REGOLAMENTO DELEGATO (UE) 2019/358 DELLA COMMISSIONE**del 13 dicembre 2018****che integra il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione per la raccolta, verifica, aggregazione, comparazione e pubblicazione dei dati sulle operazioni di finanziamento tramite titoli (SFT) da parte dei repertori di dati sulle negoziazioni****(Testo rilevante ai fini del SEE)**

LA COMMISSIONE EUROPEA,

visto il trattato sul funzionamento dell'Unione europea,

visto il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 25 novembre 2015, sulla trasparenza delle operazioni di finanziamento tramite titoli e del riutilizzo e che modifica il regolamento (UE) n. 648/2012 ⁽¹⁾, in particolare l'articolo 5, paragrafo 7, lettera a), e l'articolo 12, paragrafo 3, lettera a) e b),

considerando quanto segue:

- (1) Per garantire la qualità delle informazioni sulle SFT segnalate loro, i repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero verificare l'identità delle entità che trasmettono le segnalazioni, l'integrità logica dell'ordine in cui le informazioni sulle SFT sono segnalate e la completezza e la correttezza di tali informazioni.
- (2) Per lo stesso motivo, i repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero riconciliare le informazioni contenute nelle singole segnalazioni di SFT ricevute. È opportuno precisare una procedura standardizzata per consentire ai repertori di riconciliare i dati in modo coerente e per ridurre il rischio di mancata riconciliazione di alcune informazioni sulle SFT. Tuttavia, è possibile che certe informazioni sulle SFT non siano identiche a causa delle specificità dei sistemi tecnologici usati dalle entità che trasmettono le segnalazioni. Occorre pertanto applicare alcune tolleranze per evitare che divergenze minori nelle informazioni segnalate sulle SFT impediscano alle autorità di analizzare i dati con una certa sicurezza.
- (3) Si prevede che le entità che trasmettono le segnalazioni possano migliorare col tempo le segnalazioni, sia in termini di riduzione del numero di rifiuti che in termini di riconciliazioni. Dovrebbero, tuttavia, disporre di tempo sufficiente per adeguarsi agli obblighi di segnalazione, in particolare per impedire l'accumulo di negoziazioni non riconciliate immediatamente dopo l'entrata in vigore dell'obbligo di segnalazione. È pertanto opportuno che in un primo tempo debba essere riconciliato solo un numero limitato di campi.
- (4) Le entità che trasmettono le segnalazioni e, se del caso, quelle responsabili delle segnalazioni dovrebbero essere in grado di monitorare il rispetto dei propri obblighi di segnalazione di cui al regolamento (UE) 2015/2365. Dovrebbero pertanto avere la possibilità di accedere a determinate informazioni, su base giornaliera, in relazione a tali segnalazioni, incluso l'esito della verifica delle segnalazioni, e all'andamento della riconciliazione dei dati segnalati. È pertanto necessario specificare le informazioni che il repertorio di dati sulle negoziazioni dovrebbe mettere a disposizione di tali entità al termine di ogni giornata lavorativa.
- (5) Per facilitare l'integrità delle informazioni sulle SFT, l'accesso diretto e immediato di cui all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365 dovrebbe essere fornito in modo armonizzato e coerente. Per standardizzare il processo di segnalazione, ridurre al minimo i costi per il settore finanziario e garantire la comparabilità e la coerente aggregazione dei dati tra i repertori, è opportuno che tutte le segnalazioni e tutti gli scambi avvengano in formato XML e seguano una metodologia ampiamente utilizzata nel settore.
- (6) L'accesso ai dati a livello di posizione sulle esposizioni tra due determinate controparti è fondamentale per consentire alle entità di cui all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365 di determinare le potenziali fonti di rischi sistemici o non sistemici per la stabilità finanziaria.
- (7) Per offrire un adeguato livello di trasparenza in merito alle SFT, i criteri utilizzati per l'aggregazione delle posizioni dovrebbero consentire al grande pubblico di comprendere il funzionamento dei mercati delle SFT, senza

⁽¹⁾ GUL 337 del 23.12.2015, pag. 1.

compromettere la riservatezza dei dati segnalati ai repertori di dati sulle negoziazioni. La frequenza e i dettagli della pubblicazione da parte di un repertorio delle posizioni aggregate a norma dell'articolo 12, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2015/2365 andrebbero specificati rifacendosi al collegato quadro previsto dal regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio ⁽²⁾ per i contratti derivati.

- (8) Il presente regolamento si basa sui progetti di norme tecniche di regolamentazione che l'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (ESMA) ha presentato alla Commissione conformemente alla procedura di cui all'articolo 10 del regolamento (UE) n. 1095/2010 del Parlamento europeo e del Consiglio ⁽³⁾.
- (9) Le disposizioni del presente regolamento riguardano gli standard operativi per la raccolta, aggregazione e comparazione dei dati da parte dei repertori di dati sulle negoziazioni e le procedure che i repertori devono applicare per verificare la completezza e la correttezza delle informazioni sulle SFT loro segnalate. Per garantire la coerenza tra tali disposizioni e per offrire una visione globale ai repertori di dati sulle negoziazioni, è opportuno inserire le relative norme tecniche di regolamentazione in un unico regolamento.
- (10) L'ESMA ha condotto consultazioni pubbliche su tali progetti di norme tecniche di regolamentazione, ne ha analizzato i potenziali costi e benefici e ha chiesto il parere del gruppo delle parti interessate nel settore degli strumenti finanziari e dei mercati istituito dall'articolo 37 del regolamento (UE) n. 1095/2010,

HA ADOTTATO IL PRESENTE REGOLAMENTO:

Articolo 1

Verifica delle segnalazioni delle SFT da parte dei repertori di dati sulle negoziazioni

1. Quando riceve una segnalazione di SFT, il repertorio di dati sulle negoziazioni verifica quanto segue:
- a) l'identità dell'entità che trasmette la segnalazione, quale indicata nella tabella 1, campo 2, dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2019/363 della Commissione ⁽⁴⁾;
 - b) che il modello XML utilizzato per segnalare l'SFT sia conforme alla metodologia ISO 20022, in linea con il regolamento di esecuzione (UE) 2019/363 della Commissione;
 - c) che l'entità che trasmette la segnalazione, se diversa dalla controparte segnalante indicata nella tabella 1, campo 3, dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2019/363 della Commissione, sia debitamente autorizzata ad effettuare la segnalazione per conto della controparte segnalante, tranne nel caso di cui all'articolo 4, paragrafo 3, del regolamento (UE) 2015/2365;
 - d) che la stessa segnalazione di SFT non sia stata presentata in precedenza;
 - e) che la segnalazione di SFT con tipo di azione «Modifica» si riferisca a una segnalazione presentata in precedenza;
 - f) che la segnalazione di SFT con tipo di azione «Modifica» non si riferisca a un'SFT segnalata come annullata;
 - g) che la segnalazione di SFT non includa un tipo di azione «Nuova» con riferimento a un'SFT già segnalata;
 - h) che la segnalazione di SFT non includa un tipo di azione «Componente posizione» con riferimento a un'SFT già segnalata;

⁽²⁾ 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).

⁽³⁾ Regolamento (UE) n. 1095/2010 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 24 novembre 2010, che istituisce l'Autorità europea di vigilanza (Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati), modifica la decisione n. 716/2009/CE e abroga la decisione 2009/77/CE della Commissione (GU L 331 del 15.12.2010, pag. 84).

⁽⁴⁾ Regolamento di esecuzione (UE) 2019/363 della Commissione, del 13 dicembre 2018, che stabilisce norme tecniche di attuazione per quanto riguarda il formato e la frequenza delle segnalazioni delle informazioni sulle operazioni di finanziamento tramite titoli (SFT) ai repertori di dati sulle negoziazioni a norma del regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio e che modifica il regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012 della Commissione relativamente all'utilizzo di codici per la segnalazione dei contratti derivati (Cfr. pag. 85 della presente Gazzetta ufficiale).

- i) che la segnalazione di SFT non intenda modificare le informazioni dell'entità che trasmette la segnalazione, della controparte segnalante o dell'altra controparte in un'SFT segnalata in precedenza;
- j) che la segnalazione di SFT non intenda modificare una segnalazione esistente indicando una data di valuta successiva alla data di scadenza dell'SFT segnalata;
- k) la correttezza e la completezza della segnalazione di SFT.

2. Il repertorio di dati sulle negoziazioni verifica se le informazioni sulle garanzie reali sono state indicate nella tabella 2, campi da 73 a 96, dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2019/363 della Commissione in relazione alle SFT per cui il campo 72 «Contrassegno Prestito titoli non garantito» della medesima tabella è segnalato come «falso». Il repertorio notifica l'esito della verifica, in conformità all'articolo 3, all'entità che trasmette la segnalazione, alla controparte segnalante e, se del caso, all'entità responsabile della segnalazione.

3. Se la segnalazione di SFT non rispetta i requisiti di cui al paragrafo 1, il repertorio di dati sulle negoziazioni la rifiuta, assegnandola a una delle rispettive categorie di cui alla tabella 2 dell'allegato I.

4. Entro sessanta minuti dal ricevimento della segnalazione di SFT, il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce all'entità che trasmette la segnalazione, alla controparte segnalante, e, se del caso, all'entità responsabile della segnalazione informazioni dettagliate sui risultati della verifica dei dati di cui al paragrafo 1. Il repertorio trasmette tali risultati in formato XML utilizzando un modello elaborato secondo la metodologia ISO 20022. I risultati comprendono, ove necessario, i motivi specifici del rifiuto della segnalazione di SFT conformemente al paragrafo 3.

Articolo 2

Riconciliazione dei dati da parte dei repertori di dati sulle negoziazioni

1. Il repertorio di dati sulle negoziazioni si adopera a riconciliare l'SFT segnalata seguendo l'iter indicato al paragrafo 2, a condizione che siano soddisfatte tutte le seguenti condizioni:

- a) il repertorio ha completato le verifiche di cui all'articolo 1, paragrafi 1 e 2;
- b) entrambe le controparti dell'SFT segnalata hanno l'obbligo di segnalazione;
- c) il repertorio non ha ricevuto per l'SFT segnalata una segnalazione successiva con il tipo di azione «Errore».

2. Se tutte le condizioni di cui al paragrafo 1 sono soddisfatte, il repertorio di dati sulle negoziazioni segue il seguente iter utilizzando l'ultimo valore segnalato per ciascun campo della tabella 1 dell'allegato I:

- a) il repertorio che ha ricevuto la segnalazione di un'SFT verifica se ha ricevuto una segnalazione corrispondente da o per conto dell'altra controparte;
- b) se non ha ricevuto la segnalazione corrispondente di cui alla lettera a), il repertorio si adopera per identificare il repertorio che l'ha ricevuta comunicando a tutti i repertori registrati i valori dei seguenti campi dell'SFT segnalata: «Identificativo unico dell'operazione (UTI)», «Controparte segnalante», «Altra controparte» e «Tipo di accordo quadro»;
- c) il repertorio che accerta che un altro repertorio ha ricevuto la segnalazione corrispondente di cui alla lettera a) scambia con esso le informazioni dell'SFT segnalata in formato XML, utilizzando un modello elaborato secondo la metodologia ISO 20022;
- d) fatta salva la lettera e), il repertorio considera riconciliata l'SFT segnalata se le informazioni dell'SFT trovano riscontro in n quelle della segnalazione corrispondente di cui alla lettera a);
- e) il repertorio si adopera a combinare separatamente i campi con i dati sui prestiti e i campi con i dati sulle garanzie reali dell'SFT segnalata osservando i limiti di tolleranza e le rispettive date di applicazione di cui alla tabella 1 dell'allegato I;

- f) per ogni SFT segnalata il repertorio assegna quindi valori alle categorie di riconciliazione della tabella 3 dell'allegato I;
- g) il repertorio conclude le fasi di cui alle lettere da a) a f) quanto prima e non le intraprende dopo le ore 18.00 del tempo universale coordinato (UCT) di un giorno lavorativo;
- h) il repertorio che non riesce a riconciliare l'SFT segnalata si adopera a combinarne le informazioni il giorno lavorativo successivo. Il repertorio cessa di adoperarsi per riconciliare l'SFT segnalata trenta giorni di calendario dopo la relativa scadenza segnalata oppure quando ha ricevuto al riguardo una segnalazione con tipo di azione «Chiusura» o «Componente posizione».
3. Al termine di ogni giorno lavorativo il repertorio di dati sulle negoziazioni conferma il numero totale di SFT segnalate oggetto di riconciliazione con ciascun repertorio con cui ha riconciliato SFT segnalate.
4. Entro sessanta minuti dalla conclusione del processo di riconciliazione di cui al paragrafo 2, lettera g), il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce all'entità che trasmette la segnalazione, alla controparte segnalante e, se del caso, all'entità responsabile della segnalazione i risultati del processo di riconciliazione che ha eseguito sulle SFT segnalate. Il repertorio trasmette tali risultati in formato XML utilizzando un modello elaborato secondo la metodologia ISO 20022, in cui inserisce informazioni sui campi che non sono stati oggetto di riconciliazione.

Articolo 3

Meccanismi di risposta a fine giornata

Entro la fine di ogni giornata lavorativa il repertorio di dati sulle negoziazioni mette a disposizione dell'entità che trasmette la segnalazione, della controparte segnalante, e, se del caso, dell'entità responsabile della segnalazione le seguenti informazioni sulle pertinenti SFT, in formato XML utilizzando un modello elaborato secondo la metodologia ISO 20022:

- a) le SFT segnalate nel corso della giornata;
- b) la situazione più recente delle SFT non giunte a scadenza o non segnalate con tipo di azione «Errore», «Chiusura» o «Componente posizione»;
- c) l'identificativo unico dell'operazione (UTI) delle SFT per cui il campo 72 della tabella 2 dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2019/363 della Commissione è segnalato come «falso» e per cui nei campi da 73 a 96 della stessa tabella non sono ancora state segnalate informazioni sulle garanzie reali;
- d) le SFT segnalate che sono state rifiutate nel corso della giornata;
- e) lo stato di riconciliazione di tutte le SFT segnalate, ad eccezione di quelle giunte a scadenza o per le quali oltre un mese prima del giorno lavorativo in questione erano pervenute segnalazioni con tipo di azione «Chiusura» o «Componente posizione».

Articolo 4

Accesso alle informazioni sulle SFT

Il repertorio di dati sulle negoziazioni dà alle entità elencate all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365, anche in caso di delega a norma dell'articolo 28 del regolamento (UE) n. 1095/2010, accesso diretto e immediato alle informazioni sulle SFT in forma elettronica informaticamente leggibile conformemente al regolamento delegato (UE) 2019/357 della Commissione ⁽³⁾.

Ai fini del primo comma, il repertorio di dati sulle negoziazioni utilizza il formato XML e un modello elaborato secondo la metodologia ISO 20022.

⁽³⁾ Regolamento delegato (UE) 2019/357 della Commissione, del 13 dicembre 2018, che integra il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione sull'accesso alle informazioni sulle operazioni di finanziamento tramite titoli registrate nei repertori di dati sulle negoziazioni (Cfr. pag. 22 della presente Gazzetta ufficiale).

Articolo 5

Calcolo e accesso ai dati a livello di posizione

1. Il repertorio di dati sulle negoziazioni calcola i dati a livello di posizione sulle esposizioni tra le controparti in termini di prestiti e garanzie reali. Il calcolo dei dati a livello di posizione si basa sui seguenti criteri:
 - a) i valori delle categorie di riconciliazione della tabella 3 dell'allegato I;
 - b) il tipo di SFT;
 - c) il settore delle controparti;
 - d) la situazione in termini di compensazione;
 - e) il fatto che l'SFT sia stata conclusa o meno in una sede di negoziazione;
 - f) il tipo di garanzia reale;
 - g) la valuta della componente contante;
 - h) lo scaglione di scadenza;
 - i) lo scaglione di scarto di garanzia;
 - j) i repertori ai quali l'altra controparte ha segnalato le informazioni sull'SFT.
2. Il repertorio di dati sulle negoziazioni assicura che le entità elencate all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365 abbiano accesso ai dati a livello di posizione conformemente alle modalità di accesso ai dati di cui al regolamento delegato (UE) 2019/357 della Commissione.
3. I dati a livello di posizione di cui al paragrafo 1 sono presentati in forma elettronica e leggibile a macchina, in formato XML utilizzando un modello elaborato secondo la metodologia ISO 20022.
4. L'accesso di cui al paragrafo 2 è dato il più presto possibile e comunque non oltre un giorno lavorativo successivo al ricevimento della segnalazione di SFT ai sensi dell'articolo 4, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2015/2365.
5. Il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce alle entità elencate all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365 l'accesso ai dati a livello aggregato conformemente alle modalità di accesso ai dati di cui al regolamento delegato (UE) 2019/357 della Commissione, calcolati in conformità alle norme e ai processi convenuti di comune accordo per la raccolta e l'aggregazione globale dei dati sulle SFT.

Articolo 6

Calcolo dei dati sulle posizioni aggregate da pubblicare

1. Il repertorio di dati sulle negoziazioni aggrega i dati sulle posizioni secondo i criteri di cui ai paragrafi 2 e 3 per i seguenti valori:
 - a) l'importo del capitale dei contratti di vendita con patto di riacquisto, delle operazioni di *buy-sell back* o di *sell-buy back*, la quantità totale di titoli o merci concessi o assunti in prestito e l'importo dei prestiti su margine;
 - b) il numero dell'identificativo unico dell'operazione (UTI) delle SFT;
 - c) il valore di mercato della garanzia reale.
2. Il repertorio di dati sulle negoziazioni aggrega i dati sulle posizioni per tutte le SFT segnalate con tipo di azione «Nuova» tra il sabato alle ore 00.00.00 UTC e il venerdì alle ore 23.59.59 UTC sulla base dei seguenti criteri e dei rispettivi valori di cui alla tabella 1 dell'allegato II:
 - a) l'ubicazione della controparte segnalante o eventualmente della relativa succursale;
 - b) l'ubicazione dell'altra controparte o eventualmente della relativa succursale;
 - c) il tipo di SFT;
 - d) lo stato di riconciliazione dell'SFT di cui alla tabella 3 dell'allegato I;

- e) il tipo di sede in cui l'SFT è stata conclusa;
 - f) il fatto che l'SFT sia stata sottoposta o meno a compensazione;
 - g) il metodo di trasferimento della garanzia reale;
 - h) ciascun indice utilizzato come riferimento per un'SFT negoziata in una sede di esecuzione diversa da «XXXX», se l'importo nominale aggregato segnalato al repertorio nell'indice è superiore a 5 miliardi di EUR e se almeno sei diverse controparti hanno segnalato le SFT corrispondenti al repertorio.
3. Il repertorio di dati sulle negoziazioni aggrega i dati sulle posizioni per tutte le SFT non giunte a scadenza oppure non segnalate con tipo di azione «Errore», «Chiusura» o «Componente posizione», entro il venerdì alle ore 23.59.59 UTC sulla base dei seguenti criteri e dei rispettivi valori di cui alla tabella 1 dell'allegato II:
- a) l'ubicazione della controparte segnalante o eventualmente della relativa succursale;
 - b) l'ubicazione dell'altra controparte o eventualmente della relativa succursale;
 - c) il tipo di SFT;
 - d) lo stato di riconciliazione dell'SFT di cui alla tabella 3 dell'allegato I;
 - e) il tipo di sede in cui l'SFT è stata conclusa;
 - f) il fatto che l'SFT sia stata sottoposta o meno a compensazione;
 - g) il metodo di trasferimento della garanzia reale;
 - h) ciascun indice utilizzato come riferimento per un'SFT negoziata in una sede di esecuzione diversa da «XXXX», se l'importo nominale aggregato segnalato al repertorio nell'indice è superiore a 5 miliardi di EUR e se almeno sei diverse controparti hanno segnalato le SFT corrispondenti al repertorio.
4. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dispone di una procedura per individuare i valori straordinari nei dati sulle posizioni aggregate.
5. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dispone di una procedura per eseguire e notificare rettifiche dei dati sulle posizioni aggregate, compresi quelle derivanti dalle segnalazioni con tipo di azione «Errore», e per pubblicare le aggregazioni originarie e rettificcate.

Articolo 7

Pubblicazione dei dati sulle posizioni aggregate

1. Il repertorio di dati sulle negoziazioni pubblica sul proprio sito Internet i dati sulle posizioni aggregate, calcolati conformemente all'articolo 6, su base settimanale e al più tardi il martedì a mezzogiorno per le SFT segnalate entro le ore 23.59.59 UTC del venerdì precedente.
2. Il repertorio di dati sulle negoziazioni pubblica tutti i dati sulle posizioni aggregate in euro utilizzando i tassi di cambio pubblicati sul sito Internet della BCE il venerdì precedente la pubblicazione di tali dati.
3. Il repertorio di dati sulle negoziazioni assicura che i dati sulle posizioni aggregate siano pubblicati in un formato tabellare di cui all'allegato II che consenta lo scaricamento dei dati.
4. I dati sulle posizioni aggregate pubblicate dal repertorio di dati sulle negoziazioni sul proprio sito Internet rimangono disponibili almeno 104 settimane.

Articolo 8

Entrata in vigore

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

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

Fatto a Bruxelles, il 13 dicembre 2018

Per la Commissione

Il presidente

Jean-Claude JUNCKER

ALLEGATO I

Tabella 1

Campi riconciliazione, livelli di tolleranza e data di inizio della fase di conciliazione

Tabella	Sezione	Campo	Tolleranza	Data di inizio specificata da:
Dati sulla controparte	NA	Controparte segnalante	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sulla controparte	NA	Lato della controparte	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sulla controparte	NA	Altra controparte	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Identificativo unico dell'operazione (UTI)	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Tipo di SFT	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Compensato	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Data e ora della compensazione	Un'ora	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Controparte centrale (CCP)	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Sede di negoziazione	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Tipo di accordo quadro	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Data e ora di esecuzione	Un'ora	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Data di valuta (data di inizio)	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Data di scadenza (data di fine)	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Data di chiusura	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Preavviso minimo	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Prima data di richiamo (<i>call-back</i>)	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Indicatore delle garanzie generiche (<i>general collateral</i>)	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi

Tabella	Sezione	Campo	Tolleranza	Data di inizio specificata da:
Dati sull'operazione	Prestito	Indicatore della consegna per valore (<i>delivery by value, DBV</i>)	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Metodo utilizzato per fornire le garanzie reali	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Scadenza aperta	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Opzione di chiusura	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Tasso fisso	Fino alla terza cifra decimale	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Convenzione sul conteggio dei giorni	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Tasso variabile	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Periodo di riferimento del tasso variabile - periodo	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Periodo di riferimento del tasso variabile - moltiplicatore	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Frequenza di pagamento per il tasso variabile - periodo	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Frequenza di pagamento per il tasso variabile - moltiplicatore	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Frequenza di revisione del tasso variabile - periodo	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Frequenza di revisione del tasso variabile - moltiplicatore	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Differenziale	Fino alla terza cifra decimale	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Importo in valuta delle operazioni di marginazione	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Valuta delle operazioni di marginazione	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365

Tabella	Sezione	Campo	Tolleranza	Data di inizio specificata da:
Dati sull'operazione	Prestito	Tasso rettificato	Fino alla terza cifra decimale	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Data di applicazione del tasso	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Importo del capitale alla data di valuta	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Importo del capitale alla data di scadenza	0,0005 %	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Valuta dell'importo del capitale	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Tipo di attività	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Identificativo del titolo	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Classificazione del titolo	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Categoria di prodotti	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Sottocategoria di prodotti	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Ulteriore sottocategoria di prodotti	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Quantità o importo nominale	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Unità di misura	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Valuta dell'importo nominale	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Prezzo del titolo o della merce	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Valuta del prezzo	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Qualità del titolo	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Scadenza del titolo	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365

Tabella	Sezione	Campo	Tolleranza	Data di inizio specificata da:
Dati sull'operazione	Prestito	Giurisdizione dell'emittente	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	LEI dell'emittente	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Tipo di titolo	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Valore del prestito	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Valore di mercato	0,0005 %	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Tasso di rimborso fisso	Fino alla terza cifra decimale	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Tasso di rimborso variabile	Fino alla terza cifra decimale	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Periodo di riferimento del tasso di rimborso variabile - periodo	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Periodo di riferimento del tasso di rimborso variabile - moltiplicatore	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Frequenza di pagamento per il tasso di rimborso variabile - periodo	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Frequenza di pagamento per il tasso di rimborso variabile - moltiplicatore	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Frequenza di revisione del tasso di rimborso variabile - periodo	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Frequenza di revisione del tasso di rimborso variabile - moltiplicatore	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Differenziale del tasso di rimborso	Fino alla terza cifra decimale	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Commissione sul prestito	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365

Tabella	Sezione	Campo	Tolleranza	Data di inizio specificata da:
Dati sull'operazione	Prestito	Accordi di esclusiva	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Prestito su margine in essere	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Valuta di base del prestito su margine in essere	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Valore di mercato dei prestiti a breve scadenza	0,0005 %	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Contrassegno Prestito titoli non garantito	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Copertura dell'esposizione netta	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Data di valuta della garanzia	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Tipo di componente della garanzia	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Importo delle garanzie in contante	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Valuta delle garanzie in contante	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Identificazione di un titolo utilizzato come garanzia	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Classificazione di un titolo utilizzato come garanzia reale	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Categoria di prodotti	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Sottocategoria di prodotti	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Ulteriore sottocategoria di prodotti	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Quantità o importo nominale della garanzia	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Unità di misura della garanzia	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi

Tabella	Sezione	Campo	Tolleranza	Data di inizio specificata da:
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Valuta dell'importo nominale della garanzia	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Valuta del prezzo	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Prezzo unitario	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Valore di mercato della garanzia	0,0005 %	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Scarto o margine	Fino alla terza cifra decimale	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Qualità della garanzia	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Data di scadenza della garanzia	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Giurisdizione dell'emittente	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	LEI dell'emittente	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Tipo di garanzia	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Possibilità di riutilizzare la garanzia reale	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Identificativo del paniere di garanzie reali	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Livello	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365

Tabella 2

Motivi di rifiuto della segnalazione di SFT

Categoria di rifiuto	Motivo
Schema	— la SFT è stata rifiutata perché non conforme allo schema
Autorizzazione	— la SFT è stata rifiutata perché l'entità che ha trasmesso la segnalazione non è autorizzata a trasmetterla a nome della controparte segnalante
Logica	— la SFT è stata rifiutata perché il tipo di azione non è a logica corretto
Conformità	— la SFT è stata rifiutata perché non è conforme a una o più norme di convalida

Tabella 3

Risultati del processo di riconciliazione

Categoria di riconciliazione	Valori
Tipo di segnalazione	Unilaterale/Bilaterale
Obbligo di segnalazione per entrambe le controparti	Sì/No
Stato di abbinamento	Abbinata/Non abbinata
Stato di riconciliazione del prestito	Riconciliato/Non riconciliato
Stato di riconciliazione della garanzia reale	Riconciliata/Non riconciliata
Ulteriori modifiche	Sì/No

Tabella 1

Dati pubblici

Tabella A. Aggregazione

Data	Registro	Tipo di aggregazione	Tipo di sede	Ubicazione della controparte segnalante	Ubicazione dell'altra controparte	Riconciliazione	Tipo di SFT	Compensata	Metodo di trasferimento della garanzia	Indice di riferimento ⁽¹⁾	Importo aggregato concesso in prestito	Numero aggregato delle operazioni	Valore aggregato delle garanzie reali
20161007	Rep. UE	Segnalata	XXXX	SEE	SEE	Bilaterale, prestito riconciliato, garanzia non riconciliata	Pronti contro termine	Sì	TTCA		...		...
...	...	In essere	XOFF	Extra SEE	Extra SEE	Bilaterale, prestito riconciliato, garanzia riconciliata	BSB/SBB	No	SICA		...		...
...	...	...	SEE - MIC	...	...	Unilaterale SEE, prestito riconciliato, garanzia riconciliata	Concessione e assunzione in prestito di titoli o merci	...	SIUR		...		...
...	...	...	SEE - MIC	...	...	...	Operazione di marginazione	...			...		...
...	...	...	...	...	...	...	...	...	...		...		...

⁽¹⁾ Inserire gli indici pertinenti indicati nel campo 25 della tabella 2 «Dati sui prestiti e sulle garanzie» dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2019/363