
Note	<p>Documentation PositionMaturity Documentation</p> <p>Indicare se la scadenza del contratto che comprende la posizione oggetto della comunicazione riguarda il primo mese utile di scadenza (<i>spot month</i>) o tutti gli altri mesi. Nota: sono richieste relazioni distinte per il primo mese utile di scadenza e tutti gli altri mesi.</p>

6.2.16 Quantitativo della posizione

Format	{DECIMAL-15/2}
Xpath	DlyRpt/PositionQuantity
Definition	Campo da compilare con il quantitativo netto della posizione detenuto nello strumento derivato su merci, quote di emissioni o relativi derivati espressi in lotti, se i limiti di posizione sono espressi in lotti, o in unità del sottostante. Compilare il campo con un numero positivo per le posizioni lunghe e un numero negativo per le posizioni corte. Se la posizione è in strumenti derivati su merci definiti all'articolo 4, paragrafo 1, punto 44, lettera c), della direttiva 2014/65/UE, in questo campo deve essere riportato il numero di unità detenute.
Standard	urn:iso:std:iso:20022
Validation	
Note	<p>documentation PositionQuantity documentation</p> <p>Campo da compilare con il quantitativo netto della posizione detenuto nello strumento derivato su merci, quote di emissioni o relativi derivati espressi in lotti, se i limiti di posizione sono espressi in lotti, o in unità del sottostante.</p>

	<p>Compilare il campo con un numero positivo per le posizioni lunghe e un numero negativo per le posizioni corte. Se la posizione è in strumenti derivati su merci definiti all'articolo 4, paragrafo 1, punto 44, lettera c), della direttiva 2014/65/UE, in questo campo deve essere riportato il numero di unità detenute.</p>
--	---

6.2.17 Notazione del quantitativo della posizione

Format	NotationPositionQuantityField
Xpath	DlyRpt/ NotationOfThePositionQuantity
Definition	Campo da compilare con le unità utilizzate per comunicare il quantitativo della posizione.
Standard	urn:iso:std:iso:20022
Validation	
Note	<p>documentation NotationOfThePositionQuantity documentation Campo da compilare con le unità utilizzate per comunicare il quantitativo della posizione.</p>

6.2.18 Quantitativo della posizione equivalente delta

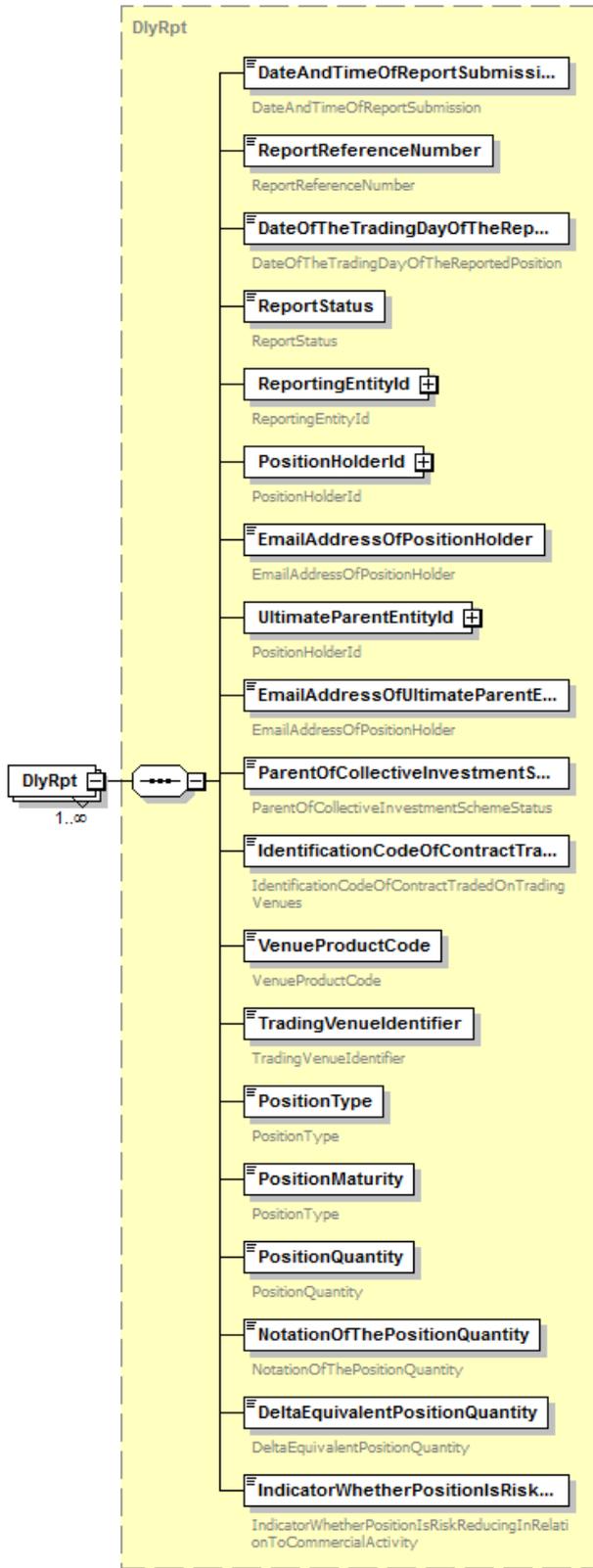
Format	PositionQuantity
Xpath	DlyRpt/ DeltaEquivalentPositionQuantity
Definition	Se il tipo di posizione è «OPTN» o un'opzione su «EMIS», questo campo specifica il quantitativo equivalente delta della posizione indicata nel campo «quantitativo della posizione». Compilare il campo con un numero positivo per <i>long call</i> e <i>short put</i> e un numero negativo per <i>long put</i> e <i>short call</i> .
Standard	urn:iso:std:iso:20022
Validation	
Note	<p>documentation DeltaEquivalentPositionQuantity documentation Se il tipo di posizione è «OPTN» o un'opzione su «EMIS», questo campo specifica il quantitativo equivalente delta della posizione indicata nel campo «quantitativo della posizione». Compilare il campo con un numero positivo per <i>long call</i> e <i>short put</i> e un numero negativo per <i>long put</i> e <i>short call</i>.</p>

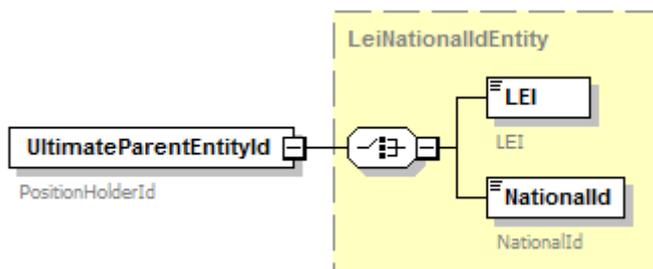
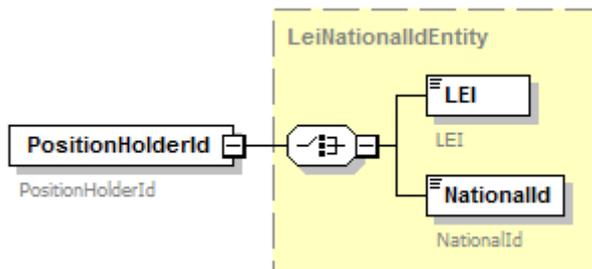
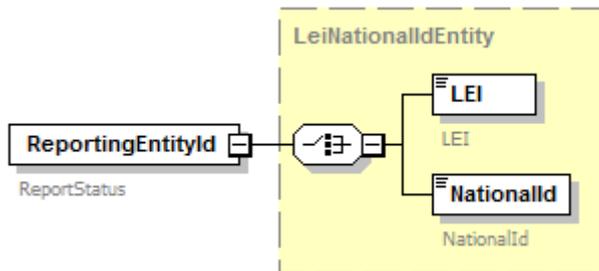
6.2.19 Indicatore di posizione che riduce il rischio in relazione ad attività commerciali

Format	PositionRisk
Xpath	DlyRpt/IndicatorWhetherPositionIsRiskReducingInRelationToCommercialActivity
Definition	Campo in cui indicare se la posizione riduce il rischio, conformemente all'articolo 7 del regolamento delegato (UE) 2017/591.
Standard	urn:iso:std:iso:20022
Validation	

Note	documentation IndicatorWhetherPositionIsRiskReducingInRelationToCommercialActivity documentation Campo in cui indicare se la posizione riduce il rischio, conformemente all'articolo 7 del regolamento delegato (UE) 2017/591.
-------------	--

6.3 Struttura del *file* da trasmettere alla Consob - schema XSD





6.4 Descrizione dei campi del file di feedback prodotto dalla Consob

Di seguito sono riportati le descrizioni dei campi al cui interno contengono le seguenti sezioni:

- Format: Formato dei campi in accordo con le definizioni della tabella 1
- XPath: Posizione nello schema XSD
- Definition: Specifica cosa deve contenere un campo
- Standard: Lo standard da utilizzare per popolare il campo (se applicabile)
- Validation: Specifica le regole che devono essere applicate al campo (se esistono)
- Note: Informazioni aggiuntive sul campo

6.4.1 Codice risultato

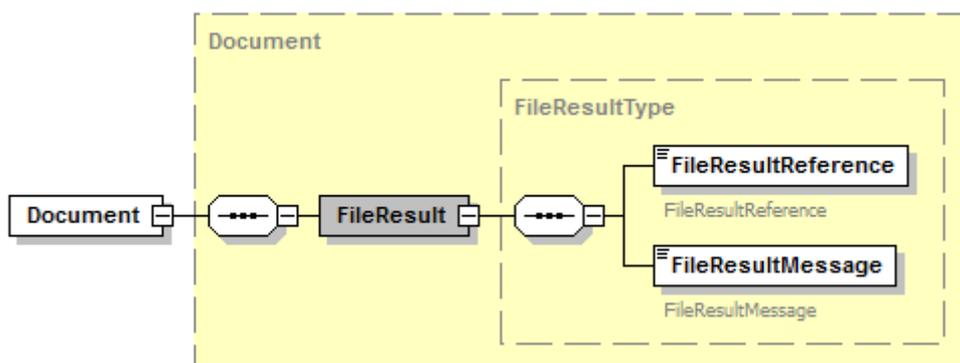
Format	FileResultReferenceType
Xpath	Document/FileResult/FileResultReference

Definition	Campo popolato con il codice del risultato
Standard	urn:iso:std:iso:20022
Validation	
Note	Documentation FileResultReference Documentation Il campo è popolato con il codice del risultato

6.4.2 Messaggio risultato

Format	FileResultMessageType
Xpath	Document/FileResult/FileResultMessage
Definition	Campo popolato con il messaggio del risultato.
Standard	urn:iso:std:iso:20022
Validation	
Note	Documentation FileResultMessage documentation Campo popolato con il messaggio del risultato

6.5 Struttura del file di feedback prodotto dalla Consob- schema XSD



7. Schema XSD – Nome degli schemi

7.1 Articolo 58, comma 1, lettera b)

Lo schema XSD relativo al *file* che il soggetto esterno deve inviare alla Consob è contenuto nel documento denominato: **DailyReport_Art_58_1_B.xsd**

Lo schema XSD relativo al *file di feedback* che la Consob produce è contenuto nel documento denominato: **RES_DailyReport_Art_58_1_B.xsd**

7.2 Articolo 58, comma 2, MiFID II

Lo schema XSD relativo al *file* che il soggetto esterno deve inviare alla Consob è contenuto nel documento denominato: **DailyReport_Art_58_2.xsd**

Lo schema XSD relativo al *file* di *feedback* che la Consob produce è contenuto nel documento denominato: **RES_DailyReport_Art_58_2.xsd**

8. Convenzione di nomenclatura dei *file*

Per i *report* giornalieri da inviare alla Consob e per i *file* di *feedback* prodotti dalla Consob, nella modalità stabilita dall'Istituto, è stabilita la seguente *naming convention*:

8.1 Articolo 58, comma 1, lettera b), MiFID II

File che i soggetti esterni inviano:

DailyReport_YYYYMMDD_CodiceConsob_NN_58_1_B.xml

File di Feedback che la Consob produce:

RES_DailyReport_YYYYMMDD_CodiceConsob_NN_58_1_B.xml

Note file:

Simboli	Descrizione
YYYYMMDD	Data nel formato YYYYMMDD
CodiceConsob	Codice identificativo del soggetto assegnato dalla Consob e comunicato ai soggetti esterni; lunghezza fissa di 7 caratteri (con zeri davanti)
NN	Progressivo numerico nel giorno, con lunghezza fissa di due (con zeri davanti)

8.2 Articolo 58, comma 2, MiFID II

File che i soggetti esterni inviano:

DailyReport_YYYYMMDD_CodiceConsob_NN_58_2.xml

File di Feedback che la Consob produce:

RES_DailyReport_YYYYMMDD_CodiceConsob_NN_58_2.xml

Note file:

Simboli	Descrizione
YYYYMMDD	Data nel formato YYYYMMDD

CodiceConsob	Codice identificativo del soggetto assegnato dalla Consob e comunicato ai soggetti esterni; lunghezza fissa di 7 caratteri (con zeri davanti)
NN	Progressivo numerico nel giorno, con lunghezza fissa di due (con zero davanti)

9. Gestione degli errori sui *File*

Il sistema SIPR della Consob effettua la validazione dei *file* ricevuti dai soggetti esterni e genera il *file* di *feedback* contenente il risultato della validazione.

Il sistema SIPR verifica due tipi di errori:

- a) Errori di struttura;
- b) Errori di contenuto.

In assenza di errori il sistema SIPR registra i dati nel database istituzionale e produce il *file* di *feedback* con lo stato ad “OK”.

In presenza di errore i dati non vengono registrati nel database istituzionale e produce il *file* di *feedback* che indica il codice di errore; i tipi di errori gestiti sono indicati nelle due tabelle seguenti.

9.1 Errori di struttura

Di seguito la tabella contenente gli errori di struttura segnalati:

Controlli	Codice errore	Messaggio di errore	Azione
Il file non può essere decompresso o il nome non rispetta il formato specificato.	FIL-001	Il file non può essere decompresso o il nome non rispetta il formato specificato.	Verificare il file compresso/ il nome dato al file e correggere il problema.
Identificativo messaggio ISO 20022 nel BAH (*.xsd) non valido.	FIL-007	Identificativo messaggio ISO 20022 nel BAH (*.xsd) non valido.	Correggere l' identificativo del messaggio.
Lo schema del file xml non corrisponde allo schema XML. Se c'è un errore nella validazione il messaggio prodotto verrà inserito nel file di <i>feedback</i> .	FIL-008	La struttura del file non corrisponde allo schema XML.	Verificare il risultato della validazione.
Quando il sistema riceve	FIL-014	Il File <Filename> e'	Aumentare il

un file controlla se esiste già un file inviato con lo stesso nome. Il sistema scarta il nuovo.		già stato inviato.	progressivo del file
--	--	--------------------	----------------------

9.2 Errori di contenuto

Di seguito la tabella contenente gli errori di contenuto nel *file*:

Controlli	Codice errore	Messaggio di errore	Azione
Verificare che il “Codice del prodotto della sede” con uno “Status della relazione” a NEWT non sia già stato inviato	POS-001	Il seguente report è già stato inviato.	Controllare il report e rinviarlo.
L’ identificativo MIC in “Identificativo della sede di negoziazione” non è un MIC valido.	POS-002	L’ identificativo MIC in “Identificativo della sede di negoziazione” non è un MIC valido.	Controllare il MIC e correggerlo.
La data indicata nel report deve essere inferiore alla data di sistema e non prima del 31-12-2017.	POS-003	La data indicata nel report è errata.	Verificare la data e correggerla.
“Status della relazione” può essere NEWT, AMND or CANC.	POS-004	Valore di “Status della relazione” non è valido	Controllare “Status della relazione” e correggerlo.

10. Comunicazioni relative all’entrata in funzione del sistema

Il *server* della Consob è raggiungibile all’indirizzo **tfr1.consob.it** ed è attivo a partire dal 3 gennaio 2018.

11. Modalità di attivazione del canale di scambio dati

Per l’attivazione del canale di scambio è necessario seguire la procedura di seguito descritta.

Tale procedura va seguita solo in sede di attivazione del canale di scambio; una volta portata a termine con successo non sarà necessario ripeterla.

- a) Il soggetto esterno segnala per il tramite della casella di posta **POSITION_REPORTING@consob.it** le seguenti informazioni:

- il nominativo e il recapito telefonico del referente incaricato della procedura di attivazione del canale di scambio;
 - indirizzo IP dal quale invierà i *file*;
 - indirizzo IP al quale vorrà ricevere i *file* di *feedback*;
 - le credenziali per il collegamento da parte della Consob al *server*, predisposto dal soggetto esterno, per la ricezione dei *file* di *feedback*; dovrà essere comunicato solo lo *User*; la *password* dovrà essere comunicata telefonicamente dal referente del soggetto esterno al referente della Consob;
- b) il soggetto esterno viene contattato telefonicamente dal referente della Consob che comunicherà le credenziali per l'invio dei *file* al *server* della Consob; i rispettivi referenti procederanno all'attivazione del canale di scambio.

12. Supporto tecnico

Qualunque richiesta di supporto potrà essere indirizzata alla casella di posta **POSITION_REPORTING@consob.it**