



Bruxelles, 17 giugno 2022  
(OR. en)

10387/22  
ADD 1

EF 179  
ECOFIN 638  
DELECT 98

#### NOTA DI TRASMISSIONE

---

Origine:	Segretaria generale della Commissione europea, firmato da Martine DEPREZ, direttrice
Destinatario:	Segretariato generale del Consiglio
n. doc. Comm.:	C(2022) 3589 final
Oggetto:	ALLEGATO del REGOLAMENTO DELEGATO (UE) .../... DELLA COMMISSIONE che integra il regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione che specificano le informazioni minime da segnalare al repertorio di dati sulle negoziazioni e il tipo di segnalazioni da utilizzare

---

Si trasmette in allegato, per le delegazioni, il documento C(2022) 3589 final.

All.: C(2022) 3589 final



COMMISSIONE  
EUROPEA

Bruxelles, 10.6.2022  
C(2022) 3589 final

ANNEX

**ALLEGATO**

**del**

**REGOLAMENTO DELEGATO (UE) .../... DELLA COMMISSIONE**

**che integra il regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione che specificano le informazioni minime da segnalare al repertorio di dati sulle negoziazioni e il tipo di segnalazioni da utilizzare**

## ALLEGATO

Tabella 1

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
1	Parti del derivato	Data e ora della segnalazione	Data e ora della trasmissione della segnalazione al repertorio di dati sulle negoziazioni.
2	Parti del derivato	Identificativo del soggetto che trasmette la segnalazione	Nel caso in cui il soggetto responsabile della segnalazione abbia delegato la trasmissione della segnalazione ad un terzo o all'altra controparte, quest'altro soggetto deve essere individuato in questo campo con un codice unico. In caso contrario, in questo campo dovrebbe essere indicato il soggetto responsabile della segnalazione.
3	Parti del derivato	Soggetto responsabile della segnalazione	Quando una controparte finanziaria ha l'esclusiva responsabilità, inclusa la responsabilità giuridica, della segnalazione per conto di entrambe le controparti a norma dell'articolo 9, paragrafo 1 bis, del regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>1</sup> e la controparte non finanziaria non decide di segnalare essa stessa i dati dei suoi contratti derivati OTC con la controparte finanziaria, il codice unico che identifica tale controparte finanziaria. Quando la società di gestione ha la responsabilità, inclusa la responsabilità giuridica, della segnalazione per conto di un organismo di investimento collettivo in valori mobiliari (OICVM) a norma dell'articolo 9, paragrafo 1 ter, del predetto regolamento, il codice unico che identifica la società di gestione. Quando il gestore di un fondo di investimento alternativo (GEFIA) ha la responsabilità, inclusa la responsabilità giuridica, della segnalazione per conto del fondo di investimento alternativo (FIA) a norma dell'articolo 9, paragrafo 1 quater, del

<sup>1</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).

	Sezione	Campo	Dati da segnalare
			<p>predetto regolamento, il codice unico che identifica il GEFIA. Quando il soggetto autorizzato che è responsabile della gestione e agisce per conto di un EPAP ha la responsabilità, inclusa la responsabilità giuridica, della segnalazione per suo conto a norma dell'articolo 9, paragrafo 1 quinquies, del predetto regolamento, il codice unico che identifica tale soggetto.</p> <p>Questo campo è applicabile solo ai derivati OTC.</p>
4	Parti del derivato	Controparte 1 (controparte segnalante)	<p>Identificativo della controparte di un'operazione su derivati che sta adempiendo al suo obbligo di segnalazione attraverso la segnalazione in questione.</p> <p>Nel caso di un'operazione su derivati allocata eseguita da un gestore di fondi per conto di un fondo, è segnalato come controparte il fondo e non il gestore di fondi.</p>
5	Parti del derivato	Natura della controparte 1	<p>Indicare se la controparte 1 è una controparte centrale (CCP), una controparte finanziaria o una controparte non finanziaria ai sensi dell'articolo 2, punti 1, 8 e 9, del regolamento (UE) n. 648/2012, o un soggetto di cui all'articolo 1, paragrafo 5, di detto regolamento.</p>
6	Parti del derivato	Settore di attività della controparte 1	<p>Natura delle attività della controparte 1.</p> <p>Se la controparte 1 è una controparte finanziaria, questo campo contiene tutti i necessari codici inclusi nella tassonomia delle controparti finanziarie nel campo 6 della tabella 1 dell'allegato del <i>[OP inserire riferimento al C(2022) 3588]</i> che si applicano a tale controparte.</p> <p>Se la controparte 1 è una controparte non finanziaria, questo campo contiene tutti i necessari codici inclusi nella tassonomia delle controparti non finanziarie nel campo 6 della tabella 1 dell'allegato del <i>[OP inserire riferimento al C(2022) 3588]</i> che si applicano a tale controparte.</p> <p>Se è segnalata più di un'attività, i codici</p>

	Sezione	Campo	Dati da segnalare
			sono inseriti in ordine di importanza relativa delle corrispondenti attività.
7	Parti del derivato	Soglia di compensazione della controparte 1	Precisare se la controparte 1 supera la soglia di compensazione di cui all'articolo 4 bis, paragrafo 3, o all'articolo 10, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012 alla data di conclusione dell'operazione.
8	Parti del derivato	Tipo di identificativo della controparte 2	Indicare se è stato usato il codice LEI per identificare la controparte 2.
9	Parti del derivato	Controparte 2	Identificativo della seconda controparte di un'operazione su derivati. Nel caso di un'operazione su derivati allocata eseguita da un gestore di fondi per conto di un fondo, è segnalato come controparte il fondo e non il gestore di fondi.
10	Parti del derivato	Paese della controparte 2	Se la controparte 2 è una persona fisica, il codice del paese di residenza di tale persona.
11	Parti del derivato	Natura della controparte 2	Indicare se la controparte 2 è una CCP, una controparte finanziaria o una controparte non finanziaria ai sensi dell'articolo 2, punti 1, 8 e 9, del regolamento (UE) n. 648/2012, o un soggetto di cui all'articolo 1, paragrafo 5, di detto regolamento.
12	Parti del derivato	Settore di attività della controparte 2	Natura delle attività della controparte 2. Se la controparte 2 è una controparte finanziaria, questo campo contiene tutti i necessari codici inclusi nella tassonomia delle controparti finanziarie nel campo 6 della tabella 1 dell'allegato del <i>[OP inserire riferimento al C(2022) 3588]</i> che si applicano a tale controparte. Se la controparte 2 è una controparte non finanziaria, questo campo contiene tutti i necessari codici inclusi nella tassonomia delle controparti non finanziarie nel campo 6 della tabella 1 dell'allegato del <i>[OP inserire riferimento al C(2022) 3588]</i> che si applicano a tale controparte.

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
			Se è segnalata più di un'attività, i codici sono inseriti in ordine di importanza relativa delle corrispondenti attività.
13	Parti del derivato	Soglia di compensazione della controparte 2	Precisare se la controparte 2 supera la soglia di compensazione di cui all'articolo 4 bis, paragrafo 3, o all'articolo 10, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012 alla data di conclusione dell'operazione.
14	Parti del derivato	Obblighi di segnalazione della controparte 2	Indicare se la controparte 2 è soggetta all'obbligo di segnalazione ai sensi del regolamento (UE) n. 648/2012, indipendentemente da chi ha la responsabilità, inclusa la responsabilità giuridica, della segnalazione.
15	Parti del derivato	Identificativo dell'intermediario	Se l'intermediario agisce per conto della controparte 1 senza diventare esso stesso una controparte, la controparte 1 lo identifica con un codice unico.
16	Parti del derivato	Partecipante diretto	Identificativo del partecipante diretto attraverso il quale è stata compensata un'operazione su derivati presso una CCP. Questo dato è applicabile alle operazioni compensate.
17	Parti del derivato	Direzione	Indicare se la controparte 1 è l'acquirente o il venditore come stabilito alla data in cui il derivato è stato concluso.
18	Parti del derivato	Direzione della gamba 1	Indicare se la controparte 1 è l'ordinante o il destinatario della gamba 1 come stabilito alla data in cui il derivato è stato concluso.
19	Parti del derivato	Direzione della gamba 2	Indicare se la controparte 1 è l'ordinante o il destinatario della gamba 2 come stabilito alla data in cui il derivato è stato concluso.

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
20	Parti del derivato	Direttamente collegato ad attività commerciali o di finanziamento di tesoreria	<p>Precisare se il contratto è oggettivamente misurabile in quanto direttamente collegato all'attività commerciale o di finanziamento di tesoreria della controparte 1, ai sensi dell'articolo 10, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012.</p> <p>Compilare questo campo solo se la controparte 1 è una controparte non finanziaria ai sensi dell'articolo 2, punto 9, del regolamento (UE) n. 648/2012.</p>

Tabella 2

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
1	Sezione 2 a – Identificativi e collegamenti	UTI	Identificativo unico dell'operazione di cui all'articolo 7 del <i>[OP inserire riferimento al C(2022) 3588]</i> .
2	Sezione 2 a – Identificativi e collegamenti	Numero di tracciamento della segnalazione	Se un derivato è stato eseguito in una sede di negoziazione, un numero generato dalla sede di negoziazione e unico per quell'esecuzione.
3	Sezione 2 a – Identificativi e collegamenti	UTI precedente (per relazioni uno-a-uno e uno-a-molti tra operazioni)	UTI assegnato all'operazione precedente che ha dato origine all'operazione segnalata a causa di un evento del ciclo di vita, in una relazione uno-a-uno tra le operazioni (ad esempio nel caso di una novazione, quando un'operazione è cessata ed è generata una nuova operazione) o in una relazione uno-a-molti tra le operazioni (ad esempio nella compensazione o se un'operazione è suddivisa in più operazioni diverse). Questo dato non è applicabile quando si segnalano relazioni multi-a-uno e multi-a-molti tra le operazioni (ad esempio nel caso di una compressione).

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
4	Sezione 2 a – Identificativi e collegamenti	UTI della posizione successiva	L'UTI della posizione in cui è incluso un derivato. Questo campo è applicabile solo alle segnalazioni relative alla cessazione di un derivato a causa della sua inclusione in una posizione.
5	Sezione 2 a – Identificativi e collegamenti	Identificativo di riduzione del rischio post-negoziazione (PTRR)	Identificativo generato dal prestatore di servizi PTRR o dalla CCP che fornisce il servizio PTRR al fine di collegare tutti i derivati che entrano in un dato evento PTRR e che risultano da tale evento PTRR.
6	Sezione 2 a – Identificativi e collegamenti	Identificativo del pacchetto	Identificativo (stabilito dalla controparte 1) finalizzato a collegare i derivati nello stesso pacchetto a norma dell'articolo 1, paragrafo 3, terzo comma, del presente regolamento. Un pacchetto può includere operazioni da segnalare e da non segnalare.
7	Sezione 2 b – Informazioni sul contratto	Codice internazionale di identificazione dei titoli (ISIN)	ISIN che identifica il prodotto se tale prodotto è ammesso alla negoziazione o è negoziato in un mercato regolamentato, MTF, OTF o internalizzatore sistematico.
8	Sezione 2 b – Informazioni sul contratto	Identificativo unico del prodotto (UPI)	UPI che identifica il prodotto.

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
9	Sezione 2 b – Informazioni sul contratto	Classificazione del prodotto	Codice di classificazione degli strumenti finanziari (CFI) relativo allo strumento.
10	Sezione 2 b – Informazioni sul contratto	Tipo di contratto	Ogni contratto segnalato è classificato in base al tipo.
11	Sezione 2 b – Informazioni sul contratto	Classe di attività	Ogni contratto segnalato è classificato secondo la classe di attività sulla quale è basato.
12	Sezione 2 b – Informazioni sul contratto	Derivato basato su cripto-attività	Indicare se il derivato è basato su cripto-attività.
13	Sezione 2 b – Informazioni sul contratto	Tipo di identificazione del sottostante	Il tipo di identificativo del pertinente sottostante.
14	Sezione 2 b – Informazioni sul contratto	Identificazione del sottostante	Il sottostante diretto è identificato mediante un identificativo unico del sottostante sulla base del suo tipo. Per i <i>credit default swap</i> indicare il codice ISIN dell'obbligazione di riferimento.
15	Sezione 2 b – Informazioni sul contratto	Indicatore dell'indice sottostante	Indicazione dell'indice sottostante, se disponibile.
16	Sezione 2 b – Informazioni sul contratto	Nome dell'indice sottostante	Il nome completo dell'indice sottostante attribuito dal fornitore dell'indice.
17	Sezione 2 b – Informazioni sul contratto	Codice del paniere personalizzato	Se l'operazione su derivati è basata su un paniere personalizzato, codice unico assegnato al soggetto responsabile della strutturazione del

	Sezione	Campo	Dati da segnalare
			paniere personalizzato per collegare i suoi componenti.
18	Sezione 2 b – Informazioni sul contratto	Identificativo dei componenti del paniere	Per i panieri personalizzati composti, tra gli altri, di strumenti finanziari negoziati in una sede di negoziazione, specificare solo gli strumenti finanziari negoziati nella sede di negoziazione.
19	Sezione 2 b – Informazioni sul contratto	Valuta di regolamento 1	Valuta per il regolamento in contanti dell'operazione, se applicabile. Per i prodotti multivaluta che non sono compensati ( <i>netting</i> ), la valuta di regolamento della gamba 1. Questo dato non è applicabile ai prodotti regolati fisicamente (ad esempio, <i>swaption</i> regolate fisicamente).
20	Sezione 2 b – Informazioni sul contratto	Valuta di regolamento 2	Valuta per il regolamento in contanti dell'operazione, se applicabile. Per i prodotti multivaluta che non sono compensati ( <i>netting</i> ), la valuta di regolamento della gamba 2. Questo dato non è applicabile ai prodotti regolati fisicamente (ad esempio, <i>swaption</i> regolate fisicamente).

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
21	Sezione 2 c – Valutazione	Importo della valutazione	Valutazione del contratto a prezzi correnti di mercato o, se del caso, valutazione in base ad un modello di cui all'articolo 4 del presente regolamento. La valutazione della CCP da utilizzare per le operazioni compensate.
22	Sezione 2 c – Valutazione	Valuta della valutazione	Valuta in cui è denominato l'importo della valutazione.
23	Sezione 2 c – Valutazione	Data e ora della valutazione	Data e ora dell'ultima valutazione a prezzi correnti di mercato, fornite dalla CCP o calcolate utilizzando l'attuale o l'ultimo prezzo di mercato disponibile degli input.
24	Sezione 2 c – Valutazione	Metodo di valutazione	Fonte e metodo utilizzati per la valutazione dell'operazione dalla controparte 1.  Se è utilizzato almeno un input di valutazione che è classificato come basato su un modello, l'intera valutazione è classificata come basata su un modello.  Se sono utilizzati solo input classificati come basati sui prezzi correnti di mercato, l'intera valutazione è classificata come basata sui prezzi correnti di mercato.

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
25	Sezione 2 c – Valutazione	Delta	<p>Il rapporto tra la variazione del prezzo di un'operazione su derivati e la variazione del prezzo del sottostante.</p> <p>Questo campo è applicabile solo a opzioni e <i>swaption</i>.</p> <p>Il delta aggiornato è segnalato su base giornaliera dalle controparti finanziarie e non finanziarie di cui all'articolo 10 del regolamento (UE) n. 648/2012.</p>
26	Sezione 2 d – Garanzie	Indicatore della garanzia per portafoglio	<p>Indicatore dell'eventualità che la garanzia sia stata costituita sulla base di un portafoglio. Con l'espressione "sulla base di un portafoglio" si intende un insieme di operazioni che sono soggette a marginazione congiunta (su base netta o lorda) contrariamente allo scenario in cui il margine è calcolato e costituito per ogni singola operazione separatamente.</p>
27	Sezione 2 d – Garanzie	Codice della garanzia per portafoglio	<p>Se la garanzia è segnalata sulla base di un portafoglio, codice unico assegnato dalla controparte 1 al portafoglio. Questo dato non è applicabile se la garanzia è stata costituita a livello di operazione, o se non esiste un contratto di garanzia o se non è fornita o ricevuta alcuna garanzia.</p>

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
28	Sezione 2 e – Attenuazione del rischio/segnalazione	Data e ora della conferma	La data e l'ora della conferma, come stabilito all'articolo 12 del regolamento delegato (UE) n. 149/2013 della Commissione <sup>2</sup> . Applicabile esclusivamente ai contratti derivati OTC non compensati da una CCP.
29	Sezione 2 e – Attenuazione del rischio/segnalazione	Confermato	Per le nuove operazioni da segnalare, se i termini giuridicamente vincolanti di un contratto derivato OTC sono stati documentati e concordati (confermati) o no (non confermati). Se documentati e concordati, se tale conferma è avvenuta: <ul style="list-style-type: none"> <li>• tramite un'infrastruttura o una piattaforma di conferma condivisa, o un sistema elettronico privato o bilaterale (per via elettronica);</li> <li>• attraverso un documento scritto leggibile dall'uomo, come fax, documenti cartacei o e-mail elaborate manualmente (per via non elettronica).</li> </ul> Applicabile esclusivamente ai contratti derivati OTC non compensati da una CCP.

<sup>2</sup> Regolamento delegato (UE) n. 149/2013 della Commissione, del 19 dicembre 2012, che integra il regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione su accordi di compensazione indiretti, obbligo di compensazione, registro pubblico, accesso alla sede di negoziazione, controparti non finanziarie, tecniche di attenuazione dei rischi per i contratti derivati OTC non compensati mediante controparte centrale (GU L 52 del 23.2.2013, pag. 11).

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
30	Sezione 2 f – Compensazione	Obbligo di compensazione	Indicare se il contratto segnalato appartiene a una classe di derivati OTC dichiarata soggetta all'obbligo di compensazione e se entrambe le controparti del contratto sono soggette all'obbligo di compensazione ai sensi del regolamento (UE) n. 648/2012 al momento dell'esecuzione del contratto. Applicabile esclusivamente ai contratti derivati OTC.
31	Sezione 2 f – Compensazione	Compensato	Indicare se il derivato è stato compensato da una CCP.
32	Sezione 2 f – Compensazione	Data e ora della compensazione	Data e ora in cui la compensazione ha avuto luogo. Applicabile esclusivamente ai derivati compensati da una CCP.
33	Sezione 2 f – Compensazione	Controparte centrale	Identificativo della CCP che ha compensato l'operazione. Questo dato non è applicabile se il valore del dato "Compensato" è "N" ("No, non compensato a livello centrale").
34	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Tipo di accordo quadro	Riferimento al tipo di accordo quadro con il quale le controparti hanno concluso un derivato.

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
35	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Altro tipo di accordo quadro	Nome dell'accordo quadro. Questo campo deve essere compilato solo se "OTHR" (Altro) è indicato nel campo 34 di questa tabella.
36	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Versione dell'accordo quadro	L'anno dell'accordo quadro pertinente per l'operazione segnalata, se del caso.
37	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Infragrupo	Indicare se il contratto è stato concluso nel quadro di un'operazione infragrupo ai sensi dell'articolo 3 del regolamento (UE) n. 648/2012.
38	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	PTRR	Indicare se il contratto deriva da un'operazione PTRR.
39	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Tipo di tecnica PTRR	Indicare un tipo di operazione PTRR ai fini della segnalazione a norma del regolamento (UE) n. 648/2012. Compressione del portafoglio senza prestatore di servizi terzo: un accordo per ridurre il rischio nei portafogli esistenti di operazioni che utilizzano operazioni che non partecipano alla formazione del prezzo, principalmente per ridurre l'importo nozionale in essere, il numero di operazioni o altrimenti per armonizzare i termini, cessando completamente o parzialmente le operazioni e più comunemente sostituendo i derivati

	Sezione	Campo	Dati da segnalare
			<p>cessati con nuove operazioni di sostituzione. Compressione del portafoglio con prestatore di servizi terzo o una CCP: un servizio PTRR prestato da un prestatore di servizi o da una CCP per ridurre il rischio nei portafogli esistenti di operazioni che utilizzano operazioni che non partecipano alla formazione del prezzo, principalmente per ridurre l'importo nozionale in essere, il numero di operazioni o altrimenti per armonizzare i termini, cessando completamente o parzialmente le operazioni e più comunemente sostituendo i derivati cessati con nuove operazioni di sostituzione. Ribilanciamento del portafoglio/gestione del margine: un servizio PTRR prestato da un prestatore di servizi per ridurre il rischio in un portafoglio esistente di operazioni aggiungendo nuove operazioni che non partecipano alla formazione del prezzo, in cui nessuna operazione esistente nel portafoglio viene cessata o sostituita e il nozionale è aumentato piuttosto che diminuito. Altri servizi PTRR del portafoglio: un servizio PTRR prestato da un prestatore di servizi per ridurre il rischio in portafogli esistenti di operazioni utilizzando</p>

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
			operazioni che non partecipano alla formazione del prezzo, laddove tale servizio non si configuri come compressione del portafoglio o ribilanciamento del portafoglio.
40	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Prestatore di servizi PTRR	LEI identificativo del prestatore di servizi PTRR.
41	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Sede di esecuzione	<p>Identificativo della sede in cui l'operazione è stata eseguita.</p> <p>Utilizzare il MIC di segmento secondo ISO 10383 per le operazioni eseguite in una sede di negoziazione, un internalizzatore sistematico (SI) o una piattaforma di negoziazione organizzata situati al di fuori dell'Unione. Se il MIC del segmento non esiste, utilizzare il MIC operativo.</p> <p>Utilizzare il codice MIC "XOFF" per gli strumenti finanziari ammessi alla negoziazione o negoziati in una sede di negoziazione o per i quali è stata presentata una richiesta di ammissione, se l'operazione su tale strumento finanziario non è eseguita in una sede di negoziazione, un SI o una piattaforma di negoziazione organizzata situati al di fuori dell'Unione, o se una controparte non</p>

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
			<p>sa che sta negoziando con una controparte 2 che agisce come SI. Utilizzare il codice MIC "XXXX" per gli strumenti finanziari che non sono ammessi alla negoziazione o negoziati in una sede di negoziazione o per i quali non è stata presentata una richiesta di ammissione e che non sono negoziati su una piattaforma di negoziazione organizzata al di fuori dell'Unione.</p>
42	Sezione 2 c – Dati sull'operazione	Data e ora di esecuzione	<p>Data e ora in cui un'operazione è stata originariamente eseguita, con conseguente generazione di un nuovo UTI. Questo dato rimane invariato per tutta la durata dell'UTI. Per le segnalazioni a livello di posizione dovrebbe riferirsi al momento in cui la posizione è stata aperta per la prima volta.</p>
43	Sezione 2 c – Dati sull'operazione	Data effettiva	<p>Data non rettificata in cui gli obblighi derivanti dall'operazione su derivati OTC prendono effetto, come indicato nella conferma. Se la data effettiva non è specificata nell'ambito dei termini del contratto, le controparti indicano in questo campo la data di esecuzione del derivato.</p>

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
44	Sezione 2 c – Dati sull'operazione	Data di scadenza	Data non rettificata in cui gli obblighi derivanti dall'operazione su derivati cessano di avere validità, come indicato nella conferma. La cessazione anticipata non incide su questo dato.
45	Sezione 2 c – Dati sull'operazione	Data di cessazione anticipata	Data effettiva della cessazione anticipata (scadenza) dell'operazione segnalata. Questo dato è applicabile se la cessazione dell'operazione avviene prima della sua scadenza a causa di una decisione ex-interim di una (o più) controparti.
46	Sezione 2 c – Dati sull'operazione	Data finale di regolamento contrattuale	Data non rettificata come da contratto, entro la quale dovrebbero avvenire tutti i trasferimenti di denaro o attività e le controparti non dovrebbero più avere alcun obbligo in essere l'una verso l'altra secondo detto contratto. Per i prodotti che possono non avere una data finale di regolamento contrattuale (per esempio le opzioni americane), questo dato corrisponde alla data entro la quale il trasferimento di denaro o di attività avrebbe luogo se la cessazione dovesse avvenire alla data di scadenza.
47	Sezione 2 c – Dati sull'operazione	Tipo di consegna	Indicare se il contratto è regolato fisicamente o in contanti.

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
48	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Prezzo	Prezzo specificato nell'operazione su derivati. Non include oneri, tasse o commissioni. Se il prezzo non è noto quando viene segnalata una nuova operazione, il prezzo è aggiornato non appena è disponibile. Per le operazioni che fanno parte di un pacchetto, questo dato contiene il prezzo delle singole operazioni, se applicabile.
49	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Valuta del prezzo	Valuta in cui è denominato il prezzo. La valuta del prezzo è applicabile esclusivamente se il prezzo è espresso come valore monetario.
	I campi da 50 a 52 sono ripetibili e sono compilati nel caso di derivati per cui sono disponibili tabelle di prezzo.		
50	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Data effettiva non rettificata del prezzo	Data effettiva non rettificata del prezzo.
51	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Data finale non rettificata del prezzo	Data finale non rettificata del prezzo (non applicabile se la data finale non rettificata di un dato periodo della tabella è contigua ( <i>back-to-back</i> ) alla data effettiva non rettificata del periodo successivo).
52	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Prezzo in essere tra la data effettiva non rettificata e la data finale.	Prezzo in essere tra la data effettiva non rettificata e la data finale non rettificata compresa.

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
53	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Prezzo dell'operazione a pacchetto	<p>Prezzo negoziato dell'intero pacchetto in cui l'operazione su derivati segnalata è un componente. Questo dato non è applicabile se</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• non è coinvolto alcun pacchetto, o</li> <li>• è utilizzato il differenziale dell'operazione a pacchetto.</li> </ul> <p>I prezzi e i relativi elementi dei dati delle operazioni (valuta del prezzo) che rappresentano i singoli componenti del pacchetto sono segnalati quando disponibili. Il prezzo dell'operazione a pacchetto potrebbe non essere noto quando è segnalata una nuova operazione, ma può essere aggiornato in seguito.</p>
54	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Valuta del prezzo dell'operazione a pacchetto	<p>Valuta in cui è denominato il prezzo dell'operazione a pacchetto. Questo dato non è applicabile se</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• non è coinvolto alcun pacchetto, o</li> <li>• è utilizzato il differenziale dell'operazione a pacchetto, o</li> <li>• il prezzo dell'operazione a pacchetto è espresso in percentuale.</li> </ul>
55	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Importo nozionale della gamba 1	Importo nozionale della gamba 1 di cui all'articolo 5 del presente regolamento.

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
56	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Valuta nozionale 1	Se applicabile, la valuta in cui è denominato l'importo nozionale della gamba 1.
	I campi da 57 a 59 sono ripetibili e sono compilati nel caso di derivati per cui sono disponibili tabelle di importi nozionali.		
57	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Data effettiva dell'importo nozionale della gamba 1	La data non rettificata in cui l'importo nozionale associato della gamba 1 acquisisce validità.
58	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Data finale dell'importo nozionale della gamba 1	Data finale non rettificata dell'importo nozionale della gamba 1 (non applicabile se la data finale non rettificata di un dato periodo della tabella è contigua ( <i>back-to-back</i> ) alla data effettiva non rettificata del periodo successivo).
59	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Importo nozionale in essere alla data effettiva associata della gamba 1	Importo nozionale della gamba 1 che acquisisce validità alla data effettiva non rettificata associata.
60	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Quantitativo nozionale totale della gamba 1	Quantitativo nozionale aggregato dell'attività sottostante della gamba 1 per la durata dell'operazione. Se il quantitativo nozionale totale non è noto quando viene segnalata una nuova operazione, esso è aggiornato non appena è disponibile.

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
	I campi da 61 a 63 sono ripetibili e sono compilati nel caso di derivati per cui sono disponibili tabelle di quantitativi nozionali.		
61	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Data effettiva del quantitativo nozionale della gamba 1	La data non rettificata in cui il quantitativo nozionale associato della gamba 1 acquisisce validità.
62	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Data finale del quantitativo nozionale della gamba 1	Data finale non rettificata del quantitativo nozionale della gamba 1 (non applicabile se la data finale non rettificata di un dato periodo della tabella è contigua ( <i>back-to-back</i> ) alla data effettiva non rettificata del periodo successivo).
63	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Quantitativo nozionale in essere alla data effettiva associata della gamba 1	Quantitativo nozionale della gamba 1 che acquisisce validità alla data effettiva non rettificata associata.
64	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Importo nozionale della gamba 2	Se applicabile, l'importo nozionale della gamba 2 di cui all'articolo 5 del presente regolamento.
65	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Valuta nozionale 2	Se applicabile, la valuta in cui è denominato l'importo nozionale della gamba 2.
	I campi da 66 a 68 sono ripetibili e sono compilati nel caso di derivati per cui sono disponibili tabelle di importi nozionali.		

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
66	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Data effettiva dell'importo nozionale della gamba 2	La data non rettificata in cui l'importo nozionale associato della gamba 2 acquisisce validità.
67	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Data finale dell'importo nozionale della gamba 2	Data finale non rettificata dell'importo nozionale della gamba 2 (non applicabile se la data finale non rettificata di un dato periodo della tabella è contigua ( <i>back-to-back</i> ) alla data effettiva non rettificata del periodo successivo).
68	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Importo nozionale in essere alla data effettiva associata della gamba 2	Importo nozionale della gamba 2 che acquisisce validità alla data effettiva non rettificata associata.
69	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Quantitativo nozionale totale della gamba 2	Quantitativo nozionale aggregato dell'attività sottostante della gamba 2 per la durata dell'operazione. Se il quantitativo nozionale totale non è noto quando viene segnalata una nuova operazione, esso è aggiornato non appena è disponibile.
	I campi da 70 a 72 sono ripetibili e sono compilati nel caso di derivati per cui sono disponibili tabelle di quantitativi nozionali.		
70	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Data effettiva del quantitativo nozionale della gamba 2	La data non rettificata in cui il quantitativo nozionale associato della gamba 2 acquisisce validità.

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
71	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Data finale del quantitativo nozionale della gamba 2	Data finale non rettificata del quantitativo nozionale della gamba 2 (non applicabile se la data finale non rettificata di un dato periodo della tabella è contigua ( <i>back-to-back</i> ) alla data effettiva non rettificata del periodo successivo).
72	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Quantitativo nozionale in essere alla data effettiva associata della gamba 2	Il quantitativo nozionale della gamba 2 che acquisisce validità alla data effettiva non rettificata associata.
	La sezione dei campi da 73 a 78 è ripetibile.		
73	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Tipo di altri pagamenti	Tipo di importo di altri pagamenti. Il pagamento del premio dell'opzione non è incluso come tipo di pagamento in quanto i premi per l'opzione sono segnalati utilizzando il dato dedicato al premio dell'opzione.
74	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Importo di altri pagamenti	Importi dei pagamenti con i corrispondenti tipi di pagamento per soddisfare i requisiti di descrizione di operazioni di classi di attività diverse.
75	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Valuta di altri pagamenti	Valuta in cui è denominato l'importo di altri pagamenti.
76	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Data di altri pagamenti	La data non rettificata in cui è pagato l'importo di altri pagamenti.

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
77	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Ordinante di altri pagamenti	Identificativo dell'ordinante dell'importo di altri pagamenti.
78	Sezione 2 g – Dati sull'operazione	Destinatario di altri pagamenti	Identificativo del destinatario dell'importo di altri pagamenti.
79	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Tasso fisso della gamba 1 o cedola	Indicazione del tasso fisso della gamba 1 utilizzato o della cedola utilizzata, se applicabile.
80	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Convenzione sul conteggio dei giorni del tasso fisso o della cedola della gamba 1	Se applicabile, convenzione sul conteggio dei giorni (spesso indicata anche come frazione per il conteggio dei giorni o base per il conteggio dei giorni o metodo di conteggio dei giorni) che determina la modalità di calcolo dei pagamenti degli interessi. Si usa per calcolare la frazione di anno del periodo di calcolo e indica il numero di giorni del periodo di calcolo diviso per il numero di giorni dell'anno.
81	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Periodo di frequenza del pagamento per il tasso fisso o la cedola della gamba 1	Se applicabile, unità di tempo associata alla frequenza dei pagamenti, ad esempio giorno, settimana, mese, anno o termine del flusso per il tasso fisso della gamba 1 o la cedola.
82	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Moltiplicatore del periodo di frequenza del pagamento per il tasso fisso o la cedola della gamba 1	Se applicabile, numero di unità di tempo (espresso dal periodo di frequenza del pagamento) che determina la frequenza con cui si susseguono le

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
			<p>date di pagamento periodico per il tasso fisso della gamba 1 o la cedola. Ad esempio, un'operazione con pagamenti che avvengono ogni due mesi è rappresentata con il periodo di frequenza del pagamento "MNTM" (mensile) e un moltiplicatore del periodo di frequenza del pagamento pari a 2. Questo dato non è applicabile se il periodo di frequenza del pagamento è "ADHO". Se il periodo di frequenza del pagamento è "EXPI", il moltiplicatore del periodo di frequenza del pagamento è 1. Se la frequenza di pagamento è infragiornaliera, il periodo di frequenza del pagamento è "DAIL" e il moltiplicatore della frequenza di pagamento è 0.</p>
83	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Identificativo del tasso variabile della gamba 1	Se applicabile, identificativo dei tassi di interesse utilizzati, rivisti a intervalli prestabiliti con riferimento ad un tasso di riferimento di mercato.
84	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Indicatore del tasso variabile della gamba 1	Indicazione del tasso d'interesse, se disponibile.
85	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Nome del tasso variabile della gamba 1	Il nome completo del tasso d'interesse attribuito dal fornitore dell'indice.

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
86	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Convenzione sul conteggio dei giorni del tasso variabile della gamba 1	Se applicabile, convenzione sul conteggio dei giorni (spesso indicata anche come frazione per il conteggio dei giorni o base per il conteggio dei giorni o metodo di conteggio dei giorni) che determina la modalità di calcolo dei pagamenti degli interessi per il tasso variabile della gamba 1. Si usa per calcolare la frazione di anno del periodo di calcolo e indica il numero di giorni del periodo di calcolo diviso per il numero di giorni dell'anno.
87	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Periodo di frequenza del pagamento per il tasso variabile della gamba 1	Se applicabile, unità di tempo associata alla frequenza dei pagamenti, ad esempio giorno, settimana, mese, anno o termine del flusso per il tasso variabile della gamba 1.
88	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Moltiplicatore del periodo di frequenza del pagamento per il tasso variabile della gamba 1	Se applicabile, numero di unità di tempo (espresso dal periodo di frequenza del pagamento) che determina la frequenza con cui si susseguono le date di pagamento periodico per il tasso variabile della gamba 1. Ad esempio, un'operazione con pagamenti che avvengono ogni due mesi è rappresentata con il periodo di frequenza del pagamento "MNTM" (mensile) e un moltiplicatore del periodo di frequenza del

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
			pagamento pari a 2. Questo dato non è applicabile se il periodo di frequenza del pagamento è "ADHO". Se il periodo di frequenza del pagamento è "EXPI", il moltiplicatore del periodo di frequenza del pagamento è 1. Se la frequenza di pagamento è infragiornaliera, il periodo di frequenza del pagamento è "DAIL" e il moltiplicatore della frequenza di pagamento è 0.
89	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Periodo di riferimento del tasso variabile della gamba 1 – periodo di tempo	Periodo di tempo che descrive il periodo di riferimento per il tasso variabile della gamba 1.
90	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Periodo di riferimento del tasso variabile della gamba 1 – moltiplicatore	Moltiplicatore del periodo di tempo che descrive il periodo di riferimento per il tasso variabile della gamba 1.
91	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Periodo di frequenza della revisione del tasso variabile della gamba 1	Se applicabile, unità di tempo associata alla frequenza delle revisioni dei pagamenti, ad esempio giorno, settimana, mese, anno o termine del flusso per il tasso variabile della gamba 1.
92	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Moltiplicatore del periodo di frequenza della revisione del tasso variabile della gamba 1	Se applicabile, numero di unità di tempo (espresso dal periodo di frequenza del pagamento) che determina la frequenza con cui si susseguono le date delle revisioni dei pagamenti periodici per il tasso variabile della gamba 1. Ad esempio, un'operazione con

	Sezione	Campo	Dati da segnalare
			<p>pagamenti che avvengono ogni due mesi è rappresentata con il periodo di frequenza del pagamento "MNTM" (mensile) e un moltiplicatore del periodo di frequenza del pagamento pari a 2. Questo dato non è applicabile se il periodo di frequenza del pagamento è "ADHO". Se il periodo di frequenza del pagamento è "EXPI", il moltiplicatore del periodo di frequenza del pagamento è 1. Se la frequenza di pagamento è infragiornaliera, il periodo di frequenza del pagamento è "DAIL" e il moltiplicatore della frequenza di pagamento è 0.</p>
93	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Differenziale della gamba 1	<p>Indicazione del differenziale della gamba 1, se applicabile: per le operazioni su derivati OTC con pagamenti periodici (ad esempio, <i>interest rate fixed/float swap, interest rate basis swap, commodity swap</i>),</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• il differenziale sul singolo prezzo di riferimento dell'indice della gamba o delle gambe a tasso variabile, nel caso in cui vi sia un differenziale sulla gamba o sulle gambe a tasso variabile;</li> <li>• la differenza tra i prezzi di riferimento dei due indici della gamba a tasso variabile.</li> </ul>

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
94	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Valuta del differenziale della gamba 1	Se applicabile, la valuta in cui è denominato il differenziale della gamba 1. Questo dato è applicabile solo se il differenziale è espresso come valore monetario.
95	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Tasso fisso della gamba 2	Indicazione del tasso fisso della gamba 2 utilizzato, se applicabile.
96	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Convenzione sul conteggio dei giorni del tasso fisso della gamba 2	Se applicabile, convenzione sul conteggio dei giorni (spesso indicata anche come frazione per il conteggio dei giorni o base per il conteggio dei giorni o metodo di conteggio dei giorni) che determina la modalità di calcolo dei pagamenti degli interessi. Si usa per calcolare la frazione di anno del periodo di calcolo e indica il numero di giorni del periodo di calcolo diviso per il numero di giorni dell'anno.
97	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Periodo di frequenza del pagamento del tasso fisso della gamba 2	Se applicabile, unità di tempo associata alla frequenza dei pagamenti, ad esempio giorno, settimana, mese, anno o termine del flusso per il tasso fisso della gamba 2.
98	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Moltiplicatore del periodo di frequenza del pagamento del tasso fisso della gamba 2	Se applicabile, numero di unità di tempo (espresso dal periodo di frequenza del pagamento) che determina la frequenza con cui si susseguono le date di pagamento periodico per il tasso fisso

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
			della gamba 2. Ad esempio, un'operazione con pagamenti che avvengono ogni due mesi è rappresentata con il periodo di frequenza del pagamento "MNTM" (mensile) e un moltiplicatore del periodo di frequenza del pagamento pari a 2. Questo dato non è applicabile se il periodo di frequenza del pagamento è "ADHO". Se il periodo di frequenza del pagamento è "EXPI", il moltiplicatore del periodo di frequenza del pagamento è 1. Se la frequenza di pagamento è infragiornaliera, il periodo di frequenza del pagamento è "DAIL" e il moltiplicatore della frequenza di pagamento è 0.
99	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Identificativo del tasso variabile della gamba 2	Se applicabile, identificativo dei tassi di interesse utilizzati, rivisti a intervalli prestabiliti con riferimento ad un tasso di riferimento di mercato.
100	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Indicatore del tasso variabile della gamba 2	Indicazione del tasso d'interesse, se disponibile.
101	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Nome del tasso variabile della gamba 2	Il nome completo del tasso d'interesse attribuito dal fornitore dell'indice.

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
102	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Convenzione sul conteggio dei giorni del tasso variabile della gamba 2	Se applicabile, convenzione sul conteggio dei giorni (spesso indicata anche come frazione per il conteggio dei giorni o base per il conteggio dei giorni o metodo di conteggio dei giorni) che determina la modalità di calcolo dei pagamenti degli interessi per il tasso variabile della gamba 2. Si usa per calcolare la frazione di anno del periodo di calcolo e indica il numero di giorni del periodo di calcolo diviso per il numero di giorni dell'anno.
103	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Periodo di frequenza del pagamento per il tasso variabile della gamba 2	Se applicabile, unità di tempo associata alla frequenza dei pagamenti, ad esempio giorno, settimana, mese, anno o termine del flusso per il tasso variabile della gamba 2.
104	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Moltiplicatore del periodo di frequenza del pagamento per il tasso variabile della gamba 2	Se applicabile, numero di unità di tempo (espresso dal periodo di frequenza del pagamento) che determina la frequenza con cui si susseguono le date di pagamento periodico per il tasso variabile della gamba 2. Ad esempio, un'operazione con pagamenti che avvengono ogni due mesi è rappresentata con il periodo di frequenza del pagamento "MNTM" (mensile) e un moltiplicatore del periodo di frequenza del

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
			pagamento pari a 2. Questo dato non è applicabile se il periodo di frequenza del pagamento è "ADHO". Se il periodo di frequenza del pagamento è "EXPI", il moltiplicatore del periodo di frequenza del pagamento è 1. Se la frequenza di pagamento è infragiornaliera, il periodo di frequenza del pagamento è "DAIL" e il moltiplicatore della frequenza di pagamento è 0.
105	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Periodo di riferimento del tasso variabile della gamba 2 – periodo di tempo	Periodo di tempo che descrive il periodo di riferimento per il tasso variabile della gamba 2.
106	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Periodo di riferimento del tasso variabile della gamba 2 – moltiplicatore	Moltiplicatore del periodo di tempo che descrive il periodo di riferimento per il tasso variabile della gamba 2.
107	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Periodo di frequenza della revisione del tasso variabile della gamba 2	Se applicabile, unità di tempo associata alla frequenza delle revisioni dei pagamenti, ad esempio giorno, settimana, mese, anno o termine del flusso per il tasso variabile della gamba 2.
108	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Moltiplicatore del periodo di frequenza della revisione del tasso variabile della gamba 2	Se applicabile, numero di unità di tempo (espresso dal periodo di frequenza del pagamento) che determina la frequenza con cui si susseguono le date delle revisioni dei pagamenti periodici per il tasso variabile della gamba 2. Ad esempio, un'operazione con

	Sezione	Campo	Dati da segnalare
			<p>pagamenti che avvengono ogni due mesi è rappresentata con il periodo di frequenza del pagamento "MNTM" (mensile) e un moltiplicatore del periodo di frequenza del pagamento pari a 2. Questo dato non è applicabile se il periodo di frequenza del pagamento è "ADHO". Se il periodo di frequenza del pagamento è "EXPI", il moltiplicatore del periodo di frequenza del pagamento è 1. Se la frequenza di pagamento è infragiornaliera, il periodo di frequenza del pagamento è "DAIL" e il moltiplicatore della frequenza di pagamento è 0.</p>
109	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Differenziale della gamba 2	<p>Indicazione del differenziale della gamba 2, se applicabile: per le operazioni su derivati OTC con pagamenti periodici (ad esempio, <i>interest rate fixed swap</i>, <i>interest rate float swap</i>, <i>interest rate basis swap</i>, <i>commodity swap</i>),</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• il differenziale sul singolo prezzo di riferimento dell'indice della gamba o delle gambe a tasso variabile, nel caso in cui vi sia un differenziale sulla gamba o sulle gambe a tasso variabile;</li> <li>• la differenza tra i prezzi di riferimento dei due indici della gamba a tasso variabile.</li> </ul>

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
110	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Valuta del differenziale della gamba 2	<p>Se applicabile, la valuta in cui è denominato il differenziale della gamba 2.</p> <p>Questo dato è applicabile solo se il differenziale è espresso come valore monetario.</p>
111	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Differenziale dell'operazione a pacchetto	<p>Prezzo negoziato dell'intero pacchetto in cui l'operazione su derivati segnalata è un componente dell'operazione a pacchetto.</p> <p>Prezzo dell'operazione a pacchetto quando il prezzo del pacchetto è espresso come differenziale, differenza tra due prezzi di riferimento.</p> <p>Questo dato non è applicabile se</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• non è coinvolto alcun pacchetto, o</li> <li>• è utilizzato il prezzo dell'operazione a pacchetto.</li> </ul> <p>Il differenziale e i relativi elementi dei dati delle operazioni (valuta del differenziale) che rappresentano i singoli componenti del pacchetto sono segnalati quando disponibili.</p> <p>Il differenziale dell'operazione a pacchetto potrebbe non essere noto quando è segnalata una nuova operazione, ma può essere aggiornato in seguito.</p>

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
112	Sezione 2 h – Tassi di interesse	Valuta del differenziale dell'operazione a pacchetto	Valuta in cui è denominato il differenziale dell'operazione a pacchetto. Questo dato non è applicabile se <ul style="list-style-type: none"> <li>• non è coinvolto alcun pacchetto, o</li> <li>• è utilizzato il prezzo dell'operazione a pacchetto, o</li> <li>• il differenziale dell'operazione a pacchetto è espresso in percentuale o punti base.</li> </ul>
113	Sezione 2 i – Tassi di cambio	Tasso di cambio 1	Tasso di cambio tra le due diverse valute specificate nell'operazione su derivati concordato dalle controparti all'inizio dell'operazione, espresso come tasso di cambio derivante dalla conversione della valuta unitaria nella valuta quotata.
114	Sezione 2 i – Tassi di cambio	Tasso di cambio a termine	Tasso di cambio a termine come concordato tra le controparti nel contratto. È espresso come il prezzo della valuta di base nella valuta quotata.
115	Sezione 2 i – Tassi di cambio	Base del tasso di cambio	Coppia di valute e ordine in cui è denominato il tasso di cambio, espresso come valuta unitaria o valuta quotata.

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
116	Sezione 2 j – Materie prime e quote di emissione (informazioni generali)	Categoria di prodotti	Categoria di prodotti come specificata nella classificazione delle merci nella tabella 4 dell'allegato del [OP inserire riferimento al C(2022) 3588].
117	Sezione 2 j – Materie prime e quote di emissione (informazioni generali)	Sottocategoria di prodotti	Sottocategoria di prodotti come specificata nella classificazione delle merci nella tabella 4 dell'allegato del [OP inserire riferimento al C(2022) 3588]. Questo campo presuppone l'indicazione di una specifica categoria di prodotti.
118	Sezione 2 j – Materie prime e quote di emissione (informazioni generali)	Ulteriore sottocategoria di prodotti	Ulteriore sottocategoria di prodotti come specificata nella classificazione delle merci nella tabella 4 dell'allegato del [OP inserire riferimento al C(2022) 3588]. Questo campo presuppone l'indicazione di una specifica categoria di prodotti.
119	Sezione 2 k – Materie prime e quote di emissione (energia)	Punto o zona di consegna	Punti di consegna o aree di mercato.
120	Sezione 2 k – Materie prime e quote di emissione (energia)	Punto di interconnessione	Identificazione dei confini o dei punti di confine di un contratto di trasporto.
121	Sezione 2 k – Materie prime e quote di emissione (energia)	Tipo di carico	Identificazione del profilo di consegna.

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
	La sezione dei campi da 122 a 131 è ripetibile.		
122	Sezione 2 k – Materie prime e quote di emissione (energia)	Ora di inizio dell'intervallo di consegna	L'ora di inizio dell'intervallo di consegna per ogni blocco o forma.
123	Sezione 2 k – Materie prime e quote di emissione (energia)	Ora di fine dell'intervallo di consegna	L'ora di fine dell'intervallo di consegna per ogni blocco o forma.
124	Sezione 2 k – Materie prime e quote di emissione (energia)	Data di inizio della consegna	La data di inizio della consegna.
125	Sezione 2 k – Materie prime e quote di emissione (energia)	Data di fine della consegna	La data di fine della consegna.
126	Sezione 2 k – Materie prime e quote di emissione (energia)	Durata	La durata del periodo di consegna.
127	Sezione 2 k – Materie prime e quote di emissione (energia)	Giorni della settimana	I giorni della settimana della consegna.
128	Sezione 2 k – Materie prime e quote di emissione (energia)	Capacità di consegna	Il numero di unità incluse nell'operazione per ogni intervallo di consegna specificato nei campi 122 e 123.

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
129	Sezione 2 k – Materie prime e quote di emissione (energia)	Unità di quantità	L'unità di misura utilizzata.
130	Sezione 2 k – Materie prime e quote di emissione (energia)	Prezzo per quantità per intervallo di tempo	Se applicabile, prezzo per quantità per intervallo di tempo di consegna.
131	Sezione 2 k – Materie prime e quote di emissione (energia)	Valuta del prezzo per quantità per intervallo di tempo	La valuta in cui è espresso il prezzo per quantità per intervallo di tempo.
132	Sezione 2 l – Opzioni	Tipo di opzione	Indicare se il contratto derivato è <i>call</i> (diritto di acquistare una determinata attività sottostante) o <i>put</i> (diritto di vendere una determinata attività sottostante) o se al momento dell'esecuzione del contratto derivato non è possibile stabilirlo. Per le <i>swaption</i> : - indicare " <i>put</i> " per le <i>swaption receiver</i> , in cui l'acquirente ha diritto di stipulare lo <i>swap</i> ricevendo un tasso fisso; - indicare " <i>call</i> " per le <i>swaption payer</i> , in cui l'acquirente ha diritto di stipulare lo <i>swap</i> pagando un tasso fisso. Per le opzioni <i>cap</i> e le opzioni <i>floor</i> : - indicare " <i>put</i> " per la <i>floor</i> ; - indicare " <i>call</i> " per la <i>cap</i> .

	Sezione	Campo	Dati da segnalare
133	Sezione 2 1 – Opzioni	Stile dell'opzione	Indicare se l'opzione può essere esercitata soltanto ad una data fissa (stile europeo), ad una serie di date prestabilite (stile bermudiano) o in qualsiasi momento nel corso del periodo di validità del contratto (stile americano).
134	Sezione 2 1 – Opzioni	Prezzo <i>strike</i>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Per le opzioni diverse da opzioni FX, <i>swaption</i> e prodotti analoghi, il prezzo al quale il titolare di un'opzione può acquistare o vendere l'attività sottostante dell'opzione.</li> <li>• Per le opzioni in valuta estera, tasso di cambio al quale l'opzione può essere esercitata, espresso come tasso di cambio derivante dalla conversione della valuta unitaria nella valuta quotata. Nell'esempio 0,9426 USD/EUR, USD è la valuta unitaria e EUR è la valuta quotata; USD 1 = EUR 0,9426. Se il prezzo <i>strike</i> non è noto quando viene segnalata una nuova operazione, esso è aggiornato non appena è disponibile.</li> <li>• Per i <i>volatility swap</i>, i <i>variance swap</i> e prodotti analoghi, il prezzo <i>strike</i> della volatilità è segnalato in questo dato.</li> </ul>

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
	I campi da 135 a 137 sono ripetibili e sono compilati nel caso di derivati per cui sono disponibili tabelle di prezzo <i>strike</i> .		
135	Sezione 2 1 – Opzioni	Data effettiva del prezzo <i>strike</i>	Data effettiva non rettificata del prezzo <i>strike</i> .
136	Sezione 2 1 – Opzioni	Data finale del prezzo <i>strike</i>	Data finale non rettificata del prezzo <i>strike</i> (non applicabile se la data finale non rettificata di un dato periodo della tabella è contigua ( <i>back-to-back</i> ) alla data effettiva non rettificata del periodo successivo).
137	Sezione 2 1 – Opzioni	Prezzo <i>strike</i> in essere alla data effettiva associata	Prezzo <i>strike</i> in essere tra la data effettiva non rettificata e la data finale non rettificata compresa.
138	Sezione 2 1 – Opzioni	Valuta/coppia di valute del prezzo <i>strike</i>	Per le opzioni su azioni, le opzioni su merci e prodotti analoghi, la valuta in cui è denominato il prezzo <i>strike</i> . Per le opzioni in valuta estera: coppia di valute e ordine in cui è espresso il prezzo <i>strike</i> . È espresso come valuta unitaria per valuta quotata.
139	Sezione 2 1 – Opzioni	Importo premio opzione	Per le opzioni e le <i>swaption</i> di tutte le classi di attività, l'importo monetario pagato dall'acquirente dell'opzione. Questo dato non è applicabile se lo strumento non è un'opzione o non prevede alcuna opzione.

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
140	Sezione 2 l – Opzioni	Valuta premio opzione	Per le opzioni e le <i>swaption</i> di tutte le classi di attività, la valuta in cui è denominato l'importo del premio dell'opzione. Questo dato non è applicabile se lo strumento non è un'opzione o non prevede alcuna opzione.
141	Sezione 2 l – Opzioni	Data di pagamento premio opzione	La data non rettificata in cui è pagato il premio dell'opzione.
142	Sezione 2 i – Opzioni	Data di scadenza del sottostante	Per le <i>swaption</i> , la data di scadenza dello <i>swap</i> sottostante.
143	Sezione 2 m – Derivati su crediti	Rango	Indicare il rango del titolo di debito, o del paniere di debito o dell'indice sottostante un derivato.
144	Sezione 2 m – Derivati su crediti	Soggetto di riferimento	Identificazione del soggetto di riferimento sottostante.
145	Sezione 2 m – Derivati su crediti	Serie	Il numero di serie della composizione dell'indice, se applicabile.
146	Sezione 2 m – Derivati su crediti	Versione	Una nuova versione della serie è emessa in caso di <i>default</i> di una delle componenti e di riponderazione dell'indice per tener conto del nuovo numero di componenti complessivi dell'indice.
147	Sezione 2 m – Derivati su crediti	Fattore dell'indice	Il fattore da applicare al nozionale (campo 55 della presente tabella) per aggiustarlo a tutti gli eventi di credito precedenti nella serie di indici.

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
148	Sezione 2 m – Derivati su crediti	Segmento	Indicare se il contratto derivato è suddiviso in segmenti.
149	Sezione 2 m – Derivati su crediti	Punto di attacco ( <i>attachment point</i> ) indice <i>Credit Default Swap</i> (CDS)	Punto inferiore definito in cui il livello di perdite nel portafoglio sottostante riduce il nozionale di un segmento. Ad esempio, il nozionale in un segmento con un punto di attacco del 3 % sarà ridotto in seguito a perdite del 3 % nel portafoglio. Questo dato non è applicabile se l'operazione non è un'operazione su segmenti CDS (indice o paniere personalizzato).
150	Sezione 2 m – Derivati su crediti	Punto di distacco ( <i>detachment point</i> ) indice CDS	Punto definito oltre il quale le perdite del portafoglio sottostante non producono più una riduzione del nozionale di un segmento. Ad esempio, il nozionale in un segmento con un punto di attacco del 3 % e un punto di distacco del 6 % sarà ridotto in seguito a perdite del 3 % nel portafoglio. Perdite del 6 % nel portafoglio esauriscono il nozionale del segmento. Questo dato non è applicabile se l'operazione non è un'operazione su segmenti CDS (indice o paniere personalizzato).
151	Sezione 2 n – Modifiche del derivato	Tipo di azione	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Nuovo: la segnalazione di un derivato, a livello di operazione o di posizione, per la prima volta.</li> <li>• Modifica: la modifica dei termini o delle informazioni</li> </ul>

	Sezione	Campo	Dati da segnalare
			<p>precedentemente trasmesse su un derivato, a livello di operazione o di posizione, ma non la correzione di una segnalazione.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• <b>Correzione:</b> una segnalazione che corregge i campi di dati errati di una segnalazione precedentemente trasmessa.</li> <li>• <b>Cessazione:</b> la cessazione di un derivato esistente, a livello di operazione o di posizione.</li> <li>• <b>Errore:</b> la cancellazione di una segnalazione integrale erroneamente trasmessa, quando il derivato, a livello di operazione o di posizione, non è mai esistito o non era soggetto agli obblighi di segnalazione imposti dal regolamento (UE) n. 648/2012 ma è stato segnalato per errore ad un repertorio di dati sulle negoziazioni o la cancellazione di una doppia segnalazione.</li> <li>• <b>Ripristino:</b> riapertura di un derivato, a livello di operazione o posizione, che è stato annullato con tipo di azione "Errore" o cessato per errore.</li> <li>• <b>Valutazione:</b> l'aggiornamento della valutazione di un derivato, a livello di operazione o di posizione.</li> <li>• <b>Componente di posizione:</b> la segnalazione di un nuovo derivato che è incluso in una distinta segnalazione di posizione</li> </ul>

	Sezione	Campo	Dati da segnalare
			lo stesso giorno.
152	Sezione 2 n – Modifiche del derivato	Tipo di evento	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Operazione: conclusione di un derivato o rinegoziazione dei suoi termini che non comporta il cambiamento di una controparte.</li> <li>• Subentro: un evento in cui una parte o la totalità del derivato è trasferita a una controparte 2 (e segnalata come un nuovo derivato) e il derivato esistente è cessato o il suo nozionale è modificato.</li> <li>• PTRR: esercizio di riduzione del rischio post-negoziato.</li> <li>• Cessazione anticipata: la cessazione di un derivato, a livello di operazione o di posizione.</li> <li>• Compensazione: compensazione secondo la definizione di cui all'articolo 2, punto 3, del regolamento (UE) n. 648/2012.</li> <li>• Esercizio: l'esercizio di un'opzione o di una <i>swaption</i> da parte di una controparte dell'operazione, in maniera completa o parziale.</li> <li>• Allocazione: evento di allocazione, in cui un derivato esistente è allocato a diverse controparti e segnalato come nuovo derivato con importi nozionali ridotti.</li> <li>• Evento di credito: si applica solo ai derivati su crediti. Un evento di</li> </ul>

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
			<p>credito che si traduce nella modifica di un derivato, a livello di operazione o di posizione.</p> <p>Evento aziendale: un'azione societaria sul sottostante in azioni che ha un impatto sui derivati su tali azioni.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Inclusione nella posizione: inclusione di contratto differenziale o derivato compensato mediante CCP in una posizione quando un derivato esistente è cessato ed è creata una nuova posizione o è modificato il nozionale di una posizione esistente.</li> </ul> <p>Aggiornamento: aggiornamento di un derivato in essere eseguito durante il periodo di transizione al fine di garantirne la conformità agli obblighi di segnalazione modificati.</p>
153	Sezione 2 n – Modifiche del derivato	Data dell'evento	Data in cui si è svolto l'evento da segnalare relativo al contratto derivato e rilevato dalla segnalazione o, nel caso di una modifica, quando la modifica ha acquisito validità.
154	Sezione 2 n – Modifiche del derivato	Livello	Indicare se la segnalazione è effettuata a livello di operazione o di posizione. La segnalazione a livello di posizione può essere utilizzata solo come integrazione della segnalazione a livello di operazione, per segnalare eventi post-negoiazione e

	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
			solo se le singole operazioni in prodotti fungibili sono state sostituite dalla posizione.

Tabella 3

<b>Voce</b>	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
1	Parti del derivato	Data e ora della segnalazione	Data e ora della trasmissione della segnalazione al repertorio di dati sulle negoziazioni.
2	Parti del derivato	Identificativo del soggetto che trasmette la segnalazione	Nel caso in cui il soggetto responsabile della segnalazione abbia delegato la trasmissione della segnalazione ad un terzo o all'altra controparte, quest'altro soggetto deve essere individuato in questo campo con un codice unico. In caso contrario, in questo campo dovrebbe essere indicato il soggetto responsabile della segnalazione.
3	Parti del derivato	Soggetto responsabile della segnalazione	Quando una controparte finanziaria ha l'esclusiva responsabilità, inclusa la responsabilità giuridica, della segnalazione per conto di entrambe le controparti a norma dell'articolo 9, paragrafo 1 bis, del regolamento (UE) n. 648/2012 e la controparte non finanziaria non decide di segnalare essa stessa i dati dei suoi contratti derivati OTC con la controparte finanziaria, il codice unico che identifica tale controparte finanziaria. Quando la società di gestione ha la responsabilità, inclusa la responsabilità giuridica, della segnalazione per conto di un organismo di investimento collettivo in valori mobiliari (OICVM) a norma dell'articolo 9, paragrafo 1 ter, del predetto regolamento, il codice unico che identifica la società di gestione. Quando il gestore di un fondo di investimento alternativo (GEFIA) ha la responsabilità, inclusa la responsabilità

Voce	Sezione	Campo	Dati da segnalare
			giuridica, della segnalazione per conto del fondo di investimento alternativo (FIA) a norma dell'articolo 9, paragrafo 1 quater, del predetto regolamento, il codice unico che identifica il GEFIA. Quando il soggetto autorizzato che è responsabile della gestione e agisce per conto di un EPAP ha la responsabilità, inclusa la responsabilità giuridica, della segnalazione per suo conto a norma dell'articolo 9, paragrafo 1 quinquies, del predetto regolamento, il codice unico che identifica tale soggetto. Questo campo è applicabile solo ai derivati OTC.
4	Parti del derivato	Controparte 1 (controparte segnalante)	Identificativo della controparte di un'operazione su derivati che sta adempiendo al suo obbligo di segnalazione attraverso la segnalazione in questione. Nel caso di un'operazione su derivati allocata eseguita da un gestore di fondi per conto di un fondo, è segnalato come controparte il fondo e non il gestore di fondi.
5	Parti del derivato	Tipo di identificativo della controparte 2	Indicare se è stato usato il codice LEI per identificare la controparte 2.
6	Parti del derivato	Controparte 2	Identificativo della seconda controparte di un'operazione su derivati. Nel caso di un'operazione su derivati allocata eseguita da un gestore di fondi per conto di un fondo, è segnalato come controparte il fondo e non il gestore di fondi.
7	Garanzie	Data e ora della garanzia	Data e ora a partire dalle quali sono segnalati i valori dei margini.
8	Garanzie	Indicatore della garanzia per portafoglio	Indicatore dell'eventualità che la garanzia sia stata costituita sulla base di un portafoglio. Con l'espressione "sulla base di un portafoglio" si intende un insieme di operazioni che sono soggette a marginazione congiunta (su base netta o lorda) contrariamente allo scenario in cui il margine

Voce	Sezione	Campo	Dati da segnalare
			è calcolato e costituito per ogni singola operazione separatamente.
9	Garanzie	Codice della garanzia per portafoglio	Se la garanzia è segnalata sulla base di un portafoglio, codice unico assegnato dalla controparte 1 al portafoglio. Questo dato non è applicabile se la garanzia è stata costituita a livello di operazione, o se non esiste un contratto di garanzia o se non è fornita o ricevuta alcuna garanzia.
10	Garanzie	UTI	Identificativo unico dell'operazione di cui all'articolo 7 del <i>[OP inserire riferimento al C(2022) 3588]</i> .
11	Garanzie	Categoria della costituzione di garanzia	Indicare se esiste un contratto di garanzia tra le controparti. Questo dato è fornito per ogni operazione o per ogni portafoglio, a seconda che la garanzia sia costituita a livello di operazione o di portafoglio, ed è applicabile sia alle operazioni compensate che a quelle non compensate.
12	Garanzie	Margine iniziale costituito dalla controparte 1 (pre-scato di garanzia)	Valore monetario del margine iniziale costituito dalla controparte 1, compreso qualsiasi margine in transito e in attesa di regolamento. Se la garanzia è costituita a livello di portafoglio, il margine iniziale costituito si riferisce all'intero portafoglio; se la garanzia è costituita a livello di singola operazione, il margine iniziale costituito si riferisce alla singola operazione. Questo campo si riferisce al valore totale corrente del margine iniziale, piuttosto che alla sua variazione giornaliera. Il dato si riferisce sia alle operazioni non compensate che a quelle compensate a livello centrale. Per le operazioni compensate a livello centrale, il dato non include i contributi al fondo di garanzia, né la garanzia costituita

Voce	Sezione	Campo	Dati da segnalare
			<p>verso la CCP a fronte di accantonamenti di liquidità, cioè le linee di credito impegnate. Se il margine iniziale costituito è denominato in più di una valuta, tali importi sono convertiti in un'unica valuta scelta dalla controparte 1 e segnalati come un unico valore totale.</p>
13	Garanzie	Margine iniziale costituito dalla controparte 1 (post-scato di garanzia)	<p>Valore monetario del margine iniziale costituito dalla controparte 1, compreso qualsiasi margine in transito e in attesa di regolamento.</p> <p>Se la garanzia è costituita a livello di portafoglio, il margine iniziale costituito si riferisce all'intero portafoglio; se la garanzia è costituita a livello di singola operazione, il margine iniziale costituito si riferisce alla singola operazione.</p> <p>Questo campo si riferisce al valore totale corrente del margine iniziale dopo l'applicazione dello scato di garanzia (se applicabile), piuttosto che alla sua variazione giornaliera.</p> <p>Il dato si riferisce sia alle operazioni non compensate che a quelle compensate a livello centrale. Per le operazioni compensate a livello centrale, il dato non include i contributi al fondo di garanzia, né la garanzia costituita verso la CCP a fronte di accantonamenti di liquidità, cioè le linee di credito impegnate.</p> <p>Se il margine iniziale costituito è denominato in più di una valuta, tali importi sono convertiti in un'unica valuta scelta dalla controparte 1 e segnalati come un unico valore totale.</p>
14	Garanzie	Valuta del margine iniziale costituito	<p>Valuta in cui è denominato il margine iniziale costituito.</p> <p>Se il margine iniziale costituito è denominato in più di una valuta, questo dato riflette una delle valute in cui la controparte 1 ha scelto di convertire tutti i valori dei margini iniziali costituiti.</p>

Voce	Sezione	Campo	Dati da segnalare
15	Garanzie	Margine di variazione costituito dalla controparte 1 (pre-scato di garanzia)	<p>Valore monetario del margine di variazione costituito dalla controparte 1, compreso il margine regolato in contante e qualsiasi margine in transito e in attesa di regolamento. Il margine di variazione potenziale non è incluso.</p> <p>Se la garanzia è costituita a livello di portafoglio, il margine di variazione costituito si riferisce all'intero portafoglio; se la garanzia è costituita a livello di singola operazione, il margine di variazione costituito si riferisce alla singola operazione.</p> <p>Questo campo si riferisce al valore totale corrente del margine di variazione, accumulato dalla prima segnalazione dei margini di variazione costituiti per il portafoglio o l'operazione.</p> <p>Se il margine di variazione costituito è denominato in più di una valuta, tali importi sono convertiti in un'unica valuta scelta dalla controparte 1 e segnalati come un unico valore totale.</p>
16	Garanzie	Margine di variazione costituito dalla controparte 1 (post-scato di garanzia)	<p>Valore monetario del margine di variazione costituito dalla controparte 1, compreso il margine regolato in contante e qualsiasi margine in transito e in attesa di regolamento. Il margine di variazione potenziale non è incluso.</p> <p>Se la garanzia è costituita a livello di portafoglio, il margine di variazione costituito si riferisce all'intero portafoglio; se la garanzia è costituita a livello di singola operazione, il margine di variazione costituito si riferisce alla singola operazione.</p> <p>Questo campo si riferisce al valore totale corrente del margine di variazione dopo l'applicazione dello scato di garanzia, se applicabile, accumulato dalla prima segnalazione dei margini di variazione costituiti per il portafoglio o l'operazione.</p> <p>Se il margine di variazione costituito è denominato in più di una valuta, tali importi sono convertiti in un'unica valuta scelta dalla</p>

Voce	Sezione	Campo	Dati da segnalare
			controparte 1 e segnalati come un unico valore totale.
17	Garanzie	Valuta dei margini di variazione costituiti	Valuta in cui è denominato il margine di variazione costituito. Se il margine di variazione costituito è denominato in più di una valuta, questo dato riflette una delle valute in cui la controparte 1 ha scelto di convertire tutti i valori dei margini di variazione costituiti.
18	Garanzie	Garanzia costituita in eccesso dalla controparte 1	Valore monetario di qualsiasi garanzia aggiuntiva costituita dalla controparte 1 separata e indipendente dal margine iniziale e di variazione. Questo campo si riferisce al valore totale corrente della garanzia costituita in eccesso prima dell'applicazione dello scarto di garanzia, se applicabile, piuttosto che alla sua variazione giornaliera. Qualsiasi importo del margine iniziale o di variazione costituito che superi il margine iniziale richiesto o il margine di variazione richiesto è segnalato, rispettivamente, come parte del margine iniziale costituito o del margine di variazione costituito, piuttosto che incluso come garanzia costituita in eccesso. Per le operazioni compensate a livello centrale, la garanzia in eccesso è segnalata solo nella misura in cui può essere assegnata a un portafoglio o a un'operazione specifici.
19	Garanzie	Valuta della garanzia costituita in eccesso	Valuta in cui è denominata la garanzia costituita in eccesso. Se la garanzia costituita in eccesso è denominata in più di una valuta, questo dato riflette una delle valute in cui la controparte 1 ha scelto di convertire tutti i valori della garanzia costituita in eccesso.

<b>Voce</b>	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
20	Garanzie	Margine iniziale raccolto dalla controparte 1 (pre-scato di garanzia)	<p>Valore monetario del margine iniziale raccolto dalla controparte 1, compreso qualsiasi margine in transito e in attesa di regolamento.</p> <p>Se la garanzia è costituita a livello di portafoglio, il margine iniziale raccolto si riferisce all'intero portafoglio; se la garanzia è costituita a livello di singola operazione, il margine iniziale raccolto si riferisce alla singola operazione.</p> <p>Questo campo si riferisce al valore totale corrente del margine iniziale, piuttosto che alla sua variazione giornaliera.</p> <p>Il dato si riferisce sia alle operazioni non compensate che a quelle compensate a livello centrale. Per le operazioni compensate a livello centrale, il dato non include la garanzia raccolta dalla CCP nell'ambito della sua attività di investimento.</p> <p>Se il margine iniziale raccolto è denominato in più di una valuta, tali importi sono convertiti in un'unica valuta scelta dalla controparte 1 e segnalati come un unico valore totale.</p>
21	Garanzie	Margine iniziale raccolto dalla controparte 1 (post-scato di garanzia)	<p>Valore monetario del margine iniziale raccolto dalla controparte 1, compreso qualsiasi margine in transito e in attesa di regolamento.</p> <p>Se la garanzia è costituita a livello di portafoglio, il margine iniziale raccolto si riferisce all'intero portafoglio; se la garanzia è costituita a livello di singola operazione, il margine iniziale raccolto si riferisce alla singola operazione.</p> <p>Questo campo si riferisce al valore totale corrente del margine iniziale dopo l'applicazione dello scato di garanzia, se applicabile, piuttosto che alla sua variazione giornaliera.</p> <p>Il dato si riferisce sia alle operazioni non compensate che a quelle compensate a livello centrale. Per le operazioni compensate a livello centrale, il dato non include la garanzia</p>

Voce	Sezione	Campo	Dati da segnalare
			<p>raccolta dalla CCP nell'ambito della sua attività di investimento.</p> <p>Se il margine iniziale raccolto è denominato in più di una valuta, tali importi sono convertiti in un'unica valuta scelta dalla controparte 1 e segnalati come un unico valore totale.</p>
22	Garanzie	Valuta del margine iniziale raccolto	<p>Valuta in cui è denominato il margine iniziale raccolto.</p> <p>Se il margine iniziale raccolto è denominato in più di una valuta, questo dato riflette una delle valute in cui la controparte 1 ha scelto di convertire tutti i valori dei margini iniziali raccolti.</p>
23	Garanzie	Margine di variazione raccolto dalla controparte 1 (pre-scato di garanzia)	<p>Valore monetario del margine di variazione raccolto dalla controparte 1, compreso il margine regolato in contante e qualsiasi margine in transito e in attesa di regolamento. Il margine di variazione potenziale non è incluso.</p> <p>Se la garanzia è costituita a livello di portafoglio, il margine di variazione raccolto si riferisce all'intero portafoglio; se la garanzia è costituita a livello di singola operazione, il margine di variazione raccolto si riferisce alla singola operazione.</p> <p>Questo campo si riferisce al valore totale corrente del margine di variazione accumulato dalla prima segnalazione dei margini di variazione raccolti per il portafoglio o l'operazione.</p> <p>Se il margine di variazione raccolto è denominato in più di una valuta, tali importi sono convertiti in un'unica valuta scelta dalla controparte 1 e segnalati come un unico valore totale.</p>
24	Garanzie	Margine di variazione raccolto dalla controparte 1 (post-scato di garanzia)	<p>Valore monetario del margine di variazione raccolto dalla controparte 1, compreso il margine regolato in contante e qualsiasi margine in transito e in attesa di regolamento. Il margine di variazione potenziale non è</p>

Voce	Sezione	Campo	Dati da segnalare
			<p>incluso.</p> <p>Se la garanzia è costituita a livello di portafoglio, il margine di variazione raccolto si riferisce all'intero portafoglio; se la garanzia è costituita a livello di singola operazione, il margine di variazione raccolto si riferisce alla singola operazione.</p> <p>Questo campo si riferisce al valore totale corrente del margine di variazione raccolto dopo l'applicazione dello scarto di garanzia, se applicabile, accumulato dalla prima segnalazione dei margini di variazione raccolti per il portafoglio/l'operazione.</p> <p>Se il margine di variazione raccolto è denominato in più di una valuta, tali importi sono convertiti in un'unica valuta scelta dalla controparte 1 e segnalati come un unico valore totale.</p>
25	Garanzie	Valuta del margine di variazione raccolto	<p>Valuta in cui è denominato il margine di variazione raccolto.</p> <p>Se il margine di variazione raccolto è denominato in più di una valuta, questo dato riflette una delle valute in cui la controparte 1 ha scelto di convertire tutti i valori dei margini variazione raccolti.</p>
26	Garanzie	Garanzia raccolta in eccesso dalla controparte 1	<p>Valore monetario di qualsiasi garanzia aggiuntiva raccolta dalla controparte 1 separata e indipendente dal margine iniziale e di variazione. Questo dato si riferisce al valore totale corrente della garanzia in eccesso prima dell'applicazione dello scarto di garanzia, se applicabile, piuttosto che alla sua variazione giornaliera.</p> <p>Qualsiasi importo del margine iniziale o di variazione raccolto che superi il margine iniziale richiesto o il margine di variazione richiesto è segnalato, rispettivamente, come parte del margine iniziale raccolto o del margine di variazione raccolto, piuttosto che incluso come garanzia raccolta in eccesso.</p> <p>Per le operazioni compensate a livello centrale la garanzia in eccesso è segnalata</p>

<b>Voce</b>	<b>Sezione</b>	<b>Campo</b>	<b>Dati da segnalare</b>
			solo nella misura in cui può essere assegnata a un portafoglio o a un'operazione specifici.
27	Garanzie	Valuta della garanzia raccolta in eccesso	Valuta in cui è denominata la garanzia raccolta in eccesso. Se la garanzia raccolta in eccesso è denominata in più di una valuta, questo dato riflette una delle valute in cui la controparte 1 ha scelto di convertire tutti i valori della garanzia raccolta in eccesso.
28	Garanzie	Tipo di azione	La segnalazione deve contenere uno dei seguenti tipi di azione: a) un nuovo saldo del margine o una modifica delle informazioni relative ai margini sono indicati come "Aggiornamento del margine"; b) la correzione di campi di dati che sono stati compilati erroneamente in una segnalazione precedente è indicata come "Correzione".
29	Garanzie	Data dell'evento	Data in cui si è svolto l'evento da segnalare relativo al contratto derivato e rilevato dalla segnalazione. In caso di aggiornamento della garanzia, la data in cui sono fornite le informazioni contenute nella segnalazione.