

REGOLAMENTO DI ESECUZIONE (UE) 2017/105 DELLA COMMISSIONE**del 19 ottobre 2016**

che modifica il regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012 della Commissione che stabilisce norme tecniche di attuazione per quanto riguarda il formato e la frequenza delle segnalazioni sulle negoziazioni ai repertori di dati sulle negoziazioni ai sensi del 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

(Testo rilevante ai fini del SEE)

LA COMMISSIONE EUROPEA,

visto il trattato sul funzionamento dell'Unione europea,

visto il regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 4 luglio 2012, sugli strumenti derivati OTC, le controparti centrali e i repertori di dati sulle negoziazioni ⁽¹⁾, in particolare l'articolo 9, paragrafo 6,

considerando quanto segue:

- (1) Il regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012 ⁽²⁾ della Commissione prevede, qualora non sia disponibile l'identificativo della persona giuridica, l'uso di identificativi temporanei. Recentemente si è resa disponibile un'infrastruttura che consente di attribuire l'identificativo della persona giuridica; inoltre l'utilizzo di tale identificativo è entrato nelle abitudini dei partecipanti al mercato. Pertanto, l'identificativo della persona giuridica dovrebbe essere ora l'unico mezzo autorizzato di identificazione delle persone giuridiche.
- (2) Nel caso degli *swap*, è particolarmente complesso determinare se la controparte segnalante è l'acquirente o il venditore del contratto, dato che tali contratti derivati comportano lo scambio di strumenti finanziari tra le parti. È pertanto necessario prevedere norme specifiche per assicurare che nei contratti derivati *swap* l'identità dell'acquirente e quella del venditore siano determinate in modo accurato e coerente.
- (3) Per determinare le reali esposizioni delle controparti, le autorità competenti hanno bisogno di informazioni complete e accurate sulle garanzie scambiate tra le controparti. Per questo motivo, è opportuno definire norme specifiche che consentano un approccio coerente per quanto riguarda le segnalazioni delle garanzie costituite per un determinato contratto derivato o portafoglio.
- (4) La classificazione accurata e l'identificazione precisa dei derivati sono essenziali per l'uso efficiente e per l'aggregazione significativa dei dati detenuti dai diversi repertori di dati sulle negoziazioni, e contribuiscono pertanto al conseguimento degli obiettivi enunciati dal Consiglio per la stabilità finanziaria (FSB) nello studio di fattibilità sull'aggregazione dei dati sui derivati OTC detenuti dai repertori di dati sulle negoziazioni ⁽³⁾, pubblicato il 19 settembre 2014. È pertanto necessario modificare gli obblighi di segnalazione per quanto riguarda la classificazione e l'identificazione dei derivati, in modo tale che le autorità competenti possano disporre di queste informazioni nella loro interezza.
- (5) Per consentire la segnalazione dei nuovi tipi di contratti derivati che si rendono disponibili grazie all'innovazione finanziaria e che sono normalmente oggetto di negoziazione, è opportuno aggiungere le *swaption* e le scommesse su differenziale (*spreadbet*) all'elenco delle classi di contratti derivati. Più in generale, in considerazione del fatto che le continue innovazioni finanziarie danno origine a nuovi tipi di contratti derivati, è importante assicurare che i nuovi tipi di contratti derivati non rientranti in una delle classi esistenti possano comunque essere segnalati. Pertanto, è opportuno mantenere la categoria «altro» nella classificazione dei tipi di contratti derivati.
- (6) Se due controparti non riescono a raggiungere un accordo su chi di esse debba generare l'identificativo unico dell'operazione entro il termine previsto per la segnalazione, potrebbe risultare impossibile identificare correttamente e associare le due segnalazioni relative alla stessa operazione. È quindi necessario stabilire i criteri per la generazione dell'identificativo unico dell'operazione, in modo da evitare che la medesima operazione venga conteggiata due volte.

⁽¹⁾ GUL 201 del 27.7.2012, pag. 1.

⁽²⁾ Regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012 della Commissione, del 19 dicembre 2012, che stabilisce norme tecniche di attuazione per quanto riguarda il formato e la frequenza delle segnalazioni sulle negoziazioni ai repertori di dati sulle negoziazioni ai sensi del 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 (GUL 352 del 21.12.2012, pag. 20).

⁽³⁾ http://www.fsb.org/wp-content/uploads/r_140919.pdf

- (7) Le controparti possono avere notevoli difficoltà a ottenere tutte le pertinenti informazioni sulle operazioni chiuse prima della data di inizio del periodo di segnalazione. Data la complessità che ne risulta per quanto riguarda la segnalazione delle operazioni chiuse e considerato il fatto che tali operazioni non aumentano il rischio sistemico, il periodo di tempo per la segnalazione delle operazioni chiuse dovrebbe essere esteso da 3 a 5 anni a decorrere dalla data di inizio del periodo di segnalazione.
- (8) Per assicurare la piena armonizzazione dei dati segnalati ai repertori di dati sulle negoziazioni e consentirne, pertanto, l'interpretazione e l'aggregazione coerenti, è necessario chiarire le norme da seguire e i formati da utilizzare per le segnalazioni delle operazioni. È anche opportuno modificare gli obblighi di segnalazione per quanto riguarda i formati dei dati. Alle controparti e ai repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbe essere concesso tempo sufficiente per adottare tutte le misure necessarie per conformarsi ai nuovi obblighi.
- (9) È opportuno pertanto modificare di conseguenza il regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012.
- (10) Il presente regolamento si basa sui progetti di norme tecniche di attuazione presentati alla Commissione dall'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (ESMA).
- (11) Conformemente all'articolo 15 del regolamento (UE) n. 1095/2010 del Parlamento europeo e del Consiglio ⁽¹⁾, l'ESMA ha effettuato consultazioni pubbliche aperte sul progetto di norme tecniche di attuazione, ne ha analizzato i potenziali costi e benefici 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

Il regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012 è così modificato:

- 1) l'articolo 3 è sostituito dal seguente:

«Articolo 3

Identificazione delle controparti e di altri soggetti

Nella segnalazione si utilizza l'identificativo della persona giuridica (*legal entity identifier*) per identificare:

- a) il beneficiario, se persona giuridica;
 - b) l'intermediario;
 - c) la controparte centrale;
 - d) il partecipante diretto;
 - e) la controparte, se persona giuridica;
 - f) il soggetto segnalante.»
- 2) sono inseriti i seguenti articoli 3 *bis* e 3 *ter*:

«Articolo 3 bis

Lato della controparte

1. Il lato della controparte del contratto derivato di cui al campo 14 della tabella 1 dell'allegato è determinato conformemente ai paragrafi da 2 a 10.
2. Per le opzioni e le *swaption*, la controparte che detiene il diritto di esercitare l'opzione è identificata come l'acquirente e la controparte che vende l'opzione e riceve un premio è identificata come il venditore.

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

3. Per i *future* e i *forward* diversi da *future* e *forward* relativi a valute, la controparte che acquista lo strumento è identificata come l'acquirente e la controparte che vende lo strumento è identificata come il venditore.
4. Per gli *swap* relativi a titoli, la controparte che sopporta il rischio di fluttuazione del prezzo del titolo sottostante e che riceve l'importo del titolo è identificata come l'acquirente e la controparte che paga l'importo del titolo è identificata come il venditore.
5. Per gli *swap* relativi a tassi di interesse o a indici di inflazione, la controparte che paga il tasso fisso è identificata come l'acquirente e la controparte che riceve il tasso fisso è identificata come il venditore. Per gli *swap* di base (*basis swap*), la controparte che paga il differenziale è identificata come l'acquirente e la controparte che riceve il differenziale è identificata come il venditore.
6. Per gli *swap* valutari (*cross-currency swap*) e gli *swap* e i *forward* relativi a valute, la controparte che riceve la valuta che figura per prima nell'ordine alfabetico secondo la norma ISO 4217 dell'Organizzazione internazionale per la standardizzazione è identificata come l'acquirente e la controparte che consegna detta valuta è identificata come il venditore.
7. Per gli *swap* relativi a dividendi, la controparte che riceve l'equivalente dei dividendi effettivamente distribuiti è identificata come l'acquirente e la controparte che paga il dividendo e che riceve il tasso fisso è identificata come il venditore.
8. Ad eccezione delle opzioni e delle *swaption*, per gli strumenti derivati che consentono il trasferimento del rischio di credito, la controparte che acquista la protezione è identificata come l'acquirente e la controparte che vende la protezione è identificata come il venditore.
9. Per i contratti derivati relativi a materie prime, la controparte che riceve la materia prima specificata nella segnalazione è identificata come l'acquirente e la controparte che consegna la materia prima è identificata come il venditore.
10. Per i contratti sui tassi a termine del tipo *forward-rate agreement*, la controparte che paga il tasso fisso è identificata come l'acquirente e la controparte che riceve il tasso fisso è identificata come il venditore.

Articolo 3 ter

Costituzione di garanzia

1. Il tipo di costituzione di garanzia per il contratto derivato di cui al campo 21 della tabella 1 dell'allegato è identificato dalla controparte segnalante conformemente ai paragrafi da 2 a 5.
2. Se tra le controparti non vi è accordo di garanzia o se il contratto di garanzia stipulato tra le controparti stabilisce che la controparte segnalante non debba costituire né margine iniziale né margine di variazione in relazione al contratto derivato, l'indicazione da riportare per il tipo di costituzione di garanzia per il contratto derivato è "senza garanzia".
3. Se il contratto di garanzia tra le controparti stabilisce che in relazione al contratto derivato la controparte segnalante deve costituire regolarmente solo il margine di variazione, l'indicazione da riportare per il tipo di costituzione di garanzia per il contratto derivato è «con garanzia parziale».
4. Se il contratto di garanzia tra le controparti stabilisce che la controparte segnalante debba costituire il margine iniziale e debba costituire regolarmente margini di variazione e che l'altra controparte debba o costituire solo margini di variazione o non debba costituire alcun margine in relazione al contratto derivato, l'indicazione da riportare per il tipo di costituzione di garanzia per il contratto derivato è «con garanzia unilaterale».
5. Se il contratto di garanzia tra le controparti stabilisce che entrambe le controparti debbano costituire il margine iniziale e debbano costituire regolarmente margini di variazione in relazione al contratto derivato, l'indicazione da riportare per il tipo di costituzione di garanzia per il contratto derivato è "pienamente garantito".»;

3) l'articolo 4 è sostituito dal seguente:

«Articolo 4

Specifica, identificazione e classificazione dei derivati

1. Nella segnalazione il derivato è indicato con riferimento al tipo di contratto e alla classe di attività conformemente ai paragrafi 2 e 3.

2. Il derivato è specificato nel campo 1 della tabella 2 dell'allegato come uno dei seguenti contratti derivati:

- a) contratto finanziario differenziale;
- b) contratto su tassi a termine del tipo *forward rate agreement*;
- c) *forward*;
- d) *future*;
- e) opzione;
- f) scommessa sul differenziale (*spreadbet*);
- g) *swap*;
- h) *swaption*;
- i) altro.

3. Il derivato è specificato nel campo 2 della tabella 2 dell'allegato come una delle seguenti classi di attività:

- a) materie prime e quote di emissione;
- b) crediti;
- c) valute;
- d) azioni;
- e) tassi di interesse.

4. Se il derivato non rientra in una delle classi di attività di cui al paragrafo 3, nella segnalazione le controparti specificano la classe di attività a cui il derivato si avvicina di più. Entrambe le controparti specificano la stessa classe di attività.

5. Il derivato è indicato nel campo 6 della tabella 2 dell'allegato utilizzando, a seconda dei casi:

- a) il codice ISIN (*International Securities Identification Number* — numero internazionale di identificazione dei titoli) secondo ISO 6166 o un codice alternativo di identificazione degli strumenti finanziari (*Alternative Instrument Identifier Code* — AII), a seconda del caso, fino alla data di applicazione dell'atto delegato adottato dalla Commissione a norma dell'articolo 27, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 600/2014 del Parlamento europeo e del Consiglio (*);
- b) il codice ISIN, dalla data di applicazione dell'atto delegato adottato dalla Commissione ai sensi dell'articolo 27, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 600/2014.

Se viene utilizzato un codice AII, riportare il codice completo.

6. Il codice AII completo di cui al paragrafo 5 è il risultato della concatenazione dei sei elementi seguenti:

- a) il codice identificativo del mercato (*Market Identifier Code* — MIC) secondo ISO 10383 della sede di negoziazione in cui il derivato è negoziato, costituito da 4 caratteri alfanumerici;
- b) il codice, assegnato dalla sede di negoziazione, associato in modo univoco ad uno strumento sottostante e tipo di regolamento particolari e ad altre caratteristiche del contratto, costituito da un massimo di 12 caratteri alfanumerici;

- c) un carattere unico, che indica se lo strumento è un'opzione o un *future*, costituito dalla lettera «O» se si tratta di un'opzione e «F» se si tratta di un *future*;
- d) un carattere unico, che indica se l'opzione è *put* o *call*, costituito dalla lettera «P» per l'opzione *put* e dalla lettera «C» per l'opzione *call*; se, in base alla lettera c), lo strumento è stato individuato come un *future*, la lettera da inserire è «F»;
- e) la data di esercizio o la data di scadenza del contratto derivato specificata nel formato della norma ISO 8601: AAAA-MM-GG;
- f) il prezzo di esercizio dell'opzione, indicato utilizzando un massimo di 19 cifre, inclusi massimo cinque decimali, senza zeri iniziali o finali. Come separatore decimale è utilizzato il punto. Non sono ammessi valori negativi. Se lo strumento è un *future*, il prezzo *strike* è pari a zero.

7. I derivati identificati con il codice ISIN secondo ISO 6166 o con un codice AII sono classificati nel campo 4 della tabella 2 dell'allegato con il codice CFI (*Classification of Financial Instrument* — classificazione degli strumenti finanziari) secondo la norma ISO 10692.

8. I derivati per i quali non è disponibile né codice ISIN secondo ISO 6166 né codice AII sono classificati mediante un codice designato. Il codice è:

- a) unico;
- b) neutro;
- c) affidabile;
- d) *open source*;
- e) scalabile;
- f) accessibile;
- g) disponibile a costi ragionevoli;
- h) soggetto ad un adeguato quadro di *governance*.

9. Fino all'approvazione da parte dell'ESMA del codice di cui al paragrafo 8, i derivati per i quali non è disponibile né codice ISIN secondo ISO 6166 né codice AII sono classificati usando un codice CFI secondo ISO 10692.

(*) 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).»;

4) sono inseriti i seguenti articoli 4 *bis* e 4 *ter*:

«Articolo 4 *bis*

Identificativo unico dell'operazione

1. La segnalazione viene identificata mediante un identificativo unico globale dell'operazione approvato dall'ESMA o, in mancanza, mediante un identificativo unico dell'operazione concordato dalle controparti.

2. In caso di mancato accordo sul soggetto responsabile della generazione dell'identificativo unico dell'operazione da assegnare alla segnalazione, le controparti determinano il soggetto responsabile della generazione dell'identificativo unico come segue:

- a) per le operazioni eseguite e compensate a livello centrale, l'identificativo unico dell'operazione è generato nel punto di compensazione dalla controparte centrale (CCP) per il partecipante diretto. Un altro identificativo unico dell'operazione è generato dal partecipante diretto per la sua controparte;
- b) per le operazioni eseguite ma non compensate a livello centrale, l'identificativo unico è generato dalla sede di esecuzione per il suo membro;

- c) per le operazioni confermate e compensate a livello centrale, l'identificativo unico dell'operazione è generato nel punto di compensazione dalla CCP per il partecipante diretto. Un altro identificativo unico dell'operazione è generato dal partecipante diretto per la sua controparte;
- d) per le operazioni confermate a livello centrale mediante mezzi elettronici ma non compensate a livello centrale, l'identificativo unico dell'operazione è generato dalla piattaforma di conferma dell'operazione nel punto di conferma;
- e) per tutte le operazioni diverse da quelle di cui alle lettere da a) a d), si applica quanto segue:
- i) per le operazioni tra controparti finanziarie e controparti non finanziarie, l'identificativo unico dell'operazione è generato dalle controparti finanziarie;
 - ii) per le operazioni tra controparti non finanziarie che superano la soglia di compensazione e controparti non finanziarie che non superano la soglia di compensazione, l'identificativo unico dell'operazione è generato dalle controparti non finanziarie che superano la soglia di compensazione;
 - iii) per tutte le operazioni diverse da quelle di cui ai punti i) e ii), l'identificativo unico dell'operazione è generato dal venditore.
3. La controparte che genera l'identificativo unico dell'operazione lo comunica all'altra controparte in tempo utile affinché quest'ultima possa adempiere agli obblighi di segnalazione.

Articolo 4 ter

Sede di esecuzione

La sede di esecuzione del contratto derivato è indicata nel campo 15 della tabella 2 dell'allegato come segue:

- a) fino alla data di applicazione dell'atto delegato adottato dalla Commissione ai sensi dell'articolo 27, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 600/2014:
- i) per le sedi di esecuzione nell'Unione, mediante il codice identificativo del mercato (*Market Identifier Code* — MIC) secondo ISO 10383 pubblicato sul sito web dell'ESMA nel registro contenente le informazioni fornite dalle autorità competenti ai sensi dell'articolo 13, paragrafo 2, del regolamento (CE) n. 1287/2006 della Commissione (*);
 - ii) per le sedi di esecuzione esterne all'Unione, mediante il MIC secondo ISO 10383 incluso nell'elenco dei codici MIC tenuto e aggiornato dall'ISO e pubblicato sul sito web dell'ISO;
- b) dalla data di applicazione dell'atto delegato adottato dalla Commissione ai sensi dell'articolo 27, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 600/2014, mediante il MIC secondo ISO 10383.

(*) Regolamento (CE) n. 1287/2006 della Commissione, del 10 agosto 2006, recante modalità di esecuzione della direttiva 2004/39/CE del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda gli obblighi in materia di registrazioni per le imprese di investimento, la comunicazione delle operazioni, la trasparenza del mercato, l'ammissione degli strumenti finanziari alla negoziazione e le definizioni di taluni termini ai fini di tale direttiva (GU L 241 del 2.9.2006, pag. 1).»;

- 5) all'articolo 5, il paragrafo 4 è sostituito dal seguente:

«4. I seguenti contratti derivati che non sono più in essere alla data di inizio del periodo di segnalazione per la relativa categoria di derivati sono segnalati al repertorio di dati sulle negoziazioni entro cinque anni da detta data:

- a) contratti derivati stipulati prima del 16 agosto 2012 e ancora in vigore al 16 agosto 2012;
- b) contratti derivati stipulati il 16 agosto 2012 o in data successiva.»;

- 6) l'allegato è sostituito dal testo riportato nell'allegato del presente regolamento.

Articolo 2

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

Esso si applica a decorrere dal 1° novembre 2017, ad eccezione dell'articolo 1, paragrafo 5, che si applica dalla data di entrata in vigore.

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

Fatto a Bruxelles, il 19 ottobre 2016

Per la Commissione

Il presidente

Jean-Claude JUNCKER

ALLEGATO

«ALLEGATO

Tabella 1

Dati della controparte

	Campo	Formato
	Parti del contratto	
1	Data e ora della segnalazione	Formato della data secondo ISO 8601 e formato dell'ora secondo il Tempo Universale Coordinato (UTC) AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ
2	Identificativo della controparte segnalante	Codice LEI (<i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici.
3	Tipo di identificativo dell'altra controparte	“LEI” per codice LEI (<i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442. “CLC” per codice cliente.
4	Identificativo dell'altra controparte	Codice LEI (<i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici. Codice cliente (50 caratteri alfanumerici).
5	Paese dell'altra controparte	Codice paese ISO 3166 di 2 caratteri.
6	Settore di attività della controparte segnalante	Tassonomia delle controparti finanziarie: A = impresa di assicurazione autorizzata ai sensi della direttiva 2009/138/CE del Parlamento europeo e del Consiglio ⁽¹⁾ C = ente creditizio autorizzato ai sensi della direttiva 2013/36/UE del Parlamento europeo e del Consiglio ⁽²⁾ F = impresa di investimento autorizzata ai sensi della direttiva 2004/39/CE del Parlamento europeo e del Consiglio ⁽³⁾ I = impresa di assicurazione autorizzata ai sensi della direttiva 2009/138/CE L = fondo di investimento alternativo gestito da un gestore di fondi di investimento alternativi (GEFIA) autorizzato o registrato ai sensi della direttiva 2011/61/UE del Parlamento europeo e del Consiglio ⁽⁴⁾ O = ente pensionistico aziendale o professionale ai sensi dell'articolo 6, lettera a), della direttiva 2003/41/CE del Parlamento europeo e del Consiglio ⁽⁵⁾ R = impresa di riassicurazione autorizzata ai sensi della direttiva 2009/138/CE U = organismo di investimento collettivo in valori mobiliari (OICVM) e la relativa società di gestione, autorizzati ai sensi della direttiva 2009/65/CE del Parlamento europeo e del Consiglio ⁽⁶⁾ Tassonomia delle controparti non finanziarie. Le seguenti categorie corrispondono alle principali sezioni della classificazione statistica delle attività economiche nella Comunità europea (NACE), quale definita dal regolamento (CE) n. 1893/2006 del Parlamento europeo e del Consiglio ⁽⁷⁾ : 1 = agricoltura, silvicoltura e pesca 2 = attività estrattive 3 = attività manifatturiere 4 = fornitura di energia elettrica, gas, vapore e aria condizionata

	Campo	Formato
		5 = fornitura di acqua, reti fognarie, attività di trattamento dei rifiuti e decontaminazione 6 = costruzione 7 = commercio all'ingrosso e al dettaglio; riparazione di autoveicoli e motocicli 8 = trasporto e magazzinaggio 9 = attività dei servizi di alloggio e di ristorazione 10 = informazione e comunicazione 11 = attività finanziarie e assicurative 12 = attività immobiliari 13 = attività professionali, scientifiche e tecniche 14 = attività amministrative e di servizi di supporto 15 = amministrazione pubblica e difesa; assicurazione sociale obbligatoria 16 = istruzione 17 = sanità e assistenza sociale 18 = arte, spettacoli e tempo libero 19 = altre attività di servizi 20 = attività di datore di lavoro svolta da famiglie e convivenze; produzione di beni e di servizi indifferenziati per uso proprio da parte di famiglie e convivenze 21 = attività di organizzazioni ed organismi extraterritoriali Se viene indicata più di un'attività, elencare i codici nell'ordine di importanza relativa delle attività corrispondenti, separati da "-". Lasciare in bianco in caso di controparti centrali (CCP) e altri tipi di controparti di cui all'articolo 1, paragrafo 5, del regolamento (UE) n. 648/2012.
7	Natura della controparte segnalante	F = controparte finanziaria N = controparte non finanziaria C = controparte centrale O = altro
8	Identificativo dell'intermediario	Codice LEI (<i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici.
9	Identificativo del soggetto segnalante	Codice LEI (<i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
10	Identificativo del partecipante diretto	Codice LEI (<i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
11	Tipo di identificativo del beneficiario	"LEI" per codice LEI (<i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442. "CLC" per codice cliente.
12	Identificativo del beneficiario	Codice LEI (<i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici o codice cliente di un massimo di 50 caratteri alfanumerici, nel caso in cui il cliente non possa ricevere il codice LEI

	Campo	Formato
13	Capacità negoziale	P = principale A = agente
14	Lato della controparte	B = acquirente S = venditore Compilato conformemente all'articolo 3 bis
15	Direttamente collegato a attività commerciali o finanziamenti di tesoreria	Y = Sì N = No
16	Soglia di compensazione	Y = al di sopra della soglia N = al di sotto della soglia
17	Valore del contratto	Massimo 20 caratteri numerici inclusi decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.
18	Valuta del valore	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
19	Data e ora della valutazione	Data nel formato di ISO 8601 e ora nel formato UTC AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ
20	Tipo di valutazione	M = ai prezzi correnti di mercato O = in base ad un modello C = valutazione della CCP
21	Costituzione di garanzia	U = senza garanzia PC = con garanzia parziale OC = con garanzia unilaterale FC = pienamente garantito Compilato conformemente all'articolo 3 ter
22	Garanzia per portafoglio	Y = Sì N = No
23	Codice della garanzia per portafoglio	Massimo 52 caratteri alfanumerici, di cui quattro caratteri speciali: ". - _." I caratteri speciali non sono autorizzati all'inizio e alla fine del codice. Non sono autorizzati gli spazi.
24	Margine iniziale costituito	Massimo 20 caratteri numerici inclusi decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
25	Valuta del margine iniziale costituito	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici

	Campo	Formato
26	Margine di variazione costituito	Massimo 20 caratteri numerici inclusi decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
27	Valuta dei margini di variazione costituiti	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
28	Margine iniziale ricevuto	Massimo 20 caratteri numerici inclusi decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
29	Valuta del margine iniziale ricevuto	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
30	Margine di variazione ricevuto	Massimo 20 caratteri numerici inclusi decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
31	Valuta dei margini di variazione ricevuti	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
32	Garanzia costituita in eccesso	Massimo 20 caratteri numerici inclusi decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
33	Valuta della garanzia costituita in eccesso	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
34	Garanzia ricevuta in eccesso	Massimo 20 caratteri numerici inclusi decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
35	Valuta della garanzia ricevuta in eccesso	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici

(¹) Direttiva 2009/138/CE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 25 novembre 2009, in materia di accesso ed esercizio delle attività di assicurazione e di riassicurazione (solvibilità II) (GU L 335 del 17.12.2009, pag. 1).

(²) Direttiva 2013/36/UE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 26 giugno 2013, sull'accesso all'attività degli enti creditizi e sulla vigilanza prudenziale sugli enti creditizi e sulle imprese di investimento, che modifica la direttiva 2002/87/CE e abroga le direttive 2006/48/CE e 2006/49/CE (GU L 176 del 27.6.2013, pag. 338).

(³) Direttiva 2004/39/CE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 21 aprile 2004, relativa ai mercati degli strumenti finanziari, che modifica le direttive 85/611/CEE e 93/6/CEE del Consiglio e la direttiva 2000/12/CE del Parlamento europeo e del Consiglio e che abroga la direttiva 93/22/CEE del Consiglio (GU L 145 del 30.4.2004, pag. 1).

(⁴) Direttiva 2011/61/UE del Parlamento europeo e del Consiglio, dell'8 giugno 2011, sui gestori di fondi di investimento alternativi, che modifica le direttive 2003/41/CE e 2009/65/CE e i regolamenti (CE) n. 1060/2009 e (UE) n. 1095/2010 (GU L 174 dell'1.7.2011, pag. 1).

(⁵) Direttiva 2003/41/CE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 3 giugno 2003, relativa alle attività e alla supervisione degli enti pensionistici aziendali o professionali (GU L 235 del 23.9.2003, pag. 10).

(⁶) Direttiva 2009/65/CE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 13 luglio 2009, concernente il coordinamento delle disposizioni legislative, regolamentari e amministrative in materia di taluni organismi d'investimento collettivo in valori mobiliari (OICVM) (GU L 302 del 17.11.2009, pag. 32).

(⁷) Regolamento (CE) n. 1893/2006 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 20 dicembre 2006, che definisce la classificazione statistica delle attività economiche NACE Revisione 2 e modifica il regolamento (CEE) n. 3037/90 del Consiglio nonché alcuni regolamenti (CE) relativi a settori statistici specifici (GU L 393 del 30.12.2006, pag. 1).

Tabella 2

Dati comuni

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
	Sezione 2a — tipo di contratto		Tutti i contratti
1	Tipo di contratto	CD = contratti finanziari differenziali FR = contratti sui tassi a termine del tipo <i>forward rate agreement</i> FU = <i>future</i> FW = <i>forward</i> OP = opzione SB = scommesse su differenziale SW = <i>swap</i> ST = <i>swaption</i> OT = altro	
2	Classe di attività	CO = materie prime e quote di emissione CR = crediti CU = valute EQ = azioni IR = tassi di interesse	
	Sezione 2b — informazioni sul contratto		Tutti i contratti
3	Tipo di classificazione del prodotto	C = CFI U = UPI	
4	Classificazione del prodotto	CFI secondo ISO 10692, codice di 6 caratteri alfabetic UPI approvato	
5	Tipo di identificazione del prodotto	Precisare l'identificazione applicabile: I = ISIN A = AII	
6	Identificazione del prodotto	Per l'identificativo del prodotto di tipo I: ISIN secondo ISO 6166, codice di 12 caratteri alfanumerici Per l'identificativo del prodotto di tipo A: Codice AII completo conformemente all'articolo 4, paragrafo 8	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
7	Tipo di identificazione del sottostante	I = ISIN A = AII U = UPI B = paniere X = indice	
8	Identificazione del sottostante	Per il tipo I di identificazione del sottostante: ISIN secondo ISO 6166, codice di 12 caratteri alfanumerici Per il tipo A di identificazione del sottostante: codice AII completo conformemente all'articolo 4, paragrafo 8 Per il tipo U di identificazione del sottostante: UPI Per il tipo B di identificazione del sottostante: identificazione di tutti i singoli componenti mediante ISIN secondo ISO 6166 o il codice AII completo conformemente all'articolo 4, paragrafo 8. Gli identificativi dei singoli componenti sono separati da una lineetta "-". Per il tipo X di identificazione del sottostante: ISIN secondo ISO 6166, se disponibile, altrimenti nome completo dell'indice attribuito dal fornitore dell'indice	
9	Valuta nozionale 1	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici	
10	Valuta nozionale 2	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici	
11	Valuta di consegna	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici	
	Sezione 2c — dati sull'operazione		Tutti i contratti
12	Identificativo dell'operazione	Fino a quando non sarà disponibile l'identificativo unico dell'operazione (UTI) globale, codice di massimo 52 caratteri alfanumerici, tra cui quattro caratteri speciali: ". - _." I caratteri speciali non sono autorizzati all'inizio e alla fine del codice. Non sono autorizzati gli spazi.	
13	Numero di tracciamento della segnalazione	Campo alfanumerico di massimo 52 caratteri	
14	Identificativo della componente di negoziazione complessa	Campo alfanumerico di massimo 35 caratteri	
15	Sede di esecuzione	Codice identificativo del mercato (<i>Market Identifier Code</i> — MIC) secondo ISO 10383 di 4 caratteri alfanumerici, conformemente all'articolo 4, lettera b).	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
16	Compressione	Y = il contratto deriva da compressione N = il contratto non deriva da compressione	
17	Prezzo/tasso	Massimo 20 caratteri numerici inclusi decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico. Se indicato in valore percentuale, il prezzo dovrebbe essere espresso in percentuale e il 100 % dovrebbe essere rappresentato da "100"	
18	Notazione del prezzo	U = unità P = percentuale Y = rendimento	
19	Valuta del prezzo	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici.	
20	Importo nozionale	Massimo 20 caratteri numerici inclusi decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.	
21	Moltiplicatore del prezzo	Massimo 20 caratteri numerici inclusi decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.	
22	Quantità	Massimo 20 caratteri numerici inclusi decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.	
23	Pagamento anticipato	Massimo 20 caratteri numerici inclusi decimali. Il simbolo negativo deve essere utilizzato per indicare che il pagamento è stato effettuato, e non ricevuto. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
24	Tipo di consegna	C = in contante P = fisica O = facoltativo per la controparte o quando stabilito da terzi	
25	Data e ora di esecuzione	Data nel formato di ISO 8601 e ora nel formato UTC AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ	
26	Data di entrata in vigore	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)	
27	Data di scadenza	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)	
28	Data di cessazione	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)	
29	Data di regolamento	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)	
30	Tipo di accordo quadro	Campo di testo libero, massimo 50 caratteri; indicare il nome dell'eventuale accordo quadro utilizzato.	
31	Versione dell'accordo quadro	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA)	
	Sezione 2d — attenuazione dei rischi/segnalazione		Tutti i contratti
32	Data e ora della conferma	Data nel formato di ISO 8601 e ora nel formato UTC AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ	
33	Mezzi di conferma	Y = confermato con mezzo non elettronico N = non confermato E = confermato con mezzo elettronico	
	Sezione 2e — compensazione		Tutti i contratti
34	Obbligo di compensazione	Y = Sì N = No	
35	Compensato	Y = Sì N = No	
36	Data e ora della compensazione	Data nel formato di ISO 8601 e ora nel formato UTC AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ	
37	Controparte centrale (CCP)	Codice LEI (<i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo della persona giuridica) secondo ISO17442 con 20 caratteri alfanumerici	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
38	Infragruppo	Y = Sì N = No	
	Sezione 2f — tassi di interesse		Derivati su tassi di interesse
39	Tasso fisso della gamba 1	Massimo 10 caratteri numerici compresi i decimali espressi in percentuale, dove il 100 % è rappresentato da "100". Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.	
40	Tasso fisso della gamba 2	Massimo 10 caratteri numerici compresi i decimali espressi in percentuale, dove il 100 % è rappresentato da "100". Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.	
41	Conteggio dei giorni del tasso fisso della gamba 1	Numeratore/denominatore, dove sia il numeratore che il denominatore sono caratteri numerici o l'espressione alfabetica "Actual", ad esempio 30/360 o Actual/365	
42	Conteggio dei giorni del tasso fisso della gamba 2	Numeratore/denominatore, dove sia il numeratore che il denominatore sono caratteri numerici o l'espressione alfabetica "Actual", ad esempio 30/360 o Actual/365	
43	Frequenza di pagamento per il tasso fisso della gamba 1 — Periodo	Periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti si scambiano i pagamenti. Si applicano le seguenti abbreviazioni: Y = anno M = mese W = settimana D = giorno	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
44	Frequenza di pagamento per il tasso fisso della gamba 1 — Moltiplicatore	Un intero multiplo del periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti si scambiano i pagamenti. Massimo 3 caratteri numerici	
45	Frequenza di pagamento per il tasso fisso della gamba 2 — Periodo	Periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti si scambiano i pagamenti. Si applicano le seguenti abbreviazioni: Y = anno M = mese W = settimana D = giorno	
46	Frequenza di pagamento per il tasso fisso della gamba 2 — Moltiplicatore	Un intero multiplo del periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti si scambiano i pagamenti. Massimo 3 caratteri numerici	
47	Frequenza di pagamento per il tasso variabile della gamba 1 — Periodo	Periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti si scambiano i pagamenti. Si applicano le seguenti abbreviazioni: Y = anno M = mese W = settimana D = giorno	
48	Frequenza di pagamento per il tasso variabile della gamba 1 — Moltiplicatore	Un intero multiplo del periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti si scambiano i pagamenti. Massimo 3 caratteri numerici	
49	Frequenza di pagamento per il tasso variabile della gamba 2 — Periodo	Periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti si scambiano i pagamenti. Si applicano le seguenti abbreviazioni: Y = anno M = mese W = settimana D = giorno	
50	Frequenza di pagamento per il tasso variabile della gamba 2 — Moltiplicatore	Un intero multiplo del periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti si scambiano i pagamenti. Massimo 3 caratteri numerici	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
51	Frequenza di revisione per il tasso variabile della gamba 1 — Periodo	Periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti rivedono il tasso variabile. Si applicano le seguenti abbreviazioni: Y = anno M = mese W = settimana D = giorno	
52	Frequenza di revisione per il tasso variabile della gamba 1 — Moltiplicatore	Un intero multiplo del periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti rivedono il tasso variabile. Massimo 3 caratteri numerici	
53	Frequenza di revisione per il tasso variabile della gamba 2 — Periodo	Periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti rivedono il tasso variabile. Si applicano le seguenti abbreviazioni: Y = anno M = mese W = settimana D = giorno	
54	Frequenza di revisione per il tasso variabile della gamba 2 — Moltiplicatore	Un intero multiplo del periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti rivedono il tasso variabile. Massimo 3 caratteri numerici	
55	Tasso variabile della gamba 1	Nome dell'indice a tasso variabile "EONA" — EONIA "EONS" — <i>swap</i> sull'EONIA "EURI" — EURIBOR "EUUS" — EURODOLLAR "EUCH" — EuroSwiss "GCFR" — GCF REPO "ISDA" — ISDAFIX "LIBI" — LIBID "LIBO" — LIBOR "MAAA" — Muni AAA "PFAN" — Pfandbriefe "TIBO" — TIBOR "STBO" — STIBOR "BBSW" — BBSW "JIBA" — JIBAR "BUBO" — BUBOR	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
		"CDOR" — CDOR "CIBO" — CIBOR "MOSP" — MOSPRIM "NIBO" — NIBOR "PRBO" — PRIBOR "TLBO" — TELBOR "WIBO" — WIBOR "TREA" — Tesoro "SWAP" — <i>swap</i> "FUSW" — <i>swap su future</i> O massimo 25 caratteri alfanumerici se il tasso di riferimento non è compreso nel precedente elenco	
56	Periodo di riferimento del tasso variabile della gamba 1 — Periodo	Periodo di tempo che descrive il periodo di riferimento. Si applicano le seguenti abbreviazioni: Y = anno M = mese W = settimana D = giorno	
57	Periodo di riferimento del tasso variabile della gamba 1 — Moltiplicatore	Un intero multiplo del periodo di tempo che descrive il periodo di riferimento. Massimo 3 caratteri numerici	
58	Tasso variabile della gamba 2	Nome dell'indice a tasso variabile "EONA" — EONIA "EONS" — <i>swap</i> sull'EONIA "EURI" — EURIBOR "EUUS" — EURODOLLAR "EUCH" — EuroSwiss "GCFR" — GCF REPO "ISDA" — ISDAFIX "LIBI" — LIBID "LIBO" — LIBOR "MAAA" — Muni AAA "PFAN" — Pfandbriefe "TIBO" — TIBOR "STBO" — STIBOR "BBSW" — BBSW "JIBA" — JIBAR "BUBO" — BUBOR "CDOR" — CDOR "CIBO" — CIBOR "MOSP" — MOSPRIM	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
		"NIBO" — NIBOR "PRBO" — PRIBOR "TLBO" — TELBOR "WIBO" — WIBOR "TREA" — Tesoro "SWAP" — <i>swap</i> "FUSW" — <i>swap su future</i> O massimo 25 caratteri alfanumerici se il tasso di riferimento non è compreso nel precedente elenco	
59	Periodo di riferimento del tasso variabile della gamba 2 — Periodo	Periodo di tempo che descrive il periodo di riferimento. Si applicano le seguenti abbreviazioni: Y = anno M = mese W = settimana D = giorno	
60	Periodo di riferimento del tasso variabile della gamba 2 — Moltiplicatore	Un intero multiplo del periodo di tempo che descrive il periodo di riferimento. Massimo 3 caratteri numerici	
	Sezione 2 g — tassi di cambio		Derivati su valute
61	Valuta di consegna 2	Codice valuta ISO 4217 a 3 caratteri alfabetici.	
62	Tasso di cambio 1	Massimo 10 caratteri numerici inclusi decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.	
63	Tasso di cambio a termine	Massimo 10 caratteri numerici inclusi decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
64	Base del tasso di cambio	Due codici valuta ISO 4217 separati da "/". Il primo codice valuta indica la valuta di base e il secondo codice valuta indica la valuta della quotazione.	
	Sezione 2 h — materie prime e quote di emissione		Derivati su materie prime e quote di emissione
	Osservazioni generali		
65	Materie prime sottostanti	AG = agricole EN = energia FR = trasporto merci ME = metalli IN = indice EV = ambientali EX = esotiche OT = altro	
66	Informazioni specifiche sulle materie prime	Agricole GO = semi oleosi DA = prodotti lattiero-caseari LI = animali FO = prodotti forestali SO = softs SF = prodotti ittici OT = altro Energia OI = petrolio NG = gas naturale CO = carbone EL = energia elettrica IE = interenergia OT = altro Trasporto merci DR = secco WT = umido OT = altro Metalli PR = preziosi NP = non preziosi Ambiente WE = clima EM = emissioni OT = altro	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
	Energia		
67	Punto o zona di consegna	Codice EIC alfanumerico di 16 caratteri. Campo ripetibile	
68	Punto di interconnessione	Codice EIC alfanumerico di 16 caratteri.	
69	Tipo di carico	BL = carico di base PL = carico di picco OP = carico normale BH = ora/blocco orario SH = profilato GD = giorno gas OT = altro	
	Sezione ripetibile dei campi da 70 a 77.		
70	Intervalli di consegna del carico	hh:mmZ	
71	Data e ora di inizio della consegna	Data nel formato di ISO 8601 e ora nel formato UTC AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ	
72	Data e ora di fine della consegna	Data nel formato di ISO 8601 e ora nel formato UTC AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ	
73	Durata	N = minuti H = ora D = giorno W = settimana M = mese Q = trimestre S = stagione Y = annuale O = altro	
74	Giorni della settimana	WD = giorni feriali WN = fine settimana MO = lunedì TU = martedì WE = mercoledì TH = giovedì FR = venerdì SA = sabato SU = domenica Sono consentiti valori multipli separati da "/"	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
75	Capacità di consegna	Massimo 20 caratteri numerici inclusi decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.	
76	Unità di quantità	KW KWh/h KWh/d MW KWh/h KWh/d GW KWh/h KWh/d Therm/d Ktherm/d Mtherm/d cm/d mcm/d	
77	Prezzo per quantità per intervallo di tempo	Massimo 20 caratteri numerici inclusi decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.	
	Sezione 2i — opzioni		Contratti contenenti un'opzione
78	Tipo di opzione	P = <i>put</i> C = <i>call</i> O = se non è possibile stabilire se si tratta di <i>call</i> o di <i>put</i>	
79	Stile di esercizio dell'opzione	A = americano B = bermudiano E = europeo S = asiatico È consentito più di un valore	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
80	Prezzo <i>strike</i> (tasso <i>cap/floor</i>)	Massimo 20 caratteri numerici inclusi decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico. Se indicato in valore percentuale, il prezzo <i>strike</i> dovrebbe essere espresso in percentuale e il 100 % dovrebbe essere rappresentato da "100"	
81	Notazione del prezzo <i>strike</i>	U = unità P = percentuale Y = rendimento	
82	Data di scadenza del sottostante	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)	
	Sezione 2 j — derivati su crediti		
83	Rango	SNDB = senior, ad esempio debito <i>senior</i> non garantito (societario/finanziario), debito sovrano in valuta estera (governo) SBOD = subordinato, ad esempio debito subordinato o debito di classe 2 inferiore (<i>lower tier 2</i>) (banche), debito subordinato <i>junior</i> o debito di classe 2 superiore (<i>upper tier 2</i>) (banche), OTHR = altro, ad esempio azioni privilegiate o capitale di classe 1 (banche) o altri derivati su crediti	
84	Entità di riferimento	Codice paese ISO 3166 di 2 caratteri. o Codice paese di 2 caratteri secondo ISO 3166-2 seguito da lineetta "-" e da un massimo di 3 caratteri alfanumerici per il codice di suddivisione del paese o Codice LEI (<i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici	
85	Frequenza pagamenti	MNTH = mensile QURT = trimestrale MIAN = semestrale YEAR = annuale	
86	La base di calcolo	Numeratore/denominatore, dove sia il numeratore che il denominatore sono caratteri numerici o l'espressione alfabetica "Actual", ad esempio 30/360 o Actual/365	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
87	Serie	Campo con numero intero di massimo 5 cifre	
88	Version (versione)	Campo con numero intero di massimo 5 cifre	
89	Fattore dell'indice	Massimo 10 caratteri numerici inclusi decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.	
90	Segmento	T = segmentato U = non segmentato	
91	Punto di attacco (<i>attachment point</i>)	Massimo 10 caratteri numerici, compresi i decimali espressi come frazione decimale tra 0 e 1. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.	
92	Punto di distacco (<i>detachment point</i>)	Massimo 10 caratteri numerici, compresi i decimali espressi come frazione decimale tra 0 e 1. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.	
	Sezione 2k — modifiche del contratto		
93	Tipo di azione	N = nuovo M = modifica E = errore C = cessazione anticipata R = correzione Z = compressione V = aggiornamento della valutazione P = componente di posizione	
94	Livello	T = operazione P = posizione»	