

## II

(Atti non legislativi)

## REGOLAMENTI

## REGOLAMENTO DELEGATO (UE) N. 148/2013 DELLA COMMISSIONE

del 19 dicembre 2012

**che integra il regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio sugli strumenti derivati OTC, le controparti centrali e i repertori di dati sulle negoziazioni per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione per precisare le informazioni minime da segnalare al repertorio di dati sulle negoziazioni**

(Testo rilevante ai fini del SEE)

LA COMMISSIONE EUROPEA,

visto il trattato sul funzionamento dell'Unione europea,

visto il parere della Banca centrale europea <sup>(1)</sup>,

visto il regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 4 luglio 2012, sugli strumenti derivati OTC, le controparti centrali e i repertori di dati sulle negoziazioni <sup>(2)</sup>, in particolare l'articolo 9, paragrafo 5,

considerando quanto segue:

- (1) Per assicurare flessibilità, è opportuno che la controparte di un contratto possa delegarne la segnalazione all'altra controparte o ad un terzo. Occorre che le controparti possano decidere di delegare la segnalazione ad un terzo comune, tra cui una controparte centrale, che effettui un'unica segnalazione, comprendente la pertinente tabella, al repertorio di dati sulle negoziazioni. In tali circostanze e per garantire la qualità dei dati, occorre che nella segnalazione sia indicato che essa viene effettuata per conto di entrambe le controparti e che contiene tutte le informazioni che sarebbero state segnalate se il contratto fosse stato segnalato separatamente.
- (2) Per evitare incoerenze nelle tabelle che riportano i dati comuni, occorre che le controparti di un contratto derivato assicurino che i dati comuni trasmessi siano convenuti da entrambe. Un identificativo unico dell'operazione consentirà di riconciliare i dati nel caso in cui le controparti effettuino la segnalazione a repertori di dati sulle negoziazioni diversi.
- (3) Per evitare la duplicazione delle segnalazioni e per ridurre l'onere, occorre che la controparte o la controparte centrale che effettuano la segnalazione per conto di entrambe le controparti possano effettuare un'unica segnalazione al repertorio di dati sulle negoziazioni contenente le pertinenti informazioni.

- (4) La valutazione dei contratti derivati è essenziale per consentire alle autorità di regolamentazione di svolgere il loro compito, in particolare per quanto riguarda la stabilità finanziaria. Il valore del contratto ai prezzi correnti sul mercato o basato su un modello indica il segno e l'entità delle esposizioni relative al contratto e integra le informazioni sul valore d'origine specificato nel contratto.

- (5) La raccolta delle informazioni sulla garanzia reale relativa ad un particolare contratto è fondamentale per assicurare un'adeguata sorveglianza delle esposizioni. A tal fine, occorre che le controparti che procedono alla costituzione di garanzie reali sulle loro operazioni siano tenute a segnalare i relativi dati per ogni singola operazione. Quando la garanzia reale è calcolata sulla base delle posizioni nette derivanti da una serie di contratti, e pertanto non è costituita per ogni singola operazione ma per portafoglio, occorre che le controparti possano segnalare il portafoglio utilizzando un codice unico o un sistema di numerazione da esse concordato. Occorre che il codice unico consenta di individuare lo specifico portafoglio per il quale è stata costituita la garanzia reale, se la controparte detiene più di un portafoglio, e di associare il contratto derivato ad un determinato portafoglio per il quale è stata costituita una garanzia reale.

- (6) Il presente regolamento si basa sui progetti di norme tecniche di regolamentazione che l'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (Aesfem) ha presentato alla Commissione e riflette la pertinenza del ruolo dei repertori di dati sulle negoziazioni ai fini del miglioramento della trasparenza dei mercati nei confronti del pubblico e delle autorità di vigilanza, i dati da segnalare ai repertori e che questi devono raccogliere e rendere accessibili in funzione della categoria di derivati e della natura dell'operazione.

<sup>(1)</sup> Non ancora pubblicato nella Gazzetta ufficiale.

<sup>(2)</sup> GU L 201 del 27.7.2012, pag. 1.

(7) L'Aesfem ha consultato le autorità competenti e i membri del Sistema europeo delle banche centrali (SEBC) prima di presentare i progetti di norme tecniche di regolamentazione su cui si basa il presente regolamento. Ai sensi dell'articolo 10 del 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) <sup>(1)</sup>, l'Aesfem ha anche condotto consultazioni pubbliche sui progetti di norme tecniche di regolamentazione, 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 dello stesso regolamento,

HA ADOTTATO IL PRESENTE REGOLAMENTO:

#### Articolo 1

#### **Dati da fornire nelle segnalazioni ai sensi dell'articolo 9, paragrafi 1 e 3 del regolamento (UE) n. 648/2012**

1. Tra le informazioni da trasmettere ai repertori di dati sulle negoziazioni figurano:

- a) i dati di cui alla tabella 1 dell'allegato, vale a dire informazioni relative alle controparti di un contratto;
- b) i dati di cui alla tabella 2 dell'allegato, vale a dire informazioni relative al contratto derivato concluso tra le due controparti.

2. Ai fini del paragrafo 1, per conclusione di un contratto si intende «l'effettuazione di un'operazione» ai sensi dell'articolo 25, paragrafo 3, della direttiva 2004/39/CE del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(2)</sup>.

3. La segnalazione unica effettuata per conto di entrambe le controparti contiene le informazioni di cui alla tabella 1 dell'allegato relative a ognuna delle controparti. Le informazioni di cui alla tabella 2 dell'allegato sono presentate soltanto una volta.

4. Nel caso in cui venga effettuata una segnalazione unica per conto di entrambe le controparti, se ne fa menzione nel campo 9 della tabella 1 dell'allegato.

5. Quando una controparte trasmette le informazioni relative ad un contratto ad un repertorio di dati sulle negoziazioni per conto della controparte, ovvero un terzo segnala un contratto ad un repertorio di dati sulle negoziazioni per conto di una o di entrambe le controparti, le informazioni trasmesse includono tutti i dati che sarebbero stati trasmessi se i contratti fossero stati segnalati al repertorio di dati sulle negoziazioni separatamente da ogni parte.

<sup>(1)</sup> GU L 331 del 15.12.2010, pag. 84.

<sup>(2)</sup> GU L 145 del 30.4.2004, pag. 1.

6. Se un contratto derivato presenta caratteristiche tipiche di varie attività sottostanti, come indicate nella tabella 2 dell'allegato, nella segnalazione è indicata la categoria di attività a cui il contratto si avvicina maggiormente, secondo quanto concordato dalle controparti prima di trasmettere la segnalazione al repertorio di dati sulle negoziazioni.

#### Articolo 2

#### **Operazioni compensate**

1. Se un contratto in essere è successivamente compensato da una controparte centrale, la compensazione è segnalata come modifica del contratto in essere.

2. Quando un contratto è concluso in una sede di negoziazione ed è compensato da una controparte centrale, per cui una controparte non è a conoscenza dell'identità dell'altra controparte, la controparte segnalante indica come sua controparte la controparte centrale.

#### Articolo 3

#### **Segnalazione delle esposizioni**

1. I dati sulle garanzie reali di cui alla tabella 1 dell'allegato includono tutte le garanzie costituite.

2. Se una controparte non costituisce garanzie reali per ogni singola operazione, le controparti segnalano al repertorio di dati sulle negoziazioni la garanzia reale costituita sul portafoglio.

3. Quando relativamente ad un contratto viene segnalata la garanzia reale costituita sul portafoglio, la controparte segnalante trasmette al repertorio di dati sulle negoziazioni il codice che identifica il portafoglio sui cui è costituita la garanzia reale fornita all'altra controparte in relazione al contratto segnalato.

4. Le controparti non finanziarie diverse da quelle di cui all'articolo 10 del regolamento (UE) n. 648/2012 non sono tenute a segnalare le garanzie reali e le valutazioni a prezzi correnti di mercato o in base ad un modello dei contratti di cui alla tabella 1 dell'allegato.

5. Per i contratti compensati da una controparte centrale, le valutazioni a prezzi correnti di mercato sono fornite unicamente dalla controparte centrale.

#### Articolo 4

#### **Log relativo ai dati**

Le modifiche dei dati registrati nei repertori di dati sulle negoziazioni sono conservate in un *log* che identifica la persona o le persone che hanno chiesto la modifica, ivi compreso il repertorio di dati sulle negoziazioni, se applicabile, le ragioni della modifica, la data e l'ora e una descrizione chiara delle modifiche, tra cui i dati originari e i nuovi dati pertinenti di cui ai campi 58 e 59 della tabella 2 dell'allegato.

*Articolo 5***Entrata in vigore**

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

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

Fatto a Bruxelles, il 19 dicembre 2012

*Per la Commissione*  
*Il presidente*  
José Manuel BARROSO

---

## ALLEGATO

## Dati da segnalare ai repertori di dati sulle negoziazioni

Tabella 1

## Dati della controparte

|    | Campo  | Dati da comunicare   |
|----|--|--|
|    | <b>Controparti del contratto</b>                       |  |
| 1  | Data e ora della segnalazione                          | Data e ora della segnalazione al repertorio di dati sulle negoziazioni.  |
| 2  | Identificativo della controparte                       | Codice unico identificativo della controparte segnalante.<br>In caso di persone fisiche, utilizzare il codice cliente.   |
| 3  | Identificativo dell'altra controparte                  | Codice unico identificativo dell'altra controparte nel contratto.<br>Questo campo è compilato dal punto di vista della controparte segnalante. In caso di persone fisiche, utilizzare il codice cliente.   |
| 4  | Nome della controparte                                 | Denominazione sociale della controparte segnalante.<br><br>Questo campo può essere lasciato in bianco se il campo «Identificativo della controparte» contiene già l'informazione.  |
| 5  | Domicilio della controparte                            | Indicazione della sede sociale, comprendente indirizzo completo, città e Stato, della controparte segnalante.<br><br>Questo campo può essere lasciato in bianco se il campo «Identificativo della controparte» contiene già l'informazione.  |
| 6  | Settore di attività della controparte                  | Natura delle attività della controparte segnalante (banca, impresa di assicurazione ecc.).<br><br>Questo campo può essere lasciato in bianco se il campo «Identificativo della controparte» contiene già l'informazione.   |
| 7  | Natura finanziaria o non finanziaria della controparte | Indicare se la controparte segnalante è una controparte finanziaria o non finanziaria ai sensi dell'articolo 2, punti 8 e 9 del regolamento (UE) n. 648/2012.  |
| 8  | Identificativo dell'intermediario                      | Nel caso in cui un intermediario agisce per conto della controparte segnalante senza diventare una controparte, la controparte segnalante lo identifica con un codice unico. In caso di persone fisiche, utilizzare il codice cliente.   |
| 9  | Identificativo del soggetto segnalante                 | Nel caso in cui la controparte segnalante abbia delegato l'effettuazione della segnalazione ad un terzo o all'altra controparte, quest'altro soggetto deve essere individuato in questo campo con un codice unico. In caso contrario, lasciare il campo in bianco.<br><br>In caso di persona fisica, indicare il codice cliente attribuito dalla persona giuridica cui la singola controparte ha fatto ricorso per l'esecuzione dell'operazione.   |
| 10 | Identificativo del partecipante diretto                | Nel caso in cui la controparte segnalante non sia un partecipante diretto, il rispettivo partecipante diretto è individuato in questo campo mediante un codice unico. Nel caso delle persone fisiche, si utilizza il codice cliente attribuito dalla controparte centrale.   |
| 11 | Identificativo del beneficiario                        | La parte titolare dei diritti e delle obbligazioni che derivano dal contratto. Quando l'operazione è eseguita attraverso una struttura, quali un <i>trust</i> o un fondo, che rappresenta una serie di beneficiari, indicare come beneficiario tale struttura. Se il beneficiario del contratto non è una controparte del contratto, la controparte segnalante deve identificarlo con un codice unico, o per le persone fisiche, con il codice cliente attribuitogli dalla persona giuridica a cui la persona fisica ha fatto ricorso. |

|    | Campo  | Dati da comunicare   |
|----|--|--|
| 12 | Capacità negoziale   | Indicare se la controparte segnalante ha concluso il contratto in qualità di principale per conto proprio (a nome proprio o a nome di un cliente) o di agente per conto e a nome di un cliente.  |
| 13 | Lato della controparte   | Indicare se il contratto è un contratto di acquisto o di vendita. Nel caso di contratto derivato su tassi di interesse la parte acquirente rappresenta il pagatore della gamba 1 e la parte venditrice è il pagatore della gamba 2.  |
| 14 | Contratto con controparte extra-SEE  | Indicare se l'altra controparte è domiciliata al di fuori del SEE.   |
| 15 | Direttamente collegato a attività commerciali o finanziamenti di tesoreria | Precisare se il contratto è oggettivamente misurabile in quanto direttamente collegato all'attività commerciale o di finanziamento di tesoreria della controparte segnalante, ai sensi dell'articolo 10, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012.<br><br>Lasciare in bianco il campo se la controparte segnalante è una controparte finanziaria ai sensi dell'articolo 2, punto 8, del regolamento (UE) n. 648/2012. |
| 16 | Soglia di compensazione  | Precisare se la controparte segnalante supera la soglia di compensazione di cui all'articolo 10, paragrafo 2, del regolamento (UE) n. 648/2012. Lasciare in bianco il campo se la controparte segnalante è una controparte finanziaria ai sensi dell'articolo 2, punto 8, del regolamento (UE) n. 648/2012.  |
| 17 | Valore del contratto a prezzi correnti di mercato                          | Valutazione a prezzi correnti di mercato del contratto o, se del caso, valutazione in base ad un modello, ai sensi dell'articolo 11, paragrafo 2, del regolamento (UE) n. 648/2012.  |
| 18 | Valuta del valore del contratto a prezzi correnti di mercato               | Valuta utilizzata per la valutazione a prezzi correnti di mercato o, se del caso, per la valutazione in base ad un modello, ai sensi dell'articolo 11, paragrafo 2, del regolamento (UE) n. 648/2012.  |
| 19 | Data della valutazione   | Data dell'ultima valutazione a prezzi correnti di mercato o in base ad un modello.   |
| 20 | Ora della valutazione  | Ora dell'ultima valutazione a prezzi correnti di mercato o in base ad un modello.  |
| 21 | Tipo di valutazione  | Indicare se è stata eseguita una valutazione a prezzi correnti di mercato o una valutazione in base ad un modello.   |
| 22 | Costituzione di garanzia reale   | Indicare se è stata costituita una garanzia reale.   |
| 23 | Garanzia reale per portafoglio   | Indicare se la garanzia reale è stata costituita su un portafoglio. Per «portafoglio» si intende che la garanzia reale è calcolata sulla base delle posizioni nette risultanti da una serie di contratti, piuttosto che sulla singola operazione.  |
| 24 | Codice della garanzia reale per portafoglio                                | Se la garanzia reale è segnalata per un portafoglio, identificare il portafoglio con un codice unico stabilito dalla controparte segnalante.   |
| 25 | Valore della garanzia reale  | Valore della garanzia reale costituita dalla controparte segnalante e fornita all'altra controparte. Laddove la garanzia sia costituita per portafoglio, includere nel campo il valore di tutte le garanzie reali costituite per il portafoglio.   |
| 26 | Valuta del valore della garanzia reale                                     | Indicare il valore della garanzia reale di cui al campo 25.  |

Tabella 2

## Dati comuni

|    | Campo                                    | Dati da comunicare  | Tipo di contratto derivato interessato |
|----|--|---|--|
|    | <b>Sezione 2a — tipo di contratto</b>    |   | <b>Tutti i contratti</b>               |
| 1  | Tassonomia utilizzata                    | Il contratto è identificato mediante un identificativo del prodotto.  |  |
| 2  | Identificativo del prodotto 1            | Il contratto è identificato mediante un identificativo del prodotto.  |  |
| 3  | Identificativo del prodotto 2            | Il contratto è identificato mediante un identificativo del prodotto.  |  |
| 4  | Sottostante                              | Il sottostante è identificato mediante un identificativo unico del sottostante. In caso di panieri o di indici, utilizzare un identificativo per il paniere o l'indice se non esiste un identificativo unico.   |  |
| 5  | Valuta nozionale 1                       | Valuta dell'importo nozionale. Per i contratti derivati su tassi di interesse corrisponde alla valuta nozionale della gamba 1.  |  |
| 6  | Valuta nozionale 2                       | Valuta dell'importo nozionale. Per i contratti derivati su tassi di interesse corrisponde alla valuta nozionale della gamba 2.  |  |
| 7  | Valuta di consegna                       | La valuta da consegnare.  |  |
|    | <b>Sezione 2b — dati sull'operazione</b> |   | <b>Tutti i contratti</b>               |
| 8  | Identificativo dell'operazione           | Identificativo unico dell'operazione, concordato a livello europeo, fornito dalla controparte segnalante. In caso di mancanza di identificativo unico dell'operazione, occorre creare e concordare con l'altra controparte un codice unico.   |  |
| 9  | Numero di riferimento dell'operazione    | Un numero unico di identificazione dell'operazione fornito dal soggetto segnalante o da un terzo che effettua la segnalazione per suo conto.  |  |
| 10 | Sede di esecuzione                       | La sede di esecuzione è identificata per mezzo di un codice unico. Nel caso di contratti OTC, occorre verificare se il relativo strumento è ammesso alla negoziazione ma negoziato fuori dai mercati regolamentati o non ammesso alla negoziazione e negoziato fuori dai mercati regolamentati. |  |
| 11 | Compressione                             | Indicare se il contratto deriva da una compressione.  |  |
| 12 | Prezzo/tasso                             | Il prezzo del derivato, esclusi, laddove applicabile, commissioni e interessi maturati.   |  |
| 13 | Notazione del prezzo                     | Il modo in cui è espresso il prezzo.  |  |
| 14 | Importo nozionale                        | Valore originario del contratto.  |  |

|    | Campo  | Dati da comunicare  | Tipo di contratto derivato interessato |
|----|--|---|--|
| 15 | Moltiplicatore del prezzo                                | Il numero di unità dello strumento finanziario contenute in un lotto di negoziazione; ad esempio, il numero di derivati rappresentati da un contratto.  |  |
| 16 | Quantitativo   | In caso di segnalazione di più di un contratto derivato, numero di contratti inclusi nella segnalazione.  |  |
| 17 | Pagamento anticipato                                     | Importo di eventuali pagamenti anticipati che la controparte segnalante ha effettuato o ricevuto.   |  |
| 18 | Tipo di consegna   | Indicare se il contratto è regolato fisicamente o in contanti.  |  |
| 19 | Data e ora di esecuzione                                 | Secondo la definizione dell'articolo 1, paragrafo 2.  |  |
| 20 | Data di efficacia  | Data alla quale le obbligazioni contrattuali entrano in vigore.   |  |
| 21 | Data di scadenza   | Data originaria di scadenza del contratto segnalato. La cessazione anticipata non può essere segnalata in questo campo.   |  |
| 22 | Data di cessazione                                       | Data di cessazione del contratto segnalato. Lasciare in bianco se identica alla data di scadenza.   |  |
| 23 | Data del regolamento                                     | Data del regolamento del sottostante. In caso di varie date, aggiungere campi come segue: 23A, 23B, 23C ecc.  |  |
| 24 | Tipo di accordo quadro                                   | Indicare il riferimento al nome del pertinente accordo quadro, se utilizzato per il contratto segnalato (ad esempio ISDA Master Agreement, Master Power Purchase and Sale Agreement, International ForEx Master Agreement, European Master Agreement o ogni altro accordo quadro locale). |  |
| 25 | Versione dell'accordo quadro                             | Indicare l'anno della versione dell'accordo quadro utilizzato per l'operazione segnalata, se del caso (ad es., 1992, 2002, ...).  |  |
|    | <b>Sezione 2c — attenuazione dei rischi/segnalazione</b> |   | <b>Tutti i contratti</b>               |
| 26 | Data e ora della conferma                                | La data e l'ora della conferma, secondo la definizione del regolamento delegato (UE) n. 149/2013 della Commissione <sup>(1)</sup> .   |  |
| 27 | Mezzo di conferma  | Indicare se il contratto è stato confermato per via elettronica, per via non elettronica o se è rimasto non confermato.   |  |
|    | <b>Sezione 2d — Compensazione</b>                        |   | <b>Tutti i contratti</b>               |
| 28 | Obbligo di compensazione                                 | Indicare se il contratto segnalato è soggetto all'obbligo di compensazione ai sensi del regolamento (UE) n. 648/2012.   |  |

|    | Campo                                      | Dati da comunicare  | Tipo di contratto derivato interessato |
|----|--|---|--|
| 29 | Compensato                                 | Indicare se la compensazione ha avuto luogo.  |  |
| 30 | Data e ora della compensazione             | Data e ora in cui la compensazione ha avuto luogo.  |  |
| 31 | Controparte centrale                       | Se il contratto è stato compensato, indicare il codice unico della controparte centrale che ha compensato il contratto.   |  |
| 32 | Infragrupo                                 | Indicare se il contratto è stato concluso nel quadro di un'operazione infragrupo ai sensi dell'articolo 3 del regolamento (UE) n. 648/2012.   |  |
|    | <b>Sezione 2e — tassi di interesse</b>     | <b>Se è indicato un identificativo unico del prodotto (Unique Product Identifier — UPI) contenente tutte le informazioni indicate di seguito, la segnalazione non è obbligatoria.</b> | <b>Derivati su tassi di interesse</b>  |
| 33 | Tasso fisso della gamba 1                  | Indicazione del tasso fisso della gamba 1, se applicabile.  |  |
| 34 | Tasso fisso della gamba 2                  | Indicazione del tasso fisso utilizzato per la gamba 2, se applicabile.  |  |
| 35 | Conteggio dei giorni del tasso fisso       | Il numero effettivo di giorni del periodo di calcolo del pagatore del pertinente tasso fisso, se applicabile.   |  |
| 36 | Frequenza di pagamento della gamba fissa   | Frequenza dei pagamenti per la gamba a tasso fisso, se applicabile.   |  |
| 37 | Frequenza di pagamento del tasso variabile | Frequenza dei pagamenti per la gamba a tasso variabile, se applicabile.   |  |
| 38 | Frequenza di revisione del tasso variabile | Frequenza di revisione della gamba a tasso variabile, se applicabile.   |  |
| 39 | Tasso variabile della gamba 1              | Indicazione dei tassi di interesse utilizzati, rivisti a intervalli prestabiliti con riferimento ad un tasso di riferimento di mercato, se applicabile.                               |  |
| 40 | Tasso variabile della gamba 2              | Indicazione dei tassi di interesse utilizzati, rivisti a intervalli prestabiliti con riferimento ad un tasso di riferimento di mercato, se applicabile.                               |  |
|    | <b>Sezione 2f — tassi di cambio</b>        | <b>Se è indicato un identificativo unico del prodotto (Unique Product Identifier — UPI) contenente tutte le informazioni indicate di seguito, la segnalazione non è obbligatoria.</b> | <b>Derivati su valute</b>              |
| 41 | Valuta 2                                   | La valuta intermedia, se diversa da quella di consegna.   |  |
| 42 | Tasso di cambio 1                          | Tasso di cambio contrattuale delle valute.  |  |
| 43 | Tasso di cambio a termine                  | Tasso di cambio a termine alla data di valore.  |  |
| 44 | Base del tasso di cambio                   | La valuta di base per il tasso di cambio.   |  |



|    | Campo  | Dati da comunicare  | Tipo di contratto derivato interessato |
|----|--|---|--|
|    | <b>Sezione 2g — materie prime</b>              | <b>Se è indicato un identificativo unico del prodotto (Unique Product Identifier — UPI) contenente tutte le informazioni indicate di seguito, la segnalazione non è obbligatoria, tranne in caso di obbligo di segnalazione ai sensi del regolamento (UE) n. 1227/2011 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(2)</sup>.</b> | <b>Derivati su materie prime</b>       |
|    | <b>Informazioni generali</b>                   |   |  |
| 45 | Materie prime sottostanti                      | Indicare il tipo di materia prima che costituisce il sottostante del contratto.   |  |
| 46 | Informazioni specifiche sulle materie prime    | Dati sulla particolare materia prima dal campo 45 in poi.   |  |
|    | <b>Energia</b>                                 | Informazioni da trasmettere ai sensi del regolamento (UE) n. 1227/2011, se applicabile.   |  |
| 47 | Punto o zona di consegna                       | Punti di consegna delle aree di mercato.  |  |
| 48 | Punto di interconnessione                      | Identificazione dei confini o dei punti di confine di un contratto di trasporto.  |  |
| 49 | Tipo di carico                                 | Sezione ripetibile dei campi da 50 a 54 per individuare il profilo di consegna del prodotto corrispondente ad un periodo di consegna di un giorno.  |  |
| 50 | Data e ora di inizio della consegna            | Data e ora di inizio della consegna.  |  |
| 51 | Data e ora di fine della consegna              | Data e ora di fine della consegna.  |  |
| 52 | Capacità oggetto del contratto                 | Quantità per intervallo di tempo di consegna.   |  |
| 53 | Numero di unità                                | Quantità giornaliera o oraria in MWh o kWh/g corrispondente alla materia prima sottostante.   |  |
| 54 | Prezzo per quantità per intervallo di tempo    | Se applicabile, prezzo per quantità per intervallo di tempo.  |  |
|    | <b>Sezione 2h — Opzioni</b>                    | <b>Se è indicato un identificativo unico del prodotto (Unique Product Identifier — UPI) contenente tutte le informazioni indicate di seguito, la segnalazione non è obbligatoria.</b>   | <b>Contratti contenenti un'opzione</b> |
| 55 | Tipo di opzione                                | Indicare se il contratto è <i>call</i> o <i>put</i> .   |  |
| 56 | Stile dell'opzione (esercizio)                 | 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).   |  |
| 57 | Prezzo <i>strike</i> (tasso <i>cap/floor</i> ) | Il prezzo di esercizio dell'opzione.  |  |

|    | Campo  | Dati da comunicare  | Tipo di contratto derivato interessato |
|----|--|---|--|
|    | <b>Sezione 2i — modifiche della segnalazione</b> |   | <b>Tutti i contratti</b>               |
| 58 | Tipo di azione                                   | <p>Se la segnalazione riguarda:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>— un contratto derivato o un evento postnegoziato per la prima volta, indicare «new»,</li> <li>— una modifica delle informazioni precedentemente trasmesse su un contratto derivato, indicare «modify»,</li> <li>— la cancellazione di un errore nella segnalazione, indicare «error»,</li> <li>— la cessazione di un contratto vigente, indicare «cancel»,</li> <li>— la compressione di un contratto segnalato, indicare «compression»,</li> <li>— l'aggiornamento della valutazione di un contratto, indicare «valuation update»,</li> <li>— ogni altra modifica della segnalazione, indicare «other».</li> </ul> |  |
| 59 | Dettagli sul tipo di azione                      | Se nel campo 58 è stato indicato «other», specificare in questo campo i dettagli della modifica.  |  |

(<sup>1</sup>) Cfr. pag. 11 della presente Gazzetta ufficiale.

(<sup>2</sup>) GU L 326 dell'8.12.2011, pag. 1.