

**REGOLAMENTO DI ESECUZIONE (UE) 2019/363 DELLA COMMISSIONE****del 13 dicembre 2018**

**che stabilisce norme tecniche di attuazione per quanto riguarda il formato e la frequenza delle segnalazioni delle informazioni sulle operazioni di finanziamento tramite titoli (SFT) ai repertori di dati sulle negoziazioni a norma del regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio e che modifica il regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012 della Commissione relativamente all'utilizzo di codici per la segnalazione dei contratti derivati**

(Testo rilevante ai fini del SEE)

LA COMMISSIONE EUROPEA,

visto il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 25 novembre 2015, sulla trasparenza delle operazioni di finanziamento tramite titoli e del riutilizzo e che modifica il regolamento (UE) n. 648/2012 <sup>(1)</sup>, in particolare l'articolo 4, paragrafo 10,

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 6,

considerando quanto segue:

- (1) Le informazioni che le controparti delle operazioni di finanziamento tramite titoli (SFT) segnalano ai repertori di dati sulle negoziazioni o all'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (ESMA) dovrebbero essere presentate in un formato armonizzato per agevolare la raccolta, l'aggregazione e la comparazione dei dati detenuti dai diversi repertori di dati sulle negoziazioni. Per ridurre al minimo i costi per le controparti segnalanti, il formato di segnalazione delle SFT dovrebbe essere per quanto possibile coerente con quello previsto per la segnalazione dei contratti derivati ai sensi dell'articolo 9 del regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio. Pertanto, il presente regolamento stabilisce il formato per ciascuno dei campi oggetto di segnalazione e definisce una segnalazione standard con riferimento a una norma ISO che trova ampio impiego nel settore finanziario.
- (2) Il sistema globale di identificazione delle entità giuridiche (codice LEI) è ormai integralmente attuato e ogni controparte di una SFT dovrebbe quindi utilizzare esclusivamente tale sistema per identificare un'entità giuridica in una segnalazione. Affinché l'utilizzo del sistema LEI a opera della controparte sia efficace, la controparte in questione dovrebbe garantire che i dati di riferimento inerenti al suo LEI vengano rinnovati conformemente alle condizioni di un emittente LEI accreditato (unità operativa locale). L'estensione del sistema LEI globale per identificare le succursali delle entità giuridiche è attualmente in fase di definizione. Fino al momento in cui tale estensione sarà stata finalizzata e considerata idonea ai fini della segnalazione delle SFT e il presente regolamento sarà stato modificato di conseguenza, per identificare la succursale nella quale una SFT è conclusa tramite una succursale di una controparte dovrebbe essere utilizzato il codice ISO del paese nel quale è ubicata la succursale.
- (3) È in fase di definizione anche un sistema globale di identificazione unica dell'operatore (UTI) per identificare le SFT. Fino al momento in cui il sistema globale UTI sarà stato finalizzato e considerato idoneo ai fini della segnalazione delle SFT e il presente regolamento sarà stato modificato di conseguenza, per identificare una SFT dovrebbe essere utilizzato un UTI concordato dalle controparti.
- (4) L'articolo 4 bis del regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012 della Commissione <sup>(3)</sup> definisce una procedura per determinare il soggetto responsabile della generazione dell'UTI in relazione alla segnalazione dei contratti derivati nelle situazioni in cui le controparti non giungono a un accordo sul soggetto responsabile della generazione dell'UTI. Per garantire la coerenza tra le segnalazioni relative ai contratti derivati e quelle relative alle SFT, dovrebbe essere istituita una procedura analoga per le controparti che segnalano le SFT.

<sup>(1)</sup> GUL 337 del 23.12.2015, pag. 1.

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

<sup>(3)</sup> 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).

- (5) Attualmente non esiste una comune prassi di mercato per determinare il lato della controparte in una SFT. Dovrebbero perciò essere stabilite norme specifiche per assicurare che il datore e il beneficiario della garanzia reale in una SFT vengano individuati in modo preciso e coerente.
- (6) Per una singola SFT è possibile che venga presentata una serie di segnalazioni, ad esempio se a tale SFT vengono apportate modifiche successive. Per assicurare la corretta comprensione di ciascuna segnalazione relativa a una SFT e di ciascuna SFT nel suo complesso, le segnalazioni dovrebbero essere presentate nell'ordine cronologico degli eventi segnalati.
- (7) Per rendere meno gravosa la segnalazione della modifica di determinati valori, e in particolare dei dati concernenti il valore della garanzia, il margine fornito o ricevuto e il riutilizzo della garanzia, tali dati dovrebbero essere segnalati secondo la situazione a fine giornata soltanto se variano rispetto ai dati segnalati in precedenza.
- (8) I dati concernenti un prestito su margine in essere dovrebbero essere segnalati secondo la situazione a fine giornata, laddove esista un addebito di cassa netto nella valuta di base o laddove il valore di mercato della posizione corta di una controparte sia positivo.
- (9) Il valore di mercato dei titoli concessi o assunti in prestito dovrebbe essere segnalato secondo la situazione a fine giornata. Analogamente, quando le controparti segnalano il valore di mercato della garanzia, dovrebbero farlo secondo la situazione a fine giornata.
- (10) Il presente regolamento si basa sui progetti di norme tecniche di attuazione che l'ESMA ha presentato alla Commissione conformemente alla procedura di cui all'articolo 15 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) (\*).
- (11) L'ESMA ha effettuato consultazioni pubbliche aperte sui progetti 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 del regolamento (UE) n. 1095/2010.
- (12) Come per la segnalazione delle SFT, taluni identificativi e codici da utilizzare per la segnalazione dei contratti derivati sono ancora in fase di definizione. Fino al momento in cui tali identificativi e codici saranno disponibili e saranno considerati idonei ai fini della segnalazione e il regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012 sarà stato modificato di conseguenza, tale regolamento prevede che per classificare i derivati per i quali non è disponibile né codice ISIN secondo ISO 6166 né codice AII venga utilizzato un codice CFI secondo ISO 10692, e che per identificare la segnalazione di un derivato venga utilizzato un identificativo unico dell'operazione concordato dalle controparti. Per garantire la certezza del diritto riguardo alla procedura appropriata per modificare i requisiti applicabili alla segnalazione dei contratti derivati, nonché il necessario livello di coerenza fra la segnalazione dei derivati e la segnalazione delle SFT, il regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012 dovrebbe rinviare unicamente ai requisiti attualmente applicabili a tale segnalazione.
- (13) È opportuno pertanto modificare di conseguenza il regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012,

HA ADOTTATO IL PRESENTE REGOLAMENTO:

#### *Articolo 1*

### **Standard e formati dei dati relativi alle segnalazioni delle SFT**

Le informazioni relative a una SFT oggetto di segnalazione ai sensi dell'articolo 4, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2015/2365 sono fornite secondo gli standard e i formati specificati nelle tabelle da 1 a 5 dell'allegato I. Tale segnalazione è trasmessa in forma elettronica uniforme e leggibile da dispositivo elettronico e in un modello XML uniforme secondo la metodologia ISO 20022.

(\*) GUL 331 del 15.12.2010, pag. 84.

*Articolo 2***Identificazione delle controparti e di altri soggetti**

1. Nella segnalazione di cui all'articolo 1 è utilizzato come identificativo della persona giuridica (LEI) il codice ISO 17442 per identificare:
  - a) il beneficiario, se persona giuridica;
  - b) l'intermediario;
  - c) la controparte centrale (CCP) autorizzata ai sensi del regolamento (UE) n. 648/2012;
  - d) il partecipante diretto;
  - e) l'agente mutuante;
  - f) il partecipante del depositario centrale di titoli (CSD);
  - g) la controparte, se persona giuridica;
  - h) l'agente *triparty*;
  - i) il soggetto che trasmette la segnalazione;
  - j) l'emittente di un titolo che è stato concesso o assunto in prestito o fornito come garanzia in una SFT.
2. La controparte di una SFT provvede a rinnovare i dati di riferimento inerenti al suo codice LEI secondo ISO 17442 conformemente alle condizioni di qualsivoglia unità operativa locale accreditata del sistema LEI globale.
3. Laddove la SFT è conclusa tramite una succursale di una controparte, per identificare tale succursale nella segnalazione di cui all'articolo 1 è utilizzato il codice specificato nel campo 7 e nel campo 8 della tabella 1 dell'allegato I.

*Articolo 3***Identificativo unico dell'operazione**

1. La segnalazione è identificata mediante un identificativo unico dell'operazione (UTI) concordato dalle controparti nel formato specificato nel campo 1 della tabella 2 dell'allegato I.
2. In caso di mancato accordo sul soggetto responsabile della generazione dell'UTI da assegnare alla segnalazione, le controparti determinano il soggetto responsabile della generazione dell'UTI come segue:
  - a) per le SFT eseguite e compensate a livello centrale, l'UTI è generato nel punto di compensazione dalla CCP per il partecipante diretto. Un altro UTI è generato dal partecipante diretto per la sua controparte;
  - b) per le SFT eseguite a livello centrale ma non compensate a livello centrale, l'UTI è generato dalla sede di esecuzione per il suo partecipante;
  - c) per le SFT confermate e compensate a livello centrale, l'UTI è generato dalla CCP per il partecipante diretto nel punto di compensazione. Un altro UTI è generato dal partecipante diretto per la sua controparte;
  - d) per le SFT confermate a livello centrale mediante mezzi elettronici ma non compensate a livello centrale, l'UTI è generato dalla piattaforma di conferma dell'operazione nel punto di conferma;
  - e) per tutte le SFT diverse da quelle di cui alle lettere da a) a d) si applica quanto segue:
    - i) per le SFT concluse tra controparti finanziarie e controparti non finanziarie, l'UTI è generato dalle controparti finanziarie;
    - ii) per tutte le operazioni di concessione o assunzione di titoli in prestito diverse da quelle di cui al punto i), l'UTI è generato dal datore della garanzia di cui all'articolo 4;

- iii) per tutte le SFT diverse da quelle di cui ai punti i) e ii), l'UTI è generato dal beneficiario della garanzia di cui all'articolo 4.
3. La controparte che genera l'UTI lo comunica all'altra controparte in tempo utile affinché quest'ultima possa adempiere agli obblighi di segnalazione.

#### Articolo 4

##### Lato della controparte

1. Il lato della controparte della SFT di cui al campo 9 della tabella 1 dell'allegato I è identificato conformemente ai paragrafi da 2 a 4.
2. Per le operazioni di vendita con patto di riacquisto e le operazioni di *buy-sell back* e di *sell-buy back*, la controparte che acquista titoli, merci o diritti garantiti riguardanti la proprietà di titoli o merci nell'*opening leg (spot leg)* dell'operazione e si impegna a venderli a un determinato prezzo a una data futura nella *closing leg (forward leg)* dell'operazione è identificata come beneficiario della garanzia nel campo 9 della tabella 1 dell'allegato I. La controparte che vende tali titoli, merci o diritti garantiti è identificata come datore della garanzia nel campo 9 della tabella 1 dell'allegato I.
3. Per le operazioni di assunzione di titoli o merci in prestito e le operazioni di concessione di titoli o merci in prestito, la controparte che concede i titoli o le merci in prestito a condizione che il prestatore restituisca titoli o merci equivalenti a una data futura o su richiesta del cedente è identificata come beneficiario della garanzia nel campo 9 della tabella 1 dell'allegato I. La controparte che assume tali titoli o merci in prestito è identificata come datore della garanzia nel campo 9 della tabella 1 dell'allegato I.
4. Per le operazioni di finanziamento con margini, il prestatore, ossia la controparte alla quale è concesso un credito in cambio di una garanzia, è identificato come datore della garanzia nel campo 9 della tabella 1 dell'allegato I. Il prestatore, ossia la controparte che concede il credito in cambio di una garanzia, è identificato come beneficiario della garanzia nel campo 9 della tabella 1 dell'allegato I.

#### Articolo 5

##### Frequenza delle segnalazioni relative alle SFT

1. Tutte le segnalazioni delle informazioni relative a una SFT di cui all'articolo 1, paragrafo 2, del regolamento delegato (UE) 2019/356 <sup>(5)</sup> sono presentate nell'ordine cronologico degli eventi segnalati.
2. La controparte di un'operazione di finanziamento con margini segnala le informazioni sul prestito su margine in essere secondo la situazione a fine giornata, laddove esiste un addebito di cassa netto nella valuta di base o laddove il valore di mercato della posizione corta di una controparte è positivo.
3. La controparte di una SFT in essere segnala ogni modifica dei dati relativi alla garanzia nei campi da 75 a 94 della tabella 2 dell'allegato I con l'azione «*Collateral update*» (Aggiornamento della garanzia reale). La controparte segnala tali dati modificati secondo la situazione a fine giornata fino a quando segnala la cessazione della SFT, oppure segnala la SFT con l'azione «*Error*» (Errore), oppure fino a quando la SFT raggiunge la sua data di scadenza, se questa data è anteriore.
4. La controparte di una SFT in essere segnala ogni modifica del valore di mercato a fine giornata dei titoli concessi o assunti in prestito nel campo 57 della tabella 2 dell'allegato I con l'azione «*Valuation update*» (Aggiornamento della valutazione). La controparte segnala il valore di mercato modificato secondo la situazione a fine giornata fino a quando segnala la cessazione della SFT, oppure segnala la SFT con l'azione «*Error*» (Errore), oppure fino a quando la SFT raggiunge la sua data di scadenza.

<sup>(5)</sup> Regolamento delegato (UE) 2019/356 della Commissione, del 13 dicembre 2018, che integra il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione che precisano le informazioni sulle operazioni di finanziamento tramite titoli da segnalare ai repertori di dati sulle negoziazioni (cfr. pag. 1 della presente Gazzetta ufficiale).

5. La controparte segnala ogni modifica dell'importo totale del margine fornito o ricevuto per tutte le SFT compensate secondo la situazione a fine giornata nei campi da 8 a 19 della tabella 3 dell'allegato I con l'azione «*Margin update*» (Aggiornamento del margine) dopo aver prima segnalato l'importo totale del margine fornito o ricevuto con l'azione «*New*» (Nuova).

6. La controparte segnala ogni modifica del valore della garanzia riutilizzata, del contante reinvestito e delle fonti di finanziamento con l'azione «*Reuse update*» (Aggiornamento del riutilizzo) secondo la situazione a fine giornata nei campi da 8 a 14 della tabella 4 dell'allegato I, dopo aver segnalato i pertinenti valori con l'azione «*New*» (Nuova).

#### Articolo 6

### Modifiche del regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012

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

1) l'articolo 4 è così modificato:

a) il paragrafo 7 è sostituito dal seguente:

«Il derivato è classificato 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.»;

b) i paragrafi 8 e 9 sono soppressi;

2) all'articolo 4 bis, il paragrafo 1 è sostituito dal seguente:

«1. La segnalazione è identificata mediante un identificativo unico dell'operazione concordato dalle controparti.»;

3) l'allegato è sostituito dal testo che figura nell'allegato II del presente regolamento.

#### Articolo 7

### 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 13 dicembre 2018

Per la Commissione

Il presidente

Jean-Claude JUNCKER

---

## ALLEGATO I

**Formati da utilizzare per segnalare le informazioni relative alle operazioni di finanziamento  
tramite titoli, di cui all'articolo 4, paragrafi 1 e 5, del regolamento (UE) 2015/2365**

Tabella 1

**Dati sulla controparte**

N.	Campo	Formato
1	Data e ora della segnalazione	Formato della data secondo ISO 8601 e formato dell'ora secondo il Tempo Universale Coordinato (UTC), ossia AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ
2	Soggetto che trasmette la segnalazione	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
3	Controparte segnalante	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
4	Natura della controparte segnalante	«F» — controparte finanziaria «N» — controparte non finanziaria
5	Settore della controparte segnalante	Tassonomia delle controparti finanziarie: «CDTI» — ente creditizio autorizzato ai sensi della direttiva 2013/36/UE del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(1)</sup> o del regolamento (UE) n. 1024/2013 del Consiglio <sup>(2)</sup> oppure entità di un paese terzo che richiederebbe l'autorizzazione o la registrazione ai sensi di tale atto legislativo «INVF» — impresa di investimento autorizzata ai sensi della direttiva 2014/65/UE del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(3)</sup> oppure entità di un paese terzo che richiederebbe l'autorizzazione o la registrazione ai sensi di tale atto legislativo «INUN» — impresa di assicurazione autorizzata ai sensi della direttiva 2009/138/CE del Parlamento europeo e del Consiglio (solvibilità II) <sup>(4)</sup> oppure entità di un paese terzo che richiederebbe l'autorizzazione o la registrazione ai sensi di tale atto legislativo «AIFD» — fondo di investimento alternativo gestito da GEFIA autorizzati o registrati ai sensi della direttiva 2011/61/UE del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(5)</sup> oppure entità di un paese terzo che richiederebbe l'autorizzazione o la registrazione ai sensi di tale atto legislativo «ORPI» — ente pensionistico aziendale o professionale autorizzato o registrato ai sensi della direttiva 2003/41/CE del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(6)</sup> oppure entità di un paese terzo che richiederebbe l'autorizzazione o la registrazione ai sensi di tale atto legislativo «CCPS» — controparte centrale autorizzata ai sensi del regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(7)</sup> oppure entità di un paese terzo che richiederebbe l'autorizzazione o la registrazione ai sensi di tale atto legislativo «REIN» — impresa di riassicurazione autorizzata ai sensi della direttiva Solvibilità II oppure entità di un paese terzo che richiederebbe l'autorizzazione o la registrazione ai sensi di tale atto legislativo «CSDS» — depositario centrale di titoli autorizzato ai sensi del regolamento (UE) n. 909/2014 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(8)</sup> oppure entità di un paese terzo che richiederebbe l'autorizzazione o la registrazione ai sensi di tale atto legislativo «UCIT» — OICVM e relativa società di gestione, autorizzati ai sensi della direttiva 2009/65/CE del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(9)</sup> oppure entità di un paese terzo che richiederebbe l'autorizzazione o la registrazione ai sensi di tale atto legislativo

N.	Campo	Formato
		<p>Tassonomia delle controparti non finanziarie. Le categorie seguenti corrispondono alle principali sezioni della classificazione NACE, quale definita dal regolamento (CE) n. 1893/2006 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(10)</sup></p> <p>«A» — agricoltura, silvicoltura e pesca</p> <p>«B» — attività estrattiva</p> <p>«C» — attività manifatturiere</p> <p>«D» — fornitura di energia elettrica, gas, vapore e aria condizionata</p> <p>«E» — fornitura di acqua; reti fognarie, attività di trattamento dei rifiuti e risanamento</p> <p>«F» — costruzioni</p> <p>«G» — commercio all'ingrosso e al dettaglio; riparazione di autoveicoli e motocicli</p> <p>«H» — trasporto e magazzinaggio</p> <p>«I» — servizi di alloggio e di ristorazione</p> <p>«J» — servizi di informazione e comunicazione</p> <p>«K» — attività finanziarie e assicurative</p> <p>«L» — attività immobiliari</p> <p>«M» — attività professionali, scientifiche e tecniche</p> <p>«N» — attività amministrative e di servizi di supporto</p> <p>«O» — amministrazione pubblica e difesa; assicurazione sociale obbligatoria</p> <p>«P» — istruzione</p> <p>«Q» — sanità e assistenza sociale</p> <p>«R» — attività artistiche, di intrattenimento e divertimento</p> <p>«S» — altre attività di servizi</p> <p>«T» — attività di famiglie e convivenze come datori di lavoro per personale domestico; produzione di beni e servizi indifferenziati per uso proprio da parte di famiglie e convivenze</p> <p>«U» — attività di organizzazioni e organismi extraterritoriali</p>
6	Classificazione settoriale supplementare	<p>«ETFT» — ETF (fondo indicizzato quotato)</p> <p>«MMFT» — MMF (fondo del mercato monetario)</p> <p>«REIT» — fondo comune di investimento immobiliare</p> <p>«OTHR» — <i>Other</i> (altro)</p>
7	Succursale della controparte segnalante	Codice paese alpha—2 secondo ISO 3166-1 di 2 caratteri alfabetici
8	Succursale dell'altra controparte	Codice paese alpha-2 secondo ISO 3166-1 di 2 caratteri alfabetici
9	Lato della controparte	<p>«TAKE» — <i>Collateral taker</i> (beneficiario della garanzia)</p> <p>«GIVE» — <i>Collateral provider</i> (datore della garanzia)</p>
10	Soggetto responsabile della segnalazione	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
11	Altra controparte	<p>Codice LEI (<i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici.</p> <p>Codice cliente (massimo 50 caratteri alfanumerici).</p>
12	Paese dell'altra controparte	Codice paese alpha-2 secondo ISO 3166-1 di 2 caratteri alfabetici

N.	Campo	Formato
13	Beneficiario	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici. Codice cliente (massimo 50 caratteri alfanumerici).
14	Agente triparty	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
15	Intermediario	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
16	Partecipante diretto	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
17	Partecipante o partecipante indiretto di depositari centrali di titoli («CSD»)	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
18	Agente mutuante	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici

- (<sup>1</sup>) 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 (GU L 176 del 27.6.2013, pag. 338).
- (<sup>2</sup>) Regolamento (UE) n. 1024/2013 del Consiglio, del 15 ottobre 2013, che attribuisce alla Banca centrale europea compiti specifici in merito alle politiche in materia di vigilanza prudenziale degli enti creditizi (GU L 287 del 29.10.2013, pag. 63).
- (<sup>3</sup>) Direttiva 2014/65/UE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 15 maggio 2014, relativa ai mercati degli strumenti finanziari (GU L 173 del 12.6.2014, pag. 349).
- (<sup>4</sup>) 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).
- (<sup>5</sup>) Direttiva 2011/61/UE del Parlamento europeo e del Consiglio, dell'8 giugno 2011, sui gestori di fondi di investimento alternativi (GU L 174 dell'1.7.2011, pag. 1).
- (<sup>6</sup>) 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).
- (<sup>7</sup>) 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 (GU L 201 del 27.7.2012, pag. 1).
- (<sup>8</sup>) Regolamento (UE) n. 909/2014 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 23 luglio 2014, relativo al miglioramento del regolamento titoli nell'Unione europea e ai depositari centrali di titoli (GU L 257 del 28.8.2014, pag. 1).
- (<sup>9</sup>) 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).
- (<sup>10</sup>) 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 (GU L 393 del 30.12.2006, pag. 1).

Tabella 2

## Dati sul prestito e sulla garanzia reale

N.	Campo	Formato
1	Identificativo unico dell'operazione (UTI)	Codice di massimo 52 caratteri alfanumerici, tra cui quattro caratteri speciali: Sono ammessi soltanto i caratteri alfabetici maiuscoli da A a Z (comprese queste due lettere) e le cifre da 0 a 9 (comprese queste due cifre).
2	Numero di tracciamento della segnalazione	Codice di massimo 52 caratteri alfanumerici, tra cui quattro caratteri speciali: Sono ammessi soltanto i caratteri alfabetici maiuscoli da A a Z (comprese queste due lettere) e le cifre da 0 a 9 (comprese queste due cifre).
3	Data dell'evento	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
4	Tipo di SFT	«SLEB» — <i>securities or commodities lending or securities or commodities borrowing</i> (concessione o assunzione di titoli o merci in prestito) «SBSC» — <i>buy-sell back transaction or sell-buy back transaction</i> (operazione di buy-sell back o di sell-buy back) «REPO» — <i>repurchase transaction</i> (operazione di vendita con patto di riacquisto) «MGLD» — <i>margin lending transaction</i> (finanziamento con margini)



N.	Campo	Formato
5	Compensata	«vero» «falso»
6	Data e ora della compensazione	Formato della data secondo ISO 8601 e formato dell'ora secondo il Tempo Universale Coordinato (UTC), ossia AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ
7	Controparte centrale (CCP)	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
8	Sede di negoziazione	Codice identificativo del mercato ( <i>Market Identifier Code</i> — MIC) secondo ISO 10383 di 4 caratteri alfanumerici. Laddove per una sede di negoziazione esistono MIC per segmenti, è utilizzato il MIC per segmento.
9	Tipo di accordo quadro	«MRAA» — MRA «GMRA» — GMRA «MSLA» — MSLA «GMSL» — GMSLA «ISDA» — ISDA «DERP» — <i>Deutscher Rahmenvertrag für Wertpapierpensionsgeschäfte</i> «CNBR» — <i>China Bond Repurchase Master Agreement</i> «KRRR» — <i>Korea Financial Investment Association (KOFIA) Standard Repurchase Agreement</i> «CARA» — <i>Investment Industry Regulatory Organization of Canada (IIROC) Repurchase/Reverse Repurchase Transaction Agreement</i> «FRFB» — <i>Convention-Cadre Relative aux Operations de Pensions Livrees</i> «CHRA» — <i>Swiss Master Repurchase Agreement</i> «DEMA» — <i>German Master Agreement</i> «JPBR» — <i>Japanese Master Agreement on the Transaction with Repurchase Agreement of the Bonds</i> «ESRA» — <i>Contrato Marco de compraventa y Reporto de valores</i> «OSLA» — <i>Overseas Securities Lending Agreement (OSLA)</i> «MEFI» — <i>Master Equity and Fixed Interest Stock Lending Agreement (MEFISLA)</i> «GESL» — <i>Gilt Edged Stock Lending Agreement (GESLA)</i> «KRSL» — <i>Korean Securities Lending Agreement (KOSLA)</i> «DERD» — <i>Deutscher Rahmenvertrag für Wertpapierdarlehen</i> «AUSL» — <i>Australian Masters Securities Lending Agreement (AMSLA)</i> «JPBL» — <i>Japanese Master Agreement on Lending Transaction of Bonds</i> «JPSL» — <i>Japanese Master Agreement on the Borrowing and Lending Transactions of Share Certificates</i> «BIAG» — <i>bilateral agreement</i> (accordo bilaterale) «CSDA» — <i>CSD bilateral agreement</i> (accordo bilaterale CSD) Oppure «OTHR» (altro) se il tipo di accordo quadro non figura nel precedente elenco
10	Altro tipo di accordo quadro	Massimo 50 caratteri alfanumerici
11	Versione dell'accordo quadro	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA)
12	Data e ora di esecuzione	Formato della data secondo ISO 8601 e formato dell'ora secondo il Tempo Universale Coordinato (UTC), ossia AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ
13	Data di valuta (data di inizio)	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)

N.	Campo	Formato
14	Data di scadenza (data di fine)	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
15	Data di cessazione	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
16	Preavviso minimo	Campo con numero intero di massimo 3 cifre
17	Prima data di richiamo (call-back)	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
18	Indicatore delle garanzie generiche (general collateral)	«SPEC» — <i>specific collateral</i> (garanzia specifica) «GENE» — <i>general collateral</i> (garanzia generica)
19	Indicatore della consegna per valore (delivery by value, DBV)	«vero» «falso»
20	Metodo utilizzato per fornire le garanzie reali	«TTCA» — <i>title transfer collateral arrangement</i> (contratto di garanzia con trasferimento del titolo di proprietà) «SICA» — <i>securities financial collateral arrangement</i> (contratto di garanzia finanziaria con costituzione di garanzia reale) «SIUR» — <i>securities financial collateral arrangement with the right of use</i> (contratto di garanzia finanziaria con costituzione di garanzia reale con diritto di uso)
21	Scadenza aperta	«vero» «falso»
22	Opzione di chiusura	«EGRN» — <i>evergreen</i> «ETSB» — <i>extendable</i> (prorogabile) «NOAP» — <i>non applicable</i> (non pertinente)

Nel caso di finanziamenti con margini, i dati dei campi da 23 a 34 devono essere ripetuti e compilati per ciascuna valuta utilizzata nel prestito su margine.

23	Tasso fisso	Massimo 11 caratteri numerici compresi massimo 10 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.
24	Convenzione sul conteggio dei giorni	Codice della convenzione sul conteggio dei giorni: «A001» — IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule «A002» — IC30365 «A003» — IC30Actual «A004» — Actual360 «A005» — Actual365Fixed «A006» — ActualActualICMA «A007» — IC30E360orEuroBondBasismodel1 «A008» — ActualActualISDA «A009» — Actual365LorActuActubasisRule «A010» — ActualActualAFB «A011» — IC30360ICMAor30360basicrule «A012» — IC30E2360orEurobondbasismodel2 «A013» — IC30E3360orEurobondbasismodel3 «A014» — Actual365NL O massimo 35 caratteri alfanumerici se la convenzione sul conteggio dei giorni non figura nel precedente elenco

N.	Campo	Formato
25	Tasso variabile	Codice dell'indice a tasso variabile «EONA» — EONIA «EONS» — EONIA SWAP ( <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 «NIBO» — NIBOR «PRBO» — PRIBOR «TLBO» — TELBOR «WIBO» — WIBOR «TREA» — <i>Treasury</i> (Tesoro) «SWAP» — <i>swap</i> «FUSW» — <i>Future SWAP</i> ( <i>swap</i> su <i>future</i> ) O massimo 25 caratteri alfanumerici se il tasso di riferimento non figura nel precedente elenco
26	Periodo di riferimento del tasso variabile — periodo	Periodo di tempo che descrive il periodo di riferimento. Si applicano le seguenti abbreviazioni: «YEAR» — anno «MNTH» — <i>month</i> (mese) «WEEK» — settimana «DAYS» — giorno
27	Periodo di riferimento del tasso variabile — moltiplicatore	Un intero multiplo del periodo di tempo che descrive il periodo di riferimento del tasso variabile Massimo 3 caratteri numerici
28	Frequenza di pagamento per il tasso variabile — periodo	Periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti si scambiano i pagamenti. Si applicano le seguenti abbreviazioni: «YEAR» — anno «MNTH» — <i>month</i> (mese) «WEEK» — settimana «DAYS» — giorno
29	Frequenza di pagamento per il tasso variabile — 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

N.	Campo	Formato
30	Frequenza di revisione del tasso variabile — periodo	Periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti rivedono il tasso variabile dei repo. Si applicano le seguenti abbreviazioni: «YEAR» — anno «MNTH» — <i>month</i> (mese) «WEEK» — settimana «DAYS» — giorno
31	Frequenza di revisione del tasso variabile — moltiplicatore	Un intero multiplo del periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti rivedono il tasso variabile dei repo Massimo 3 caratteri numerici
32	Differenziale	Massimo 5 caratteri numerici
33	Importo in valuta dei finanziamenti con margini	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
34	Valuta dei finanziamenti con margini	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici

I campi 35-36 devono essere ripetuti e compilati per ciascuna rettifica del tasso d'interesse variabile.

35	Tasso rettificato	Massimo 11 caratteri numerici compresi massimo 10 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.
36	Data di applicazione del tasso	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
37	Importo del capitale alla data di valuta	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
38	Importo del capitale alla data di scadenza	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
39	Valuta dell'importo del capitale	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
40	Tipo di attività	«SECU» — <i>Securities</i> (titoli) «COMM» — <i>Commodities</i> (merci)
41	Identificativo del titolo	ISIN secondo ISO 6166, codice di 12 caratteri alfanumerici
42	Classificazione del titolo	CFI secondo ISO 10692, codice di 6 caratteri alfabetici

Se una merce è stata concessa o assunta in prestito, la classificazione di tale merce è specificata nei campi 43, 44 e 45.

43	Categoria di prodotti	Sono ammessi solo i valori della colonna «Categoria di prodotti» secondo la tabella della classificazione dei derivati su merci.
----	-----------------------	--

N.	Campo	Formato
44	Sottocategoria di prodotti	Sono ammessi solo i valori della colonna «Sottocategoria di prodotti» secondo la tabella della classificazione dei derivati su merci.
45	Ulteriore sottocategoria di prodotti	Sono ammessi solo i valori della colonna «Ulteriore sottocategoria di prodotti» secondo la tabella della classificazione dei derivati su merci.
46	Quantità o importo nominale	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
47	Unità di misura	«KILO» — Kilogram (chilogrammo), «PIEC» — Piece (pezzo), «TONS» — Ton (tonnellata), «METR» — Metre (metro), «INCH» — Inch (pollice), «YARD» — Yard (iarda), «GBGA» — GBGallon (gallone GB), «GRAM» — Gram (grammo), «CMET» — Centimetre (centimetro), «SMET» — SquareMetre (metro quadrato), «FOOT» — Foot (piede), «MILE» — Mile (miglio), «SQIN» — SquareInch (pollice quadrato), «SQFO» — SquareFoot (piede quadrato), «SQMI» — SquareMile (miglio quadrato), «GBOU» — GBounce (oncia GB), «USOU» — USOunce (oncia USA), «GBPI» — GBPint (pinta GB), «USPI» — USPint (pinta USA), «GBQA» — GBQuart (quarto GB), «USQA» — USQuart (quarto USA), «USGA» — USGallon (gallone USA), «MMET» — Millimetre (millimetro), «KMET» — Kilometre (chilometro), «SQYA» — SquareYard (iarda quadrata) «ACRE» — Acre (acro), «ARES» — Are (ara), «SMIL» — SquareMillimetre (millimetro quadrato), «SCMT» — SquareCentimetre (centimetro quadrato), «HECT» — Hectare (ettaro), «SQKI» — SquareKilometre (chilometro quadrato), «MILI» — MilliLitre (millilitro), «CEL» — Centilitre (centilitro), «LITR» — Litre (litro), «PUND» — Pound (libbra), «ALOW» — Allowances (quote), «ACCY» — AmountOfCurrency (importo in valuta), «BARL» — Barrels (barili), «BCUF» — BillionCubicFeet (miliardi di piedi cubi), «BDFT» — BoardFeet (piedi tavolari), «BUSL» — Bushels (stai), «CEER» — CertifiedEmissionsReduction (riduzione certificata delle emissioni), «CLRT» — ClimateReserveTonnes (tonnellate di riserva per il clima), «CBME» — CubicMeters (metri cubi), «DAYS» — Days (giorni), «DMET» — DryMetricTons (tonnellate metriche secche), «ENVC» — EnvironmentalCredit (credito ambientale), «ENVO» — EnvironmentalOffset (compensazione ambientale) «HUWG» — Hundredweight (cental), «KWDC» — KilowattDayCapacity (capacità in kilowatt-giorno), «KWHO» — KilowattHours (kilowattora), «KWHC» — KilowattHoursCapacity (capacità in kilowattora), «KMOC» — KilowattMinuteCapacity (capacità in kilowatt-minuto), «KWMC» — KilowattMonthCapacity (capacità in kilowatt-mese), «KWYC» — KilowattYearCapacity (capacità in kilowatt-anno), «MWDC» — MegawattDayCapacity (capacità in megawatt-giorno), «MWHO» — MegawattHours (megawattora), «MWHC» — MegawattHoursCapacity (capacità in megawattora), «MWMC» — MegawattMinuteCapacity (capacità in megawatt-minuto), «MMOC» — MegawattMonthCapacity (capacità in megawatt-mese), «MWYC» — MegawattYearCapacity (capacità in megawatt-anno), «TONE» — MetricTons (tonnellate metriche), «MIBA» — MillionBarrels (milioni di barili), «MBTU» — OneMillionBTU (un milione di BTU), «OZTR» — TroyOunces (once troy), «UCWT» — USHundredweight (cental USA), «IPNT» — IndexPoint (punto indice), «PWRD» — PrincipalWithRelationToDebtInstrument (capitale relativo allo strumento di debito), «DGEU» — DieselGallonEquivalent (gallone diesel equivalente), «GGEU» — GasolineGallonEquivalent (gallone benzina equivalente), «TOCD» — TonsOfCarbonDioxide (tonnellate di anidride carbonica).
48	Valuta dell'importo nominale	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
49	Prezzo del titolo o della merce	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali se il prezzo è espresso in unità. Massimo 11 caratteri numerici compresi massimo 10 decimali se il prezzo è espresso in percentuale o rendimento. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
50	Valuta del prezzo	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici

N.	Campo	Formato
51	Qualità del titolo	«INVG» — <i>Investment grade</i> «NIVG» — <i>Non-investment grade</i> «NOTR» — <i>Non-rated</i> (privo di rating) «NOAP» — <i>Not applicable</i> (non pertinente)
52	Scadenza del titolo	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
53	Giurisdizione dell'emittente	Codice paese alpha-2 secondo ISO 3166-1 di 2 caratteri alfabetici
54	LEI dell'emittente	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
55	Tipo di titolo	«GOVS» — <i>Government securities</i> (titoli di Stato) «SUNS» — <i>Supra-nationals and agencies securities</i> (titoli sovranazionali e di agenzie) «FIDE» — <i>Debt securities (including covered bonds) issued by banks and other financial institutions</i> (titoli di debito, comprese le obbligazioni garantite, emessi da banche e altri enti finanziari) «NFID» — <i>Corporate debt securities (including covered bonds) issued by non-financial institutions</i> (titoli di debito societario, comprese le obbligazioni garantite, emessi da enti non finanziari) «SEPR» — <i>Securitized products (including CDO, CMBS, ABCP)</i> (prodotti cartolarizzati, compresi CDO, CMBS, ABCP) «MEQU» — <i>Main index equities (including convertible bonds)</i> (strumenti di capitale inclusi in un listino principale, comprese le obbligazioni convertibili) «OEQU» — <i>Other equities (including convertible bonds)</i> (altri strumenti di capitale, comprese le obbligazioni convertibili) «OTHR» — <i>Other assets (including shares in mutual funds)</i> (altre attività, comprese le quote di fondi comuni di investimento)
56	Valore del prestito	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
57	Valore di mercato	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
58	Tasso di rimborso fisso	Massimo 11 caratteri numerici compresi massimo 10 decimali espressi in percentuale, dove il 100 % è rappresentato da «100». Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.
59	Tasso di rimborso variabile	Codice dell'indice a tasso variabile «EONA» — EONIA «EONS» — EONIA SWAP ( <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

N.	Campo	Formato
		«JIBA» — JIBAR «BUBO» — BUBOR «CDOR» — CDOR «CIBO» — CIBOR «MOSP» — MOSPRIM «NIBO» — NIBOR «PRBO» — PRIBOR «TLBO» — TELBOR «WIBO» — WIBOR «TREA» — <i>Treasury</i> (Tesoro) «SWAP» — <i>swap</i> «FUSW» — <i>Future SWAP (swap su future)</i> O massimo 25 caratteri alfanumerici se il tasso di riferimento non figura nel precedente elenco
60	Periodo di riferimento del tasso di rimborso variabile — periodo	Periodo di tempo che descrive il periodo di riferimento. Si applicano le seguenti abbreviazioni: «YEAR» — anno «MNTH» — <i>month</i> (mese) «WEEK» — settimana «DAYS» — giorno
61	Periodo di riferimento del tasso di rimborso variabile — moltiplicatore	Un intero multiplo del periodo di tempo che descrive il periodo di riferimento del tasso di rimborso variabile Massimo 3 caratteri numerici
62	Frequenza di pagamento per il tasso di rimborso variabile — periodo	Periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti si scambiano i pagamenti. Si applicano le seguenti abbreviazioni: «YEAR» — anno «MNTH» — <i>month</i> (mese) «WEEK» — settimana «DAYS» — giorno
63	Frequenza di pagamento per il tasso di rimborso variabile — 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
64	Frequenza di revisione del tasso di rimborso variabile — periodo	Periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti rivedono il tasso di rimborso variabile. Si applicano le seguenti abbreviazioni: «YEAR» — anno «MNTH» — <i>month</i> (mese) «WEEK» — settimana «DAYS» — giorno
65	Frequenza di revisione del tasso di rimborso variabile — moltiplicatore	Un intero multiplo del periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti rivedono il tasso di rimborso variabile Massimo 3 caratteri numerici
66	Differenziale del tasso di rimborso	Massimo 5 caratteri numerici
67	Commissione sul prestito	Massimo 11 caratteri numerici compresi massimo 10 decimali espressi in percentuale, dove il 100 % è rappresentato da «100».

N.	Campo	Formato
68	Accordi di esclusiva	«vero» «falso»
69	Prestito su margine in essere	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
70	Valuta di base del prestito su margine in essere	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
71	Valore di mercato della posizione corta	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.

## Dati sulla garanzia reale

72	Contrassegno Prestito titoli «Securities Lending» — «SL») non garantito	«vero» «falso»
73	Copertura dell'esposizione netta	«vero» «falso»
74	Data di valuta della garanzia	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)

Se è stata utilizzata una garanzia reale specifica, i campi da 75 a 94 devono essere ripetuti e compilati per ogni componente della garanzia, se del caso.

75	Tipo di componente della garanzia reale	«SECU» — <i>Securities</i> (titoli) «COMM» — <i>Commodities</i> (merci) (soltanto per operazioni di vendita con patto di riacquisto, concessione o assunzione di titoli o merci in prestito e buy-sell back) «CASH» — contante
----	---	--

Se è stato utilizzato il contante come garanzia, ciò viene specificato nei campi 76 e 77.

76	Importo delle garanzie in contante	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
77	Valuta della garanzia in contante	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
78	Identificazione del titolo utilizzato come garanzia	ISIN secondo ISO 6166, codice di 12 caratteri alfanumerici
79	Classificazione del titolo utilizzato come garanzia	CFI secondo ISO 10692, codice di 6 caratteri alfabetici



N.	Campo	Formato
Se una merce è stata usata come garanzia, la classificazione di tale merce è specificata nei campi 80, 81 e 82.		
80	Categoria di prodotti	Sono ammessi solo i valori della colonna «Categoria di prodotti» secondo la tabella della classificazione dei derivati su merci.
81	Sottocategoria di prodotti	Sono ammessi solo i valori della colonna «Sottocategoria di prodotti» secondo la tabella della classificazione dei derivati su merci.
82	Ulteriore sottocategoria di prodotti	Sono ammessi solo i valori della colonna «Ulteriore sottocategoria di prodotti» secondo la tabella della classificazione dei derivati su merci.
83	Quantità o importo nominale della garanzia	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
84	Unità di misura della garanzia reale	«KILO» — Kilogram (chilogrammo), «PIEC» — Piece (pezzo), «TONS» — Ton (tonnellata), «METR» — Metre (metro), «INCH» — Inch (pollice), «YARD» — Yard (iarda), «GBGA» — GBGallon (gallone GB), «GRAM» — Gram (grammo), «CMET» — Centimetre (centimetro), «SMET» — SquareMetre (metro quadrato), «FOOT» — Foot (piede), «MILE» — Mile (miglio), «SQIN» — SquareInch (pollice quadrato), «SQFO» — SquareFoot (piede quadrato), «SQMI» — SquareMile (miglio quadrato), «GBOU» — GBounce (oncia GB), «USOU» — USOunce (oncia USA), «GBPI» — GBPint (pinta GB), «USPI» — USPint (pinta USA), «GBQA» — GBQuart (quarto GB), «USQA» — USQuart (quarto USA), «USGA» — USGallon (gallone USA), «MMET» — Millimetre (millimetro), «KMET» — Kilometre (chilometro), «SQYA» — SquareYard (iarda quadrata), «ACRE» — Acre (acro), «ARES» — Are (ara), «SMIL» — SquareMillimetre (millimetro quadrato), «SCMT» — SquareCentimetre (centimetro quadrato), «HECT» — Hectare (ettaro), «SQKI» — SquareKilometre (chilometro quadrato), «MILL» — MilliLitre (millilitro), «CELL» — Centilitre (centilitro), «LITR» — Litre (litro), «PUND» — Pound (libbra), «ALOW» — Allowances (quote), «ACCY» — AmountOfCurrency (importo in valuta), «BARL» — Barrels (barili), «BCUF» — BillionCubicFeet (miliardi di piedi cubi), «BDFT» — BoardFeet (piedi tavolari), «BUSL» — Bushels (stai), «CEER» — CertifiedEmissionsReduction (riduzione certificata delle emissioni), «CLRT» — ClimateReserveTonnes (tonnellate di riserva per il clima), «CBME» — CubicMeters (metri cubi), «DAYS» — Days (giorni), «DMET» — DryMetricTons (tonnellate metriche secche), «ENVC» — EnvironmentalCredit (credito ambientale), «ENVO» — EnvironmentalOffset (compensazione ambientale) «HUWG» — Hundredweight (cental), «KWDC» — KilowattDayCapacity (capacità in kilowatt-giorno), «KWHO» — KilowattHours (kilowattora), «KWHC» — KilowattHoursCapacity (capacità in kilowattora), «KMOC» — KilowattMinuteCapacity (capacità in kilowatt-minuto), «KWMC» — KilowattMonthCapacity (capacità in kilowatt-mese), «KWYC» — KilowattYearCapacity (capacità in kilowatt-anno), «MWDC» — MegawattDayCapacity (capacità in megawatt-giorno), «MWHO» — MegawattHours (megawattora), «MWHC» — MegawattHoursCapacity (capacità in megawattora), «MWMC» — MegawattMinuteCapacity (capacità in megawatt-minuto), «MMOC» — MegawattMonthCapacity (capacità in megawatt-mese), «MWYC» — MegawattYearCapacity (capacità in megawatt-anno), «TONE» — MetricTons (tonnellate metriche), «MIBA» — MillionBarrels (milioni di barili), «MBTU» — OneMillionBTU (un milione di BTU), «OZTR» — TroyOunces (once troy), «UCWT» — USHundredweight (cental USA), «IPNT» — IndexPoint (punto indice), «PWRD» — PrincipalWithRelationToDebtInstrument (capitale relativo allo strumento di debito), «DGEU» — DieselGallonEquivalent (gallone diesel equivalente), «GGEU» — GasolineGallonEquivalent (gallone benzina equivalente), «TOCD» — TonsOfCarbonDioxide (tonnellate di anidride carbonica).
85	Valuta dell'importo nominale della garanzia reale	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
86	Valuta del prezzo	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
87	Prezzo unitario	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali se il prezzo è espresso in unità. Massimo 11 caratteri numerici compresi massimo 10 decimali se il prezzo è espresso in percentuale o rendimento. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.

N.	Campo	Formato
88	Valore di mercato della garanzia reale	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
89	Scarto o margine	Massimo 11 caratteri numerici compresi massimo 10 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.
90	Qualità della garanzia reale	«INVG» — <i>Investment grade</i> «NIVG» — <i>Non-investment grade</i> «NOTR» — <i>Non-rated</i> (privo di rating) «NOAP» — <i>Not applicable</i> (non pertinente)
91	Data di scadenza del titolo	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
92	Giurisdizione dell'emittente	Codice paese alpha-2 secondo ISO 3166-1 di 2 caratteri alfabetici
93	LEI dell'emittente	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
94	Tipo di garanzia reale	«GOVS» — <i>Government securities</i> (titoli di Stato) «SUNS» — <i>Supra-nationals and agencies securities</i> (titoli sovranazionali e di agenzie) «FIDE» — <i>Debt securities (including covered bonds) issued by banks and other financial institutions</i> (titoli di debito, comprese le obbligazioni garantite, emessi da banche e altri enti finanziari) «NFID» — <i>Corporate debt securities (including covered bonds) issued by non-financial institutions</i> (titoli di debito societario, comprese le obbligazioni garantite, emessi da enti non finanziari) «SEPR» — <i>Securitized products (including CDO, CMBS, ABCP)</i> (prodotti cartolarizzati, compresi CDO, CMBS, ABCP) «MEQU» — <i>Main index equities (including convertible bonds)</i> (strumenti di capitale inclusi in un listino principale, comprese le obbligazioni convertibili) «OEQU» — <i>Other equities (including convertible bonds)</i> (altri strumenti di capitale, comprese le obbligazioni convertibili) «OTHR» — <i>Other assets (including shares in mutual funds)</i> (altre attività, comprese le quote di fondi comuni di investimento)
95	Possibilità di riutilizzare la garanzia reale	«vero» «falso»
<p>Compilare il campo 96 in caso di utilizzo di un paniere di garanzie. Nei campi da 75 a 94 va specificata l'allocazione dettagliata delle garanzie reali per le SFT concluse a fronte di un aggregato di garanzie, se disponibile.</p>		
96	Identificativo del paniere di garanzie reali	ISIN secondo ISO 6166, codice di 12 caratteri alfanumerici, oppure «NTAV»
97	Codice del portafoglio	Codice di 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.
98	Tipo di azione	«NEWT» — <i>New</i> (nuova) «MODI» — <i>Modification</i> (modifica) «VALU» — <i>Valuation</i> (valutazione) «COLU» — <i>Collateral update</i> (aggiornamento della garanzia) «EROR» — <i>Error</i> (errore) «CORR» — <i>Correction</i> (correzione)

N.	Campo	Formato
		«ETRM» — <i>Termination/Early Termination</i> (cessazione/cessazione anticipata) «POSC» — <i>Position component</i> (componente della posizione)
99	Livello	«TCTN» — <i>Transaction</i> (operazione) «PSTN» — <i>Position</i> (posizione)

Tabella 3

**Dati sui margini**

N.	Campo	Formato
1	Data e ora della segnalazione	Formato della data secondo ISO 8601 e formato dell'ora secondo il Tempo Universale Coordinato (UTC), ossia AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ
2	Data dell'evento	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
3	Soggetto che trasmette la segnalazione	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
4	Controparte segnalante	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
5	Soggetto responsabile della segnalazione	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
6	Altra controparte	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
7	Codice del portafoglio	Codice di 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.
8	Margine iniziale costituito	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
9	Valuta del margine iniziale costituito	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
10	Margine di variazione costituito	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
11	Valuta del margine di variazione costituito	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
12	Margine iniziale ricevuto	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
13	Valuta del margine iniziale ricevuto	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
14	Margine di variazione ricevuto	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.

N.	Campo	Formato
15	Valuta del margine di variazione ricevuto	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
16	Garanzia costituita in eccesso	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
17	Valuta della garanzia costituita in eccesso	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
18	Garanzia ricevuta in eccesso	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
19	Valuta della garanzia ricevuta in eccesso	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
20	Tipo di azione	«NEWT» — <i>New</i> (nuova) «MARU» — <i>Margin update</i> (aggiornamento del margine) «EROR» — <i>Error</i> (errore) «CORR» — <i>Correction</i> (correzione)

Tabella 4

**Dati sul riutilizzo, sul reinvestimento del contante e sulle fonti di finanziamento**

N.	Campo	Formato
1	Data e ora della segnalazione	Formato della data secondo ISO 8601 e formato dell'ora secondo UTC, ossia AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ
2	Data dell'evento	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
3	Soggetto che trasmette la segnalazione	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
4	Controparte segnalante	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
5	Soggetto responsabile della segnalazione	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici

Il campo 6 deve essere ripetuto e compilato per ciascuna componente della garanzia.

6	Tipo di componente della garanzia reale	«SECU» — <i>Securities</i> (titoli) «CASH» — contante
---	---	--

I campi 7, 8, 9 e 10 devono essere ripetuti e compilati per ciascun titolo.

7	Componente della garanzia reale	ISIN secondo ISO 6166, codice di 12 caratteri alfanumerici
8	Valore della garanzia riutilizzata	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
9	Riutilizzo stimato della garanzia reale	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.

N.	Campo	Formato
10	Valuta della garanzia riutilizzata	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
11	Tasso di reinvestimento	Massimo 11 caratteri numerici compresi massimo 10 decimali espressi in percentuale, dove il 100 % è rappresentato da «100».

I campi 12, 13 e 14 devono essere ripetuti e compilati per ogni investimento se la garanzia in contante è stata reinvestita e per ciascuna valuta.

12	Tipo di reinvestimento del contante	«MMFT» — <i>registered money market fund</i> (fondo del mercato monetario registrato) «OCMP» — <i>any other commingled pool</i> (ogni altro aggregato combinato) «REPM» — <i>the repo market</i> (il mercato delle operazioni di vendita con patto di riacquisto) «SDPU» — <i>direct purchase of securities</i> (acquisto diretto di titoli) «OTHR» — <i>other</i> (altro)
13	Importo del contante reinvestito	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
14	Valuta del contante reinvestito	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici

Nel caso di finanziamenti con margini, la controparte ripete e compila i campi 15, 16 e 17 per ciascuna fonte di finanziamento e fornisce le informazioni in questi campi a livello di soggetto.

15	Fonti di finanziamento	«REPO» — <i>repos or BSB</i> (operazioni di vendita con patto di riacquisto o BSB) «SECL» — <i>cash collateral from securities lending</i> (garanzia in contante proveniente da operazioni di prestito titoli) «FREE» — <i>free credits</i> (crediti gratuiti) «CSHS» — <i>proceeds from customer short sales</i> (proventi delle vendite allo scoperto del cliente) «BSHS» — <i>proceeds from broker short sales</i> (proventi delle vendite allo scoperto dell'intermediario) «UBOR» — <i>unsecured borrowing</i> (assunzione di prestiti non garantiti) «OTHR» — <i>other</i> (altro)
16	Valore di mercato delle fonti di finanziamento	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se non è possibile, importo proporzionale.
17	Valuta delle fonti di finanziamento	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
18	Tipo di azione	«NEWT» — <i>New</i> (nuova) «REUU» — <i>Reuse update</i> (aggiornamento del riutilizzo) «EROR» — <i>Error</i> (errore) «CORR» — <i>Correction</i> (correzione)

Tabella 5

### Classificazione delle merci

Categoria di prodotti	Sottocategoria di prodotti	Ulteriore sottocategoria di prodotti
«AGRI» — <i>Agricultural</i> (agricoli)	«GROS» — <i>Grains Oil Seeds</i> (cereali e semi oleosi)	«FWHT» — <i>Feed Wheat</i> (frumento da foraggio) «SOYB» — <i>Soybeans</i> (soia) «CORN» — <i>Granturco</i> «RPSD» — <i>Rapeseed</i> (colza) «RICE» — <i>Riso</i> «OTHR» — <i>Other</i> (altro)

Categoria di prodotti	Sottocategoria di prodotti	Ulteriore sottocategoria di prodotti
	«SOFT» — <i>Softs</i>	«CCOA» — <i>Cocoa</i> (cacao) «ROBU» — Caffè Robusta «WHSG» — <i>White Sugar</i> (zucchero bianco) «BRWN» — <i>Raw Sugar</i> (zucchero grezzo) «OTHR» — <i>Other</i> (altro)
	«POTA» — <i>Potato</i> (patate)	
	«OOLI» — Olio di oliva	«LAMP» — «Lampante» «OTHR» — <i>Other</i> (altro)
	«DIRY» — <i>Dairy</i> (prodotti lattiero-caseari)	
	«FRST» — <i>Forestry</i> (silvicoltura)	
	«SEAF» — <i>Seafood</i> (prodotti ittici)	
	«LSTK» — <i>Livestock</i> (bestiame)	
	«GRIN» — <i>Grain</i> (cereali)	«MWHT» — <i>Milling Wheat</i> (frumento da panificazione) «OTHR» — <i>Other</i> (altro)
	«OTHR» — <i>Other</i> (altro)	
«NRGY» — Energy (energia)	«ELEC» — <i>Electricity</i> (energia elettrica)	«BSLD» — <i>Base load</i> (carico di base) «FITR» — <i>Financial Transmission Rights</i> (diritti di trasmissione finanziari) «PKLD» — <i>Peak load</i> (carico di punta) «OFFP» — <i>Off-peak</i> (orario normale) «OTHR» — <i>Other</i> (altro)
	«NGAS» — <i>Natural Gas</i> (gas naturale)	«GASP» — GASPOOL «LNGG» — LNG «NBPG» — NBP «NCGG» — NCG «TTFG» — TTF «OTHR» — <i>Other</i> (altro)
	«OILP» — <i>Oil</i> (petrolio)	«BAKK» — Bakken «BDSL» — Biodiesel «BRNT» — Brent «BRNX» — Brent NX «CNDA» — <i>Canadian</i> (canadese) «COND» — Condensato «DSEL» — Diesel «DUBA» — Dubai «ESPO» — ESPO «ETHA» — <i>Ethanol</i> (etanolo) «FUEL» — Combustibile «FOIL» — <i>Fuel Oil</i> (olio combustibile) «GOIL» — <i>Gasoil</i> (gasolio)

Categoria di prodotti	Sottocategoria di prodotti	Ulteriore sottocategoria di prodotti
		«GSLN» — <i>Gasoline</i> (benzina) «HEAT» — <i>Heating Oil</i> (gasolio da riscaldamento) «JTFL» — JET Fuel «KERO» — Kerosene «LLSO» — <i>Light Louisiana Sweet</i> (LLS) «MARS» — Mars «NAPH» — Nafta «NGLO» — NGL «TAPI» — Tapis «URAL» — Urali «WTIO» — WTI «OTHR» — <i>Other</i> (altro)
	«COAL» — Carbone «INRG» — Inter Energy «RNNG» — <i>Renewable energy</i> (energie rinnovabili) «LGHT» — <i>Light ends</i> (benzina leggera di prima distillazione) «DIST» — Distillati «OTHR» — <i>Other</i> (altro)	
«ENVR» — <i>Environmental</i> (ambientali)	«EMIS» — Emissioni	«CERE» — CER «ERUE» — ERU «EUAЕ» — EUA «EUAA» — EUAA «OTHR» — <i>Other</i> (altro)
	«WTHR» — <i>Weather</i> (meteo) «CRBR» — <i>Carbon related</i> (associati al carbonio) «OTHR» — <i>Other</i> (altro)	
«FRGT» — <i>Freight</i> (carico)	«WETF» — Wet	«TNKR» — <i>Tankers</i> (navi cisterna) «OTHR» — <i>Other</i> (altro)
	«DRYF» — Dry	«DBCR» — <i>Dry bulk carriers</i> (portarinfuse) «OTHR» — <i>Other</i> (altro)
	«CSHP» — <i>Containerships</i> (portacontainer)	
	«OTHR» — <i>Other</i> (altro)	
«FRTL» — <i>Fertilizer</i> (concimi)	«AMMO» — Ammoniaca «DAPH» — DAP ( <i>Diammonium Phosphate</i> ) (fosfato di diammonio, DAP) «PTSH» — <i>Potash</i> (potassa) «SLPH» — <i>Sulphur</i> (zolfo) «UREA» — Urea «UAAN» — UAN ( <i>urea and ammonium nitrate</i> ) (nitrato di ammonio e urea, UAN) «OTHR» — <i>Other</i> (altro)	

Categoria di prodotti	Sottocategoria di prodotti	Ulteriore sottocategoria di prodotti
«INDP» — <i>Industrial products</i> (prodotti industriali)	«CSTR» — <i>Construction</i> (costruzioni) «MFTG» — <i>Manufacturing</i> (manifatturieri)	
«METL» — <i>Metals</i> (metalli)	«NPRM» — <i>Non Precious</i> (non preziosi)	«ALUM» — <i>Aluminium</i> (alluminio) «ALUA» — <i>Aluminium Alloy</i> (lega di alluminio) «CBLT» — Cobalto «COPR» — <i>Copper</i> (rame) «IRON» — <i>Iron ore</i> (minerale di ferro) «LEAD» — Piombo «MOLY» — <i>Molybdenum</i> (molibdeno) «NASC» — NASAAC «NICK» — <i>Nickel</i> (nicel) «STEL» — <i>Steel</i> (acciaio) «TINN» — <i>Tin</i> (stagno) «ZINC» — Zinco «OTHR» — <i>Other</i> (altro)
	«PRME» — <i>Precious</i> (preziosi)	«GOLD» — Oro «SLVR» — <i>Silver</i> (argento) «PTNM» — <i>Platinum</i> (platino) «PLDM» — <i>Palladium</i> (palladio) «OTHR» — <i>Other</i> (altro)
«MCEX» — <i>Multi Commodity Exotic</i> (esotici multimerci)		
«PAPR» — <i>Paper</i> (carta)	«CBRD» — <i>Containerboard</i> (cartone grezzo ondulato) «NSPT» — <i>Newsprint</i> (carta da giornale) «PULP» — <i>Pulp</i> (polpa) «RCVP» — <i>Recovered paper</i> (carta di recupero) «OTHR» — <i>Other</i> (altro)	
«POLY» — <i>Polypropylene</i> (polipropilene)	«PLST» — <i>Plastica</i> «OTHR» — <i>Other</i> (altro)	
«INFL» — <i>Inflazione</i>		
«OEST» — <i>Official economic statistics</i> (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» — <i>Other</i> (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 (GU L 87 del 31.3.2017, pag. 229).



## ALLEGATO II

L'allegato del regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012 è sostituito dal testo seguente.

«ALLEGATO

Tabella 1

**Dati sulla 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 (massimo 50 caratteri alfanumerici)
5	Paese dell'altra controparte	Codice paese secondo 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 <sup>(1)</sup> C = ente creditizio autorizzato ai sensi della direttiva 2013/36/UE del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(2)</sup> F = impresa di investimento autorizzata ai sensi della direttiva 2004/39/CE del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(3)</sup> 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 <sup>(4)</sup> O = ente pensionistico aziendale o professionale ai sensi dell'articolo 6, lettera a), della direttiva 2003/41/CE del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(5)</sup> R = impresa di riassicurazione autorizzata ai sensi della direttiva 2009/138/CE U = organismo di investimento collettivo in valori mobiliari (OICVM) e relativa società di gestione, autorizzati ai sensi della direttiva 2009/65/CE del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(6)</sup>  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 <sup>(7)</sup> : 1 = agricoltura, silvicoltura e pesca 2 = attività estrattiva 3 = attività manifatturiere 4 = fornitura di energia elettrica, gas, vapore e aria condizionata

	Campo	Formato
		<p>5 = fornitura di acqua; reti fognarie, attività di trattamento dei rifiuti e risanamento</p> <p>6 = costruzioni</p> <p>7 = commercio all'ingrosso e al dettaglio; riparazione di autoveicoli e motocicli</p> <p>8 = trasporto e magazzinaggio</p> <p>9 = servizi di alloggio e di ristorazione</p> <p>10 = servizi di informazione e comunicazione</p> <p>11 = attività finanziarie e assicurative</p> <p>12 = attività immobiliari</p> <p>13 = attività professionali, scientifiche e tecniche</p> <p>14 = attività amministrative e di servizi di supporto</p> <p>15 = amministrazione pubblica e difesa; assicurazione sociale obbligatoria</p> <p>16 = istruzione</p> <p>17 = sanità e assistenza sociale</p> <p>18 = attività artistiche, di intrattenimento e divertimento</p> <p>19 = altre attività di servizi</p> <p>20 = attività di famiglie e convivenze come datori di lavoro per personale domestico; produzione di beni e di servizi indifferenziati per uso proprio da parte di famiglie e convivenze</p> <p>21 = attività di organizzazioni ed organismi extraterritoriali</p> <p>Se viene indicata più di un'attività, elencare i codici nell'ordine di importanza relativa delle attività corrispondenti, separati da "-".</p> <p>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.</p>
7	Natura della controparte segnalante	<p>F = controparte finanziaria</p> <p>N = controparte non finanziaria</p> <p>C = controparte centrale</p> <p>O = altro</p>
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	<p>"LEI" per codice LEI (<i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442</p> <p>"CLC" per codice cliente</p>
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 massimo 50 caratteri alfanumerici, nel caso in cui il cliente non possa ricevere il codice LEI
13	Capacità negoziale	<p>P = principale</p> <p>A = agente</p>
14	Lato della controparte	<p>B = acquirente</p> <p>S = venditore</p> <p>Compilato conformemente all'articolo 3 bis</p>

	Campo	Formato
15	Direttamente collegato ad attività commerciali o di finanziamento 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 i 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 secondo 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 <i>ter</i>
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 i 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
26	Margine di variazione costituito	Massimo 20 caratteri numerici inclusi i 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 i 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

	Campo	Formato
30	Margine di variazione ricevuto	Massimo 20 caratteri numerici inclusi i 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 i 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 i 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	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
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	
4	Classificazione del prodotto	CFI secondo ISO 10692, codice di 6 caratteri alfabetici	
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	
7	Tipo di identificazione del sottostante	I = ISIN A = AII 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 Per il tipo B di identificazione del sottostante: identificazione di tutti i singoli componenti mediante ISIN secondo ISO 6166 o il codice AII completo. Gli identificativi dei singoli componenti sono separati da un trattino “-”. 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	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.	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
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)	
16	Compressione	Y = il contratto deriva da compressione N = il contratto non deriva da compressione	
17	Prezzo/tasso	Massimo 20 caratteri numerici inclusi i 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, dove il 100 % è 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 i 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 i 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 i 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 i 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 secondo 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 secondo 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 secondo 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 ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici	
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"	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
		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	
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.	



	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
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.	
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 del 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" — EONIA SWAP ( <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	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
		"JIBA" — JIBAR "BUBO" — BUBOR "CDOR" — CDOR "CIBO" — CIBOR "MOSP" — MOSPRIM "NIBO" — NIBOR "PRBO" — PRIBOR "TLBO" — TELBOR "WIBO" — WIBOR "TREA" — <i>Treasury</i> (Tesoro) "SWAP" — <i>swap</i> "FUSW" — <i>swap su future</i> O massimo 25 caratteri alfanumerici se il tasso di riferimento non figura 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" — EONIA SWAP ( <i>swap sull'EONIA</i> ) "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 "NIBO" — NIBOR "PRBO" — PRIBOR	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
		"TLBO" — TELBOR "WIBO" — WIBOR "TREA" — <i>Treasury</i> (Tesoro) "SWAP" — <i>swap</i> "FUSW" — <i>swap su future</i> O massimo 25 caratteri alfanumerici se il tasso di riferimento non figura 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 i 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 i 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.	
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	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
		FR = trasporto merci ME = metalli IN = indice EV = ambientali EX = esotiche OT = altro	
66	Informazioni specifiche sulle materie prime	<p><i>Agricole</i></p> GO = cereali e semi oleosi DA = prodotti lattiero-caseari LI = animali FO = prodotti forestali SO = softs SF = prodotti ittici OT = altro	
		<p><i>Energia</i></p> OI = petrolio NG = gas naturale CO = carbone EL = energia elettrica IE = interenergia OT = altro	
		<p><i>Trasporto merci</i></p> DR = secco WT = umido OT = altro	
		<p><i>Metalli</i></p> PR = preziosi NP = non preziosi	
		<p><i>Ambiente</i></p> WE = clima EM = emissioni OT = altro	
	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	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
	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 secondo ISO 8601 e ora nel formato UTC AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ	
72	Data e ora di fine della consegna	Data nel formato secondo 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 "/"	
75	Capacità di consegna	Massimo 20 caratteri numerici inclusi i 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 MWh/h MWh/d GW GWh/h GWh/d	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
		Therm/d KTherm/d MTherm/d cm/d mcm/d	
77	Prezzo per quantità per intervallo di tempo	Massimo 20 caratteri numerici inclusi i 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	
80	Prezzo <i>strike</i> (tasso <i>cap/floor</i> )	Massimo 20 caratteri numerici inclusi i 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, dove il 100 % è 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)	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
		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 secondo ISO 3166 di 2 caratteri o Codice paese secondo ISO 3166-2 di 2 caratteri seguito da trattino "-" e da massimo 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	
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 i 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 = nuova M = modifica	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
		E = errore C = cessazione anticipata R = correzione Z = compressione V = aggiornamento della valutazione P = componente della posizione	
94	Livello	T = operazione P = posizione»	