

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

(Testo rilevante ai fini del SEE)

LA COMMISSIONE EUROPEA,

visto il trattato sul funzionamento dell'Unione europea,

visto il parere della Banca centrale europea ⁽¹⁾,

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 ⁽²⁾, in particolare l'articolo 9, paragrafo 6,

considerando quanto segue:

- (1) Per evitare discrepanze, occorre che per la trasmissione dei dati ai repertori di dati sulle negoziazioni ai sensi dell'articolo 9 del regolamento (UE) n. 648/2012 si applichino le stesse regole e gli stessi standard e formati a tutti i repertori, a tutte le controparti e a tutti i tipi di derivati. È pertanto necessario utilizzare una serie unica di dati per descrivere le operazioni su derivati.
- (2) Poiché di norma i derivati OTC non sono né identificabili in modo univoco con codici esistenti e di ampio uso nei mercati finanziari, quali i numeri internazionali di identificazione dei titoli (*International Securities Identification Numbers* – ISIN), né descrivibili utilizzando il codice ISO di classificazione degli strumenti finanziari (*Classification of Financial Instruments* – CFI), occorre sviluppare un metodo nuovo e universale di identificazione. Occorre utilizzare, se disponibile, un identificativo unico del prodotto che sia conforme ai principi di unicità, neutralità, affidabilità, *open source*, scalabilità, accessibilità, che abbia un costo ragionevole, che sia offerto sulla base di un quadro di *governance* appropriato e sia adottato per l'uso nell'Unione. Se non è disponibile un identificativo unico del prodotto che soddisfi questi requisiti, occorre utilizzare una tassonomia temporanea.
- (3) È necessario identificare il sottostante mediante un identificativo unico; tuttavia non esiste al momento un codice standardizzato per tutto il mercato di identificazione del sottostante in un paniere. Occorre pertanto che le controparti siano tenute a indicare almeno che il sottostante è un paniere e a utilizzare, se possibile, i codici ISIN per gli indici standardizzati.

- (4) Per garantire uniformità, tutte le parti di un contratto derivato devono essere identificate con un codice identificativo unico. Occorre utilizzare, una volta disponibile, un identificativo internazionale della persona giuridica o un identificativo temporaneo della persona giuridica da definire nell'ambito di un quadro di *governance* che sia compatibile con le raccomandazioni del Consiglio per la stabilità finanziaria (FSB) in merito ai requisiti in materia di dati e adottato per l'uso nell'Unione, per identificare tutte le controparti finanziarie e non finanziarie, le controparti centrali, gli intermediari e i beneficiari, in particolare per assicurare l'uniformità con la relazione del Comitato sui sistemi di pagamento e regolamento (*Committee on Payment and Settlement Systems* – CPSS) e dell'*International Organisation of Securities Commissions* (Organizzazione internazionale delle commissioni per i valori mobiliari – IOSCO) sui requisiti in materia di aggregazione e di segnalazione dei dati sui derivati OTC, relazione che indica nell'identificativo della persona giuridica uno strumento di aggregazione dei dati. Nel caso delle operazioni eseguite per conto terzi, i beneficiari da identificare sono le persone fisiche o giuridiche per conto delle quali il contratto è stato concluso.
- (5) Occorre tener conto dell'impostazione adottata nei paesi terzi e seguita anche dai repertori di dati sulle negoziazioni stessi quando iniziano la loro attività. Pertanto, per assicurare una soluzione efficace sotto il profilo dei costi per le controparti e per attenuare il rischio operativo per i repertori di dati sulle negoziazioni, nel fissare la data di inizio della segnalazione occorre indicare date di introduzione graduale per le diverse categorie di derivati, iniziando con le categorie di attività più standardizzate ed estendendo successivamente l'obbligo alle altre categorie. I contratti derivati conclusi prima della data di entrata in vigore del regolamento (UE) n. 648/2012, alla stessa data o in data successiva che non sono più in essere alla data di inizio della segnalazione o dopo tale data non sono di grande rilevanza a fini regolamentari. Tuttavia, devono essere segnalati ai sensi dell'articolo 9, paragrafo 1, lettera a), del regolamento (UE) n. 648/2012. Per assicurare un regime di segnalazione efficiente e proporzionato in questi casi e tenendo conto delle difficoltà di ricostruire i dati dei contratti scaduti, occorre prevedere un termine più lungo per la segnalazione.
- (6) Il presente regolamento si basa sui progetti di norme tecniche di attuazione che l'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (AESFEM) ha presentato alla Commissione.
- (7) Ai sensi dell'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

⁽¹⁾ Non ancora pubblicata nella Gazzetta ufficiale.

⁽²⁾ GU L 201 del 27.7.2012.

dei mercati) ⁽¹⁾, l'AESFEM ha condotto consultazioni pubbliche sui progetti di norme tecniche di attuazione, ha analizzato i potenziali costi e benefici collegati e ha chiesto il parere del gruppo delle parti interessate nel settore degli strumenti finanziari e dei mercati istituito dall'articolo 37 dello stesso regolamento,

HA ADOTTATO IL PRESENTE REGOLAMENTO:

Articolo 1

Formato delle segnalazioni relative ai contratti derivati

Le informazioni da includere nelle segnalazioni ai sensi dell'articolo 9 del regolamento (UE) n. 648/2012 sono trasmesse secondo il formato di cui all'allegato del presente regolamento.

Articolo 2

Frequenza delle segnalazioni relative ai contratti derivati

Per i contratti segnalati ai repertori di dati sulle negoziazioni la valutazione a prezzi correnti di mercato o la valutazione in base ad un modello è effettuata ogni giorno, se così previsto all'articolo 11, paragrafo 2, del regolamento (UE) n. 648/2012. Tutti gli altri elementi da segnalare conformemente all'allegato del presente regolamento e all'allegato dell'atto delegato riguardante le norme tecniche di regolamentazione per precisare le informazioni da segnalare al repertorio di dati sulle negoziazioni, ai sensi dell'articolo 9, paragrafo 5, del regolamento (UE) n. 648/2012, sono segnalati appena disponibili, tenendo conto dei termini di cui all'articolo 9 del regolamento (UE) n. 648/2012, in particolare per quanto riguarda la conclusione, la modifica o la cessazione del contratto.

Articolo 3

Identificazione delle controparti e di altri soggetti

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

- (a) il beneficiario, se persona giuridica;
- (b) l'intermediario;
- (c) la controparte centrale;
- (d) il partecipante diretto, se persona giuridica;
- (e) la controparte, se persona giuridica;
- (f) il soggetto segnalante.

2. Se l'identificativo della persona giuridica non è disponibile, la segnalazione include l'identificativo temporaneo della persona giuridica definito a livello dell'Unione, che sia:

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

3. Se non è disponibile né l'identificativo della persona giuridica né l'identificativo temporaneo della persona giuridica, nella segnalazione è utilizzato il *Business Identifier Code (BIC)* conformemente alla norma ISO 9362, se disponibile.

Articolo 4

Identificazione dei derivati

1. Nella segnalazione il contratto derivato è identificato mediante un identificativo unico del prodotto (*Unique product identifier*), che sia:

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

2. Se l'identificativo unico del prodotto non esiste, nella segnalazione il contratto derivato è identificato mediante una combinazione del codice ISIN secondo ISO 6166 assegnato, o del codice identificativo alternativo dello strumento (*Alternative Instrument Identifier – AII*), e del corrispondente codice CFI secondo ISO 10962.

3. Se la combinazione di cui al paragrafo 2 non è disponibile, il tipo di derivato è identificato sulla base dei seguenti elementi:

- (a) la categoria di derivati è identificata come una delle seguenti:
 - i) materie prime;
 - ii) crediti;
 - iii) tassi di cambio;
 - iv) azioni;
 - v) tassi di interesse;
 - vi) altro.
- (b) il tipo di derivato è identificato come uno dei seguenti:
 - i) contratto per differenza;
 - ii) contratto sui tassi a termine del tipo *Forward Rate Agreements*;
 - iii) forward;
 - iv) future;
 - v) opzione;
 - vi) swap;
 - vii) altro;
- (c) nel caso di derivati non rientranti in una specifica categoria di derivati o in uno specifico tipo di derivato, la segnalazione è effettuata sulla base della categoria di derivati o del tipo di derivati a cui il derivato si avvicina maggiormente, secondo quanto concordato dalle parti.

⁽¹⁾ GU L 331 del 15.12.2010, pag. 84.

Articolo 5

Data di inizio della segnalazione

1. I contratti derivati su crediti e su tassi di interesse sono segnalati:

- (a) entro il 1° luglio 2013, se il repertorio di dati sulle negoziazioni per la particolare categoria di derivati è stato registrato ai sensi dell'articolo 55 del regolamento (UE) n. 648/2012 prima del 1° aprile 2013;
 - (b) 90 giorni dopo la registrazione del repertorio di dati sulla negoziazione per la particolare categoria di derivati ai sensi dell'articolo 55 del regolamento (UE) n. 648/2012, se non esiste un repertorio di dati sulle negoziazioni registrato per la particolare categoria di derivati prima del 1° aprile 2013 o a tale data;
 - (c) entro il 1° luglio 2015, se non esiste un repertorio di dati sulle negoziazioni registrato per la particolare categoria di derivati ai sensi dell'articolo 55 del regolamento (UE) n. 648/2012. L'obbligo di segnalazione decorre da detta data e i contratti sono segnalati all'AESFEM ai sensi dell'articolo 9, paragrafo 3, dello stesso regolamento fino al momento in cui sarà registrato un repertorio di dati sulle negoziazioni per la particolare categoria di derivati.
2. I contratti derivati non menzionati al paragrafo 1 sono segnalati:
- (a) entro il 1° luglio 2014, se il repertorio di dati sulle negoziazioni per la particolare categoria di derivati è stato registrato ai sensi dell'articolo 55 del regolamento (UE) n. 648/2012 prima del 1° ottobre 2013;
 - (b) 90 giorni dopo la registrazione del repertorio di dati sulle negoziazioni per la particolare categoria di derivati ai sensi dell'articolo 55 del regolamento (UE) n. 648/2012, se non esiste un repertorio di dati sulle negoziazioni registrato per la particolare categoria di derivati prima del 1° ottobre 2013 o a tale data;

(c) entro il 1° luglio 2015, se non esiste un repertorio di dati sulle negoziazioni registrato per la particolare categoria di derivati ai sensi dell'articolo 55 del regolamento (UE) n. 648/2012. L'obbligo di segnalazione decorre da detta data e i contratti sono segnalati all'AESFEM ai sensi dell'articolo 9, paragrafo 3, dello stesso regolamento fino al momento in cui sarà registrato un repertorio di dati sulle negoziazioni per la particolare categoria di derivati.

3. I contratti derivati in essere al 16 agosto 2012 e ancora in essere alla data di inizio della segnalazione sono segnalati al repertorio di dati sulle negoziazioni entro 90 giorni dalla data di inizio della segnalazione per la particolare categoria di derivati.

4. I contratti derivati che

(a) sono stati stipulati prima del 16 agosto 2012 e sono ancora in essere al 16 agosto 2012 o

(b) sono stati stipulati il 16 agosto 2012 o dopo tale data

e che non sono più in essere alla data di inizio della segnalazione o dopo tale data sono segnalati al repertorio di dati sulle negoziazioni entro 3 anni dalla data di inizio della segnalazione per la particolare categoria di derivati.

5. La data di inizio della segnalazione è prorogata di 180 giorni per la segnalazione delle informazioni di cui all'articolo 3 dell'atto delegato riguardante le norme tecniche di regolamentazione per precisare le informazioni da segnalare al repertorio di dati sulle negoziazioni ai sensi dell'articolo 9, paragrafo 5, del regolamento (UE) n. 648/2012.

Articolo 6

Entrata in vigore

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

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

Fatto a Bruxelles, il 19 dicembre 2012

Per la Commissione

Il presidente

José Manuel BARROSO

ALLEGATO

Tabella 1

dati della controparte

	Campo	Formato
	Parti del contratto	
1	Data e ora della segnalazione	Formato della data secondo ISO 8601, formato dell'ora secondo UTC.
2	Identificativo della controparte	Identificativo della persona giuridica (<i>Legal Entity Identifier</i> - LEI) (20 caratteri alfanumerici), identificativo temporaneo della persona giuridica (20 caratteri alfanumerici), BIC (11 caratteri alfanumerici) o codice cliente (50 caratteri alfanumerici).
3	Identificativo dell'altra controparte	Identificativo della persona giuridica (LEI) (20 caratteri alfanumerici), identificativo temporaneo della persona giuridica (20 caratteri alfanumerici); BIC (11 caratteri alfanumerici) o codice cliente (50 caratteri alfanumerici).
4	Nome della controparte	100 caratteri alfanumerici o lasciare in bianco se è stato indicato l'identificativo della persona giuridica (LEI).
5	Domicilio della controparte	500 caratteri alfanumerici o lasciare in bianco se è stato indicato il rispettivo identificativo della persona giuridica (LEI).
6	Settore di attività della controparte	Tassonomia: A = impresa di assicurazione autorizzata ai sensi della direttiva 2002/83/CE; C = ente creditizio autorizzato ai sensi della direttiva 2006/48/CE; F = impresa di investimento ai sensi della direttiva 2004/39/CE; I = impresa di assicurazione autorizzata ai sensi della direttiva 73/239/CEE; L = fondo di investimento alternativo gestito da GEPIA autorizzati o registrati ai sensi della direttiva 2011/61/UE; O = ente pensionistico aziendale o professionale ai sensi dell'articolo 6, lettera a), della direttiva 2003/41/CE. R = impresa di riassicurazione autorizzata ai sensi della direttiva 2005/68/CE; U = OICVM e relativa società di gestione autorizzati ai sensi della direttiva 2009/65/CE; o lasciare in bianco se è stato indicato l'identificativo della persona giuridica (LEI) o in caso di controparte non finanziaria.
7	Natura finanziaria o non finanziaria della controparte	F=controparte finanziaria, N = controparte non finanziaria.
8	Identificativo dell'intermediario	Identificativo della persona giuridica (LEI) (20 caratteri alfanumerici), identificativo temporaneo della persona giuridica (20 caratteri alfanumerici); BIC (11 caratteri alfanumerici) o codice cliente (50 caratteri alfanumerici).

	Campo	Formato
	Parti del contratto	
9	Identificativo del soggetto segnalante	Identificativo della persona giuridica (LEI) (20 caratteri alfanumerici), identificativo temporaneo della persona giuridica (20 caratteri alfanumerici); BIC (11 caratteri alfanumerici) o codice cliente (50 caratteri alfanumerici).
10	Identificativo del partecipante diretto	Identificativo della persona giuridica (LEI) (20 caratteri alfanumerici), identificativo temporaneo della persona giuridica (20 caratteri alfanumerici); BIC (11 caratteri alfanumerici) o codice cliente (50 caratteri alfanumerici).
11	Identificativo del beneficiario	Identificativo della persona giuridica (LEI) (20 caratteri alfanumerici), identificativo temporaneo della persona giuridica (20 caratteri alfanumerici); BIC (11 caratteri alfanumerici) o codice cliente (50 caratteri alfanumerici).
12	Capacità negoziale	P=principale, a=agente.
13	Lato della controparte	B=acquirente, S=venditore.
14	Operazione con controparte extra-SEE	S=sì, N=no.
15	Direttamente collegato a attività commerciali o finanziamenti di tesoreria	S=sì, N=no.
16	Soglia di compensazione	Y=superiore, N=inferiore.
17	Valore del contratto a prezzi correnti di mercato	Fino a 20 caratteri numerici nel formato xxxx,yyyyy.
18	Valuta del valore del contratto a prezzi correnti di mercato	Codice valuta secondo ISO 4217, 3 caratteri alfabetici.
19	Data della valutazione	Formato della data secondo ISO 8601.
20	Ora della valutazione	Formato dell'ora secondo UTC.
21	Tipo di valutazione	M=ai prezzi correnti di mercato, O=in base ad un modello.
22	Costituzione di garanzia reale	U=non garantito, PC=parzialmente garantito, OC=garantito in un unico senso o FC=garantito integralmente.
23	Garanzia reale per portafoglio	S=sì, N=no.
24	Codice della garanzia reale per portafoglio	Fino a 10 caratteri numerici.
25	Valore della garanzia reale	Indicare il valore dell'importo complessivo delle garanzie reali fornite; fino a 20 caratteri numerici nel formato xxxx,yyyyy.

	Campo	Formato
	Parti del contratto	
26	Valuta del valore della garanzia reale	Indicare la valuta del campo 25; codice valuta secondo ISO 4217, 3 caratteri alfabetici.

Tabella 2

dati comuni

	Campo	Formato	Tipo di contratto derivato interessato
	Sezione 2a – tipo di contratto		Tutti i contratti
1	Tassonomia utilizzata	Indicare la tassonomia utilizzata: U = identificativo del prodotto [approvato in Europa] I = ISIN/AII + CFI. E = tassonomia temporanea	
2	Identificativo del prodotto 1	Per tassonomia = U: identificativo unico del prodotto (UPI), da definire Per tassonomia = I: ISIN o AII, codice di 12 caratteri alfanumerici Per tassonomia = E: categorie di derivati: CO = materie prime Cr = crediti CU = valuta EQ = azioni IR = tassi di interesse OT = altro	
3	Identificativo del prodotto 2	Per tassonomia = U: lasciare in bianco Per tassonomia = I: CFI, codice di 6 caratteri alfabetici Per tassonomia = E: tipo di derivati: CD = contratti per differenza FR = forward rate agreement FU = future FW = forward OP = opzione SW = swap OT = altro	

	Campo	Formato	Tipo di contratto derivato interessato
4	Sottostante	ISIN (12 caratteri alfanumerici); LEI (20 caratteri alfanumerici); Identificativo temporaneo della persona giuridica (20 caratteri alfanumerici); UPI (da definire); B = paniere; I = indice.	
5	Valuta nozionale 1	Codice valuta secondo ISO 4217, 3 caratteri alfabetici.	
6	Valuta nozionale 2	Codice valuta secondo ISO 4217, 3 caratteri alfabetici.	
7	Valuta di consegna	Codice valuta secondo ISO 4217, 3 caratteri alfabetici.	
	Sezione 2b – dati sull'operazione		Tutti i contratti
8	Identificativo dell'operazione	Fino a 52 caratteri alfanumerici.	
9	Numero di riferimento dell'operazione	Campo alfanumerico fino a 40 caratteri	
10	Sede di esecuzione	Codice identificativo del mercato (<i>Market Identifier Code</i> – MIC) secondo ISO 10383, 4 caratteri alfabetici. Se del caso, XOFF per i derivati quotati negoziati fuori dai mercati regolamentati o XXXX per i derivati OTC.	
11	Compressione	Y = se il contratto deriva da compressione; N = se il contratto non deriva da compressione.	
12	Prezzo/tasso	Fino a 20 caratteri numerici nel formato xxxx,yyyyy.	
13	Notazione del prezzo	Ad es. codice valuta secondo ISO 4217, 3 caratteri alfabetici, percentuale.	
14	Importo nozionale	Fino a 20 caratteri numerici nel formato xxxx,yyyyy.	
15	Moltiplicatore del prezzo	Fino a 10 caratteri numerici.	
16	Quantitativo	Fino a 10 caratteri numerici.	
17	Pagamento anticipato	Fino a 10 caratteri numerici nel formato xxxx,yyyyy per i pagamenti effettuati dalla controparte segnalante e nel formato xxxx,yyyyy per i pagamenti ricevuti dalla controparte segnalante.	
18	Tipo di consegna	C=in contanti, P=fisica, O=a scelta della controparte.	
19	Data e ora di esecuzione	Formato della data secondo ISO 8601, formato dell'ora secondo UTC.	
20	Data di efficacia	Formato della data secondo ISO 8601.	
21	Data di scadenza	Formato della data secondo ISO 8601.	

	Campo	Formato	Tipo di contratto derivato interessato
22	Data di cessazione	Formato della data secondo ISO 8601.	
23	Data di regolamento	Formato della data secondo ISO 8601.	
24	Tipo di accordo quadro	Campo di testo libero, fino a 50 caratteri; indicare il nome dell'eventuale accordo quadro utilizzato.	
25	Versione dell'accordo quadro	Anno, xxxx.	
	Sezione 2c – attenuazione dei rischi/segnalazione		Tutti i contratti
26	Data e ora della conferma	Formato della data secondo ISO 8601, formato dell'ora secondo UTC.	
27	Mezzo di conferma	Y=confermato mediante mezzo non elettronico, N=non confermato, E=confermato con mezzo elettronico.	
	Sezione 2d – Compensazione		Tutti i contratti
28	Obbligo di compensazione	S=sì, N=no.	
29	Compensato	S=sì, N=no.	
30	Data e ora della compensazione	Formato della data secondo ISO 8601, formato dell'ora secondo UTC.	
31	Codice identificativo della controparte centrale	Identificatore delle persone giuridiche (<i>Legal entity identifier</i> – LEI) (20 caratteri alfanumerici) o, se non disponibile, identificativo temporaneo della persona giuridica (20 caratteri alfanumerici) o, se non disponibile, BIC (11 caratteri alfanumerici).	
32	Infragruppo	S=sì, N=no.	
	Sezione 2e – tassi di interesse		Derivati su tassi di interesse
33	Tasso fisso della gamba 1	Caratteri numerici in formato xxxx,yyyyy.	
34	Tasso fisso della gamba 2	Caratteri numerici in formato xxxx,yyyyy.	
35	Conteggio dei giorni del tasso fisso	Effettivi/365, 30B/360 o altro.	
36	Frequenza di pagamento della gamba fissa	Un intero multiplo di un periodo di tempo che descrive la frequenza dello scambio di pagamenti tra le controparti, ad esempio 10D, 3M, 5Y.	
37	Frequenza di pagamento del tasso variabile	Un intero multiplo di un periodo di tempo che descrive la frequenza dello scambio di pagamenti tra le controparti, ad esempio 10D, 3M, 5Y.	
38	Frequenza di revisione del tasso variabile	D = Un intero multiplo di un periodo di tempo che descrive la frequenza dello scambio di pagamenti tra le controparti, ad esempio 10D, 3M, 5Y.	
39	Tasso variabile della gamba 1	Nome dell'indice a tasso variabile, ad es. 3M Euribor.	

	Campo	Formato	Tipo di contratto derivato interessato
40	Tasso variabile della gamba 2	Nome dell'indice a tasso variabile, ad es. 3M Euribor.	
	Sezione 2f – tassi di cambio		Derivati su valuta
41	Valuta 2	Codice valuta ISO 4217, 3 caratteri alfabetici.	
42	Tasso di cambio 1	Fino a 10 caratteri numerici nel formato xxxx,yyyyy.	
43	Tasso di cambio a termine	Fino a 10 caratteri numerici nel formato xxxx,yyyyy.	
44	Base del tasso di cambio	Ad esempio EUR/USD o USD/EUR.	
	Sezione 2g – materie prime	Non necessario se viene fornito un UPI contenente tutte le informazioni indicate di seguito, tranne in caso di obbligo di segnalazione ai sensi del regolamento (UE) n. 1227/2011.	Derivati su materie prime
	Informazioni generali		
45	Materie prime sottostanti	AG = agricole EN = energia FR = trasporto merci ME = metalli IN = indice EV = ambientali EX = esotiche	
46	Informazioni specifiche sulle materie prime	<i>Agricole</i> GO = semi oleosi DA = prodotti lattiero-caseari LI = animali FO = prodotti forestali SO = softs <i>Energia</i> OI = petrolio NG = gas naturale CO = carbone EL = energia elettrica IE = interenergia <i>Metalli</i> PR = preziosi NP = non preziosi <i>Ambiente</i> WE = clima EM = emissioni	

	Campo	Formato	Tipo di contratto derivato interessato
	Energia		
47	Punto o zona di consegna	Codice EIC, codice alfanumerico di 16 caratteri.	
48	Punto di interconnessione	Campo di testo libero, fino a 50 caratteri.	
49	Tipo di carico	Sezione ripetibile dei campi da 50 a 54 per individuare il profilo di consegna del prodotto corrispondente ai periodi di consegna nel corso della giornata BL = carico di base PL = carico di punta OP = fuori picco BH = ore blocco OT = altro	
50	Data e ora di inizio della consegna	Formato della data secondo ISO 8601, formato dell'ora secondo UTC.	
51	Data e ora di fine della consegna	Formato della data secondo ISO 8601, formato dell'ora secondo UTC.	
52	Capacità oggetto del contratto	Campo di testo libero, fino a 50 caratteri.	
53	Numero di unità	10 caratteri numerici in formato xxxx,yyyyy.	
54	Prezzo per quantità per intervallo di tempo	10 caratteri numerici in formato xxxx,yyyyy.	
	Sezione 2h - Opzioni		Contratti contenenti un'opzione
55	Tipo di opzione	P=put, c=call.	
56	Stile dell'opzione (esercizio)	A=americano, b=bermudiano, E=europeo, S=asiatico.	
57	Prezzo strike (tasso cap/floor)	Fino a 10 caratteri numerici in formato xxxx,yyyyy.	
	Sezione 2i - Modifiche del contratto		Tutti i contratti
58	Tipo di azione	N = nuovo M = modifica E = errore C = annullamento Z = compressione V = aggiornamento della valutazione O = altro	
59	Dettagli sul tipo di azione	Campo di testo libero, fino a 50 caratteri.	