

**REGOLAMENTO DELEGATO (UE) 2017/585 DELLA COMMISSIONE****del 14 luglio 2016**

**che integra il regolamento (UE) n. 600/2014 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione per gli standard e il formato dei dati di riferimento relativi agli strumenti finanziari e le misure tecniche in relazione alle disposizioni che devono adottare l'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati e le autorità competenti**

(Testo rilevante ai fini del SEE)

LA COMMISSIONE EUROPEA,

visto il trattato sul funzionamento dell'Unione europea,

visto il 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 <sup>(1)</sup>, in particolare l'articolo 27, paragrafo 3, terzo comma,

considerando quanto segue:

- (1) Per consentire un'efficace sorveglianza del mercato da parte delle autorità competenti, è opportuno che i dati di riferimento per gli strumenti finanziari siano segnalati in un formato uniforme e secondo standard uniformi.
- (2) La segnalazione e la pubblicazione dei dati di riferimento in forma e formato elettronici, leggibili da dispositivo elettronico e scaricabili ne facilitano l'utilizzo e lo scambio efficaci.
- (3) Il pronto ricevimento dei dati di riferimento per tutti gli strumenti finanziari ammessi alla negoziazione o negoziati in una sede di negoziazione o tramite un internalizzatore sistematico consente alle autorità competenti e all'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (ESMA) di garantire la qualità dei dati e l'efficace sorveglianza del mercato, contribuendo ad assicurare l'integrità del mercato.
- (4) Per assicurare che le sedi di negoziazione e gli internalizzatori sistematici presentino dati di riferimento completi ed esatti e che le autorità competenti siano in grado di ricevere e di utilizzare tali dati in maniera efficace e tempestiva, dovrebbero essere stabilite scadenze appropriate per la presentazione. Dovrebbe essere altresì previsto un periodo di tempo adeguato per individuare eventuali inesattezze o lacune prima della pubblicazione. Per garantire che i dati di riferimento presentati siano coerenti con le corrispondenti informazioni segnalate in conformità all'articolo 26 del regolamento (UE) n. 600/2014, i dati di riferimento per un dato giorno dovrebbero essere utilizzati dalle autorità competenti per convalidare e scambiare le segnalazioni delle operazioni eseguite nello stesso giorno.
- (5) Conformemente all'articolo 27, paragrafo 2, del regolamento (UE) n. 600/2014, i mittenti e i destinatari dei dati di riferimento devono garantire l'effettivo ricevimento, lo scambio efficiente e l'adeguata qualità dei dati e la loro coerenza con le corrispondenti segnalazioni delle operazioni di cui all'articolo 26 del medesimo regolamento. Le sedi di negoziazione e gli internalizzatori sistematici dovrebbero pertanto fornire dati di riferimento completi ed esatti e informare prontamente le autorità competenti delle lacune o inesattezze riscontrate nei dati già forniti. Essi dovrebbero inoltre mantenere sistemi e controlli adeguati a garantire che i dati di riferimento siano forniti in modo esatto, completo e tempestivo.
- (6) Ai fini di un uso e scambio efficaci dei dati di riferimento, e al fine di garantire la coerenza dei dati di riferimento con i corrispondenti dati forniti nelle segnalazioni delle operazioni, le sedi di negoziazione e gli internalizzatori sistematici devono basare l'identificazione degli strumenti finanziari e dei soggetti giuridici da includere nei dati di riferimento su standard accettati e uniformi. In particolare, e al fine di garantire la corrispondenza tra i dati di riferimento e le segnalazioni delle rispettive operazioni, le sedi di negoziazione e gli internalizzatori sistematici dovrebbero procurarsi i codici internazionali di identificazione dei titoli (ISIN) secondo l'ISO 6166 relativi agli strumenti finanziari oggetto di segnalazione e includerli nei dati segnalati.
- (7) A fini di coerenza e per assicurare il corretto funzionamento dei mercati finanziari, è necessario che le disposizioni del presente regolamento e le disposizioni del regolamento (UE) n. 600/2014 si applichino a decorrere dalla stessa data.

<sup>(1)</sup> GUL 173 del 12.6.2014, pag. 84.

- (8) Il presente regolamento si basa sui progetti di norme tecniche di regolamentazione che l'ESMA ha presentato alla Commissione.
- (9) L'ESMA ha condotto una consultazione pubblica aperta sui progetti di norme tecniche di regolamentazione sui quali è basato il presente regolamento, ha analizzato i potenziali costi e benefici collegati e ha chiesto il parere del gruppo delle parti interessate nel settore degli strumenti finanziari e dei mercati istituito dall'articolo 37 del regolamento (UE) n. 1095/2010 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(1)</sup>,

HA ADOTTATO IL PRESENTE REGOLAMENTO:

#### *Articolo 1*

### **Contenuto, standard, forma e formato dei dati di riferimento**

Le sedi di negoziazione e gli internalizzatori sistematici forniscono alle autorità competenti tutte le informazioni dettagliate contenute nei dati di riferimento relativi agli strumenti finanziari (nel seguito «dati di riferimento») di cui alla tabella 3 dell'allegato riguardanti lo strumento finanziario in questione. Tutte le informazioni dettagliate fornite sono presentate conformemente agli standard e ai formati specificati nella tabella 3 dell'allegato, in forma elettronica e leggibile da dispositivo elettronico e in un modello XML uniforme secondo la metodologia ISO 20022.

#### *Articolo 2*

### **Tempistica per la trasmissione dei dati di riferimento alle autorità competenti**

1. Le sedi di negoziazione e gli internalizzatori sistematici trasmettono alle rispettive autorità competenti, entro le ore 21:00 CET di ogni giorno in cui sono aperti per le negoziazioni, i dati di riferimento per tutti gli strumenti finanziari che, prima delle ore 18:00 CET del giorno stesso, risultano ammessi alla negoziazione o negoziati, anche tramite inoltro di ordini o quotazioni nel loro sistema.
2. Se, dopo le ore 18:00 CET di un giorno in cui la sede di negoziazione o l'internalizzatore sistematico sono aperti per le negoziazioni, uno strumento finanziario risulta ammesso alla negoziazione o negoziato, anche nei casi in cui un ordine o una quotazione sono immessi per la prima volta, i dati di riferimento per lo strumento finanziario interessato sono trasmessi entro le ore 21:00 CET del giorno successivo in cui la sede di negoziazione o l'internalizzatore sistematico di cui trattasi sono aperti per le negoziazioni.

#### *Articolo 3*

### **Identificazione degli strumenti finanziari e dei soggetti giuridici**

1. Prima di iniziare la negoziazione di uno strumento finanziario, la sede di negoziazione o l'internalizzatore sistematico si procurano il relativo codice ISIN secondo l'ISO 6166.
2. Le sedi di negoziazione e gli internalizzatori sistematici garantiscono che i codici di identificazione dei soggetti giuridici inclusi nei dati di riferimento trasmessi siano conformi alla norma ISO 17442:2012, si riferiscano all'emittente interessato e siano elencati nella base dati degli identificativi internazionali dei soggetti giuridici gestita dall'unità operativa centrale nominata dal comitato di sorveglianza sulla regolamentazione per il sistema internazionale di identificazione dei soggetti giuridici.

#### *Articolo 4*

### **Disposizioni per garantire l'effettivo ricevimento dei dati di riferimento**

1. Le autorità competenti provvedono a monitorare e valutare la completezza dei dati di riferimento ricevuti da una sede di negoziazione o internalizzatore sistematico e la loro conformità agli standard e ai formati specificati nella tabella 3 dell'allegato.

<sup>(1)</sup> Regolamento (UE) n. 1095/2010 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 24 novembre 2010, che istituisce l'Autorità europea di vigilanza (Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati), modifica la decisione n. 716/2009/CE e abroga la decisione 2009/77/CE della Commissione (GU L 331 del 15.12.2010, pag. 84).

2. Dopo aver ricevuto, dalle sedi di negoziazione e dagli internalizzatori sistematici, i dati di riferimento per ogni giorno di apertura delle negoziazioni, le autorità competenti notificano alle sedi di negoziazione e agli internalizzatori sistematici eventuali lacune di tali dati o la loro eventuale mancata trasmissione entro i termini di cui all'articolo 2.
3. L'ESMA provvede a monitorare e valutare la completezza dei dati di riferimento ricevuti dalle autorità competenti e la loro conformità agli standard e ai formati specificati nella tabella 3 dell'allegato.
4. Dopo aver ricevuto i dati di riferimento dalle autorità competenti, l'ESMA notifica a tali autorità le eventuali lacune di tali dati o la loro eventuale mancata trasmissione entro i termini di cui all'articolo 7, paragrafo 1.

#### *Articolo 5*

### **Disposizioni per garantire la qualità dei dati di riferimento**

Le autorità competenti effettuano, almeno su base trimestrale, le valutazioni di qualità per quanto riguarda il contenuto e l'esattezza dei dati di riferimento ricevuti a norma dell'articolo 27, paragrafo 1, del regolamento (UE) n. 600/2014.

#### *Articolo 6*

### **Metodi e disposizioni per la trasmissione dei dati di riferimento**

1. Le sedi di negoziazione e gli internalizzatori sistematici provvedono a trasmettere dati di riferimento completi ed esatti alle loro autorità competenti a norma degli articoli 1 e 3.
2. Le sedi di negoziazione e gli internalizzatori sistematici adottano metodi e disposizioni che consentono loro di individuare i dati di riferimento lacunosi o inesatti presentati in precedenza. Una sede di negoziazione o un internalizzatore sistematico che rileva lacune o inesattezze nei dati di riferimento presentati lo comunica prontamente alla propria autorità competente e le trasmette senza indebito ritardo i dati di riferimento pertinenti completi ed esatti.

#### *Articolo 7*

### **Disposizioni per uno scambio e pubblicazione efficaci dei dati di riferimento**

1. Ogni giorno entro le ore 23:59 CET le autorità competenti trasmettono all'ESMA i dati di riferimento completi ed esatti utilizzando il canale di comunicazione elettronica sicuro previsto a tale scopo da autorità competenti e ESMA.
2. Il giorno successivo al ricevimento dei dati di riferimento in conformità del paragrafo 1, l'ESMA consolida i dati ricevuti da ciascuna autorità competente.
3. Entro le ore 08:00 CET del giorno successivo al ricevimento l'ESMA mette i dati consolidati a disposizione di tutte le autorità competenti utilizzando i canali di comunicazione elettronica sicuri di cui al paragrafo 1.
4. Le autorità competenti utilizzano i dati consolidati relativi a un dato giorno per convalidare le segnalazioni delle operazioni eseguite tale giorno e segnalate a norma dell'articolo 26 del regolamento (UE) n. 600/2014.
5. Le autorità competenti utilizzano i dati consolidati relativi a un dato giorno per scambiarsi le segnalazioni delle operazioni presentate tale giorno, conformemente all'articolo 26, paragrafo 1, secondo comma, del regolamento (UE) n. 600/2014.
6. L'ESMA pubblica i dati di riferimento in un formato elettronico, scaricabile e leggibile da dispositivo elettronico.

---

*Articolo 8***Entrata in vigore e applicazione**

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

Esso si applica a decorrere dalla data di cui all'articolo 55, secondo comma, del regolamento (UE) n. 600/2014.

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

Fatto a Bruxelles, il 14 luglio 2016

*Per la Commissione*

*Il presidente*

Jean-Claude JUNCKER

---

## ALLEGATO

Tabella 1

## Legenda della tabella 3

| SIMBOLO            | TIPO DI DATI  | DEFINIZIONE   |
|--------------------|---|---|
| {ALPHANUM-n}       | Fino a n caratteri alfanumerici   | Campo per testo libero.   |
| {CFI_CODE}         | 6 caratteri   | Codice CFI secondo l'ISO 10962.   |
| {COUNTRYCODE_2}    | 2 caratteri alfanumerici  | Codice del paese a 2 lettere in base ai codici paese alpha-2 dell'ISO 3166-1.   |
| {CURRENCYCODE_3}   | 3 caratteri alfanumerici  | Codice della valuta a 3 lettere secondo i codici delle valute dell'ISO 4217.  |
| {DATE_TIME_FORMAT} | Formato della data e dell'ora secondo l'ISO 8601                                  | <p>— Data e ora nel formato seguente:<br/>AAAA-MM-GGThh:mm:ss.ddddZ.</p> <p>— «AAAA» indica l'anno;</p> <p>— «MM» indica il mese;</p> <p>— «GG» indica il giorno;</p> <p>— «T» indica che va inserita la lettera «T»;</p> <p>— «hh» indica l'ora;</p> <p>— «mm» indica il minuto;</p> <p>— «ss.ddddd» indica il secondo e la relativa frazione;</p> <p>— «Z» indica l'ora UTC.</p> <p>Le date e ore sono indicate al tempo universale coordinato (UTC).</p> |
| {DATEFORMAT}       | Formato della data secondo l'ISO 8601   | Le date sono indicate con il formato seguente:<br>AAAA-MM-GG.   |
| {DECIMAL-n/m}      | Numero decimale fino a n cifre in totale, di cui fino a m possono essere decimali | <p>Campo numerico per valori sia positivi che negativi.</p> <p>— il simbolo del decimale è «.» (punto);</p> <p>— i numeri negativi sono preceduti dal segno «-» (meno);</p> <p>— i valori sono arrotondati e non troncati.</p>  |
| {INDEX}            | 4 caratteri alfabetici  | <p>«EONA» — EONIA</p> <p>«EONS» — swap sull'EONIA</p> <p>«EURI» — EURIBOR</p> <p>«EUUS» — EURODOLLAR</p> <p>«EUCH» — EuroSwiss</p> <p>«GCFR» — GCF REPO</p> <p>«ISDA» — ISDAFIX</p> <p>«LIBI» — LIBID</p> <p>«LIBO» — LIBOR</p> <p>«MAAA» — Muni AAA</p> <p>«PFAN» — Pfandbriefe</p> <p>«TIBO» — TIBOR</p> <p>«STBO» — STIBOR</p> <p>«BBSW» — BBSW</p> <p>«JIBA» — JIBAR</p> <p>«BUBO» — BUBOR</p>  |

| SIMBOLO     | TIPO DI DATI                           | DEFINIZIONE  |
|-------------|--|--|
|             |  | «CDOR» — CDOR<br>«CIBO» — CIBOR<br>«MOSP» — MOSPRIM<br>«NIBO» — NIBOR<br>«PRBO» — PRIBOR<br>«TLBO» — TELBOR<br>«WIBO» — WIBOR<br>«TREA» — Treasury<br>«SWAP» — swap<br>«FUSW» — swap su future |
| {INTEGER-n} | Numero intero fino a n cifre in totale | Campo numerico per valori interi sia positivi sia negativi.  |
| {ISIN}      | 12 caratteri alfanumerici              | Codice ISIN secondo l'ISO 6166.  |
| {LEI}       | 20 caratteri alfanumerici              | Identificativo della persona giuridica secondo l'ISO 17442.  |
| {MIC}       | 4 caratteri alfanumerici               | Identificativo del mercato secondo l'ISO 10383.  |
| {FISN}      | 35 caratteri alfanumerici              | Codice FISN secondo l'ISO 18774.   |

Tabella 2

**Classificazioni dei derivati su merci e su quote di emissione ai fini della tabella 3 (campi da 35 a 37)**

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

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

| Categoria di prodotti         | Sottocategoria di prodotti   | Ulteriore sottocategoria di prodotti   |
|-------------------------------|--|--|
| «ENVR» — Ambientali           | «EMIS» — Emissioni   | «CERE» — CER<br>«ERUE» — ERU<br>«EUA» — EUA<br>«EUAA» — EUAA<br>«OTHR» — Altro   |
|                               | «WTHR» — Meteo<br>«CRBR» — Associati al carbonio   |  |
| «FRGT» — Carico               | «WETF» — Wet   | «TNKR» — Petroliere  |
|                               | «DRYF» — Dry   | «DBCR» — Portarinfuse  |
|                               | «CSHP» — Portacontainer  |  |
| «FRTL» — Concimi              | «AMMO» — Ammoniaca<br>«DAPH» — Fosfato di diammonio (DAP)<br>«PTSH» — Potassa<br>«SLPH» — Zolfo<br>«UREA» — Urea<br>«UAAN» — Nitrato di ammonio e urea (UAN) |  |
| «INDP» — Prodotti industriali | «CSTR» — Edilizia<br>«MFTG» — Manifatturieri   |  |
| «METL» — Metalli              | «NPRM» — Non preziosi  | «ALUM» — Alluminio<br>«ALUA» — Leghe di alluminio<br>«CBLT» — Cobalto<br>«COPR» — Rame<br>«IRON» — Minerale di ferro<br>«LEAD» — Piombo<br>«MOLY» — Molibdeno<br>«NASC» — NASAAC<br>«NICK» — Nichel<br>«STEL» — Acciaio<br>«TINN» — Stagno<br>«ZINC» — Zinco<br>«OTHR» — Altro |
|                               | «PRME» — Preziosi  | «GOLD» — Oro<br>«SLVR» — Argento<br>«PTNM» — Platino<br>«PLDM» — Palladio<br>«OTHR» — Altro  |

| Categoria di prodotti   | Sottocategoria di prodotti   | Ulteriore sottocategoria di prodotti |
|---|--|--------------------------------------|
| «MCEX» — Esotici multimerchi  |  |                                      |
| «PAPR» — Carta  | «CBRD» — Cartone ondulato grezzo<br>«NSPT» — Carta da giornale<br>«PULP» — Polpa<br>«RCVP» — Carta di recupero |                                      |
| «POLY» — Polipropilene  | «PLST» — Plastica  |                                      |
| «INFL» — Inflazione   |  |                                      |
| «OEST» — Statistiche economiche ufficiali   |  |                                      |
| «OTHC» — Altri C10 secondo la definizione della tabella 10.1 dell'allegato III, sezione 10, del regolamento delegato (UE) 2017/583 della Commissione <sup>(1)</sup> |  |                                      |
| «OTHR» — Altro  |  |                                      |

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

Tabella 3

### Informazioni dettagliate da segnalare come dati di riferimento relativi agli strumenti finanziari

| N.                                  | CAMPO  | CONTENUTO  | FORMATO E STANDARD PER LE SEGNALAZIONI |
|-------------------------------------|--|--|--|
| <b>Campi generali</b>               |  |  |  |
| 1                                   | Codice identificativo dello strumento                                  | Codice usato per identificare lo strumento finanziario.  | {ISIN}                                 |
| 2                                   | Nome completo dello strumento  | Nome completo dello strumento finanziario.   | {ALPHANUM-350}                         |
| 3                                   | Classificazione dello strumento  | Tassonomia usata per classificare lo strumento finanziario.<br>Indicare un codice CFI esatto e completo.   | {CFI_CODE}                             |
| 4                                   | Indicatore di derivati su merci o quote di emissioni                   | Indicare se lo strumento finanziario rientra nella definizione di derivati su merci di cui all'articolo 2, paragrafo 1, punto 30), del regolamento (UE) n. 600/2014 o è uno strumento derivato connesso a quote di emissioni di cui all'allegato I, sezione C, punto 4), della direttiva 2014/65/UE. | «true» — sì<br>«false» — no            |
| <b>Campi relativi all'emittente</b> |  |  |  |
| 5                                   | Identificativo dell'emittente o del gestore della sede di negoziazione | LEI dell'emittente o del gestore della sede di negoziazione.   | {LEI}                                  |

| N.   | CAMPO   | CONTENUTO   | FORMATO E STANDARD PER LE SEGNALAZIONI |
|--|---|---|--|
| <b>Campi relativi alla sede</b>  |   |   |  |
| 6  | Sede di negoziazione  | MIC del segmento per la sede di negoziazione o internalizzatore sistematico, se disponibile, altrimenti MIC operativo.  | {MIC}                                  |
| 7  | Nome breve dello strumento finanziario                            | Nome breve dello strumento finanziario secondo l'ISO 18774.   | {FISN}                                 |
| 8  | Richiesta di ammissione alla negoziazione da parte dell'emittente | Indicare se l'emittente dello strumento finanziario ha chiesto o autorizzato la negoziazione o l'ammissione alla negoziazione del suo strumento finanziario in una sede di negoziazione.  | «true» — sì<br>«false» — no            |
| 9  | Data di approvazione dell'ammissione alla negoziazione            | Data e ora in cui l'emittente ha approvato l'ammissione alla negoziazione o la negoziazione dei suoi strumenti finanziari in una sede di negoziazione.  | {DATE_TIME_FORMAT}                     |
| 10   | Data della richiesta di ammissione alla negoziazione              | Data e ora della richiesta di ammissione alla negoziazione nella sede di negoziazione.  | {DATE_TIME_FORMAT}                     |
| 11   | Data di ammissione alla negoziazione o data di prima negoziazione | Data e ora dell'ammissione alla negoziazione in una sede di negoziazione o data e ora in cui lo strumento è stato negoziato per la prima volta o in cui un ordine o una quotazione è stato ricevuto per la prima volta dalla sede di negoziazione.  | {DATE_TIME_FORMAT}                     |
| 12   | Data di cessazione  | Se disponibile, data e ora in cui lo strumento finanziario cessa di essere negoziato o di essere ammesso alla negoziazione nella sede di negoziazione.  | {DATE_TIME_FORMAT}                     |
| <b>Campi relativi al nozionale</b>                                     |   |   |  |
| 13   | Valuta nozionale 1  | Valuta in cui è denominato il nozionale.<br><br>Per i contratti derivati su tassi di interesse o su valute corrisponde alla valuta nozionale della gamba 1 o alla valuta 1 della coppia.<br><br>Per le swaption con swap sottostante monovaluta corrisponde alla valuta nozionale dello swap sottostante. Per le swaption con sottostante multivaluta corrisponde alla valuta nozionale della gamba 1 dello swap. | {CURRENCYCODE_3}                       |
| <b>Campi relativi a obbligazioni o altre forme di titoli di debito</b> |   |   |  |
| 14   | Importo nominale emesso totale                                    | Importo nominale emesso totale in valore monetario.   | {DECIMAL-18/5}                         |
| 15   | Data di scadenza  | Data di scadenza dello strumento finanziario.<br><br>Campo applicabile per gli strumenti di debito con scadenza definita.   | {DATEFORMAT}                           |
| 16   | Valuta del valore nominale  | Valuta del valore nominale degli strumenti di debito.   | {CURRENCYCODE_3}                       |
| 17   | Valore nominale per unità/valore minimo di negoziazione           | Valore nominale di ciascuno strumento. Se non è disponibile, indicare il valore minimo di negoziazione.   | {DECIMAL-18/5}                         |

| N. | CAMPO   | CONTENUTO   | FORMATO E STANDARD PER LE SEGNALAZIONI  |
|----|---|---|---|
| 18 | Tasso fisso   | Tasso fisso di rendimento dello strumento di debito se tenuto fino a scadenza, espresso in percentuale.                   | {DECIMAL-11/10}<br>Espresso in percentuale (ad esempio, 7.0 indica 7 % e 0.3 indica 0,3 %)                              |
| 19 | Identificativo dell'indice/parametro dell'obbligazione a tasso variabile              | Se esiste.  | {ISIN}  |
| 20 | Nome dell'indice/parametro dell'obbligazione a tasso variabile                        | Se non esiste identificativo, indicare il nome dell'indice.   | {INDEX}<br>Oppure<br>{ALPHANUM-25} — se il nome dell'indice non è compreso nell'elenco {INDEX}                          |
| 21 | Durata dell'indice/parametro dell'obbligazione a tasso variabile.                     | Durata dell'indice/parametro dell'obbligazione a tasso variabile. La durata è espressa in giorni, settimane, mesi o anni. | {INTEGER-3}+«DAYS» — giorni<br>{INTEGER-3}+«WEEK» — settimane<br>{INTEGER-3}+«MNTH» — mesi<br>{INTEGER-3}+«YEAR» — anni |
| 22 | Differenziale in punti base dell'indice/parametro dell'obbligazione a tasso variabile | Numero di punti base al di sopra o al di sotto dell'indice usato per calcolare un prezzo.                                 | {INTEGER-5}   |
| 23 | Rango (seniority) dell'obbligazione   | Indicare il tipo di obbligazione: senior, mezzanina, subordinata o junior.  | «SNDB» — debito senior<br>«MZZD» — mezzanino<br>«SBOD» — debito subordinato<br>«JUND» — debito junior                   |

#### Campi relativi a derivati e derivati cartolarizzati

|    |                                    |   |                 |
|----|------------------------------------|---|-----------------|
| 24 | Data di scadenza                   | Data di scadenza dello strumento finanziario.<br>Campo applicabile per i derivati con data di scadenza definita.  | {DATEFORMAT}    |
| 25 | Moltiplicatore del prezzo          | Numero di unità dello strumento sottostante rappresentate da un unico contratto derivato.<br>Per i future o le opzioni su indici indicare l'importo per punto dell'indice.<br>Per le spreadbet indicare la variazione di prezzo dello strumento sottostante su cui si basano.   | {DECIMAL-18/17} |
| 26 | Codice dello strumento sottostante | Codice ISIN dello strumento sottostante.<br>Per gli ADR, GDR e strumenti analoghi indicare il codice ISIN dello strumento finanziario su cui si basano.<br>Per le obbligazioni convertibili indicare il codice ISIN dello strumento in cui l'obbligazione può essere convertita.<br>Per i derivati o altri strumenti con sottostante indicare il codice ISIN dello strumento sottostante, allorché questo è ammesso alla negoziazione o negoziato in una sede di negoziazione. Se il sottostante è un dividendo in azioni, indicare il codice ISIN dell'azione che dà diritto al dividendo sottostante. | {ISIN}          |

| N. | CAMPO                          | CONTENUTO   | FORMATO E STANDARD PER LE SEGNALAZIONI   |
|----|--------------------------------|---|--|
|    |                                | <p>Per i credit default swap indicare il codice ISIN dell'obbligazione di riferimento.</p> <p>Se il sottostante è un indice che ha un codice ISIN, indicare il codice ISIN dell'indice.</p> <p>Se il sottostante è un paniere, indicare i codici ISIN di ciascuno dei componenti ammesso alla negoziazione o negoziato in una sede di negoziazione. I campi 26 e 27 sono compilati e ripetuti più volte fino a elencazione completa di tutti gli strumenti del paniere.</p>   |  |
| 27 | Emittente sottostante          | Se lo strumento fa riferimento ad un emittente piuttosto che a un unico strumento, indicare il codice LEI dell'emittente.   | {LEI}  |
| 28 | Nome dell'indice sottostante   | Se il sottostante è un indice, indicare il nome dell'indice.  | {INDEX}<br>Oppure<br>{ALPHANUM-25} — se il nome dell'indice non è compreso nell'elenco {INDEX}   |
| 29 | Durata dell'indice sottostante | Se il sottostante è un indice, indicare la durata dell'indice.  | {INTEGER-3}+«DAYS» — giorni<br>{INTEGER-3}+«WEEK» — settimane<br>{INTEGER-3}+«MNTH» — mesi<br>{INTEGER-3}+«YEAR» — anni  |
| 30 | Tipo di opzione                | <p>Indicare se il contratto derivato è call (diritto di acquistare una determinata attività sottostante) o put (diritto di vendere una determinata attività sottostante) o indicare che al momento dell'esecuzione non è possibile stabilirlo. Per le swap-tion:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>— indicare «put» per le swaption «receiver», in cui l'acquirente ha diritto di entrare nello swap ricevendo un tasso fisso;</li> <li>— indicare «call» per le swaption «payer», in cui l'acquirente ha diritto di entrare nello swap pagando un tasso fisso.</li> </ul> <p>Per le opzioni cap e le opzioni floor:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>— indicare «put» per la floor;</li> <li>— indicare «call» per la cap. Campo applicabile solo per i derivati che sono opzioni o warrant.</li> </ul> | «PUTO» — put<br>«CALL» — call<br>«OTHR» — se non è possibile stabilire se si tratta di call o di put   |
| 31 | Prezzo di esercizio            | <p>Prezzo prestabilito al quale il detentore dovrà acquistare o vendere lo strumento sottostante o indicazione del fatto che il prezzo non può essere determinato al momento dell'esecuzione.</p> <p>Campo applicabile alle opzioni o warrant, laddove il prezzo di esercizio può essere determinato al momento dell'esecuzione.</p> <p>Se il prezzo non è disponibile ma in procinto di esserlo, indicare «PNDG».</p> <p>Lasciare in bianco se il prezzo di esercizio non è applicabile.</p>   | {DECIMAL-18/13} se il prezzo è espresso in valore monetario<br>{DECIMAL-11/10} se il prezzo è espresso in percentuale o rendimento<br>{DECIMAL-18/17} se il prezzo è espresso in punti base<br>«PNDG» se il prezzo non è disponibile |
| 32 | Valuta del prezzo di esercizio | Valuta del prezzo di esercizio.   | {CURRENCYCODE_3}   |

| N. | CAMPO                           | CONTENUTO  | FORMATO E STANDARD PER LE SEGNALAZIONI  |
|----|---------------------------------|--|---|
| 33 | Stile di esercizio dell'opzione | Indicare se l'opzione può essere esercitata soltanto ad una data fissa (stile europeo e stile asiatico), ad una serie di date prestabilite (stile bermudiano) o in qualsiasi momento nel corso del periodo di validità del contratto (stile americano).<br>Campo applicabile solo per opzioni, warrant e certificati di diritto. | «EURO» — europeo<br>«AMER» — americano<br>«ASIA» — asiatico<br>«BERM» — bermudiano<br>«OTHR» — altro                                  |
| 34 | Tipo di consegna                | Indicare se lo strumento finanziario è regolato fisicamente o in contanti.<br>Se non è possibile stabilire il tipo di consegna al momento dell'esecuzione, indicare «OPTL».<br>Campo applicabile solo per i derivati.  | «PHYS» — regolato fisicamente<br>«CASH» — regolato in contanti<br>«OPTN» — facoltativo per la controparte o quando stabilito da terzi |

#### Derivati su merci e su quote di emissione

|    |                                      |  |  |
|----|--------------------------------------|--|--|
| 35 | Categoria di prodotti                | Categoria di base della classe di attività sottostante secondo la tabella della classificazione dei derivati su merci e su quote di emissione.   | Sono ammessi solo i valori della colonna «Categoria di prodotti» secondo la tabella della classificazione dei derivati su merci.   |
| 36 | Sottocategoria di prodotti           | Sottocategoria della classe di attività sottostante secondo la tabella della classificazione dei derivati su merci e su quote di emissione.<br>Campo che implica l'indicazione della categoria di base.        | Sono ammessi solo i valori della colonna «Sottocategoria di prodotti» secondo la tabella della classificazione dei derivati su merci.  |
| 37 | Ulteriore sottocategoria di prodotti | Ulteriore sottocategoria della classe di attività sottostante secondo la tabella della classificazione dei derivati su merci e su quote di emissione.<br>Campo che implica l'indicazione della sottocategoria. | Sono ammessi solo i valori della colonna «Ulteriore sottocategoria di prodotti» secondo la tabella della classificazione dei derivati su merci.  |
| 38 | Tipo di operazione                   | Tipo di operazione indicato dalla sede di negoziazione.  | «FUTR» — future<br>«OPTN» — opzioni<br>«TAPO» — TAPO<br>«SWAP» — swap<br>«MINI» — mini<br>«OTCT» — OTC<br>«ORIT» — vendita a fermo<br>«CRCK» — crack<br>«DIFF» — differenziale<br>«OTHR» — Altro |
| 39 | Tipo di prezzo finale                | Tipo di prezzo finale indicato dalla sede di negoziazione  | «ARGM» — Argus/McCloskey<br>«BLTC» — Baltic<br>«EXOF» — Exchange<br>«GBCL» — GlobalCOAL<br>«IHSM» — IHS McCloskey<br>«PLAT» — Platts<br>«OTHR» — Altro   |

| N.   | CAMPO  | CONTENUTO  | FORMATO E STANDARD PER LE SEGNALAZIONI  |
|--|--|--|---|
| <b>Derivati su tassi di interesse</b>  |  |  |   |
| — Compilare solo per gli strumenti il cui sottostante è uno strumento non finanziario del tipo tassi di interesse. |  |  |   |
| 40   | Tasso di riferimento                                     | Nome del tasso di riferimento  | {INDEX}<br>Oppure<br>{ALPHANUM-25} — se il tasso di riferimento non è compreso nell'elenco {INDEX}                      |
| 41   | Durata del contratto su tassi di interesse               | Se la classe di attività è costituita dai tassi di interesse, indicare la durata del contratto. La durata è espressa in giorni, settimane, mesi o anni.  | {INTEGER-3}+«DAYS» — giorni<br>{INTEGER-3}+«WEEK» — settimane<br>{INTEGER-3}+«MNTH» — mesi<br>{INTEGER-3}+«YEAR» — anni |
| 42   | Valuta nozionale 2                                       | Per gli swap multivaluta o su tassi di interesse in differenti valute indicare la valuta in cui è denominata la gamba 2 del contratto.<br>Per le swaption in cui lo swap sottostante è multivaluta indicare la valuta in cui è denominata la gamba 2 dello swap. | {CURRENCYCODE_3}  |
| 43   | Tasso fisso della gamba 1                                | Indicare il tasso fisso utilizzato per la gamba 1, se applicabile.   | {DECIMAL -11/10}<br>Espresso in percentuale (ad esempio, 7.0 indica 7 % e 0.3 indica 0,3 %)                             |
| 44   | Tasso fisso della gamba 2                                | Indicare il tasso fisso utilizzato per la gamba 2, se applicabile.   | {DECIMAL -11/10}<br>Espresso in percentuale (ad esempio, 7.0 indica 7 % e 0.3 indica 0,3 %)                             |
| 45   | Tasso variabile della gamba 2                            | Indicare il tasso di interesse utilizzato, se applicabile.   | {INDEX}<br>Oppure<br>{ALPHANUM-25} — se il tasso di riferimento non è compreso nell'elenco {INDEX}                      |
| 46   | Durata del contratto su tassi di interesse della gamba 2 | Indicare il periodo di riferimento del tasso di interesse, che è fissato a intervalli prestabiliti con riferimento ad un tasso di riferimento di mercato. La durata è espressa in giorni, settimane, mesi o anni.  | {INTEGER-3}+«DAYS» — giorni<br>{INTEGER-3}+«WEEK» — settimane<br>{INTEGER-3}+«MNTH» — mesi<br>{INTEGER-3}+«YEAR» — anni |

**Derivati su cambi**

— Compilare solo per gli strumenti il cui sottostante è uno strumento non finanziario del tipo cambi.

|    |                    |   |   |
|----|--------------------|---|---|
| 47 | Valuta nozionale 2 | Indicare la valuta sottostante 2 della coppia di valute (la valuta 1 è indicata nel campo 13 Valuta nozionale 1). | {CURRENCYCODE_3}  |
| 48 | Tipo FX            | Tipo di valuta sottostante.   | «FXCR» — FX valute incrociate<br>«FXEM» — FX mercati emergenti<br>«FXM» — FX Majors |