



BANCA D'ITALIA  
EUROSISTEMA

# **ISTRUZIONI PER LA COMPILAZIONE DEI MESSAGGI FEAT E FE129**

# INDICE

<b>PREMESSA .....</b>	<b>3</b>
<b>ISTRUZIONI PER LA COMPILAZIONE DEI MESSAGGI FEAT .....</b>	<b>4</b>
RUOLI FEAT .....	4
MESSAGGI PREVISTI PER I DIVERSI RUOLI FEAT .....	4
<b>ISTRUZIONI PER LA COMPILAZIONE DEI MESSAGGI FE129 .....</b>	<b>7</b>
RUOLI FE129 .....	7
MESSAGGI PREVISTI PER I DIVERSI RUOLI FE129 .....	7
<b>DESCRIZIONE MESSAGGI.....</b>	<b>10</b>
MESSAGGI SENZA EFFETTI AI FINI SEGNALETICI EX ART.129 DEL TUB .....	10
MESSAGGI CON EFFETTI AI FINI SEGNALETICI EX ART.129 DEL TUB.....	11
<b>ISTRUZIONI OPERATIVE.....</b>	<b>13</b>
<b>COMPOSIZIONE MESSAGGI.....</b>	<b>15</b>
TITOLI DI DEBITO (SENZA EFFETTI AI FINI SEGNALETICI EX ART.129) .....	16
TITOLI DI DEBITO (CON EFFETTI AI FINI SEGNALETICI EX ART.129).....	20
TITOLI DI DEBITO: ABS E CDO (SENZA EFFETTI AI FINI SEGNALETICI EX ART.129).....	26
TITOLI DI DEBITO: ABS E CDO (CON EFFETTI AI FINI SEGNALETICI EX ART.129) .....	30
TITOLI DI CAPITALE.....	36
DIRITTI .....	37
WARRANT .....	38
INVESTMENT CERTIFICATES (SENZA EFFETTI AI FINI SEGNALETICI EX ART.129).....	39
INVESTMENT CERTIFICATES (CON EFFETTI AI FINI SEGNALETICI EX ART.129) .....	41
COVERED WARRANT, LEVERAGE CERTIFICATES, ETC, ETN (SENZA EFFETTI AI FINI SEGNALETICI EX ART.129).....	46
COVERED WARRANT, LEVERAGE CERTIFICATES, ETC, ETN (CON EFFETTI AI FINI SEGNALETICI EX ART.129) .....	47
NUMERO OPERAZIONE CARTOLARIZZAZIONE .....	51
QUOTAZIONE.....	51
<b>DESCRIZIONE CAMPI.....</b>	<b>52</b>
STRUMENTO FINANZIARIO.....	53
GARANZIE .....	62
RESTRIZIONI.....	65
REGIME FISCALE .....	66
QUOTAZIONE SU MERCATI REGOLAMENTATI E MFT .....	67
COLLOCAMENTO .....	68
TRANCHE DI COLLOCAMENTO .....	69
MODALITA' DI COLLOCAMENTO .....	70
COLLOCATORI .....	74
RENDIMENTO.....	74
<i>Titoli a Tasso Variabile</i> .....	78
<i>Titoli Strutturati</i> .....	78
<i>Piano di Rendimento</i> .....	80
RIMBORSO .....	81
TITOLI CON AMMORTAMENTO.....	82
ALTRE OPZIONI .....	84
SEZIONI 2-3 DELLE DISPOSIZIONI 129.....	86
SEZIONE 4 DELLE DISPOSIZIONI 129 .....	89
DATI SPECIFICI CARTOLARIZZAZIONI.....	92
DATI SPECIFICI TITOLI DI CAPITALE.....	96
DATI SPECIFICI DIRITTI .....	99
DATI SPECIFICI WARRANT .....	100
DATI SPECIFICI INVESTMENT CERTIFICATES .....	101
DATI SPECIFICI LEVERAGE CERTIFICATE E COVERED WARRANT .....	102
ALTRI DATI SPECIFICI .....	103
ALTRI CAMPI.....	107
<b>COMPILAZIONE MESSAGGI TRAMITE CARICAMENTO FILE.....</b>	<b>108</b>
MESSAGGI FEAT COMPILABILI CON CSV.....	108
MESSAGGI FE129 COMPILABILI CON CSV .....	110

## Premessa

Il presente documento contiene le istruzioni sulle modalità di compilazione dei messaggi nelle due survey INFOSTAT:

- FEAT: Front End Anagrafe Titoli
- FE129: Front End 129

Le due survey, sebbene presentino un'interfaccia molto simile, permettono agli utenti abilitati di svolgere operazioni tra loro differenti.

In particolare, la survey FEAT permette di effettuare operazioni di richiesta ISIN, censimento ISIN e comunicazione di aggiornamenti per i titoli di emittenti residenti o accentrati in Italia secondo le disposizioni dello standard ISO 6166. Tali operazioni rientrano tra le attività del “Servizio di Codifica Strumenti Finanziari” fornito dalla Banca d'Italia nel suo ruolo di Agenzia Nazionale di Codifica (NNA). Per ulteriori approfondimenti si rinvia al documento “[Condizioni di utilizzo del Servizio di Codifica](#)” disponibile sul sito web della Banca d'Italia.

La survey FE129 permette di effettuare le segnalazioni di cui all'Art.129 del TUB (di seguito “segnalazione 129”) aventi per oggetto esclusivamente le tipologie di strumenti finanziari di cui alle “Disposizioni in materia di segnalazioni a carattere consuntivo relative all'emissione e all'offerta di strumenti finanziari” (di seguito “Disposizioni 129”). Per i suddetti titoli consente, inoltre, di effettuare le stesse operazioni previste dalla survey FEAT, in questo modo il partner potrà utilizzare lo stesso applicativo per richiedere/censire il codice ISIN e adempiere agli obblighi di segnalazione ex Art.129.

Entrambe le survey si avvalgono della piattaforma INFOSTAT, per le modalità di accesso ai servizi si rinvia alle [istruzioni](#) presente sul sito web della Banca d'Italia.

Per le modalità operative di utilizzo degli applicativi fare riferimento ai manuali operativi disponibili sul sito web della Banca d'Italia.

Ai fini del presente documento si definisce:

- **PARTNER**: il soggetto (banca, società di cartolarizzazione, SIM, società non finanziaria, ...) abilitato all'utilizzo delle survey;
- **UTENTE**: la persona fisica delegata dal Partner ad operare all'interno di una survey. Qualora il Partner sia abilitato ad entrambe le survey, la delega relativa ad una survey non ha valore per l'altra; un Utente può essere delegato da più di un Partner.

## Istruzioni per la compilazione dei messaggi FEAT

La survey FEAT è strutturata come un insieme di messaggi che consentono all'Utente di effettuare operazioni di richiesta ISIN, censimento ISIN e comunicazione di aggiornamenti sui titoli di interesse.

Nei prossimi paragrafi verranno descritti i diversi profili ("Ruoli") con cui un Partner abilitato alla survey può operare all'interno dell'applicazione e le tipologie di messaggi disponibili per ciascuno di essi.

### Ruoli FEAT

Ad ogni Partner abilitato all'utilizzo della survey FEAT è associato uno o più dei seguenti Ruoli:

- **EMITTENTE:** da utilizzare per le operazioni relative a strumenti finanziari di propria emissione;
- **COLLOCATORE:** da utilizzare per le operazioni relative a strumenti di debito per cui si opera in qualità di "Lead Manager";
- **SEGNALANTE:** da utilizzare per le operazioni relative a strumenti finanziari non di propria emissione già emessi, ma rispetto ai quali devono essere effettuate segnalazioni statistiche o di vigilanza alla Banca d'Italia.

### Messaggi previsti per i diversi Ruoli FEAT

A ciascun Ruolo è associato un insieme di messaggi attraverso cui è possibile effettuare le diverse operazioni disponibili.

Per visualizzare i messaggi associati a ciascun Ruolo, una volta eseguito l'accesso alla survey<sup>1</sup>, è sufficiente selezionare il nome di uno dei Partner per cui l'Utente è delegato e successivamente uno dei Ruoli disponibili nell'elenco a tendina. Sulla schermata principale apparirà una lista di cartelle contenenti i messaggi suddivisi per tipologia di strumento finanziario.

Si riportano di seguito le tabelle riepilogative dei messaggi disponibili per tipologia di strumento finanziario e Ruolo del Partner. Per la descrizione della finalità dei messaggi si rimanda al capitolo "Descrizione messaggi".

#### TITOLI DI DEBITO<sup>2</sup>

TIPO MESSAGGIO	Emittente	Collocatore	Segnalante
Richiesta ISIN	X	X	
Richiesta ISIN con dati definitivi	X		X
Censimento ISIN	X		
Comunicazione dati definitivi	X	X	
Comunicazione aggiornamento informazioni sul collocamento	X		
Comunicazione cedole	X	X	
Comunicazione rimborsi	X <sup>3</sup>	X	

<sup>1</sup> Per maggiori informazioni sulle modalità operative di accesso a FEAT si rimanda al documento "[Indicazioni operative per l'accesso al servizio di codifica strumenti finanziari](#)".

<sup>2</sup> Escluse Cartolarizzazioni e Certificates, ETC e ETN.

**TITOLI DI DEBITO: ABS e CDO**

TIPO MESSAGGIO	Emittente <sup>3</sup>	Collocatore	Segnalante
Richiesta ISIN	X	X	
Censimento ISIN	X	X	
Comunicazione dati definitivi	X	X	
Comunicazione aggiornamento	X	X	
Comunicazione collocato	X	X	
Comunicazione cedole	X	X	
Comunicazione aggiornamento informazioni sul collocamento	X		
Comunicazione rimborsi	X	X	

**TITOLI DI CAPITALE**

TIPO MESSAGGIO	Emittente	Collocatore	Segnalante
Richiesta ISIN	X		X
Comunicazione aggiornamento	X		X

**DIRITTI**

TIPO MESSAGGIO	Emittente	Collocatore	Segnalante
Richiesta ISIN	X		X
Comunicazione aggiornamento	X		X

**WARRANT**

TIPO MESSAGGIO	Emittente	Collocatore	Segnalante
Richiesta ISIN	X		X
Comunicazione aggiornamento	X		X

**INVESTMENT CERTIFICATES**

TIPO MESSAGGIO	Emittente	Collocatore	Segnalante
Richiesta ISIN	X	X	
Censimento ISIN	X	X	
Comunicazione dati definitivi	X	X	
Comunicazione aggiornamento	X	X	
Comunicazione cedole	X	X	

<sup>3</sup> Valido solo per società veicolo di operazioni di cartolarizzazione.

**COVERED WARRANT, LEVERAGE CERTIFICATES, ETC, ETN**

<b>TIPO MESSAGGIO</b>	<b>Emittente</b>	<b>Collocatore</b>	<b>Segnalante</b>
Richiesta ISIN massiva	X		
Comunicazione dati definitivi massiva	X		
Comunicazione aggiornamento singolo	X		

**NUMERO OPERAZIONE CARTOLARIZZAZIONE<sup>4</sup>**

<b>TIPO MESSAGGIO</b>	<b>Emittente</b>	<b>Collocatore</b>	<b>Segnalante</b>
Richiesta numero operazione	X		
Comunicazione aggiornamento	X		
Comunicazione chiusura operazione	X		

**QUOTAZIONE**

<b>TIPO MESSAGGIO</b>	<b>Emittente</b>	<b>Collocatore</b>	<b>Segnalante</b>
Comunicazione quotazione	X	X	X

**COMUNICAZIONE GENERICA**

<b>TIPO MESSAGGIO</b>	<b>Emittente</b>	<b>Collocatore</b>	<b>Segnalante</b>
Comunicazione generica	X	X	X

**COMUNICAZIONE MANCATA EMISSIONE**

<b>TIPO MESSAGGIO</b>	<b>Emittente</b>	<b>Collocatore</b>	<b>Segnalante</b>
Annullamento ISIN per mancata emissione	X		

<sup>4</sup> Valido solo per società veicolo di operazioni di cartolarizzazione.

## Istruzioni per la compilazione dei messaggi FE129

La survey FE129, similmente alla survey FEAT, è strutturata come un insieme di messaggi che permettono all'Utente di effettuare le segnalazioni 129 e, volendo, di svolgere nel contempo tutte le attività della survey FEAT (richiesta e censimento ISIN).

Nel caso di dati comuni le informazioni fornite tramite FE129 sono successivamente consultabili anche via FEAT.

La survey FE129 ha ad oggetto esclusivamente le tipologie di strumenti finanziari di cui alle Disposizioni 129.

Nei prossimi paragrafi verranno descritti i diversi profili ("Ruoli") con cui un Partner abilitato alla survey può operare all'interno dell'applicazione e le tipologie di messaggi disponibili per ciascuno di essi.

### Ruoli FE129

A ogni Partner abilitato all'utilizzo della survey FE129 è associato uno o più dei seguenti Ruoli:

- **EMITTENTE:** da utilizzare per le operazioni relative a strumenti finanziari di propria emissione;
- **COLLOCATORE o OFFERENTE:** da utilizzare per le operazioni relative a strumenti finanziari emessi da soggetti esteri per cui si è collocatore o offerente in Italia. È assegnato solo a intermediari finanziari abilitati all'attività di collocamento. Al momento della selezione del titolo oggetto della segnalazione 129, l'applicativo richiederà la compilazione di un breve questionario attraverso il quale il Partner dichiarerà la propria "funzione" nell'ambito del processo di collocamento/offerta del titolo (es. Lead Manager, Responsabile del Regolamento, Offerente, ...);
- **CAPOGRUPPO:** da utilizzare per le operazioni relative a strumenti finanziari emessi da soggetti esteri appartenenti al gruppo bancario vigilato residente di cui il Partner è capogruppo.

### Messaggi previsti per i diversi Ruoli FE129

A ciascun Ruolo è associato un insieme di messaggi attraverso cui è possibile effettuare le diverse operazioni disponibili.

Per visualizzare i messaggi associati a ciascun Ruolo, una volta eseguito l'accesso alla survey<sup>5</sup>, è sufficiente selezionare il nome di uno dei Partner per cui l'Utente è delegato e successivamente uno dei Ruoli disponibili nell'elenco a tendina. Sulla schermata principale apparirà una lista di cartelle contenenti i messaggi suddivisi per tipologia di strumento finanziario.

Si riportano di seguito le tabelle riepilogative dei messaggi disponibili per classe di strumento finanziario e Ruolo del Partner. Per la descrizione della finalità dei messaggi si rimanda al capitolo "Descrizione messaggi".

#### TITOLI DI DEBITO

TIPO MESSAGGIO	Emittente	Collocatore	Capogruppo
Richiesta ISIN	X		X
Richiesta ISIN con dati definitivi e info anagrafiche 129 (sez. 1)	X		X
Censimento ISIN per segnalazione 129 - sezione 4		X	
Censimento ISIN e info anagrafiche 129 (sez. 1)	X	X	X
Comunicazione dati definitivi e info anagrafiche 129 (sez. 1)	X	X	X
Comunicazione info anagrafiche 129 (sez. 1)	X	X	X
Comunicazione info anagrafiche 129 (sez. 2-3)	X	X	X
Comunicazione cedole	X	X	X

<sup>5</sup> Per maggiori informazioni sulle modalità operative di accesso a FE129 si rimanda al documento "[Indicazioni operative per l'accesso al servizio di codifica strumenti finanziari](#)".

Comunicazione aggiornamento informazioni sul collocamento	X		
Comunicazione collocato (sez. 4)	X <sup>6</sup>	X	X
Comunicazione rimborsi anticipati (sez. 4)	X <sup>7</sup>		X

#### TITOLI DI DEBITO: ABS e CDO

TIPO MESSAGGIO	Emittente <sup>7</sup>	Collocatore	Capogruppo
Richiesta ISIN	X		X
Censimento ISIN per segnalazione 129 - sezione 4		X	
Censimento ISIN e info anagrafiche 129 (sez. 1)	X	X	X
Comunicazione dati definitivi e info anagrafiche 129 (sez. 1)	X	X	X
Comunicazione info anagrafiche 129 (sez. 1)	X	X	X
Comunicazione info anagrafiche 129 (sez. 2-3)	X	X	X
Comunicazione cedole	X	X	X
Comunicazione aggiornamento informazioni sul collocamento	X		
Comunicazione collocato (sez. 4)	X	X	X
Comunicazione rimborsi anticipati (sez. 4)	X		X

#### INVESTMENT CERTIFICATES

TIPO MESSAGGIO	Emittente	Collocatore	Capogruppo
Richiesta ISIN massiva	X		
Censimento ISIN massivo <sup>8</sup> e info anagrafiche 129 (sez. 1)	X	X	X
Comunicazione massiva dati definitivi e info anagrafiche 129 (sez. 1)	X		
Comunicazione massiva <sup>9</sup> info anagrafiche 129 (sez. 1)	X	X	X
Comunicazione massiva <sup>9</sup> info anagrafiche 129 (sez. 2-3)	X	X	X
Comunicazione cedole	X	X	X

#### COVERED WARRANT, LEVERAGE CERTIFICATES, ETC, ETN

TIPO MESSAGGIO	Emittente	Collocatore	Capogruppo
Richiesta ISIN massiva	X		
Censimento ISIN massivo e info anagrafiche 129 (sez. 1)	X	X	X
Comunicazione massiva dati definitivi e info anagrafiche 129 (sez. 1)	X		
Comunicazione massiva info anagrafiche 129 (sez. 1)	X	X	X
Comunicazione massiva info anagrafiche 129 (sez. 2-3)	X	X	X

<sup>6</sup> Sono escluse le banche residenti poiché effettuano analoga segnalazione ai sensi delle Circ. n.154 e n.272.

<sup>7</sup> Valido solo per società veicolo di operazioni di cartolarizzazione.

<sup>8</sup> Messaggi non massivi per Ruolo Collocatore.



**SEGNALAZIONE TRIMESTRALE**

<b>TIPO MESSAGGIO</b>	<b>Emittente</b>	<b>Collocatore</b>	<b>Capogruppo</b>
Comunicazione informazioni quantitative Certificates, CW, ETC e ETN (sez. 4)	X	X	X

**QUOTAZIONE**

<b>TIPO MESSAGGIO</b>	<b>Emittente</b>	<b>Collocatore</b>	<b>Capogruppo</b>
Comunicazione quotazione	X	X	X

**NUMERO OPERAZIONE CARTOLARIZZAZIONE<sup>9</sup>**

<b>TIPO MESSAGGIO</b>	<b>Emittente</b>	<b>Collocatore</b>	<b>Capogruppo</b>
Richiesta numero operazione	X		
Comunicazione aggiornamento	X		
Comunicazione chiusura operazione	X		

**COMUNICAZIONE GENERICA**

<b>TIPO MESSAGGIO</b>	<b>Emittente</b>	<b>Collocatore</b>	<b>Capogruppo</b>
Comunicazione generica	X	X	X

**COMUNICAZIONE MANCATA EMISSIONE**

<b>TIPO MESSAGGIO</b>	<b>Emittente</b>	<b>Collocatore</b>	<b>Segnalante</b>
Annullamento ISIN per mancata emissione	X		

<sup>9</sup> Valido solo per società veicolo di operazioni di cartolarizzazione.

## Descrizione messaggi

Si riporta di seguito la descrizione degli utilizzi dei messaggi disponibili, suddivisi tra messaggi **senza effetti** ai fini segnaletici ex Art.129 del TUB e messaggi **con effetti** ai fini segnaletici ex Art.129 del TUB.

### Messaggi senza effetti ai fini segnaletici ex Art.129 del TUB

#### Richiesta ISIN

Da utilizzare per richiedere il codice ISIN di strumenti finanziari "in corso di emissione" per i quali la Banca d'Italia è Agenzia di Codifica competente (ISIN con prefisso "IT"). Il messaggio prevede l'invio obbligatorio di documentazione a supporto della codifica dello strumento. Tale documentazione è da considerarsi provvisoria. La relativa documentazione definitiva dovrà essere allegata al successivo messaggio di comunicazione dati definitivi o di aggiornamento.

#### Richiesta ISIN con dati definitivi

Da utilizzare per richiedere il codice ISIN di strumenti finanziari "già emessi" per i quali la Banca d'Italia è Agenzia di Codifica competente (ISIN con prefisso "IT"). Il messaggio prevede l'invio di documentazione a supporto della codifica dello strumento. Tale documentazione è da considerarsi definitiva.

*Per maggiori dettagli sugli strumenti finanziari oggetto di codifica da parte della Banca d'Italia in qualità di Agenzia Nazionale di Codifica (NNA), fare riferimento al documento ["Condizioni di utilizzo del Servizio di Codifica"](#) disponibile sul sito web della Banca d'Italia.*

#### Censimento ISIN

Da utilizzare per richiedere l'inserimento in Anagrafe Titoli (censimento) di strumenti finanziari emessi da soggetti residenti, per i quali la Banca d'Italia non è Agenzia di Codifica competente (ISIN con prefisso diverso da "IT").

#### Censimento ISIN a fini segnalazione 129 - sezione 4

Per il solo ruolo Collocatore, da utilizzare per richiedere l'inserimento in Anagrafe Titoli (censimento) di strumenti finanziari emessi da soggetti non residenti per i quali la Banca d'Italia non è Agenzia di Codifica competente (ISIN con prefisso diverso da "IT"). Questa tipologia di censimento deve essere utilizzata solo quando: (1) il Partner, in base a quanto previsto dalle Disposizioni 129, ha l'obbligo di segnalare la sola Sezione 4 e (2) il titolo non è presente in Anagrafe Titoli.

#### Comunicazione dati definitivi

Da utilizzare per comunicare i dati definitivi per gli strumenti finanziari già codificati attraverso il messaggio "Richiesta ISIN". La documentazione allegata è da considerarsi definitiva.

#### Comunicazione rimborsi

Per i Partner diversi dalle banche residenti<sup>11</sup>: da utilizzare per comunicare le informazioni sui rimborsi effettuati su di uno strumento finanziario già codificato.

#### Comunicazione aggiornamento informazioni sul collocamento

Messaggio per comunicare l'aggiornamento delle seguenti informazioni sul collocamento: aumento plafond, proroga/chiusura anticipata del periodo di collocamento, data regolamento e prezzo di emissione della prima tranche.

#### Comunicazione cedole

Da utilizzare per comunicare il tasso cedolare periodale per i titoli non a tasso fisso (per i titoli a tasso misto, limitatamente alla componente variabile). La comunicazione non è dovuta per i titoli one-coupon e zero coupon.

#### Comunicazione aggiornamento

Da utilizzare per comunicare l'aggiornamento di informazioni precedentemente trasmesse.

L'aggiornamento può avere carattere di:

- **Variazione:** la modifica ha effetto a partire da una specifica data di decorrenza da indicare obbligatoriamente nel messaggio (p.e.: società Alpha delibera in data dd/mm/yyyy la proroga di tre anni della data di scadenza dell'obbligazione ITxxxxxxxxx);
- **Correzione:** la modifica si riferisce a tutta la vita del titolo (p.e.: società Beta ha indicato una data di scadenza errata per l'obbligazione ITxxxxxxxxx ed intende correggerla).

In entrambi i casi il messaggio prevede l'invio di documentazione a supporto dell'aggiornamento trasmesso.

### **Comunicazione quotazione**

Da utilizzare per comunicare aggiornamenti sullo stato di quotazione di uno strumento finanziario.

L'aggiornamento può avere carattere di:

- **Variazione:** la modifica ha effetto a partire da una specifica data di decorrenza da indicare obbligatoriamente nel messaggio (p.e.: società Alpha viene ammessa a quotazione sul mercato regolamentato ZZZ in data dd/mm/yyyy);
- **Correzione:** la modifica si riferisce a tutta la vita del titolo (p.e.: società Beta ha commesso un errore nella comunicazione dello stato di quotazione sul mercato ZZZ ed intende correggerlo).

In entrambi i casi il messaggio prevede l'invio di documentazione a supporto dell'aggiornamento trasmesso.

**Comunicazione inizio attività di cartolarizzazione** Per le sole società veicolo di operazioni di cartolarizzazione: da utilizzare per richiedere l'attribuzione del numero identificativo della singola operazione di cartolarizzazione, necessario per la successiva richiesta di codifica ISIN dei titoli da emettere. Nel messaggio si richiedono informazioni su operazione, originator, attività cedute, servicer ed eventuale struttura di repackaging.

### **Comunicazione aggiornamento**

Per le sole società veicolo di operazioni di cartolarizzazione: da utilizzare per comunicare l'aggiornamento di informazioni precedentemente trasmesse sull'operazione di cartolarizzazione. Il messaggio ha sempre carattere di correzione (mai di variazione).

### **Comunicazione chiusura operazione**

Per le sole società veicolo di operazioni di cartolarizzazione: da utilizzare per comunicare la chiusura di un'operazione di cartolarizzazione.

### **Comunicazione collocato**

Per le sole società veicolo di operazioni di cartolarizzazione: da utilizzare per comunicare le informazioni sul collocato a seguito della chiusura del periodo di collocamento dello strumento finanziario già codificato.

### **Comunicazione generica**

Da utilizzare per inviare una richiesta non collegata a uno specifico strumento finanziario o comunque non prevista nei messaggi precedenti.

### **Annullamento ISIN per mancata emissione**

Messaggio per comunicare l'annullamento di un titolo il cui codice ISIN è stato richiesto ma mai emesso.

## **Messaggi con effetti ai fini segnaletici ex Art.129 del TUB**

*L'eventuale documentazione da allegare ai messaggi è richiesta **esclusivamente** per finalità di codifica/censimento ISIN e non per finalità segnaletiche ex Art. 129.*

### **Richiesta ISIN con dati definitivi e info anagrafiche 129 (sez. 1)**

Da utilizzare per richiedere il codice ISIN di strumenti finanziari "già emessi" ed effettuare la segnalazione 129 di sezione 1. Il messaggio prevede l'invio di documentazione a supporto della codifica dello strumento. Tale documentazione è da considerarsi definitiva.

### **Censimento ISIN e info anagrafiche 129 (sez. 1)**

Da utilizzare per richiedere l'inserimento in Anagrafe Titoli (censimento) degli strumenti finanziari per i quali la Banca d'Italia non è Agenzia di Codifica competente (ISIN con prefisso diverso da "IT") ed effettuare la segnalazione 129 di sezione 1.

### **Comunicazione dati definitivi e info anagrafiche 129 (sez. 1)**

Da utilizzare per comunicare i dati definitivi ed effettuare la segnalazione 129 di sezione 1 per gli strumenti finanziari già codificati attraverso il messaggio "Richiesta ISIN". La documentazione allegata è da considerarsi definitiva.

**Comunicazione info anagrafiche 129 (sez. 1)**

Da utilizzare per effettuare la segnalazione 129 di sezione 1 per gli strumenti finanziari già presenti in Anagrafe Titoli e per cui siano stati forniti i dati definitivi nel caso di titoli con prefisso "IT".

**Comunicazione info anagrafiche 129 (sez. 2-3)**

Da utilizzare per effettuare le segnalazioni 129 di sezione 2 e 3 per gli strumenti finanziari già presenti in Anagrafe Titoli e per cui sia già stata effettuata la segnalazione 129 di sezione 1.

**Comunicazione collocato (sez. 4)**

Da utilizzare, ove applicabile, per effettuare la segnalazione 129 di sezione 4 relativa al collocato.

**Comunicazione rimborsi anticipati (sez. 4)**

Da utilizzare, ove applicabile, per effettuare la segnalazione 129 di sezione 4 relativa ai rimborsi anticipati.

Si ricorda che la segnalazione dei rimborsi non è dovuta per il Ruolo "Collocatore" nè per covered warrant, certificates, ETC e ETN.

**Comunicazione informazioni quantitative certificates, CW, ETC e ETN (sez. 4)**

Da utilizzare, ove applicabile, per effettuare le segnalazioni 129 di sezione 4 su numero di strumenti in circolazione e prezzo di negoziazione.

## Istruzioni operative

### Modalità di compilazione dei messaggi

I messaggi possono essere compilati attraverso due modalità:

1. **data-entry manuale;**
2. **importazione file csv:** caricamento delle informazioni in formato csv tramite la funzione 'Importa' (ove disponibile). Per maggiori informazioni consultare il capitolo 'Compilazione messaggi tramite caricamento file' del presente manuale.

### Documentazione da allegare

Alcuni messaggi prevedono l'obbligo di allegare alcuni documenti a supporto dell'attività di codifica richiesta.

*La documentazione da allegare è richiesta **esclusivamente** per finalità di codifica/censimento ISIN e non per finalità segnaletiche ex Art. 129.*

Si precisa che la documentazione allegata ai messaggi di richiesta ISIN è da considerarsi provvisoria. Una volta conclusa l'emissione di un titolo, il Partner dovrà inviare la relativa documentazione definitiva in allegato ad un messaggio di comunicazione dati definitivi (per titoli di debito, ABS, CDO, investment certificates, ETC, ETN, covered warrant o leverage certificates) o di aggiornamento (per titoli di capitale, diritti o warrant).

Il numero minimo di allegati obbligatori per un dato messaggio è riportato nella schermata di **data-entry** all'interno della sezione "Lista degli allegati"<sup>10</sup>.

Si consiglia di nominare i documenti da allegare indicando il tipo documento che si sta inviando: ad es. "Regolamento\_Provvisorio", "Condizioni\_definitive", "Verbale\_CdA", ecc.

Il nome del file da allegare può assumere le seguenti estensioni:

.pdf      .xls      .jpg      .tiff;  
.doc      .rtf      .gif;      .bmp  
.txt      .ppt      .png;      .xlsx  
.docx    .pps      .jpeg;

Si riporta di seguito la descrizione degli allegati obbligatori per ciascuna tipologia di strumento finanziario.

#### TITOLI DI DEBITO<sup>11</sup>

La documentazione varia a seconda del tipo di emissione:

- con obbligo di prospetto: Condizioni definitive, Prospetto Ordinario o Prospetto semplificato;
- esente da obbligo di prospetto: Regolamento di emissione o documento equipollente.

Per le emissioni esenti da obbligo di prospetto, se l'emittente è una società, diversa da una banca, va trasmesso, oltre alla documentazione indicata, anche il verbale dell'organo amministrativo societario (Assemblea, CdA) che ha deliberato l'emissione.

Per le emissioni da parte di Srl va trasmessa anche una dichiarazione di accettazione del ruolo di sottoscrittori da parte di "investitori professionali soggetti a vigilanza prudenziale a norma delle leggi speciali", ai sensi dell'art. 2483, comma 2, del c.c..

In alternativa, nel caso in cui il titolo di debito sia offerto tramite un portale di crowdfunding, è possibile allegare una dichiarazione del portale, confermando che:

- il titolo oggetto di codifica sarà offerto tramite la piattaforma stessa;
  - o l'operazione non sarà in alcun modo offerta ad investitori diversi da quelli soggetti a vigilanza prudenziale, come previsto dall'Art 2483 del c.c. e dal Regolamento Consob 18592/13.

#### TITOLI DI CAPITALE

Nessuna documentazione obbligatoria.

#### DIRITTI

Va trasmesso il verbale dell'organo amministrativo societario che ha disposto l'emissione del diritto.

<sup>10</sup> Per ulteriori informazioni al paragrafo "Allegati" del "[Manuale Operativo FEAT](#)".

<sup>11</sup> Inclusi ABS e CDO

## **WARRANT**

Va trasmesso il verbale dell'organo amministrativo societario che ha disposto l'emissione del warrant.

## **INVESTMENT CERTIFICATES, ETC, ETN, CW e LEVERAGE CERTIFICATES**

La documentazione varia a seconda dei casi:

- con obbligo di prospetto: Condizioni definitive, Prospetto Ordinario o Prospetto semplificato;
- esente da obbligo di prospetto: Regolamento di emissione o documento equipollente.

## **Altre istruzioni operative**

### **Titoli di Debito con Piano di Ammortamento**

Limitatamente ai titoli di debito che rimborsano il capitale mediante un piano di ammortamento rateale il Partner deve trasmettere detto piano all'atto della **chiusura del collocamento**.

Il piano di ammortamento deve essere allegato ad un messaggio di "Comunicazione generica".

In caso di **rimborsi anticipati parziali** fuori dalle scadenze programmate il Partner deve inviare una "Comunicazione generica" allegando il nuovo piano di ammortamento.

### **Notifica di scarto**

La Banca d'Italia, qualora dai controlli effettuati sui messaggi ricevuti (controlli di coerenza interna delle informazioni fornite, discordanza tra il dato comunicato e la documentazione trasmessa) rilevi un'anomalia, rifiuta il messaggio inviando una notifica di scarto.

Al ricevimento di una notifica di scarto il Partner, se vuole rimuovere l'anomalia, deve:

1. Richiamare l'attività scartata che presenta lo stato "Consegnato rifiutato";
2. Cliccare sul pulsante "Crea copia";
3. Effettuare modifiche e/o integrazioni ai dati precedentemente inseriti sulla copia del messaggio così creata;
4. Consegnare il nuovo messaggio.

Gli enti interessati da notifica di scarto devono provvedere alla sistemazione delle anomalie con la massima tempestività. Se lo scarto è dovuto all'uso di una tipologia di messaggio errata, è invece necessario creare un nuovo messaggio della tipologia indicata nella notifica.

### **Richiesta di codifica ISIN di emittente non presente in Anagrafe Titoli**

Qualora l'emittente del titolo oggetto di codifica non sia presente in Anagrafe Titoli è possibile richiederne il censimento contestualmente alla richiesta del codice ISIN.

In caso di codifica di più titoli di uno stesso emittente non presente in Anagrafe Titoli (ad es. azioni di categoria A, B, oppure azioni, diritti e warrant), al fine di non dover richiedere ripetutamente il censimento del soggetto, è possibile procedere nel seguente modo:

- Inviare una prima richiesta di codice ISIN chiedendo contestualmente il censimento dell'emittente con la funzione "Attiva censimento";
- Il giorno seguente la ricezione del codice ISIN assegnato procedere alla richiesta dei restanti codici ISIN.

## Composizione messaggi

Si riporta nelle seguenti tabelle la composizione dei messaggi esistenti per ciascuna tipologia di strumento finanziario.

Legenda:

- **O**: campo presente nel messaggio, da valorizzare obbligatoriamente;
- **X**: campo presente nel messaggio, la cui valorizzazione può essere facoltativa o condizionatamente obbligatoria;
- **D**: campo presente nel messaggio, non deve essere valorizzato perché viene determinato automaticamente dall'applicazione;
- **vuoto**: campo non presente nel messaggio;
- **grigio**: sezione di data-entry non presente nel messaggio.

Il valore (\*) nella colonna "Dato 129", presente solo nelle tabelle relative ai messaggi con effetto ai fini segnaletici ex Art.129 del TUB, indica che il campo è un dato segnaletico ai sensi delle Disposizioni 129 oltre che un'informazione anagrafica per il servizio di codifica.

Per istruzioni sulla compilazione dei campi e per informazioni sui domini si veda il capitolo "Descrizione campi" del presente documento.

## Titoli di Debito (senza effetti ai fini segnaletici ex Art.129)

**TABELLA 1:** Richiesta ISIN  
 Richiesta ISIN con dati definitivi  
 Censimento ISIN a fini segnalazione 129 - sezione 4  
 Censimento ISIN  
 Comunicazione dati definitivi

ID	DESCRIZIONE CAMPO	Richiesta ISIN	Richiesta ISIN con dati definitivi	Censimento ISIN a fini segnalazione sezione 4	Censimento ISIN	Comun. dati definitivi
<b>INFORMAZIONI SULLO STRUMENTO FINANZIARIO</b>						
<b>ISIN</b>						
ME001	TIPO AGGIORNAMENTO					
ME002	DECORRENZA VARIAZIONE					
SF001	CODICE ISIN			D	D	D
SF002	CODICE CFI					D
SF003	DESCRIZIONE					D
SF004	DESCRIZIONE BREVE					D
<b>STRUMENTO FINANZIARIO</b>						
SF005	EMITTENTE RESIDENTE	O	O		O	O
SF006	EMITTENTE NON RESIDENTE	O	O	O	O	O
SF011	LM B&D / RESP. REGOL. RESID.	X	X	O	X	X
SF012	LM B&D / RESP. REGOL. NON RESID.	X	X	O	X	X
SF013	TIPOLOGIA STRUMENTO FINANZIARIO	O	O	O	O	O
SF014	COMPARTO	D	D		D	D
SF015	FORMA DEL TITOLO	O	O		O	O
SF017	TITOLO CUM WARRANT	O	O		O	O
SF018	TITOLO CONVERTIBILE	O	O		O	O
SF019	TITOLO CREDIT LINKED	O	O		O	O
SF020	TITOLO SUBORDINATO	O	O		O	O
SF021	TIPO OBBLIGAZIONE	X	O		O	O
SF022	NOME COMMERCIALE	X	X	X	X	X
SF023	TIPO DOCUMENTAZIONE	D	D			D
SF041	NUMERO PROGRAMMA COVERED BOND	X	X		X	X
<b>GARANZIE</b>						
SF024	TIPO GARANZIA	O	O		O	O
SF025	CODICE GARANZIA FONDO BCC					D
SF026	GARANTE RESIDENTE	X	X		X	X
SF027	GARANTE NON RESIDENTE	X	X		X	X
<b>RESTRIZIONI</b>						
SF032	RESTRIZIONI	X	X		X	X
SF033	RESTRIZIONI ALLA TRASFERIBILITÀ	X	X		X	X
<b>REGIME FISCALE</b>						
SF035	TRATTAMENTO FISCALE	O	O		O	O
SF036	ASSOGGETTAMENTO AL DLGS 239/96	X	X		X	X
<b>QUOTAZIONE SU MERCATI REGOLAMENTATI</b>						
SF037	STATO QUOTAZIONE	X	X		X	
SF038	CODICE MERCATO REGOLAMENTATO	X	X		X	
SF039	MERCATO PRINCIPALE	X	X		X	



ID	DESCRIZIONE CAMPO	Richiesta ISIN	Richiesta ISIN con dati definitivi	Censimento ISIN a fini segnalazione sezione 4	Censimento ISIN	Comun. dati definitivi
<b>INFORMAZIONI SUL COLLOCAMENTO</b>						
<b>COLLOCAMENTO</b>						
CO001	DATA INIZIO GODIMENTO	O	O	O	O	O
CO002	DATA SCADENZA	X	X	X	X	X
CO003	VALUTA	O	O	O	O	O
CO004	PREZZO RIMBORSO	O	O		O	O
CO005	VALORE NOMINALE UNITARIO	O	O		O	O
CO006	TAGLIO MINIMO SOTTOSCRIZIONE	X	O		O	O
<b>TRANCHE DI COLLOCAMENTO</b>						
CO007	NUMERO SERIE	X	X		X	X
CO008	NUMERO TRANCHE	X	X		X	X
CO009	DATA APERTURA COLLOCAMENTO	O	O		O	O
CO010	DATA CHIUSURA COLLOCAMENTO	O	O		O	O
CO011	IMPORTO DELIBERATO	O	O		O	O
CO013	PREZZO EMISSIONE O OFFERTA	O	O		O	O
CO014	DATA REGOLAMENTO	O	O		O	O
<b>MODALITÀ DI COLLOCAMENTO</b>						
CO015	TIPO COLLOCAMENTO	O	O		O	O
CO016	METODO COLLOCAMENTO - OFFERTA	O	O		O	O
CO017	SEGMENTO MERCATO	O	O		O	O
<b>COLLOCATORI</b>						
CO018	COLLOCATORE RESIDENTE	X	X	D	X	X
CO019	COLLOCATORE NON RESIDENTE	X	X	D	X	X
CO020	FUNZIONE	X	X	D	X	X
<b>INFORMAZIONI SUL RENDIMENTO</b>						
<b>RENDIMENTO</b>						
RE001	TIPO TASSO	O	O	O	O	O
RE002	TASSO EMISSIONE	X	X	X	X	X
RE003	TASSO PRIMA CEDOLA	X	X	X	X	X
RE004	DATA PRIMA CEDOLA	X	X	X	X	X
RE005	PERIODICITÀ CEDOLA	O	O	O	O	O
RE006	TASSO RENDIMENTO EFFETTIVO	X	X		X	X
RE007	TITOLO STEPPED	X	X		X	X
RE008	BASE CALCOLO INTERESSI	X	O		O	O
RE009	STRUTTURA RENDIMENTO	X	O	O	O	O
RE010	DATA VARIAZIONE TIPO TASSO	X	X		X	X
<b>TITOLI A TASSO VARIABILE</b>						
RE011	DATA INIZIO APPLICAZIONE SPREAD	X	X		X	X
RE012	DATA FINE APPLICAZIONE SPREAD	X	X		X	X
RE013	OPERATORE MATEMATICO	X	X		X	X
RE014	SPREAD	X	X		X	X
RE015	PERIODO DI CALCOLO CEDOLA VARIABILE	X	X		X	X
RE016	CODICE ISIN PARAMETRO	X	X		X	X
<b>TITOLI STRUTTURATI</b>						
RE017	CEDOLA CAP	X	X		X	X
RE018	CEDOLA FLOOR	X	X		X	X
RE019	INDICIZZAZIONE CEDOLA	X	X		X	X
<b>PIANO RENDIMENTO</b>						
RE020	DATA INIZIO GODIMENTO	X	X		X	X
RE021	DATA FINE GODIMENTO	X	X		X	X
RE022	DATA PAGAMENTO	X	X		X	X
RE023	TASSO CEDOLA	X	X		X	X
RE024	TASSO ANNUO	X	X		X	X
RE025	BASE CALCOLO	X	X		X	X
RE026	TIPO TASSO	X	X		X	X
RE027	PERIODICITÀ	X	X		X	X
RE028	CEDOLA REGOLARE	X	X		X	X

ID	DESCRIZIONE CAMPO	Richiesta ISIN	Richiesta ISIN con dati definitivi	Censimento ISIN a fini segnalazione sezione 4	Censimento ISIN	Comun. dati definitivi
<b>INFORMAZIONI SUL RIMBORSO</b>						
<b>RIMBORSO</b>						
RI001	TIPO RIMBORSO	O	O	O	O	O
RI002	OPZIONE RIMBORSO ANTICIPATO	O	O		O	O
RI003	INDICIZZAZIONE CAPITALE	X	X		X	X
<b>TITOLI CON AMMORTAMENTO</b>						
AM001	TIPO AMMORTAMENTO	X	X		X	X
AM002	MODALITÀ AMMORTAMENTO	X	X		X	X
AM003	PERIODICITÀ AMMORTAMENTO	X	X		X	X
AM004	DATA PRIMA RATA AMMORTAMENTO	X	X		X	X
AM005	TASSO SVILUPPO AMMORTAMENTO	X	X		X	X
<b>ALTRE OPZIONI</b>						
<b>ALTRE OPZIONI</b>						
AO001	TIPO OPZIONE	X	X		X	X
AO002	DATA INIZIO ESERCIZIO	X	X		X	X
AO003	DATA FINE ESERCIZIO	X	X		X	X
AO004	TIPO ESERCIZIO	X	X		X	X
AO005	PREZZO ESERCIZIO OPZIONE	X	X		X	X
AO006	STRIKE TIPO TASSO	X	X		X	X
AO007	STRIKE DATA SCADENZA	X	X		X	X
AO008	STRIKE PERIODICITÀ	X	X		X	X
AO009	TITOLO OFFERTO IN CAMBIO	X	X		X	X
AO010	RAPPORTO DI CAMBIO	X	X		X	X

**TABELLA 2:** Comunicazione aggiornamento informazioni sul collocamento

ID	DESCRIZIONE CAMPO	Comunicazione collocato
<b>AGGIORNAMENTO INFORMAZIONI SUL COLLOCAMENTO</b>		
<b>ISIN</b>		
SF001	CODICE ISIN	D
SF003	DESCRIZIONE	D
<b>INFORMAZIONI SUL COLLOCAMENTO</b>		
CO001	DATA INIZIO GODIMENTO	D
CO002	DATA SCADENZA	D
CO003	VALUTA	D
CO009	DATA APERTURA COLLOCAMENTO	O
CO010	DATA CHIUSURA COLLOCAMENTO	O
CO011	IMPORTO DELIBERATO	O
CO013	PREZZO EMISSIONE O OFFERTA	O
CO014	DATA REGOLAMENTO	O
<b>TRANCHE DI COLLOCAMENTO</b>		
CO007	NUMERO SERIE	D
CO008	NUMERO TRANCHE	D
CO009	DATA APERTURA COLLOCAMENTO	D
CO010	DATA CHIUSURA COLLOCAMENTO	D
CO011	IMPORTO DELIBERATO	D
CO013	PREZZO EMISSIONE O OFFERTA	D
CO014	DATA REGOLAMENTO	D
CO012	IMPORTO COLLOCATO	D

**TABELLA 3:** Comunicazione cedole

ID	DESCRIZIONE CAMPO	Comunicazione cedole
<b>INFORMAZIONI</b>		
<b>ISIN</b>		
SF001	CODICE ISIN	<b>D</b>
<b>PIANO CEDOLE</b>		
RE020	DATA INIZIO GODIMENTO	<b>O</b>
RE021	DATA FINE GODIMENTO	<b>O</b>
RE022	DATA PAGAMENTO	<b>X</b>
RE023	TASSO CEDOLA	<b>X</b>
RE024	TASSO ANNUO	<b>X</b>
RE025	BASE CALCOLO	<b>X</b>
RE026	TIPO TASSO	<b>O</b>
RE027	PERIODICITÀ	<b>O</b>
RE028	CEDOLA REGOLARE	<b>O</b>

**TABELLA 4:** Comunicazione rimborsi anticipati

ID	DESCRIZIONE CAMPO	Comunicazione rimborsi
<b>INFORMAZIONI</b>		
<b>ISIN</b>		
SF001	CODICE ISIN	<b>D</b>
<b>PIANO RIMBORSO</b>		
AQ020	DATA RIMBORSO	<b>O</b>
AQ021	CAPITALE RIMBORSATO	<b>O</b>
AQ022	CAUSALE RIMBORSO	<b>O</b>
AQ023	PREZZO RIMBORSO EFFETTIVO	<b>X</b>
AQ024	POOL FACTOR	<b>X</b>
AQ025	CIRCOLANTE DOPO RIMBORSO	<b>X</b>

## Titoli di Debito (con effetti ai fini segnaletici ex Art.129)

**TABELLA 5:** Richiesta ISIN con dati definitivi e info anagrafiche 129 (sez. 1)  
Censimento ISIN e info anagrafiche 129 (sez. 1)  
Comunicazione dati definitivi e info anagrafiche 129 (sez. 1)

ID	DATO 129	DESCRIZIONE CAMPO	Richiesta ISIN con dati definitivi e info anagrafiche 129	Censimento ISIN e info anagrafiche 129 [RUOLI EMI/CPGR]	Censimento ISIN e info anagrafiche 129 [RUOLO COLL]	Comunicazione dati definitivi e info anagrafiche 129
<b>INFORMAZIONI SULLO STRUMENTO FINANZIARIO</b>						
<b>ISIN</b>						
SF001	(*)	CODICE ISIN		D	D	D
SF002		CODICE CFI				D
SF003		DESCRIZIONE				D
SF004		DESCRIZIONE BREVE				D
<b>STRUMENTO FINANZIARIO</b>						
SF005	(*)	EMITTENTE RESIDENTE	O	O		O
SF006	(*)	EMITTENTE NON RESIDENTE	O		O	O
SF007	(*)	SAE EMITTENTE	D	D	D	D
SF008	(*)	CAPOGRUPPO EMITTENTE RESIDENTE	X	X	X	X
SF009	(*)	CAPOGRUPPO EMITTENTE NON RESIDENTE	X	X	X	X
SF010	(*)	SAE CAPOGRUPPO EMITTENTE	D	D	D	D
SF011	(*)	LM B&D / RESP. REGOL. RESID.	X	X	X	X
SF012	(*)	LM B&D / RESP. REGOL. NON RESID.	X	X	X	X
SF013	(*)	TIPOLOGIA STRUMENTO FINANZIARIO	O	O	O	O
SF014		COMPARTO	D	D	D	D
SF015		FORMA DEL TITOLO	O	O	X	O
SF016	(*)	PRESENZA COMPONENTE DERIVATIVA	O	O	O	O
SF017	(*)	TITOLO CUM WARRANT	O	O	O	O
SF018	(*)	TITOLO CONVERTIBILE	O	O	O	O
SF019	(*)	TITOLO CREDIT LINKED	O	O	O	O
SF020	(*)	TITOLO SUBORDINATO	O	O	O	O
SF021	(*)	TIPO OBBLIGAZIONE	O	O	O	O
SF022		NOME COMMERCIALE	X	X	X	X
SF023		TIPO DOCUMENTAZIONE	D			D
ME003		STATO 129	D	D	D	D
SF041		NUMERO PROGRAMMA COVERED BOND	X	X	X	X
<b>GARANZIE</b>						
SF024		TIPO GARANZIA	O	O	O	O
SF025		CODICE GARANZIA FONDO BCC				X
SF026	(*)	GARANTE RESIDENTE	X	X	X	X
SF027	(*)	GARANTE NON RESIDENTE	X	X	X	X
SF028	(*)	SAE GARANTE	D	D	D	D
SF029	(*)	CAPOGRUPPO GARANTE RESIDENTE	X	X	X	X
SF030	(*)	CAPOGRUPPO GARANTE NON RESIDENTE	X	X	X	X
SF031	(*)	SAE CAPOGRUPPO GARANTE	D	D	D	D
<b>RESTRIZIONI</b>						
SF032		RESTRIZIONI	X	X	X	X
SF033		RESTRIZIONI ALLA TRASFERIBILITÀ	X	X	X	X
SF034	(*)	RESTRIZIONI ALLA VENDITA	O	O	O	O
<b>REGIME FISCALE</b>						
SF035		TRATTAMENTO FISCALE	O	O	X	O
SF036		ASSOGGETTAMENTO AL DLGS 239/96	X	X	X	X
<b>QUOTAZIONE SU MERCATI REGOLAMENTATI</b>						
SF037		STATO QUOTAZIONE	X	X	X	
SF038	(*)	CODICE MERCATO REGOLAMENTATO	X	X	X	
SF039	(*)	MERCATO PRINCIPALE	X	X	X	
<b>QUOTAZIONE SU MTF</b>						
SF037		STATO QUOTAZIONE	X	X	X	X
SF040	(*)	CODICE MTF	X	X	X	X

ID	DATO 129	DESCRIZIONE CAMPO	Richiesta ISIN con dati definitivi e info anagrafiche 129	Censimento ISIN e info anagrafiche 129 [RUOLI EMI/CPGR]	Censimento ISIN e info anagrafiche 129 [RUOLO COLL]	Comunicazione dati definitivi e info anagrafiche 129
<b>INFORMAZIONI SUL COLLOCAMENTO</b>						
<b>COLLOCAMENTO</b>						
CO001	(*)	DATA INIZIO GODIMENTO	O	O	O	O
CO002	(*)	DATA SCADENZA	X	X	X	X
CO003	(*)	VALUTA	O	O	O	O
CO004	(*)	PREZZO RIMBORSO	O	O	O	O
CO005		VALORE NOMINALE UNITARIO	O	O	X	O
CO006		TAGLIO MINIMO SOTTOSCRIZIONE	O	O	X	O
<b>TRANCHE DI COLLOCAMENTO</b>						
CO007		NUMERO SERIE	X	X	X	X
CO008		NUMERO TRANCHE	X	X	X	X
CO009		DATA APERTURA COLLOCAMENTO	O	O	X	O
CO010		DATA CHIUSURA COLLOCAMENTO	O	O	X	O
CO011		IMPORTO DELIBERATO	O	O	O	O
CO013	(*)	PREZZO EMISSIONE O OFFERTA	O	O	O	O
CO014	(*)	DATA REGOLAMENTO	O	O	O	O
<b>MODALITÀ DI COLLOCAMENTO</b>						
CO015		TIPO COLLOCAMENTO	O	O	X	O
CO016		METODO COLLOCAMENTO - OFFERTA	O	O	X	O
CO017		SEGMENTO MERCATO	O	O	X	O
<b>COLLOCATORI</b>						
CO018		COLLOCATORE RESIDENTE	X	X	X	X
CO019		COLLOCATORE NON RESIDENTE	X	X	X	X
CO020		FUNZIONE	X	X	X	X
<b>INFORMAZIONI SUL RENDIMENTO</b>						
<b>RENDIMENTO</b>						
RE001	(*)	TIPO TASSO	O	O	O	O
RE002	(*)	TASSO EMISSIONE	X	X	X	X
RE003		TASSO PRIMA CEDOLA	X	X	X	X
RE004		DATA PRIMA CEDOLA	X	X	X	X
RE005	(*)	PERIODICITÀ CEDOLA	O	O	O	O
RE006		TASSO RENDIMENTO EFFETTIVO	X	X	X	X
RE007		TITOLO STEPPED	X	X	X	X
RE008		BASE CALCOLO INTERESSI	O	O	X	O
RE009		STRUTTURA RENDIMENTO	O	O	O	O
RE010		DATA VARIAZIONE TIPO TASSO	X	X	X	X
<b>TITOLI A TASSO VARIABILE</b>						
RE011		DATA INIZIO APPLICAZIONE SPREAD	X	X	X	X
RE012		DATA FINE APPLICAZIONE SPREAD	X	X	X	X
RE013		OPERATORE MATEMATICO	X	X	X	X
RE014		SPREAD	X	X	X	X
RE015		PERIODO DI CALCOLO CEDOLA VARIABILE	X	X	X	X
RE016	(*)	CODICE ISIN PARAMETRO	X	X	X	X
<b>TITOLI STRUTTURATI</b>						
RE017	(*)	CEDOLA CAP	X	X	X	X
RE018	(*)	CEDOLA FLOOR	X	X	X	X
RE019	(*)	INDICIZZAZIONE CEDOLA	X	X	X	X

ID	DATO 129	DESCRIZIONE CAMPO	Richiesta ISIN con dati definitivi e info anagrafiche 129	Censimento ISIN e info anagrafiche 129 [RUOLI EMI/CPGR]	Censimento ISIN e info anagrafiche 129 [RUOLO COLL]	Comunicazione dati definitivi e info anagrafiche 129
<b>PIANO RENDIMENTO</b>						
RE020		DATA INIZIO GODIMENTO	X	X	X	X
RE021		DATA FINE GODIMENTO	X	X	X	X
RE022		DATA PAGAMENTO	X	X	X	X
RE023		TASSO CEDOLA	X	X	X	X
RE024		TASSO ANNUO	X	X	X	X
RE008		BASE CALCOLO INTERESSI	X	X	X	X
RE026		TIPO TASSO	X	X	X	X
RE027		PERIODICITÀ	X	X	X	X
RE028		CEDOLA REGOLARE	X	X	X	X
<b>INFORMAZIONI SUL RIMBORSO</b>						
<b>RIMBORSO</b>						
RI001		TIPO RIMBORSO	O	O	O	O
RI002	(*)	OPZIONE RIMBORSO ANTICIPATO	O	O	O	O
RI003	(*)	INDICIZZAZIONE CAPITALE	X	X	X	X
<b>TITOLI CON AMMORTAMENTO</b>						
AM001		TIPO AMMORTAMENTO	X	X	X	X
AM002		MODALITÀ AMMORTAMENTO	X	X	X	X
AM003		PERIODICITÀ AMMORTAMENTO	X	X	X	X
AM004		DATA PRIMA RATA AMMORTAMENTO	X	X	X	X
AM005		TASSO SVILUPPO AMMORTAMENTO	X	X	X	X
<b>ALTRE OPZIONI</b>						
<b>ALTRE OPZIONI</b>						
AO001		TIPO OPZIONE	X	X	X	X
AO002		DATA INIZIO ESERCIZIO	X	X	X	X
AO003		DATA FINE ESERCIZIO	X	X	X	X
AO004		TIPO ESERCIZIO	X	X	X	X
AO005		PREZZO ESERCIZIO OPZIONE	X	X	X	X
AO006		STRIKE TIPO TASSO	X	X	X	X
AO007		STRIKE DATA SCADENZA	X	X	X	X
AO008		STRIKE PERIODICITÀ	X	X	X	X
AO009		TITOLO OFFERTO IN CAMBIO	X	X	X	X
AO010		RAPPORTO DI CAMBIO	X	X	X	X

**TABELLA 6:** Comunicazione info anagrafiche 129 (sez. 1)

ID	DATO 129	DESCRIZIONE CAMPO	Comunicazione info anagrafiche 129 (sezione 1)
<b>INFORMAZIONI SULLO STRUMENTO FINANZIARIO</b>			
<b>ISIN</b>			
SF001	(*)	CODICE ISIN	D
SF002		CODICE CFI	D
SF003		DESCRIZIONE	D
SF004		DESCRIZIONE BREVE	D
ME003		STATO 129	D
<b>STRUMENTO FINANZIARIO</b>			
SF005	(*)	EMITTENTE RESIDENTE	O
SF006	(*)	EMITTENTE NON RESIDENTE	O
SF007	(*)	SAE EMITTENTE	D
SF008	(*)	CAPOGRUPPO EMITTENTE RESIDENTE	X
SF009	(*)	CAPOGRUPPO EMITTENTE NON RESIDENTE	X
SF010	(*)	SAE CAPOGRUPPO EMITTENTE	D
SF011	(*)	LM B&D / RESP. REGOL. RESID.	X
SF012	(*)	LM B&D / RESP. REGOL. NON RESID.	X
SF013	(*)	TIPOLOGIA STRUMENTO FINANZIARIO	O
SF014		COMPARTO	D
SF016	(*)	PRESENZA COMPONENTE DERIVATIVA	O
SF017	(*)	TITOLO CUM WARRANT	O
SF018	(*)	TITOLO CONVERTIBILE	O
SF019	(*)	TITOLO CREDIT LINKED	O
SF020	(*)	TITOLO SUBORDINATO	O
<b>GARANZIE</b>			
SF024		TIPO GARANZIA	O
SF025		CODICE GARANZIA FONDO BCC	X
SF026	(*)	GARANTE RESIDENTE	X
SF027	(*)	GARANTE NON RESIDENTE	X
SF028	(*)	SAE GARANTE	D
SF029	(*)	CAPOGRUPPO GARANTE RESIDENTE	X
SF030	(*)	CAPOGRUPPO GARANTE NON RESIDENTE	X
SF031	(*)	SAE CAPOGRUPPO GARANTE	D
<b>RESTRIZIONI</b>			
SF034	(*)	RESTRIZIONI ALLA VENDITA	O
<b>QUOTAZIONE SU MTF</b>			
SF037		STATO QUOTAZIONE	X
SF040	(*)	CODICE MTF	X
<b>INFORMAZIONI SUL COLLOCAMENTO</b>			
<b>COLLOCAMENTO</b>			
CO001	(*)	DATA INIZIO GODIMENTO	O
CO002	(*)	DATA SCADENZA	X
CO003	(*)	VALUTA	O
RI001		TIPO RIMBORSO	O
CO004	(*)	PREZZO RIMBORSO	O
CO013	(*)	PREZZO EMISSIONE O OFFERTA	O
CO014	(*)	DATA REGOLAMENTO	O
<b>MODALITÀ DI COLLOCAMENTO</b>			
CO016		METODO COLLOCAMENTO - OFFERTA	O
<b>COLLOCATORI</b>			
CO018		COLLOCATORE RESIDENTE	X
CO019		COLLOCATORE NON RESIDENTE	X
CO020		FUNZIONE	X

ID	DATO 129	DESCRIZIONE CAMPO	Comunicazione info anagrafiche 129 (sezione 1)
<b>INFORMAZIONI RIMBORSO E RENDIMENTO</b>			
<b>RIMBORSO</b>			
RI002	(*)	OPZIONE RIMBORSO ANTICIPATO	O
RI003	(*)	INDICIZZAZIONE CAPITALE	X
<b>RENDIMENTO</b>			
RE001	(*)	TIPO TASSO	O
RE002	(*)	TASSO EMISSIONE	X
RE003		TASSO PRIMA CEDOLA	X
RE004		DATA PRIMA CEDOLA	X
RE005	(*)	PERIODICITÀ CEDOLA	O
RE007		TITOLO STEPPED	X
RE009		STRUTTURA RENDIMENTO	O
RE010		DATA VARIAZIONE TIPO TASSO	X
<b>TITOLI A TASSO VARIABILE</b>			
RE011		DATA INIZIO APPLICAZIONE SPREAD	X
RE012		DATA FINE APPLICAZIONE SPREAD	X
RE013		OPERATORE MATEMATICO	X
RE014		SPREAD	X
RE015		PERIODO DI CALCOLO CEDOLA VARIABILE	X
RE016	(*)	CODICE ISIN PARAMETRO	X
<b>TITOLI STRUTTURATI</b>			
RE017	(*)	CEDOLA CAP	X
RE018	(*)	CEDOLA FLOOR	X
RE019	(*)	INDICIZZAZIONE CEDOLA	X

**TABELLA 7:** Comunicazione info anagrafiche 129 (sez. 2-3)

ID	DATO 129	DESCRIZIONE CAMPO	Comunicazione info anagrafiche 129 (sezione 2-3)
<b>INFORMAZIONI ANAGRAFICHE 129 SEZIONI 2-3</b>			
<b>ISIN</b>			
SF001	(*)	CODICE ISIN	D
SF002		CODICE CFI	D
SF003		DESCRIZIONE	D
SF004		DESCRIZIONE BREVE	D
SF005	(*)	EMITTENTE RESIDENTE	D
SF006	(*)	EMITTENTE NON RESIDENTE	D
SF016	(*)	PRESENZA COMPONENTE DERIVATIVA	O
ME003		STATO 129	D
<b>SEZIONE 2</b>			
AA001	(*)	DURATA ATTESA	O
AA002	(*)	TASSO DI RENDIMENTO EFFETTIVO ALL'EMISSIONE - COMPONENTE GARANTITA	O
AA003	(*)	TASSO DI RENDIMENTO EFFETTIVO ALL'EMISSIONE - COMPONENTE VARIABILE	O
AA004	(*)	TIPO VALORE COSTO DELLA RACCOLTA	O
AA005	(*)	COSTO DELLA RACCOLTA	O
<b>SEZIONE 3</b>			
AA006	(*)	NUMERO DI SOTTOSTANTI DELLA COMPONENTE DERIVATIVA	X
AA007	(*)	COMPONENTE DERIVATIVA PATH DEPENDENT	X
AA008	(*)	TIPO ESERCIZIO DEL DERIVATO	X



**TABELLA 8:** Comunicazione collocato (sez. 4)

ID	DAT O 129	DESCRIZIONE CAMPO	Comun. collocato (sezione 4)
<b>INFORMAZIONI ANAGRAFICHE 129 SEZIONE 4</b>			
<b>ISIN</b>			
SF001	(*)	CODICE ISIN	D
SF002		CODICE CFI	D
SF003		DESCRIZIONE	D
SF004		DESCRIZIONE BREVE	D
SF005	(*)	EMITTENTE RESIDENTE	D
SF006	(*)	EMITTENTE NON RESIDENTE	D
ME003		STATO 129	D
CO016		METODO COLLOCAMENTO - OFFERTA	X
<b>COLLOCATO</b>			
AQ006	(*)	DATA DI FINE COLLOCAMENTO	O
AQ007	(*)	IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO BANCHE RESIDENTI	O
AQ008	(*)	IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO BANCHE NON RESIDENTI	O
AQ009	(*)	IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO AMMINISTRAZIONI PUBBLICHE RESIDENTI	O
AQ010	(*)	IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO AMMINISTRAZIONI PUBBLICHE NON RESIDENTI	O
AQ011	(*)	IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO FINANZIARIE RESIDENTI	O
AQ012	(*)	IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO FINANZIARIE NON RESIDENTI	O
AQ013	(*)	IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO SOCIETÀ NON FINANZIARIE RESIDENTI	O
AQ014	(*)	IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO SOCIETÀ NON FINANZIARIE NON RESIDENTI	O
AQ015	(*)	IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO FAMIGLIE RESIDENTI	O
AQ016	(*)	IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO FAMIGLIE NON RESIDENTI	O
AQ017	(*)	IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO ALTRO RESIDENTI	O
AQ018	(*)	IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO ALTRO NON RESIDENTI	O
AQ019	(*)	TIPOLOGIA IMPORTI SEGNALATI	O

**TABELLA 9:** Comunicazione rimborsi anticipati (sez. 4)

ID	DATO 129	DESCRIZIONE CAMPO	Comunicazione rimborsi anticipati (sezione 4)
<b>INFORMAZIONI ANAGRAFICHE 129 SEZIONE 4</b>			
<b>ISIN</b>			
SF001	(*)	CODICE ISIN	D
SF002		CODICE CFI	D
SF003		DESCRIZIONE	D
SF004		DESCRIZIONE BREVE	D
SF005	(*)	EMITTENTE RESIDENTE	D
SF006	(*)	EMITTENTE NON RESIDENTE	D
ME003		STATO 129	D
<b>RIMBORSI</b>			
AQ020	(*)	DATA RIMBORSO	O
AQ021	(*)	CAPITALE RIMBORSATO	O
AQ022	(*)	CAUSALE RIMBORSO	O
AQ023	(*)	PREZZO RIMBORSO EFFETTIVO	O
AQ024	(*)	POOL FACTOR	O
AQ025	(*)	CIRCOLANTE DOPO RIMBORSO	O

## Titoli di Debito: ABS e CDO (senza effetti ai fini segnaletici ex Art.129)

**TABELLA 10:** Richiesta ISIN  
 Censimento ISIN a fini segnalazione 129 - sezione 4  
 Censimento ISIN  
 Comunicazione dati definitivi  
 Comunicazione aggiornamento

ID	DESCRIZIONE CAMPO	Richiesta ISIN	Censimento ISIN a fini segnalazione sezione 4	Censimento ISIN	Comun. dati definitivi	Comun. aggiorn.
<b>INFORMAZIONI SULLO STRUMENTO FINANZIARIO</b>						
<b>ISIN</b>						
ME001	TIPO AGGIORNAMENTO					O
ME002	DECORRENZA VARIAZIONE					X
SF001	CODICE ISIN		D	D	D	D
SF002	CODICE CFI					D
SF003	DESCRIZIONE					D
SF004	DESCRIZIONE BREVE					D
<b>STRUMENTO FINANZIARIO</b>						
SF005	EMITTENTE RESIDENTE	O		O	O	O
SF006	EMITTENTE NON RESIDENTE	O	O	O	O	O
SF011	LM B&D / RESP. REGOL. RESID.	X	O	X	X	X
SF012	LM B&D / RESP. REGOL. NON RESID.	X	O	X	X	X
SF013	TIPOLOGIA STRUMENTO FINANZIARIO	O	O	O	O	O
SF014	COMPARTO	D		D	D	D
SF015	FORMA DEL TITOLO	O		O	O	O
SF021	TIPO OBBLIGAZIONE	X		O	O	O
SF022	NOME COMMERCIALE	X	X	X	X	X
<b>DATI SPECIFICI ABS</b>						
AB001	NUMERO OPERAZIONE	O		O	O	O
AB002	TRIGGER EVENT	O		O	O	O
AB003	CALL OPTION	O		O	O	O
AB004	CLASSE	X	X	X	X	X
AB005	RANKING	O	X	O	O	O
<b>RESTRIZIONI</b>						
SF032	RESTRIZIONI	X		X	X	X
SF033	RESTRIZIONI ALLA TRASFERIBILITÀ	X		X	X	X
<b>REGIME FISCALE</b>						
SF035	TRATTAMENTO FISCALE	O		O	O	O
SF036	ASSOGGETTAMENTO AL DLGS 239/96	X		X	X	X
<b>QUOTAZIONE SU MERCATI REGOLAMENTATI</b>						
SF037	STATO QUOTAZIONE	X		X		
SF038	CODICE MERCATO REGOLAMENTATO	X		X		
SF039	MERCATO PRINCIPALE	X		X		

ID	DESCRIZIONE CAMPO	Richiesta ISIN	Censimento ISIN a fini segnalazione sezione 4	Censimento ISIN	Comun. dati definitivi	Comun. aggiorn.
<b>INFORMAZIONI SUL COLLOCAMENTO</b>						
<b>COLLOCAMENTO</b>						
CO001	DATA INIZIO GODIMENTO	O	O	O	O	O
CO002	DATA SCADENZA	X	X	X	X	X
CO003	VALUTA	O	O	O	O	O
CO004	PREZZO RIMBORSO	O		O	O	O
CO005	VALORE NOMINALE UNITARIO	O		O	O	O
CO006	TAGLIO MINIMO SOTTOSCRIZIONE	X		O	O	O
<b>TRANCHE DI COLLOCAMENTO</b>						
CO007	NUMERO SERIE	X		X	X	X
CO008	NUMERO TRANCHE	X		X	X	X
CO009	DATA APERTURA COLLOCAMENTO	O		O	O	O
CO010	DATA CHIUSURA COLLOCAMENTO	O		O	O	O
CO011	IMPORTO DELIBERATO	O		O	O	O
CO013	PREZZO EMISSIONE O OFFERTA	O		O	O	O
CO014	DATA REGOLAMENTO	O		O	O	O
<b>MODALITÀ DI COLLOCAMENTO</b>						
CO015	TIPO COLLOCAMENTO	O		O	O	O
CO016	METODO COLLOCAMENTO - OFFERTA	O		O	O	O
CO017	SEGMENTO MERCATO	O		O	O	O
<b>COLLOCATORI</b>						
CO018	COLLOCATORE RESIDENTE	X		X	X	X
CO019	COLLOCATORE NON RESIDENTE	X		X	X	X
CO020	FUNZIONE	X		X	X	X
<b>INFORMAZIONI SUL RENDIMENTO</b>						
<b>RENDIMENTO</b>						
RE001	TIPO TASSO	O	O	O	O	O
RE002	TASSO EMISSIONE	X	X	X	X	X
RE003	TASSO PRIMA CEDOLA	X	X	X	X	X
RE004	DATA PRIMA CEDOLA	X	X	X	X	X
RE005	PERIODICITÀ CEDOLA	O	O	O	O	O
RE006	TASSO RENDIMENTO EFFETTIVO	X		X	X	X
RE007	TITOLO STEPPED	X		X	X	X
RE008	BASE CALCOLO INTERESSI	X		O	O	O
RE009	STRUTTURA RENDIMENTO	X	O	O	O	O
RE010	DATA VARIAZIONE TIPO TASSO	X		X	X	X
<b>TITOLI A TASSO VARIABILE</b>						
RE011	DATA INIZIO APPLICAZIONE SPREAD	X		X	X	X
RE012	DATA FINE APPLICAZIONE SPREAD	X		X	X	X
RE013	OPERATORE MATEMATICO	X		X	X	X
RE014	SPREAD	X		X	X	X
RE015	PERIODO DI CALCOLO CEDOLA VARIABILE	X		X	X	X
RE016	CODICE ISIN PARAMETRO	X		X	X	X
<b>TITOLI STRUTTURATI</b>						
RE017	CEDOLA CAP	X		X	X	X
RE018	CEDOLA FLOOR	X		X	X	X
RE019	INDICIZZAZIONE CEDOLA	X		X	X	X
<b>PIANO RENDIMENTO</b>						
RE020	DATA INIZIO GODIMENTO	X		X	X	X
RE021	DATA FINE GODIMENTO	X		X	X	X
RE022	DATA PAGAMENTO	X		X	X	X
RE023	TASSO CEDOLA	X		X	X	X
RE024	TASSO ANNUO	X		X	X	X
RE025	BASE CALCOLO	X		X	X	X
RE026	TIPO TASSO	X		X	X	X
RE027	PERIODICITÀ	X		X	X	X
RE028	CEDOLA REGOLARE	X		X	X	X

ID	DESCRIZIONE CAMPO	Richiesta ISIN	Censimento ISIN a fini segnalazione sezione 4	Censimento ISIN	Comun. dati definitivi	Comun. aggiorn.
<b>INFORMAZIONI SUL RIMBORSO</b>						
<b>RIMBORSO</b>						
RI001	TIPO RIMBORSO	O		O	O	O
RI002	OPZIONE RIMBORSO ANTICIPATO	O		O	O	O
RI003	INDICIZZAZIONE CAPITALE	X		X	X	X
AM004	DATA PRIMA RATA AMMORTAMENTO	X		X	X	X
<b>ALTRE OPZIONI</b>						
<b>ALTRE OPZIONI</b>						
AO001	TIPO OPZIONE	X		X	X	X
AO002	DATA INIZIO ESERCIZIO	X		X	X	X
AO003	DATA FINE ESERCIZIO	X		X	X	X
AO004	TIPO ESERCIZIO	X		X	X	X
AO005	PREZZO ESERCIZIO OPZIONE	X		X	X	X
AO006	STRIKE TIPO TASSO	X		X	X	X
AO007	STRIKE DATA SCADENZA	X		X	X	X
AO008	STRIKE PERIODICITÀ	X		X	X	X
AO009	TITOLO OFFERTO IN CAMBIO	X		X	X	X
AO010	RAPPORTO DI CAMBIO	X		X	X	X

**TABELLA 11:** Comunicazione collocato

ID	DESCRIZIONE CAMPO	Comunicazione collocato
<b>INFORMAZIONI</b>		
<b>ISIN</b>		
SF001	CODICE ISIN	<b>D</b>
<b>TRANCHE DI COLLOCAMENTO</b>		
CO007	NUMERO SERIE	<b>X</b>
CO008	NUMERO TRANCHE	<b>X</b>
CO009	DATA APERTURA COLLOCAMENTO	<b>X</b>
CO010	DATA CHIUSURA COLLOCAMENTO	<b>X</b>
CO011	IMPORTO DELIBERATO	<b>X</b>
CO013	PREZZO EMISSIONE O OFFERTA	<b>O</b>
CO014	DATA REGOLAMENTO	<b>O</b>
CO012	IMPORTO COLLOCATO	<b>X</b>

**TABELLA 12:** Comunicazione cedole

ID	DESCRIZIONE CAMPO	Comunicazione cedole
<b>INFORMAZIONI</b>		
<b>ISIN</b>		
SF001	CODICE ISIN	<b>D</b>
<b>PIANO CEDOLE</b>		
RE020	DATA INIZIO GODIMENTO	<b>O</b>
RE021	DATA FINE GODIMENTO	<b>O</b>
RE022	DATA PAGAMENTO	<b>X</b>
RE023	TASSO CEDOLA	<b>X</b>
RE024	TASSO ANNUO	<b>X</b>
RE025	BASE CALCOLO	<b>X</b>
RE026	TIPO TASSO	<b>O</b>
RE027	PERIODICITÀ	<b>O</b>
RE028	CEDOLA REGOLARE	<b>O</b>

**TABELLA 13:** Comunicazione rimborsi anticipati

ID	DESCRIZIONE CAMPO	Comunicazione rimborsi
<b>INFORMAZIONI</b>		
<b>ISIN</b>		
SF001	CODICE ISIN	<b>D</b>
<b>PIANO RIMBORSO</b>		
AQ020	DATA RIMBORSO	<b>O</b>
AQ021	CAPITALE RIMBORSATO	<b>O</b>
AQ022	CAUSALE RIMBORSO	<b>O</b>
AQ023	PREZZO RIMBORSO EFFETTIVO	<b>X</b>
AQ024	POOL FACTOR	<b>X</b>
AQ025	CIRCOLANTE DOPO RIMBORSO	<b>X</b>

## Titoli di Debito: ABS e CDO (con effetti ai fini segnaletici ex Art.129)

**TABELLA 14:** Censimento ISIN e info anagrafiche 129 (sez. 1)  
Comunicazione dati definitivi e info anagrafiche 129 (sez. 1)

ID	DATO 129	DESCRIZIONE CAMPO	Censimento ISIN e info anagrafiche 129 [RUOLI EMI/CPGR]	Censimento ISIN e info anagrafiche 129 [RUOLO COLL]	Comunicazione dati definitivi e informazioni anagrafiche 129
<b>INFORMAZIONI SULLO STRUMENTO FINANZIARIO</b>					
<b>ISIN</b>					
SF001	(*)	CODICE ISIN	D	D	D
ME003		STATO 129	D	D	D
<b>STRUMENTO FINANZIARIO</b>					
SF005	(*)	EMITTENTE RESIDENTE	O	O	O
SF006	(*)	EMITTENTE NON RESIDENTE	O	O	O
SF007	(*)	SAE EMITTENTE	D	D	D
SF008	(*)	CAPOGRUPPO EMITTENTE RESIDENTE	X	X	X
SF009	(*)	CAPOGRUPPO EMITTENTE NON RESIDENTE	X	X	X
SF010	(*)	SAE CAPOGRUPPO EMITTENTE	D	D	D
SF011	(*)	LM B&D / RESP. REGOL. RESID.	X	X	X
SF012	(*)	LM B&D / RESP. REGOL. NON RESID.	X	X	X
SF013	(*)	TIPOLOGIA STRUMENTO FINANZIARIO	O	O	O
SF014		COMPARTO	D	D	D
SF015		FORMA DEL TITOLO	O	X	O
SF016	(*)	PRESENZA COMPONENTE DERIVATIVA	O	O	O
SF021		TIPO OBBLIGAZIONE	O	O	O
SF022		NOME COMMERCIALE	X	X	X
<b>DATI SPECIFICI ABS</b>					
AB001		NUMERO OPERAZIONE	O	X	O
AB002		TRIGGER EVENT	O	X	O
AB003		CALL OPTION	O	X	O
AB004		CLASSE	X	X	X
AB005	(*)	RANKING	O	O	O
<b>RESTRIZIONI</b>					
SF032		RESTRIZIONI	X	X	X
SF033		RESTRIZIONI ALLA TRASFERIBILITÀ	X	X	X
SF034	(*)	RESTRIZIONI ALLA VENDITA	O	O	O
<b>REGIME FISCALE</b>					
SF035		TRATTAMENTO FISCALE	O	X	O
SF036		ASSOGGETTAMENTO AL DLGS 239/96	X	X	X
<b>QUOTAZIONE SU MERCATI REGOLAMENTATI</b>					
SF037		STATO QUOTAZIONE	X	X	X
SF038	(*)	CODICE MERCATO REGOLAMENTATO	X	X	X
SF039	(*)	MERCATO PRINCIPALE	X	X	X
<b>QUOTAZIONE SU MTF</b>					
SF037		STATO QUOTAZIONE	X	X	X
SF040	(*)	CODICE MTF	X	X	X

ID	DATO 129	DESCRIZIONE CAMPO	Censimento ISIN e info anagrafiche 129 [RUOLI EMI/CPGR]	Censimento ISIN e info anagrafiche 129 [RUOLO COLL]	Comunicazione dati definitivi e info anagrafiche 129
<b>INFORMAZIONI SUL COLLOCAMENTO</b>					
<b>COLLOCAMENTO</b>					
CO001	(*)	DATA INIZIO GODIMENTO	O	O	O
CO002	(*)	DATA SCADENZA	X	X	X
CO003	(*)	VALUTA	O	O	O
CO004	(*)	PREZZO RIMBORSO	O	O	O
CO005		VALORE NOMINALE UNITARIO	O	X	O
CO006		TAGLIO MINIMO SOTTOSCRIZIONE	O	X	O
<b>TRANCHE DI COLLOCAMENTO</b>					
CO007		NUMERO SERIE	X	X	X
CO008		NUMERO TRANCHE	X	X	X
CO009		DATA APERTURA COLLOCAMENTO	O	X	O
CO010		DATA CHIUSURA COLLOCAMENTO	O	X	O
CO011		IMPORTO DELIBERATO	O	O	O
CO013	(*)	PREZZO EMISSIONE O OFFERTA	O	O	O
CO014	(*)	DATA REGOLAMENTO	O	O	O
<b>MODALITÀ DI COLLOCAMENTO</b>					
CO015		TIPO COLLOCAMENTO	O	X	O
CO016		METODO COLLOCAMENTO - OFFERTA	O	X	O
CO017		SEGMENTO MERCATO	O	X	O
<b>COLLOCATORI</b>					
CO018		COLLOCATORE RESIDENTE	X	X	X
CO019		COLLOCATORE NON RESIDENTE	X	X	X
CO020		FUNZIONE	X	X	X
<b>INFORMAZIONI SUL RENDIMENTO</b>					
<b>RENDIMENTO</b>					
RE001	(*)	TIPO TASSO	O	O	O
RE002	(*)	TASSO EMISSIONE	X	X	X
RE003		TASSO PRIMA CEDOLA	X	X	X
RE004		DATA PRIMA CEDOLA	X	X	X
RE005	(*)	PERIODICITÀ CEDOLA	O	O	O
RE006		TASSO RENDIMENTO EFFETTIVO	X	X	X
RE007		TITOLO STEPPED	X	X	X
RE008		BASE CALCOLO INTERESSI	O	X	O
RE009		STRUTTURA RENDIMENTO	O	O	O
RE010		DATA VARIAZIONE TIPO TASSO	X	X	X
<b>TITOLI A TASSO VARIABILE</b>					
RE011		DATA INIZIO APPLICAZIONE SPREAD	X	X	X
RE012		DATA FINE APPLICAZIONE SPREAD	X	X	X
RE013		OPERATORE MATEMATICO	X	X	X
RE014		SPREAD	X	X	X
RE015		PERIODO DI CALCOLO CEDOLA VARIABILE	X	X	X
RE016	(*)	CODICE ISIN PARAMETRO	X	X	X
<b>TITOLI STRUTTURATI</b>					
RE017	(*)	CEDOLA CAP	X	X	X
RE018	(*)	CEDOLA FLOOR	X	X	X
RE019	(*)	INDICIZZAZIONE CEDOLA	X	X	X

ID	DATO 129	DESCRIZIONE CAMPO	Censimento ISIN e info anagrafiche 129 [RUOLI EMI/CPGR]	Censimento ISIN e info anagrafiche 129 [RUOLO COLL]	Comunicazione dati definitivi e info anagrafiche 129
<b>PIANO RENDIMENTO</b>					
RE020		DATA INIZIO GODIMENTO	X	X	X
RE021		DATA FINE GODIMENTO	X	X	X
RE022		DATA PAGAMENTO	X	X	X
RE023		TASSO CEDOLA	X	X	X
RE024		TASSO ANNUO	X	X	X
RE008		BASE CALCOLO INTERESSI	X	X	X
RE026		TIPO TASSO	X	X	X
RE027		PERIODICITÀ	X	X	X
RE028		CEDOLA REGOLARE	X	X	X
<b>INFORMAZIONI SUL RIMBORSO</b>					
<b>RIMBORSO</b>					
RI001		TIPO RIMBORSO	O	O	O
RI002	(*)	OPZIONE RIMBORSO ANTICIPATO	O	O	O
RI003	(*)	INDICIZZAZIONE CAPITALE	X	X	X
AM004		DATA PRIMA RATA AMMORTAMENTO	X	X	X
<b>ALTRE OPZIONI</b>					
<b>ALTRE OPZIONI</b>					
AO001		TIPO OPZIONE	X	X	X
AO002		DATA INIZIO ESERCIZIO	X	X	X
AO003		DATA FINE ESERCIZIO	X	X	X
AO004		TIPO ESERCIZIO	X	X	X
AO005		PREZZO ESERCIZIO OPZIONE	X	X	X
AO006		STRIKE TIPO TASSO	X	X	X
AO007		STRIKE DATA SCADENZA	X	X	X
AO008		STRIKE PERIODICITÀ	X	X	X
AO009		TITOLO OFFERTO IN CAMBIO	X	X	X
AO010		RAPPORTO DI CAMBIO	X	X	X



**TABELLA 15:** Comunicazione info anagrafiche 129 (sez. 1)

ID	DATO 129	DESCRIZIONE CAMPO	Comunicazione info anagrafiche 129 (sezione 1)
<b>INFORMAZIONI SULLO STRUMENTO FINANZIARIO</b>			
<b>ISIN</b>			
SF001	(*)	CODICE ISIN	D
SF002		CODICE CFI	D
SF003		DESCRIZIONE	D
SF004		DESCRIZIONE BREVE	D
ME003		STATO 129	D
<b>STRUMENTO FINANZIARIO</b>			
SF005	(*)	EMITTENTE RESIDENTE	O
SF006	(*)	EMITTENTE NON RESIDENTE	O
SF007	(*)	SAE EMITTENTE	D
SF008	(*)	CAPOGRUPPO EMITTENTE RESIDENTE	O
SF009	(*)	CAPOGRUPPO EMITTENTE NON RESIDENTE	O
SF010	(*)	SAE CAPOGRUPPO EMITTENTE	D
SF011	(*)	LM B&D / RESP. REGOL. RESID.	X
SF012	(*)	LM B&D / RESP. REGOL. NON RESID.	X
SF013	(*)	TIPOLOGIA STRUMENTO FINANZIARIO	O
SF014		COMPARTO	D
SF016	(*)	PRESENZA COMPONENTE DERIVATIVA	O
<b>DATI SPECIFICI ABS</b>			
AB001		NUMERO OPERAZIONE	X
AB005	(*)	RANKING	X
<b>RESTRIZIONI</b>			
SF034	(*)	RESTRIZIONI ALLA VENDITA	O
<b>QUOTAZIONE SU MTF</b>			
SF037		STATO QUOTAZIONE	X
SF040	(*)	CODICE MTF	X
<b>INFORMAZIONI SUL COLLOCAMENTO</b>			
<b>COLLOCAMENTO</b>			
CO001	(*)	DATA INIZIO GODIMENTO	O
CO002	(*)	DATA SCADENZA	X
CO003	(*)	VALUTA	O
RI001		TIPO RIMBORSO	O
CO004	(*)	PREZZO RIMBORSO	O
CO013	(*)	PREZZO EMISSIONE O OFFERTA	O
CO014	(*)	DATA REGOLAMENTO	O
<b>MODALITÀ DI COLLOCAMENTO</b>			
CO016		METODO COLLOCAMENTO - OFFERTA	O
<b>COLLOCATORI</b>			
CO018		COLLOCATORE RESIDENTE	X
CO019		COLLOCATORE NON RESIDENTE	X
CO020		FUNZIONE	X

ID	DATO129	DESCRIZIONE CAMPO	Comunicazione info anagrafiche 129 (sezione 1)
<b>INFORMAZIONI RIMBORSO E RENDIMENTO</b>			
<b>RIMBORSO</b>			
RI002	(*)	OPZIONE RIMBORSO ANTICIPATO	O
RI003	(*)	INDICIZZAZIONE CAPITALE	X
<b>RENDIMENTO</b>			
RE001	(*)	TIPO TASSO	X
RE002	(*)	TASSO EMISSIONE	X
RE003		TASSO PRIMA CEDOLA	X
RE004		DATA PRIMA CEDOLA	X
RE005	(*)	PERIODICITÀ CEDOLA	O
RE007		TITOLO STEPPED	X
RE009		STRUTTURA RENDIMENTO	X
RE010		DATA VARIAZIONE TIPO TASSO	X
<b>TITOLI A TASSO VARIABILE</b>			
RE011		DATA INIZIO APPLICAZIONE SPREAD	X
RE012		DATA FINE APPLICAZIONE SPREAD	X
RE013		OPERATORE MATEMATICO	X
RE014		SPREAD	X
RE015		PERIODO DI CALCOLO CEDOLA VARIABILE	X
RE016	(*)	CODICE ISIN PARAMETRO	X
<b>TITOLI STRUTTURATI</b>			
RE017	(*)	CEDOLA CAP	X
RE018	(*)	CEDOLA FLOOR	X
RE019	(*)	INDICIZZAZIONE CEDOLA	X

**TABELLA 16:** Comunicazione info anagrafiche 129 (sez. 2-3)

ID	DATO 129	DESCRIZIONE CAMPO	Comunicazione info anagrafiche 129 (sezione 2-3)
<b>INFORMAZIONI ANAGRAFICHE 129 SEZIONI 2-3</b>			
<b>ISIN</b>			
SF001	(*)	CODICE ISIN	D
SF002		CODICE CFI	D
SF003		DESCRIZIONE	D
SF004		DESCRIZIONE BREVE	D
SF005	(*)	EMITTENTE RESIDENTE	D
SF006	(*)	EMITTENTE NON RESIDENTE	D
SF016	(*)	PRESENZA COMPONENTE DERIVATIVA	O
ME003		STATO 129	D
<b>SEZIONE 2</b>			
AA001	(*)	DURATA ATTESA	O
AA002	(*)	TASSO DI RENDIMENTO EFFETTIVO ALL'EMISSIONE - COMPONENTE GARANTITA	O
AA003	(*)	TASSO DI RENDIMENTO EFFETTIVO ALL'EMISSIONE - COMPONENTE VARIABILE	O
AA004	(*)	TIPO VALORE COSTO DELLA RACCOLTA	O
AA005	(*)	COSTO DELLA RACCOLTA	O
<b>SEZIONE 3</b>			
AA006	(*)	NUMERO DI SOTTOSTANTI DELLA COMPONENTE DERIVATIVA	X
AA007	(*)	COMPONENTE DERIVATIVA PATH DEPENDENT	X
AA008	(*)	TIPO ESERCIZIO DEL DERIVATO	X

**TABELLA 17:** Comunicazione collocato (sez. 4)

ID	DAT O 129	DESCRIZIONE CAMPO	Comun. collocato (sezione 4)
<b>INFORMAZIONI ANAGRAFICHE 129 SEZIONE 4</b>			
<b>ISIN</b>			
SF001	(*)	CODICE ISIN	D
SF002		CODICE CFI	D
SF003		DESCRIZIONE	D
SF004		DESCRIZIONE BREVE	D
SF005	(*)	EMITTENTE RESIDENTE	D
SF006	(*)	EMITTENTE NON RESIDENTE	D
ME003		STATO 129	D
CO016		METODO COLLOCAMENTO - OFFERTA	X
<b>COLLOCATO</b>			
AQ006	(*)	DATA DI FINE COLLOCAMENTO	O
AQ007	(*)	IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO BANCHE RESIDENTI	O
AQ008	(*)	IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO BANCHE NON RESIDENTI	O
AQ009	(*)	IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO AMMINISTRAZIONI PUBBLICHE RESIDENTI	O
AQ010	(*)	IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO AMMINISTRAZIONI PUBBLICHE NON RESIDENTI	O
AQ011	(*)	IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO FINANZIARIE RESIDENTI	O
AQ012	(*)	IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO FINANZIARIE NON RESIDENTI	O
AQ013	(*)	IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO SOCIETÀ NON FINANZIARIE RESIDENTI	O
AQ014	(*)	IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO SOCIETÀ NON FINANZIARIE NON RESIDENTI	O
AQ015	(*)	IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO FAMIGLIE RESIDENTI	O
AQ016	(*)	IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO FAMIGLIE NON RESIDENTI	O
AQ017	(*)	IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO ALTRO RESIDENTI	O
AQ018	(*)	IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO ALTRO NON RESIDENTI	O
AQ019	(*)	TIPOLOGIA IMPORTI SEGNALATI	O

**TABELLA 18:** Comunicazione rimborsi anticipati (sez. 4)

ID	DATO 129	DESCRIZIONE CAMPO	Comun. rimborsi anticipati (sezione 4)
<b>INFORMAZIONI ANAGRAFICHE 129 SEZIONE 4</b>			
<b>ISIN</b>			
SF001	(*)	CODICE ISIN	D
SF002		CODICE CFI	D
SF003		DESCRIZIONE	D
SF004		DESCRIZIONE BREVE	D
SF005	(*)	EMITTENTE RESIDENTE	D
SF006	(*)	EMITTENTE NON RESIDENTE	D
ME003		STATO 129	D
<b>RIMBORSI</b>			
AQ020	(*)	DATA RIMBORSO	O
AQ021	(*)	CAPITALE RIMBORSATO	O
AQ022	(*)	CAUSALE RIMBORSO	O
AQ023	(*)	PREZZO RIMBORSO EFFETTIVO	O
AQ024	(*)	POOL FACTOR	O
AQ025	(*)	CIRCOLANTE DOPO RIMBORSO	O

## Titoli di Capitale

**TABELLA 19:** Richiesta ISIN  
Comunicazione aggiornamento

ID	DESCRIZIONE CAMPO	Richiesta ISIN	Comun. aggiorn.
<b>INFORMAZIONI SULLO STRUMENTO FINANZIARIO</b>			
<b>ISIN</b>			
ME001	TIPO AGGIORNAMENTO		O
ME002	DECORRENZA VARIAZIONE		X
SF001	CODICE ISIN		D
SF002	CODICE CF		D
SF003	DESCRIZIONE		D
SF004	DESCRIZIONE BREVE		D
<b>STRUMENTO FINANZIARIO</b>			
SF005	EMITTENTE RESIDENTE	O	O
SF006	EMITTENTE NON RESIDENTE	O	O
SF013	TIPOLOGIA STRUMENTO FINANZIARIO	D	D
TC001	TIPOLOGIA AZIONI	O	O
SF014	COMPARTO	D	D
SF015	FORMA DEL TITOLO	O	O
CO003	VALUTA	O	O
SF023	TIPO DOCUMENTAZIONE	O	D
AD017	DATA INIZIO DIFFUSIONE	X	D
TC002	CATEGORIA AZIONI	X	X
<b>DATI SPECIFICI</b>			
TC003	ASSENZA VALORE NOMINALE UNITARIO	O	O
CO005	VALORE NOMINALE UNITARIO	X	X
TC004	NUMERO AZIONI	O	O
TC005	VALORE NOMINALE COMPLESSIVO	O	O
TC006	DIRITTO DI VOTO	O	O
TC007	QUOTA DI CAPITALE VERSATO	O	O
TC008	TIPO DIVIDENDO	X	X
TC009	TIPO GODIMENTO	O	O
TC010	DATA INIZIO GODIMENTO PRO RATA	X	X
TC011	CONVERTIBILITÀ	O	O
<b>RESTRIZIONI E VINCOLI</b>			
TC012	RESTRIZIONI AL POSSESSO-TRASFERIMENTO	O	O
TC014	PREMIO FEDELTA' (BONUS SHARE)	O	O
TC013	DATA FINE RESTRIZIONE	X	X
TC015	DATA BONUS SHARE	X	X
<b>QUOTAZIONE SU MERCATI REGOLAMENTATI</b>			
SF037	STATO QUOTAZIONE	X	
SF038	CODICE MERCATO REGOLAMENTATO	X	
SF039	MERCATO PRINCIPALE	X	

## Diritti

**TABELLA 20:** Richiesta ISIN  
Comunicazione aggiornamento

ID	DESCRIZIONE CAMPO	Richiesta ISIN	Comun. aggiorn.
<b>INFORMAZIONI SULLO STRUMENTO FINANZIARIO</b>			
<b>ISIN</b>			
ME001	TIPO AGGIORNAMENTO		O
ME002	DECORRENZA VARIAZIONE		X
SF001	CODICE ISIN		D
SF002	CODICE CFI		D
SF003	DESCRIZIONE		D
SF004	DESCRIZIONE BREVE		D
<b>STRUMENTO FINANZIARIO</b>			
SF005	EMITTENTE RESIDENTE	O	O
SF006	EMITTENTE NON RESIDENTE	O	O
SF013	TIPOLOGIA STRUMENTO FINANZIARIO	D	D
SF014	COMPARTO	D	D
DI001	TIPOLOGIA DIRITTO	O	O
CO003	VALUTA	O	O
SF023	TIPO DOCUMENTAZIONE	O	D
AD017	DATA INIZIO DIFFUSIONE	X	D
<b>DATI SPECIFICI</b>			
DI002	DATA INIZIO ESERCIZIO	O	O
DI003	DATA FINE ESERCIZIO	O	O
DI004	RAPPORTO DI ESERCIZIO	X	X
DI005	CEDOLA RAPPRESENTATIVA DEL DIRITTO	X	O
AD005	ATTIVITÀ SOTTOSTANTE	O	O
<b>QUOTAZIONE SU MERCATI REGOLAMENTATI</b>			
SF037	STATO QUOTAZIONE	X	
SF038	CODICE MERCATO REGOLAMENTATO	X	
SF039	MERCATO PRINCIPALE	X	

## Warrant

**TABELLA 21:** Richiesta ISIN  
Comunicazione aggiornamento

ID	DESCRIZIONE CAMPO	Richiesta ISIN	Comun. aggiorn.
<b>INFORMAZIONI SULLO STRUMENTO FINANZIARIO</b>			
<b>ISIN</b>			
ME001	TIPO AGGIORNAMENTO		O
ME002	DECORRENZA VARIAZIONE		X
SF001	CODICE ISIN		D
SF002	CODICE CFI		D
SF003	DESCRIZIONE		D
SF004	DESCRIZIONE BREVE		D
<b>STRUMENTO FINANZIARIO</b>			
SF005	EMITTENTE RESIDENTE	O	O
SF006	EMITTENTE NON RESIDENTE	O	O
SF013	TIPOLOGIA STRUMENTO FINANZIARIO	D	D
SF014	COMPARTO	D	D
AD001	TIPOLOGIA FACOLTÀ	O	O
SF023	TIPO DOCUMENTAZIONE	O	O
AD017	DATA INIZIO DIFFUSIONE	X	X
AD005	ATTIVITÀ SOTTOSTANTE	O	O
<b>QUOTAZIONE SU MERCATI REGOLAMENTATI</b>			
SF037	STATO QUOTAZIONE	X	
SF038	CODICE MERCATO REGOLAMENTATO	X	
SF039	MERCATO PRINCIPALE	X	
<b>DATI EMISSIONE - ESERCIZIO</b>			
<b>EMISSIONE ESERCIZIO</b>			
AD009	DATA EMISSIONE	O	O
CO002	DATA SCADENZA	O	O
AD010	VALUTA EMISSIONE	O	O
AD011	PREZZO EMISSIONE	X	X
AD012	BASE QUOTAZIONE	X	X
WA001	NUMERO WARRANT EMESSI	X	X
AD014	VALUTA PREZZO ESERCIZIO-DENOMINAZIONE	X	X
AD015	PREZZO ESERCIZIO	X	X
WA002	NUMERO TITOLI DI COMPENDIO	X	X

## Investment certificates (senza effetti ai fini segnaletici ex Art.129)

**TABELLA 22:** Richiesta ISIN  
Censimento ISIN  
Comunicazione dati definitivi  
Comunicazione aggiornamento

ID	DESCRIZIONE CAMPO	Richiesta ISIN	Censimento ISIN	Comun. dati definitivi	Comun. aggiorn.
<b>INFORMAZIONI SULLO STRUMENTO FINANZIARIO</b>					
<b>ISIN</b>					
ME001	TIPO AGGIORNAMENTO				O
ME002	DECORRENZA VARIAZIONE				X
SF001	CODICE ISIN		D	D	D
SF002	CODICE CFI		D	D	D
SF003	DESCRIZIONE		D	D	D
SF004	DESCRIZIONE BREVE		D	D	D
<b>STRUMENTO FINANZIARIO</b>					
SF005	EMITTENTE RESIDENTE	O	O	O	O
SF006	EMITTENTE NON RESIDENTE	O	O	O	O
SF011	LM B&D / RESP. REGOL. RESID.	X	X	X	X
SF012	LM B&D / RESP. REGOL. NON RESID.	X	X	X	X
SF013	TIPOLOGIA STRUMENTO FINANZIARIO	O	O	O	O
SF014	COMPARTO	D	D	D	D
SF022	NOME COMMERCIALE	X	X	X	X
<b>DATI SPECIFICI</b>					
CE001	CLASSE INVESTIMENTO	X	X	X	X
AD002	EUSIPA	O	O	O	O
CE002	MODALITÀ DI RIMBORSO	O	X	O	X
CE003	DIVIDEND COUPON	O	X	O	X
CE004	BARRIER OPTION	X	X	X	X
<b>ATTIVITÀ SOTTOSTANTE</b>					
AD005	ATTIVITÀ SOTTOSTANTE	O	O	O	O
AD006	DESCRIZIONE ATTIVITÀ SOTTOSTANTE	O	O	O	O
AD008	MULTIPLO	X	X	X	X
<b>LEGAME ATTIVITÀ SOTTOSTANTE</b>					
AD007	CODICE ISIN TITOLO COLLEGATO	X	X	X	X
<b>QUOTAZIONE SU MERCATI REGOLAMENTATI</b>					
SF037	STATO QUOTAZIONE	X	X		
SF038	CODICE MERCATO REGOLAMENTATO	X	X		
SF039	MERCATO PRINCIPALE	X	X		

ID	DESCRIZIONE CAMPO	Richiesta ISIN	Censimento ISIN	Comun. dati definitivi	Comun. aggiorn.
<b>DATI EMISSIONE - ESERCIZIO</b>					
<b>EMISSIONE - RIMBORSO - ESERCIZIO</b>					
AD009	DATA EMISSIONE	O	O	O	O
CO002	DATA SCADENZA	O	O	O	O
AD010	VALUTA EMISSIONE	O	O	O	O
AD011	PREZZO EMISSIONE	X	O	O	O
AD014	VALUTA PREZZO ESERCIZIO-DENOMINAZIONE	O	O	O	O
AD015	PREZZO ESERCIZIO	X	X	X	X
CO005	VALORE NOMINALE UNITARIO	O	O	O	O
AD013	NUMERO CERTIFICATI EMESSI	O	O	O	O
AD012	BASE QUOTAZIONE	X	X	X	X
AD016	ESERCIZIO ANTICIPATO	X	O	O	O
RE005	PERIODICITÀ CEDOLA	O	O	O	O
RE004	DATA PRIMA CEDOLA	X	X	X	X
<b>COLLOCAMENTO</b>					
CO016	METODO COLLOCAMENTO - OFFERTA	O	O	O	O
CO014	DATA REGOLAMENTO	O	O	O	O
<b>COLLOCATORI</b>					
CO018	COLLOCATORE RESIDENTE	X	X	X	X
CO019	COLLOCATORE NON RESIDENTE	X	X	X	X
CO020	FUNZIONE	X	X	X	X

**TABELLA 23:** Comunicazione cedole

ID	DESCRIZIONE CAMPO	Comunicazione cedole
<b>PIANO CEDOLE</b>		
<b>ISIN</b>		
SF001	CODICE ISIN	D
<b>STRUMENTO FINANZIARIO</b>		
CO001	DATA INIZIO GODIMENTO	O
RE021	DATA FINE GODIMENTO	O
RE022	DATA PAGAMENTO	X
RE023	TASSO CEDOLA	X
RE024	TASSO ANNUO	X
RE025	BASE CALCOLO	X
RE026	TIPO TASSO	O
RE005	PERIODICITÀ CEDOLA	O
RE028	CEDOLA REGOLARE	O



## Investment certificates (con effetti ai fini segnaletici ex Art.129)

**TABELLA 24:** Censimento ISIN e info anagrafiche 129 (sez. 1)  
Comunicazione dati definitivi e info anagrafiche 129 (sez. 1)

ID	DATO 129	DESCRIZIONE CAMPO	Censimento ISIN e info anagrafiche 129 [RUOLI EMI/CPGR]	Censimento ISIN e info anagrafiche 129 [RUOLO COLL]	Comunicazione dati definitivi e info anagrafiche 129
<b>INFORMAZIONI SULLO STRUMENTO FINANZIARIO</b>					
<b>ISIN</b>					
SF001	(*)	CODICE ISIN	D	D	D
SF002		CODICE CFI			D
SF003		DESCRIZIONE			D
SF004		DESCRIZIONE BREVE			D
ME003		STATO 129	D	D	D
<b>STRUMENTO FINANZIARIO</b>					
SF005	(*)	EMITTENTE RESIDENTE	O	O	O
SF006	(*)	EMITTENTE NON RESIDENTE	O	O	O
SF007	(*)	SAE EMITTENTE	D	D	D
SF008	(*)	CAPOGRUPPO EMITTENTE RESIDENTE	X	X	X
SF009	(*)	CAPOGRUPPO EMITTENTE NON RESIDENTE	X	X	X
SF010	(*)	SAE CAPOGRUPPO EMITTENTE	D	D	D
SF013	(*)	TIPOLOGIA STRUMENTO FINANZIARIO	O	O	O
SF014		COMPARTO	D	D	D
SF022		NOME COMMERCIALE	X	X	X
SF024		TIPO GARANZIA	O	O	O
SF026	(*)	GARANTE RESIDENTE	X	X	X
SF027	(*)	GARANTE NON RESIDENTE	X	X	X
SF028	(*)	SAE GARANTE	D	D	D
SF029	(*)	CAPOGRUPPO GARANTE RESIDENTE	X	X	X
SF030	(*)	CAPOGRUPPO GARANTE NON RESIDENTE	X	X	X
SF031	(*)	SAE CAPOGRUPPO GARANTE	D	D	D
<b>DATI SPECIFICI</b>					
CE001		CLASSE INVESTIMENTO	X	X	X
AD002	(*)	EUSIPA	O	O	O
CE002		MODALITÀ DI RIMBORSO	X	X	O
CE003		DIVIDEND COUPON	X	X	O
CE004		BARRIER OPTION	X	X	X
<b>ATTIVITÀ SOTTOSTANTE</b>					
AD005	(*)	ATTIVITÀ SOTTOSTANTE	O	O	O
AD006		DESCRIZIONE ATTIVITÀ SOTTOSTANTE	O	X	O
AD008		MULTIPLO	X	X	X
<b>LEGAME ATTIVITÀ SOTTOSTANTE</b>					
AD007		CODICE ISIN TITOLO COLLEGATO	X	X	X
<b>QUOTAZIONE SU MERCATI REGOLAMENTATI</b>					
SF037		STATO QUOTAZIONE	X	X	
SF038	(*)	CODICE MERCATO REGOLAMENTATO	X	X	
SF039	(*)	MERCATO PRINCIPALE	X	X	
<b>SISTEMI MULTILATERALI DI NEGOZIAZIONE</b>					
<b>QUOTAZIONE SU MTF</b>					
SF037		STATO QUOTAZIONE	X	X	X
SF040	(*)	CODICE MTF	X	X	X

ID	DATO 129	DESCRIZIONE CAMPO	Censimento ISIN e info anagrafiche 129 [RUOLI EMI/CPGR]	Censimento ISIN e info anagrafiche 129 [RUOLO COLL]	Comunicazione dati definitivi e info anagrafiche 129
<b>DATI EMISSIONE --ESERCIZIO - COLLOCAMENTO</b>					
<b>EMISSIONE - RIMBORSO - ESERCIZIO</b>					
AD009	(*)	DATA EMISSIONE	O	O	O
CO002	(*)	DATA SCADENZA	O	O	O
AD010	(*)	VALUTA EMISSIONE	O	O	O
AD011	(*)	PREZZO EMISSIONE	O	O	O
AD014		VALUTA PREZZO ESERCIZIO-DENOMINAZIONE	O	X	O
CO005		VALORE NOMINALE UNITARIO	O	X	O
AD013		NUMERO CERTIFICATI EMESSI	O	X	O
AD012		BASE QUOTAZIONE	X	X	X
SF034	(*)	RESTRIZIONI ALLA VENDITA	O	O	O
SF016	(*)	PRESENZA COMPONENTE DERIVATIVA	D	D	D
<b>COLLOCAMENTO</b>					
CO016		METODO COLLOCAMENTO - OFFERTA	O	X	O
CO014	(*)	DATA REGOLAMENTO	O	X	O
<b>COLLOCATORI</b>					
CO018		COLLOCATORE RESIDENTE	X	X	X
CO019		COLLOCATORE NON RESIDENTE	X	X	X
CO020		FUNZIONE	X	X	X
<b>INFORMAZIONI RIMBORSO E RENDIMENTO</b>					
<b>RIMBORSO</b>					
RI002	(*)	OPZIONE RIMBORSO ANTICIPATO	O	O	O
RI003	(*)	INDICIZZAZIONE CAPITALE	X	X	X
<b>RENDIMENTO</b>					
RE001	(*)	TIPO TASSO	O	O	O
RE002	(*)	TASSO EMISSIONE	X	X	X
RE003		TASSO PRIMA CEDOLA	X	X	X
RE004		DATA PRIMA CEDOLA	X	X	X
RE005	(*)	PERIODICITÀ CEDOLA	O	O	O
RE007		TITOLO STEPPED	X	X	X
RE009		STRUTTURA RENDIMENTO	O	O	O
RE010		DATA VARIAZIONE TIPO TASSO	X	X	X
<b>TITOLI STRUTTURATI</b>					
RE017	(*)	CEDOLA CAP	X	X	X
RE018	(*)	CEDOLA FLOOR	X	X	X
RE019	(*)	INDICIZZAZIONE CEDOLA	X	X	X

**TABELLA 25:** Comunicazione info anagrafiche 129 (sez. 1)

Comunicazione  
info anagrafiche  
129  
(sezione 1)

ID	DATO 129	DESCRIZIONE CAMPO	
<b>INFORMAZIONI SULLO STRUMENTO FINANZIARIO</b>			
<b>ISIN</b>			
SF001	(*)	CODICE ISIN	D
SF002		CODICE CFI	D
SF003		DESCRIZIONE	D
SF004		DESCRIZIONE BREVE	D
ME003		STATO 129	D
<b>STRUMENTO FINANZIARIO</b>			
SF005	(*)	EMITTENTE RESIDENTE	D
SF006	(*)	EMITTENTE NON RESIDENTE	D
SF007	(*)	SAE EMITTENTE	D
SF008	(*)	CAPOGRUPPO EMITTENTE RESIDENTE	X
SF009	(*)	CAPOGRUPPO EMITTENTE NON RESIDENTE	X
SF010	(*)	SAE CAPOGRUPPO EMITTENTE	D
SF011	(*)	LM B&D / RESP. REGOL. RESID.	X
SF012	(*)	LM B&D / RESP. REGOL. NON RESID.	X
SF013	(*)	TIPOLOGIA STRUMENTO FINANZIARIO	O
SF014		COMPARTO	D
AD002	(*)	EUSIPA	O
CE002		MODALITÀ DI RIMBORSO	X
CE003		DIVIDEND COUPON	X
CE004		BARRIER OPTION	X
SF024		TIPO GARANZIA	O
SF026	(*)	GARANTE RESIDENTE	X
SF027	(*)	GARANTE NON RESIDENTE	X
SF028	(*)	SAE GARANTE	D
SF029	(*)	CAPOGRUPPO GARANTE RESIDENTE	X
SF030	(*)	CAPOGRUPPO GARANTE NON RESIDENTE	X
SF031	(*)	SAE CAPOGRUPPO GARANTE	D
SF016	(*)	PRESENZA COMPONENTE DERIVATIVA	D
<b>SISTEMI MULTILATERALI DI NEGOZIAZIONE</b>			
<b>QUOTAZIONE SU MTF</b>			
SF040	(*)	CODICE MTF	X
SF037		STATO QUOTAZIONE	X
<b>DATI EMISSIONE - ESERCIZIO - COLLOCAMENTO</b>			
<b>EMISSIONE - RIMBORSO - ESERCIZIO</b>			
AD009	(*)	DATA EMISSIONE	O
CO002	(*)	DATA SCADENZA	O
AD014		VALUTA PREZZO ESERCIZIO-DENOMINAZIONE	O
SF034	(*)	RESTRIZIONI ALLA VENDITA	O
<b>COLLOCAMENTO</b>			
CO016		METODO COLLOCAMENTO - OFFERTA	O
CO014	(*)	DATA REGOLAMENTO	O
<b>COLLOCATORI</b>			
CO018		COLLOCATORE RESIDENTE	X
CO019		COLLOCATORE NON RESIDENTE	X
CO020		FUNZIONE	D

ID	DATO 129	DESCRIZIONE CAMPO	Comunicazione info anagrafiche 129 (sezione 1)
<b>INFORMAZIONI RIMBORSO E RENDIMENTO</b>			
<b>RIMBORSO</b>			
RI002	(*)	OPZIONE RIMBORSO ANTICIPATO	O
RI003	(*)	INDICIZZAZIONE CAPITALE	X
<b>RENDIMENTO</b>			
RE001	(*)	TIPO TASSO	O
RE002	(*)	TASSO EMISSIONE	X
RE003		TASSO PRIMA CEDOLA	X
RE004		DATA PRIMA CEDOLA	X
RE005	(*)	PERIODICITÀ CEDOLA	O
RE007		TITOLO STEPPED	X
RE009		STRUTTURA RENDIMENTO	O
RE010		DATA VARIAZIONE TIPO TASSO	X
<b>TITOLI STRUTTURATI</b>			
RE017	(*)	CEDOLA CAP	X
RE018	(*)	CEDOLA FLOOR	X
RE019	(*)	INDICIZZAZIONE CEDOLA	X

**TABELLA 26:** Comunicazione info anagrafiche 129 (sez. 2-3)

ID	DATO 129	DESCRIZIONE CAMPO	Comunicazione info anagrafiche 129 (sezione 2-3)
<b>INFORMAZIONI ANAGRAFICHE 129 SEZIONI 2-3</b>			
<b>ISIN</b>			
SF001	(*)	CODICE ISIN	D
SF002		CODICE CFI	D
SF003		DESCRIZIONE	D
SF004		DESCRIZIONE BREVE	D
SF005	(*)	EMITTENTE RESIDENTE	D
SF006	(*)	EMITTENTE NON RESIDENTE	D
SF016	(*)	PRESENZA COMPONENTE DERIVATIVA	D
ME003		STATO 129	O
<b>SEZIONE 2</b>			
AA005	(*)	COSTO DELLA RACCOLTA	O
AA004	(*)	TIPO VALORE COSTO DELLA RACCOLTA	O
<b>SEZIONE 3</b>			
AA006	(*)	NUMERO DI SOTTOSTANTI DELLA COMPONENTE DERIVATIVA	O
AA007	(*)	COMPONENTE DERIVATIVA PATH DEPENDENT	O

**TABELLA 27:** Comunicazione info quantitative Certificates, CW, ETC e ETN (sez. 4)

ID	DATO 129	DESCRIZIONE CAMPO	Comunicazione info quantitative (sezione 4)
<b>INFORMAZIONI QUANTITATIVE SEZIONE 4</b>			
<b>ISIN</b>			
SF001	(*)	CODICE ISIN	D
SF002		CODICE CFI	D
SF003		DESCRIZIONE	D
SF004		DESCRIZIONE BREVE	D
SF005	(*)	EMITTENTE RESIDENTE	D
SF006	(*)	EMITTENTE NON RESIDENTE	D

AD009	(*)	DATA EMISSIONE	D
CO002	(*)	DATA SCADENZA	D
<b>INFORMAZIONI QUANTITATIVE</b>			
AQ002	(*)	DATA FINE TRIMESTRE DI RIFERIMENTO	O
AQ003	(*)	PREZZO DI NEGOZIAZIONE	O
AQ005	(*)	VALUTA PREZZO DI NEGOZIAZIONE	O
AQ001	(*)	NUMERO DI CERTIFICATI IN CIRCOLAZIONE	O
AQ004	(*)	STATO NEGOZIAZIONE	O
CO018	(*)	CODICE COLLOCATORE RESIDENTE	X
CO019	(*)	CODICE COLLOCATORE NON RESIDENTE	X
CO016	(*)	METODO COLLOCAMENTO - OFFERTA	D
CO020	(*)	FUNZIONE	D

## Covered Warrant, Leverage Certificates, ETC, ETN (senza effetti ai fini segnaletici ex Art.129)

**TABELLA 28:** Richiesta ISIN  
Comunicazione dati definitivi  
Comunicazione aggiornamento singolo

ID	DESCRIZIONE CAMPO	Richiesta ISIN massiva	Comun. dati definitivi massiva	Comun. aggiorn. singolo
<b>INFORMAZIONI SULLO STRUMENTO FINANZIARIO</b>				
<b>ISIN</b>				
ME001	TIPO AGGIORNAMENTO			O
ME002	DECORRENZA VARIAZIONE			X
SF001	CODICE ISIN		D	D
SF002	CODICE CFI		D	D
SF003	DESCRIZIONE		D	D
SF004	DESCRIZIONE BREVE		D	D
<b>STRUMENTO FINANZIARIO</b>				
SF005	EMITTENTE RESIDENTE	O	O	O
SF006	EMITTENTE NON RESIDENTE	O	O	O
SF013	TIPOLOGIA STRUMENTO FINANZIARIO	O	O	O
SF014	COMPARTO	D	D	D
SF022	NOME COMMERCIALE	X	X	X
<b>DATI SPECIFICI</b>				
AD001	TIPOLOGIA FACOLTÀ	O	O	O
AD003	MODALITÀ ESERCIZIO	X	X	X
AD002	EUSIPA	X	X	X
LV001	TIPO DIPENDENZA DELLA BARRIERA	X	X	X
<b>EMISSIONE ESERCIZIO</b>				
AD009	DATA EMISSIONE	O	O	O
CO002	DATA SCADENZA	O	O	O
AD010	VALUTA EMISSIONE	O	O	O
AD011	PREZZO EMISSIONE	X	X	X
AD014	VALUTA PREZZO ESERCIZIO-DENOMINAZIONE	O	O	O
AD015	PREZZO ESERCIZIO	O	O	O
AD013	NUMERO CERTIFICATI EMESSI	X	X	X
AD012	BASE QUOTAZIONE	X	X	X
AD016	ESERCIZIO ANTICIPATO	X	X	X
<b>ATTIVITÀ SOTTOSTANTE</b>				
AD005	ATTIVITÀ SOTTOSTANTE	O	O	O
AD006	DESCRIZIONE ATTIVITÀ SOTTOSTANTE	X	X	X
AD008	MULTIPLO	X	X	X
<b>LEGAME ATTIVITÀ SOTTOSTANTE</b>				
AD007	CODICE ISIN TITOLO COLLEGATO	X	X	X
<b>QUOTAZIONE SU MERCATI REGOLAMENTATI</b>				
SF037	STATO QUOTAZIONE	X		
SF038	CODICE MERCATO REGOLAMENTATO	X		
SF039	MERCATO PRINCIPALE	X		

## Covered Warrant, Leverage Certificates, ETC, ETN (con effetti ai fini segnaletici ex Art.129)

**TABELLA 29:** Censimento ISIN e info anagrafiche 129 (sez. 1)  
Comunicazione dati definitivi e info anagrafiche 129 (sez. 1)

ID	DATO 129	DESCRIZIONE CAMPO	Censimento ISIN e info anagrafiche 129 [RUOLI EMI/CPGR]	Censimento ISIN e info anagrafiche 129 [RUOLO COLL]	Comunicazione dati definitivi e info anagrafiche 129
<b>INFORMAZIONI SULLO STRUMENTO FINANZIARIO</b>					
<b>ISIN</b>					
SF001	(*)	CODICE ISIN	D	D	D
SF002		CODICE CFI			D
SF003		DESCRIZIONE			D
SF004		DESCRIZIONE BREVE			D
<b>STRUMENTO FINANZIARIO</b>					
SF005	(*)	EMITTENTE RESIDENTE	O	O	D
SF006	(*)	EMITTENTE NON RESIDENTE	O	O	D
SF007	(*)	SAE EMITTENTE	D	D	D
SF008	(*)	CAPOGRUPPO EMITTENTE RESIDENTE	X	X	X
SF009	(*)	CAPOGRUPPO EMITTENTE NON RESIDENTE	X	X	X
SF010	(*)	SAE CAPOGRUPPO EMITTENTE	D	D	D
SF013	(*)	TIPOLOGIA STRUMENTO FINANZIARIO	O	O	O
SF014		COMPARTO	D	D	D
SF022		NOME COMMERCIALE	X	X	X
ME003		STATO 129	D	D	D
<b>DATI SPECIFICI</b>					
AD001		TIPOLOGIA FACOLTÀ	O	O	O
AD003		MODALITÀ ESERCIZIO	X	X	X
AD002	(*)	EUSIPA	X	X	X
LV001		TIPO DIPENDENZA DELLA BARRIERA	X	X	X
<b>ATTIVITÀ SOTTOSTANTE</b>					
AD005	(*)	ATTIVITÀ SOTTOSTANTE	O	O	O
AD006		DESCRIZIONE ATTIVITÀ SOTTOSTANTE	X	X	X
AD008		MULTIPLO	X	X	X
<b>LEGAME ATTIVITÀ SOTTOSTANTE</b>					
AD007		CODICE ISIN TITOLO COLLEGATO	X	X	X
<b>QUOTAZIONE SU MERCATI REGOLAMENTATI</b>					
SF037		STATO QUOTAZIONE	X	X	
SF038	(*)	CODICE MERCATO REGOLAMENTATO	X	X	
SF039	(*)	MERCATO PRINCIPALE	X	X	
<b>SISTEMI MULTILATERALI DI NEGOZIAZIONE</b>					
<b>QUOTAZIONE SU MTF</b>					
SF040	(*)	CODICE MTF	X	X	X
SF037		STATO QUOTAZIONE	X	X	X

ID	DATO 129	DESCRIZIONE CAMPO	Censimento ISIN e info anagrafiche 129 [RUOLI EMI/CPGR]	Censimento ISIN e info anagrafiche 129 [RUOLO COLL]	Comunicazione dati definitivi e info anagrafiche 129
<b>DATI EMISSIONE - ESERCIZIO - GARANZIE</b>					
<b>EMISSIONE - ESERCIZIO</b>					
AD009	(*)	DATA EMISSIONE	O	O	O
CO002	(*)	DATA SCADENZA	O	O	O
AD011	(*)	PREZZO EMISSIONE	X	X	X
AD012		BASE QUOTAZIONE	X	X	X
AD013		NUMERO CERTIFICATI EMESSI	X	X	X
AD015		PREZZO ESERCIZIO	O	O	O
AD010	(*)	VALUTA EMISSIONE	O	X	O
AD014		VALUTA PREZZO ESERCIZIO-DENOMINAZIONE	O	O	O
AD016	(*)	ESERCIZIO ANTICIPATO	O	X	O
SF034	(*)	RESTRIZIONI ALLA VENDITA	O	O	O
CO014	(*)	DATA REGOLAMENTO	O	O	O
SF016	(*)	PRESENZA COMPONENTE DERIVATIVA	O	O	O
<b>GARANZIE</b>					
SF026	(*)	GARANTE RESIDENTE	X	X	X
SF027	(*)	GARANTE NON RESIDENTE	X	X	X
SF028	(*)	SAE GARANTE	D	D	D
SF029	(*)	CAPOGRUPPO GARANTE RESIDENTE	X	X	X
SF030	(*)	CAPOGRUPPO GARANTE NON RESIDENTE	X	X	X
SF031	(*)	SAE CAPOGRUPPO GARANTE	D	D	D
SF024		TIPO GARANZIA	O	O	O



**TABELLA 30:** Comunicazione info anagrafiche 129 (sez. 1)

ID	DATO 129	DESCRIZIONE CAMPO	Comunicazione info anagrafiche 129 (sezione 1)
<b>INFORMAZIONI SULLO STRUMENTO FINANZIARIO</b>			
<b>ISIN</b>			
SF001	(*)	CODICE ISIN	D
SF002		CODICE CFI	D
SF003		DESCRIZIONE	D
SF004		DESCRIZIONE BREVE	D
ME003		STATO 129	D
<b>STRUMENTO FINANZIARIO</b>			
SF005	(*)	EMITTENTE RESIDENTE	O
SF006	(*)	EMITTENTE NON RESIDENTE	O
SF007	(*)	SAE EMITTENTE	D
SF008	(*)	CAPOGRUPPO EMITTENTE RESIDENTE	X
SF009	(*)	CAPOGRUPPO EMITTENTE NON RESIDENTE	X
SF010	(*)	SAE CAPOGRUPPO EMITTENTE	D
SF013	(*)	TIPOLOGIA STRUMENTO FINANZIARIO	O
SF014		COMPARTO	D
SF016	(*)	PRESENZA COMPONENTE DERIVATIVA	O
SF024		TIPO GARANZIA	O
SF026	(*)	GARANTE RESIDENTE	X
SF027	(*)	GARANTE NON RESIDENTE	X
SF028	(*)	SAE GARANTE	D
SF029	(*)	CAPOGRUPPO GARANTE RESIDENTE	X
SF030	(*)	CAPOGRUPPO GARANTE NON RESIDENTE	X
SF031	(*)	SAE CAPOGRUPPO GARANTE	D
<b>DATI SPECIFICI</b>			
AD001		TIPOLOGIA FACOLTÀ	O
AD002	(*)	EUSIPA	O
LV001		TIPO DIPENDENZA DELLA BARRIERA	X
<b>ATTIVITÀ SOTTOSTANTE</b>			
AD005	(*)	ATTIVITÀ SOTTOSTANTE	O
AD006		DESCRIZIONE ATTIVITÀ SOTTOSTANTE	X
<b>LEGAME ATTIVITÀ SOTTOSTANTE</b>			
AD007		CODICE ISIN TITOLO COLLEGATO	X
<b>EMISSIONE - RIMBORSO</b>			
AD009	(*)	DATA EMISSIONE	O
CO002	(*)	DATA SCADENZA	O
AD014	(*)	VALUTA PREZZO ESERCIZIO-DENOMINAZIONE	O
CO014	(*)	DATA REGOLAMENTO	O
SF034	(*)	RESTRIZIONI ALLA VENDITA	O
AD016		ESERCIZIO ANTICIPATO	O
<b>SISTEMI MULTILATERALI DI NEGOZIAZIONE</b>			
<b>QUOTAZIONE SU MTF</b>			
SF040	(*)	CODICE MTF	X
SF037		STATO QUOTAZIONE	X

**TABELLA 31:** Comunicazione info anagrafiche 129 (sez. 2-3)

ID	DATO 129	DESCRIZIONE CAMPO	Comunicazione info anagrafiche 129 (sezione 2-3)
<b>INFORMAZIONI ANAGRAFICHE 129 SEZIONI 2-3</b>			
<b>ISIN</b>			
SF001	(*)	CODICE ISIN	D
SF002		CODICE CFI	D
SF003		DESCRIZIONE	D
SF004		DESCRIZIONE BREVE	D
SF005	(*)	EMITTENTE RESIDENTE	D
SF006	(*)	EMITTENTE NON RESIDENTE	D
SF016	(*)	PRESENZA COMPONENTE DERIVATIVA	O
ME003		STATO 129	D
<b>SEZIONE 2</b>			
AA005	(*)	COSTO DELLA RACCOLTA	O
AA004	(*)	TIPO VALORE COSTO DELLA RACCOLTA	O
<b>SEZIONE 3</b>			
AA006	(*)	NUMERO DI SOTTOSTANTI DELLA COMPONENTE DERIVATIVA	X
AA007	(*)	COMPONENTE DERIVATIVA PATH DEPENDENT	X
AA008	(*)	TIPO ESERCIZIO DEL DERIVATO	X
AA009	(*)	TIPO LEVA	X
AA010	(*)	LEVA MASSIMA	X
AA011	(*)	LEVA MINIMA	X
AA012	(*)	BASE CALCOLO LEVA	X

**TABELLA 32:** Comunicazione info quantitative Certificates, CW, ETC e ETN (sez. 4)

ID	DATO 129	DESCRIZIONE CAMPO	Comunicazione info quantitative (sezione 4)
<b>INFORMAZIONI QUANTITATIVE SEZIONE 4</b>			
<b>ISIN</b>			
SF001	(*)	CODICE ISIN	D
SF002		CODICE CFI	D
SF003		DESCRIZIONE	D
SF004		DESCRIZIONE BREVE	D
SF005	(*)	EMITTENTE RESIDENTE	D
SF006	(*)	EMITTENTE NON RESIDENTE	D
AD009	(*)	DATA EMISSIONE	D
CO002	(*)	DATA SCADENZA	D
<b>INFORMAZIONI QUANTITATIVE</b>			
AQ002	(*)	DATA FINE TRIMESTRE DI RIFERIMENTO	O
AQ003	(*)	PREZZO DI NEGOZIAZIONE	O
AQ005	(*)	VALUTA PREZZO DI NEGOZIAZIONE	O
AQ001	(*)	NUMERO DI CERTIFICATI IN CIRCOLAZIONE	O
AQ004	(*)	STATO NEGOZIAZIONE	O
CO018	(*)	CODICE COLLOCATORE RESIDENTE	X
CO019	(*)	CODICE COLLOCATORE NON RESIDENTE	X
CO016	(*)	METODO COLLOCAMENTO - OFFERTA	D
CO020	(*)	FUNZIONE	D

## Numero Operazione di Cartolarizzazione

**TABELLA 33:** Comunicazione inizio attività di cartolarizzazione  
Comunicazione aggiornamento  
Comunicazione chiusura operazione

ID	DESCRIZIONE CAMPO	Comun. inizio attività di cartolarizzazione	Comun. aggiorn.	Comun. chiusura operazione
<b>CARTOLARIZZAZIONE</b>				
<b>NUMERO OPERAZIONE</b>				
AB001	NUMERO OPERAZIONE		D	D
<b>DATI CARTOLARIZZAZIONE</b>				
SF005	EMITTENTE RESIDENTE	O	O	
CA001	DESCRIZIONE CARTOLARIZZAZIONE	O	O	D
CA002	TIPOLOGIA CARTOLARIZZAZIONE	O	O	
CA003	TIPO ATTIVITÀ SOTTOSTANTE LA CARTOLARIZZAZIONE	O	O	
CA004	ESIGIBILITÀ CREDITO CARTOLARIZZATO	O	O	
CA005	REVOLVING	O	O	
CA006	MASTER TRUST	O	O	
CA007	WAREHOUSE	O	O	
CA008	FLAG REPACKAGING	O	O	
CA010	PARTLY PAID	O	O	
CA011	CREDITI PA	O	O	
CA012	INDIRIZZO E-MAIL SVC	X	X	
CA013	DATA CHIUSURA OPERAZIONE			O
CA014	MOTIVO CHIUSURA OPERAZIONE			O
<b>ORIGINATOR</b>				
CA015	CODICE CONTROPARTE CEDENTE	O	O	
CA016	VALUTA ATTIVITÀ CEDUTE	O	O	
CA017	VALORE ATTIVITÀ	O	O	
CA018	DATA CESSIONE	O	O	
CA019	VALORE CESSIONE	O	O	
CA020	INDIRIZZO E-MAIL ORIGINATOR	O	O	
<b>SERVICER</b>				
CA021	CODICE SERVICER	X	X	
CA022	INDIRIZZO E-MAIL SERVICER	X	X	
CA023	DATA INIZIO ATTIVITÀ	X	X	
CA024	DATA FINE ATTIVITÀ	X	X	
<b>REPACKAGING</b>				
CA023	NUMERO OPERAZIONE REPACKAGING	X	X	

## Quotazione

**TABELLA 34:** Quotazione

ID	DESCRIZIONE CAMPO	Quotazione
<b>INFORMAZIONI SULLO STRUMENTO FINANZIARIO</b>		
<b>ISIN</b>		
ME001	TIPO AGGIORNAMENTO	O
ME002	DECORRENZA VARIAZIONE	X
SF001	CODICE ISIN	D
<b>QUOTAZIONE SU MERCATI REGOLAMENTATI</b>		
SF037	STATO QUOTAZIONE	O
SF038	CODICE MERCATO REGOLAMENTATO	O
SF039	MERCATO PRINCIPALE	O

## Descrizione campi

In questo capitolo, per ciascun campo riportato nelle tabelle del capitolo precedente vengono indicate le seguenti informazioni, utili alla compilazione dei messaggi:

- **Codice identificativo** del campo (es. SF005);
- Il simbolo (\*) che indica che il campo è un dato segnaletico ai sensi delle Disposizioni 129 oltre che un'informazione anagrafica per il servizio di codifica;
- **Etichetta** del campo (es. Emittente Residente);
- **Descrizione** del contenuto del campo, quando non autoesplicativo;
- **Modalità di compilazione**;
- **Dominio**, ove applicabile.

Sono inoltre riportati i più rilevanti controlli sulla valorizzazione dei campi che possono impedire la consegna dei messaggi.

## Strumento Finanziario

### SF001 CODICE ISIN

Codice internazionale che identifica univocamente gli strumenti finanziari.

### SF002 CODICE CFI

Codice di classificazione degli strumenti finanziari, ove presente viene valorizzato automaticamente dall'applicazione.

### SF003 DESCRIZIONE

Descrizione dello strumento finanziario generata in automatico dall'applicazione sulla base delle informazioni fornite. Il campo non è modificabile.

### SF004 DESCRIZIONE BREVE

Descrizione sintetica dello strumento finanziario generata in automatico dall'applicazione sulla base delle informazioni fornite. Il campo non è modificabile.

### SF005 (\*) EMITTENTE RESIDENTE

**Codice fiscale** dell'emittente.

#### FEAT

La valorizzazione del campo varia a seconda del ruolo selezionato dal Partner:

- "Emittente": il campo viene valorizzato automaticamente e si richiede di confermarne la valorizzazione selezionando "Y – Conferma Emittente Residente" nell'apposito campo
- "Segnalante" e "Collocatore": effettuare la ricerca del soggetto inserendo il codice fiscale o la denominazione

Per i ruoli "Segnalante" e "Collocatore" FEAT, nel caso in cui il soggetto non sia presente all'interno della base dati, è possibile richiederne il censimento inserendo il codice fiscale, se noto, nel campo "Codice fiscale emittente da censire" o, in caso contrario, inviando un messaggio di "Comunicazione generica" con le informazioni utili al censimento (si veda Riquadro 1 di pag. 56) di cui si è a conoscenza.

#### FE129

La valorizzazione del campo varia a seconda del ruolo selezionato dal Partner:

- "Emittente": il campo viene valorizzato automaticamente e si richiede di confermarne la valorizzazione selezionando "Y – Conferma Emittente Residente" nell'apposito campo
- "Capogruppo" e "Collocatore": il ruolo non permette di gestire strumenti emessi da soggetti residenti

### SF006 (\*) EMITTENTE NON RESIDENTE

**Codice soggetto** dell'emittente attribuito dalla Banca d'Italia.

#### FEAT

La valorizzazione del campo varia a seconda del ruolo selezionato dal Partner:

- "Emittente": il campo viene valorizzato automaticamente
- "Segnalante" e "Collocatore": effettuare la ricerca del soggetto inserendo il codice soggetto o la denominazione

Per i ruoli "Segnalante" e "Collocatore" FEAT, nel caso in cui il soggetto non sia presente all'interno della base dati è possibile richiederne il censimento inviando un messaggio di "Comunicazione generica" con le informazioni utili al censimento (si veda Riquadro 1 di pag. 56) di cui si è a conoscenza.

#### FE129

La valorizzazione del campo varia a seconda del ruolo selezionato dal Partner:

- "Emittente": il campo viene valorizzato automaticamente
- "Capogruppo": effettuare la ricerca del soggetto facente parte del gruppo inserendo il codice soggetto o la denominazione, tenendo presente che la composizione del gruppo è quella risultante all'interno

dell'albo dei gruppi GIAVA; nel caso in cui il soggetto non sia disponibile contattare la Divisione di Vigilanza competente

- "Collocatore": effettuare la ricerca del soggetto inserendo il codice soggetto o la denominazione; nel caso in cui il soggetto non sia presente all'interno della base dati disponibile è possibile richiederne il censimento inviando una email alla casella [titoli.estero@bancaditalia.it](mailto:titoli.estero@bancaditalia.it).

#### **SF007 (\*) SAE EMITTENTE**

Settore di Attività Economica (SAE).

I campi SF007, SF010, SF035 e SF038 vengono automaticamente valorizzati poiché già comunicati al momento del censimento del soggetto. Per richiedere la rettifica del SAE inviare un messaggio di "Comunicazione generica".

#### **SF008 (\*) CAPOGRUPPO EMITTENTE RESIDENTE**

**Codice fiscale** del capogruppo dell'emittente secondo la definizione delle "Disposizioni 129". Se l'emittente è controllato o soggetto a "direzione e coordinamento" da parte di un altro soggetto, si intende il codice identificativo della persona giuridica al vertice della catena del controllo. Per i soggetti diversi dai soggetti vigilati capogruppo fare eventualmente riferimento alle relazioni di controllo di cui all'art. 2 della direttiva 2013/34/UE.

La valorizzazione del campo varia a seconda del ruolo selezionato dal Partner:

- "Emittente":
  - se il Partner appartiene ad un gruppo bancario residente il campo viene valorizzato automaticamente ed è modificabile
  - negli altri casi il campo viene valorizzato automaticamente, se disponibile, altrimenti occorre effettuare la ricerca del soggetto inserendo il codice fiscale, la denominazione o il Settore di Attività Economica
- "Capogruppo": il campo viene valorizzato automaticamente
- "Collocatore": effettuare la ricerca del soggetto inserendo il codice fiscale, la denominazione o il Settore di Attività Economica

Nel caso in cui il soggetto non sia presente all'interno della base dati disponibile è possibile effettuare il censimento tramite la funzione "Attiva Censimento" (si veda Riquadro 1 a pag. 56).

#### **SF009 (\*) CAPOGRUPPO EMITTENTE NON RESIDENTE**

**Codice soggetto** del capogruppo dell'emittente secondo la definizione delle "Disposizioni 129", viene attribuito dalla Banca d'Italia. Se l'emittente è controllato o soggetto a "direzione e coordinamento" da parte di un altro soggetto, si intende il codice identificativo della persona giuridica al vertice della catena del controllo. Per i soggetti diversi dai soggetti vigilati capogruppo fare eventualmente riferimento alle relazioni di controllo di cui all'art. 2 della direttiva 2013/34/UE.

Per valorizzare il campo effettuare la ricerca del soggetto inserendo il codice soggetto, la denominazione, il Settore di Attività Economica o il paese di residenza.

Nel caso in cui il soggetto non sia presente all'interno della base dati disponibile è possibile effettuare il censimento tramite la funzione "Attiva Censimento" (si veda Riquadro 1 a pag. 56).

#### **SF010 (\*) SAE CAPOGRUPPO EMITTENTE**

Si veda il campo SF007.

**FUNZIONE “ATTIVA CENSIMENTO”**

Qualora la ricerca di un soggetto non dia risultati è possibile richiederne il censimento attivando la funzione “Attiva Censimento”.

Cliccando sul pulsante “**Attiva censimento**” nel menù di sinistra verrà aggiunta una nuova scheda, all’interno della quale saranno presenti i seguenti attributi da compilare per censire il soggetto:

- DENOMINAZIONE
- PAESE  
Indicare lo stato in cui ha sede legale il soggetto da censire
- SETTORE DI ATTIVITÀ ECONOMICA (SAE)  
Indicare il “Settore di Attività Economica” al quale appartiene il soggetto per il quale si sta richiedendo il censimento. Per maggiori informazioni si rinvia alla Circolare 140 *Istruzioni relative alla classificazione della clientela*
- NATURA GIURIDICA  
Indicare la natura giuridica del soggetto da censire. Per i soggetti non residenti indicare la natura giuridica: 13 – Società di diritto estero

Se soggetto residente:

- CODICE FISCALE
- COMUNE SEDE LEGALE

Se soggetto non residente:

- LOCALITÀ ESTERA  
Indicare la località estera in cui ha sede legale il soggetto da censire.

**SF011 LEAD MANAGER B&D - RESP. REGOLAMENTO RESIDENTE**

**Codice fiscale** del soggetto Lead Manager B&D o Responsabile del regolamento nei confronti dell’emittente.

**FEAT**

Il campo è obbligatorio se il campo CO016 “Metodo Collocamento - Offerta” è uguale a “2 - Sindacato con Lead manager noto”. Effettuare la ricerca del soggetto inserendo il codice fiscale, la denominazione o il Settore di Attività Economica.

**FE129**

La valorizzazione del campo varia a seconda del ruolo selezionato dal Partner:

- “Emittente” e “Capogruppo”: il campo è obbligatorio se il campo CO016 “Metodo Collocamento - Offerta” è uguale a 2, 3, 5 o 6 vale a dire in caso di collocamento sindacato, con uno/più collocatori in Italia, in presenza di Pot System o in sua assenza a patto che il lead manager o responsabile del regolamento sia un soggetto identificato. Effettuare la ricerca del soggetto inserendo il codice fiscale, la denominazione o il Settore di Attività Economica.
- “Collocatore”: il campo è obbligatorio se il campo CO016 “Metodo Collocamento - Offerta” è uguale a 2, 3, 5 o 6 e viene valorizzato automaticamente dall’applicazione quando il soggetto segnalante è il lead manager o responsabile del regolamento.

Sia in FEAT, che in FE129, nel caso in cui il soggetto non sia presente all’interno della base dati disponibile è possibile effettuare il censimento tramite la funzione “Attiva Censimento” (si veda Riquadro 1 a pag. 56).

**Quando il campo viene valorizzato nella scheda “Informazioni sullo strumento finanziario”, la sua valorizzazione verrà riportata in automatico anche nella Sezione “Collocatori” della scheda “Informazioni sul collocamento” con la relativa Funzione (si veda campo CO020). Per cancellare o modificare, è necessario intervenire su entrambe le schede.**

**SF012 LEAD MANAGER B&D - RESP. REGOLAMENTO NON RESIDENTE**

**Codice soggetto** del Lead Manager B&D o Responsabile del regolamento nei confronti dell’emittente.

**FEAT**

Il campo è obbligatorio se il campo CO016 “Metodo Collocamento - Offerta” è uguale a “2 - Sindacato con Lead manager noto”. Effettuare la ricerca del soggetto inserendo il codice soggetto, la denominazione, il Settore di Attività Economica o il paese di residenza.

## FE129

La valorizzazione del campo varia a seconda del ruolo selezionato dal Partner:

- "Emittente" e "Capogruppo": il campo è obbligatorio se il campo CO016 "Metodo Collocamento - Offerta" è uguale a 2, 3, 5 o 6 vale a dire in caso di collocamento sindacato, con uno/più collocatori in Italia, in presenza di Pot System o in sua assenza a patto che il lead manager o responsabile del regolamento sia un soggetto identificato. **Il campo deve essere valorizzato con il codice censito attribuito dalla Banca d'Italia al soggetto.** Effettuare la ricerca del soggetto inserendo il codice soggetto, la denominazione, il Settore di Attività Economica o il paese di residenza.
- "Collocatore": il campo è obbligatorio se il campo CO016 "Metodo Collocamento - Offerta" è uguale a 2, 3, 5 o 6 e viene valorizzato automaticamente dall'applicazione quando il soggetto segnalante è il lead manager o responsabile del regolamento.

Sia in FEAT, che in FE129, nel caso in cui il soggetto non sia presente all'interno della base dati disponibile è possibile effettuare il censimento tramite la funzione "Attiva Censimento" (si veda Riquadro 1 a pag. 56).

**Quando il campo viene valorizzato nella scheda "Informazioni sullo strumento finanziario", la sua valorizzazione verrà riportata in automatico anche nella Sezione "Collocatori" della scheda "Informazioni sul collocamento" con la relativa Funzione (si veda campo CO020). Per cancellare o modificare, è necessario intervenire su entrambe le schede.**

## SF013 (\*) TIPOLOGIA STRUMENTO FINANZIARIO

Il dominio del campo varia a seconda della classe di strumento finanziario selezionato.

### TITOLI DI DEBITO

Assume i valori:

- O OBBLIGAZIONI
- OC OBBLIGAZIONI CONVERTIBILI
- OW OBBLIGAZIONI CUM WARRANT
- SP OBBLIGAZIONI STRUTTURATE CON PROTEZIONE DEL CAPITALE
- SNP ALTRE OBBLIGAZIONI STRUTTURATE A CAPITALE NON PROTETTO
- CD CERTIFICATI DI DEPOSITO
- CLN CREDIT LINKED NOTES
- CP COMMERCIAL PAPER E POLIZZE DI CREDITO COMMERCIALE
- CB COVERED BOND
- AT1 TITOLI ADDITIONAL TIER 1
- T2 TITOLI TIER 2
- TS ALTRI TITOLI SUBORDINATI
- SFP STRUMENTI FINANZIARI DI PARTECIPAZIONE
- CF CAMBIALI FINANZIARIE
- RVC REVERSE CONVERTIBLE
- ALT ALTRI TITOLI DI DEBITO

### O OBBLIGAZIONI

Titoli di debito con le caratteristiche di cui all'art. 2414 c.c., emessi per la raccolta di risparmio a medio e lungo termine.

Sono tipicamente "titoli di massa" cioè rappresentativi di una singola emissione quali frazioni uguali di un prestito unitario, fungibili tra loro. Possono essere offerti in tranches e il relativo periodo di collocamento può essere anche protratto nel tempo. Vengono rimborsati a scadenza ovvero secondo un piano di ammortamento. Possono contenere o meno una componente derivativa.

**OC OBBLIGAZIONI CONVERTIBILI** Titoli obbligazionari che attribuiscono unicamente al possessore il diritto di convertirli, nei termini e secondo le modalità prefissate, in azioni della società emittente o di altre società. Sono compresi in questa tipologia anche i titoli di debito scambiabili con altre obbligazioni.

### OW OBBLIGAZIONI CUM WARRANT

Titoli obbligazionari che incorporano un diritto (warrant) a sottoscrivere azioni oppure obbligazioni della società emittente o di altra società a un prezzo predeterminato. Il warrant può essere staccato dall'obbligazione e circolare autonomamente.



**SP OBBLIGAZIONI STRUTTURATE CON PROTEZIONE DEL CAPITALE**

Prodotti strutturati con caratteristiche simili agli investment certificate a capitale protetto, ma emessi sotto forma di notes.

**SNP ALTRE OBBLIGAZIONI STRUTTURATE A CAPITALE NON PROTETTO**

Prodotti strutturati diversi da credit linked notes, con caratteristiche simili agli investment certificate senza protezione del capitale, ma emessi sotto forma di notes.

**CD CERTIFICATI DI DEPOSITO**

Titoli di debito emessi dalle banche per la raccolta di risparmio a breve e medio termine<sup>12</sup>.

Sono **soggetti agli obblighi di segnalazione 129** i certificati di deposito emessi come titoli di massa - ossia come frazioni con caratteristiche tra loro identiche (criterio di fungibilità) di un'operazione unica di raccolta presso il pubblico – con possibilità di negoziazione sui mercati finanziari.

Sono invece **esentati dagli obblighi di segnalazione 129** i certificati di deposito quando si configurano come "titoli individuali" e non negoziabili in quanto ogni titolo, rappresentando una specifica operazione di prestito, può essere emesso su richiesta del singolo cliente delle cui specifiche esigenze può quindi tener conto; sono emessi generalmente "a flusso continuo" (Circolare n. 229, Titolo V, Cap. 3).

**CLN CREDIT LINKED NOTES**

Titoli obbligazionari in cui il pagamento della cedola e/o il rimborso del capitale è condizionato al verificarsi di un determinato evento di credito.

**CP COMMERCIAL PAPER E POLIZZE DI CREDITO COMMERCIALE**

Titoli di debito a breve termine emessi da imprese. I commercial paper sono strumenti negoziati sui mercati simili alle cambiali finanziarie che circolano sul mercato italiano.

**CB COVERED BOND**

Obbligazioni bancarie garantite da attività di elevata qualità creditizia appositamente segregate e destinate, in caso di insolvenza dell'emittente, al rimborso degli obbligazionisti. Per maggiori informazioni sulla disciplina italiana delle obbligazioni bancarie garantite fare riferimento alla Legge n.130 del 30 aprile 1999 (art. 7-bis).

**AT1 TITOLI ADDITIONAL TIER 1**

Titoli di debito computabili nel capitale aggiuntivo di classe 1, così come definiti nel Regolamento (EU) n. 575/2013.

**T2 TITOLI TIER 2**

Titoli di debito computabili nel capitale di classe 2, così come definiti nel Regolamento (EU) n. 575/2013.

**TS ALTRI TITOLI SUBORDINATI**

Altri titoli di debito subordinati non ricompresi nei titoli Additional Tier 1 e Tier 2.

**SFP STRUMENTI FINANZIARI DI PARTECIPAZIONE**

Titoli di debito emessi in base all'art. 2346 c.c. ultimo comma, che presentano diritti amministrativi oltre che patrimoniali. Qualora il regolamento di emissione preveda l'obbligo di restituzione del capitale versato ad una certa data il titolo dovrà essere classificato come debito, in caso contrario come capitale.

**CF CAMBIALI FINANZIARIE**

Titolo di debito di durata da 1 a 36 mesi. Per maggiori informazioni sulla disciplina italiana delle cambiali finanziarie fare riferimento alla Legge n.134 del 13 gennaio 1991 e s.m.i.

**RVC REVERSE CONVERTIBLE**

Titoli obbligazionari caratterizzati dalla presenza di un'opzione put implicita, esercitabile alla scadenza dall'emittente nei confronti del sottoscrittore, su una quantità predefinita di un'attività sottostante ad un prezzo prestabilito.

**ALT ALTRI TITOLI DI DEBITO**

Strumenti di raccolta che comportano l'emissione di titoli di debito diversi dai precedenti.

**CARTOLARIZZAZIONI**

<sup>12</sup> Secondo lo standard ISO 6166 (ISIN) è possibile assegnare il codice ISIN solo agli strumenti finanziari "negoziabili". Sono pertanto esclusi i certificati di deposito emessi come "titoli individuali".

Assume i valori:

- ABS CARTOLARIZZAZIONI
- CDO COLLATERALIZED DEBT OBLIGATIONS

### **ABS CARTOLARIZZAZIONI**

Titoli obbligazionari emessi da una società veicolo nel corso di un'operazione di cartolarizzazione di attività finanziarie o reali. Per maggiori informazioni sulla disciplina italiana delle cartolarizzazioni fare riferimento alla Legge n.130 del 30 aprile 1999 e s.m.i.

### **CDO COLLATERALIZED DEBT OBLIGATIONS**

Titoli obbligazionari emessi da una società veicolo nel corso di un'operazione di cartolarizzazione di un portafoglio di titoli di debito, crediti o derivati. Per maggiori informazioni sulla disciplina italiana delle cartolarizzazioni fare riferimento alla Legge n.130 del 30 aprile 1999 e s.m.i.

### **INVESTMENT CERTIFICATES**

Assume i valori:

- CRT CERTIFICATES

### **CRT INVESTMENT CERTIFICATES**

Titoli di debito derivati cartolarizzati rappresentativi di una combinazione di opzioni su di un medesimo sottostante, che permettono di ottenere strategie di investimento sia semplici che molto complesse, cui sono associati profili di rischio/rendimento differenti.

### **TITOLI DI CAPITALE**

Assume il valore non modificabile:

- E EQUITIES

### **DIRITTI**

Assume il valore non modificabile:

- DIR DIRITTI

### **WARRANT**

Assume il valore non modificabile:

- W WARRANT

### **COVERED WARRANT, LEVERAGE CERTIFICATES, ETC, ETN**

Assume i valori:

- CW COVERED WARRANT
- CRT LEVERAGE CERTIFICATES
- ETC EXCHANGE TRADED COMMODITIES
- ETN EXCHANGE TRADED NOTES

### **CW COVERED WARRANT**

Strumenti finanziari derivati che incorporano il diritto di acquistare o vendere una quantità predefinita (multiplo) di un sottostante ad un prezzo predeterminato, entro un periodo di tempo o ad una data di scadenza prefissati. Se il campo SF013 viene valorizzato con CW il campo AD002 "EUSIPA" dovrà essere obbligatoriamente valorizzato.

### **CRT LEVERAGE CERTIFICATES**

Certificates che sfruttano la leva finanziaria al fine di replicare in maniera più che proporzionale la performance del sottostante. Se il campo SF013 viene valorizzato con CERT il campo AD002 "EUSIPA" dovrà essere obbligatoriamente valorizzato.

### **ETC EXCHANGE TRADED COMMODITIES**

Titoli di debito senza scadenza, emessi da una società veicolo a fronte dell'investimento diretto da parte della stessa in materie prime o in contratti derivati su materie prime. Se il campo SF013 viene valorizzato con ETC, al momento del salvataggio dei dati il campo "Tipologia Facoltà" viene automaticamente valorizzato con X.

### **ETN EXCHANGE TRADED NOTES**

Titoli di debito senza scadenza, emessi da una società veicolo a fronte dell'investimento diretto da parte della stessa in contratti derivati su asset diversi dalle materie prime come, ad esempio, indici di valute, indici azionari

o obbligazionari. Se il campo SF013 viene valorizzato con ETN, al momento del salvataggio dei dati il campo "Tipologia Facoltà" viene automaticamente valorizzato con X.

#### **SF014 COMPARTO**

Classificazione degli strumenti finanziari interna della Banca d'Italia. Il campo viene automaticamente valorizzato in base alle caratteristiche del titolo fornite.

#### **SF015 FORMA DEL TITOLO**

Assume i valori:

- B PORTATORE
- R NOMINATIVO
- M ALTRO
- X NON APPLICABILE

Per i titoli emessi da soggetti residenti non utilizzare il valore X.

#### **SF016 (\*) PRESENZA COMPONENTE DERIVATIVA**

Indicare l'eventuale presenza di almeno una componente derivativa che qualifica il titolo come uno strumento finanziario strutturato; sono da considerare tali anche gli strumenti a leva rialzista o ribassista. Sono esclusi i titoli rivenienti da operazioni di cartolarizzazione del rischio di credito e i covered warrant "plain vanilla", nonché gli strumenti finanziari in cui la componente derivativa è la mera facoltà di rimborso anticipato.

Assume i valori:

- 0 NON PRESENTE
- 1 PRESENTE

Se uguale ad 1, al momento dell'invio del messaggio "Comunicazione informazioni anagrafiche 129 (sezione 2-3)" dovranno essere obbligatoriamente compilati i campi di Sezione 3 (da AA006 a AA012).

#### **SF017 (\*) TITOLO CUM WARRANT**

Assume i valori:

- 0 NO WARRANT
- 1 CUM WARRANT

L'attributo deve essere valorizzato con "1" solo se Tipologia Strumento Finanziario è "OW – Obbligazioni Cum Warrant" o "OC – Obbligazioni Convertibili"

Le obbligazioni cum warrant prevedono l'attribuzione di tre codici ISIN:

- un codice attribuito all'obbligazione cum warrant
- un codice attribuito all'obbligazione ex warrant
- un codice attribuito al warrant

All'atto della richiesta del codice ISIN per l'obbligazione cum warrant viene attribuito anche il codice ISIN relativo all'obbligazione ex warrant. Oltre alla richiesta per l'obbligazione cum warrant il Partner dovrà inoltrare un messaggio di richiesta ISIN per il warrant.

**Convenzionalmente l'importo collocato totale deve essere attribuito all'obbligazione "ex warrant".** Pertanto, quando l'emittente o il collocatore comunicherà alla fine del collocamento l'importo collocato, dovrà nel messaggio "Comunicazione collocato" fare riferimento al codice ISIN del titolo di debito classificato come ex warrant.

#### **SF018 (\*) TITOLO CONVERTIBILE**

Indicare se l'obbligazione incorpora l'opzione di conversione o di scambiabilità.

Le **obbligazioni convertibili** consentono al debitore di decidere se rimanere creditore della società emittente per tutta la durata del prestito, oppure se, in determinati periodi, convertire il proprio status da creditore a socio (azionista) sulla base di un rapporto di cambio

Le **obbligazioni scambiabili** consentono al debitore di sostituire, a una data determinata o dopo uno o più periodi, gli originari titoli con altri di pari valore nominale, ma con caratteristiche diverse (quali ad esempio scadenza, cedole) sulla base di un rapporto predeterminato, definito rapporto di concambio.

Assume i valori:

- 0 NON CONVERTIBILE
- 1 CONVERTIBILE IN TITOLI DI CAPITALE
- 2 SCAMBIABILE CON TITOLI DI DEBITO

L'attributo deve essere valorizzato con "1" o "2" solo se Tipologia Strumento Finanziario è "OC – Obbligazioni Convertibili" o "OW – Obbligazioni Cum Warrant".

Quando l'attributo è valorizzato con "1" o "2" è obbligatorio selezionare il Tipo Opzione "07 – OPZIONE DI CONVERSIONE/SCAMBIO" ed indicare il Titolo Offerto in Cambio nella scheda "Altre Opzioni".

#### **SF019(\*) TITOLO CREDIT LINKED**

Indicare se il pagamento degli interessi e/o del capitale risulta, in tutto o in parte, condizionato al verificarsi o meno di uno o più eventi economici connessi con la solvibilità di un soggetto diverso da quello emittente i titoli.

Assume i valori:

- 0 NO CREDIT LINKED
- 1 CEDOLA
- 2 CAPITALE
- 3 CAPITALE E CEDOLA

L'attributo deve essere valorizzato con "1", "2" o "3" solo se Tipologia Strumento Finanziario è "CLN – Credit Linked Notes".

#### **SF020 (\*) TITOLO SUBORDINATO**

Indicare se il rimborso del capitale, in caso di procedura fallimentare, avverrà solo dopo aver soddisfatto tutti i creditori privilegiati e chirografari.

Assume i valori:

- 0 NON SUBORDINATO
- 1 SUBORDINATO

L'attributo deve essere valorizzato con "1" solo se Tipologia Strumento Finanziario è "TS - Titoli subordinati", "T2 - TIER 2" o "AT1 - Titoli additional TIER 1".

#### **SF021 (\*) TIPO OBBLIGAZIONE**

Indicare la presenza di ulteriori caratteristiche dello strumento utili alla sua classificazione. Il dominio del campo varia a seconda della classe di strumento finanziario selezionato.

#### **TITOLI DI DEBITO**

Assume i valori:

- X NON APPLICABILE
- 1 OBBLIGAZIONE CON REGOLAMENTO PARTLY PAID
- 3 OBBLIGAZIONE ETICA
- 4 OBBLIGAZIONE ISLAMICA
- 6 DETACHABLE COUPON
- 8 N NOTES
- 9 X NOTES
- A CACs (CLAUSOLE DI AZIONE COLLETTIVA)
- G OBBLIGAZIONE GARANTITA DALLO STATO EX L. 214/2011
- L OBBLIGAZIONE EMESSA EX L. 77/2020 (c.d. "Decreto Rilancio")
- M NUOVI STRUMENTI FINANZIARI EX L. 135/2012 (c.d. "Monti Bond")
- P PROJECT BOND
- R REVERSE INQUIRY
- T TITOLI DI RISPARMIO PER L'ECONOMIA MERIDIONALE EX L. 106/2011

## **CARTOLARIZZAZIONI**

Assume i valori:

- X NON APPLICABILE
- 1 OBBLIGAZIONE CON REGOLAMENTO PARTLY PAID

### **X NON APPLICABILE**

Da inserire qualora l'emissione per la quale si sta richiedendo il codice ISIN non appartenga a nessuna tipologia fra quelle di seguito previste.

### **1 OBBLIGAZIONE CON REGOLAMENTO PARTLY PAID**

Obbligazioni per le quali al momento della prima erogazione viene accreditata all'emittente solo una quota parte dell'operazione, con facoltà per l'emittente di richiedere di volta in volta al sottoscrittore ulteriori erogazioni entro un periodo di utilizzo prestabilito fino ad un importo massimo predefinito. Il calcolo degli interessi viene effettuato esclusivamente sull'importo effettivamente regolato.

### **3 OBBLIGAZIONE ETICA**

Obbligazioni che devolvono una parte del tasso di interesse che spetta all'obbligazionista ad iniziative di solidarietà, ovvero investono il patrimonio raccolto secondo criteri di responsabilità sociale ed ambientale.

### **4 OBBLIGAZIONE ISLAMICA**

I Sukuk sono certificati di investimento conformi alla Sharia, la legge islamica.

### **6 DETACHABLE COUPON**

Titoli di debito rappresentativi di un flusso cedolare di interessi calcolati sulla base di un valore nominale predefinito.

### **8 N NOTES**

Si veda "X NOTES".

### **9 X NOTES**

N e X Notes sono obbligazioni rappresentative di un'unica emissione, cui sono assegnati due differenti codici ISIN per fini operativi (nettisti e lordisti).

### **A CACs (CLAUSOLE DI AZIONE COLLETTIVA)**

Titoli di Stato cui si applica la Clausola di Azione Collettiva introdotta in Italia dal Decreto del Ministero dell'Economia e delle Finanze n. 96717 del 7 dicembre 2012.

### **G OBBLIGAZIONE GARANTITA DALLO STATO EX L. 214/2011**

### **L OBBLIGAZIONE EMESSA EX L. 77/2020 (c.d. "Decreto Rilancio")**

### **M NUOVI STRUMENTI FINANZIARI EX L. 135/2012 (c.d. "Monti Bond")**

### **P PROJECT BOND**

Obbligazioni emesse da una "società di progetto" allo scopo di finanziare uno specifico progetto (in genere legato alla realizzazione di opere infrastrutturali o a servizi di pubblica utilità), i cui flussi di rimborso dipendono dai flussi finanziari che il progetto sarà in grado di assicurare.

### **R REVERSE INQUIRY**

Operazioni di emissione di strumenti finanziari, effettuate su richiesta di uno o più sottoscrittori, nelle quali è esclusa la successiva negoziabilità dei titoli. Il regolamento delle operazioni deve prevedere che il sottoscrittore possa a sua volta cedere gli strumenti finanziari unicamente all'emittente medesimo o a un soggetto predefinito, il quale manterrà i titoli nel proprio portafoglio fino a scadenza ovvero procederà all'annullamento degli stessi.

### **T TITOLI DI RISPARMIO PER L'ECONOMIA MERIDIONALE EX L. 106/2011**

<b>SF022 NOME COMMERCIALE</b>
-------------------------------

Campo facoltativo da utilizzare esclusivamente per aggiungere, alla descrizione dello strumento finanziario, l'eventuale nome di mercato che ne possa agevolare l'identificazione.

Si ricorda che l'applicazione genera sempre in automatico la descrizione dello strumento finanziario, con le principali caratteristiche, quali ad esempio, per i titoli di debito: codice emittente, data inizio godimento e scadenza, tipo tasso.

#### **SF023 TIPO DOCUMENTAZIONE**

Nel messaggio "Richiesta ISIN" assume il valore di default, non modificabile:

- 1 DOCUMENTAZIONE PROVVISORIA

Nel messaggio "Comunicazione dati definitivi" assume il valore di default, non modificabile:

- 2 DOCUMENTAZIONE DEFINITIVA

Si precisa che la documentazione è richiesta solo per finalità di codifica. Nelle Disposizioni 129 non è richiesta alcuna documentazione.

#### **SF041 NUMERO PROGRAMMA COVERED BOND**

Campo indicante il numero di programma secondo il quale è stato emesso un CB – covered bond (vedasi campo SF013), obbligatorio per emittenti residenti che emettono un covered bond sotto programma, come da disposizioni della "Circolare 285 di Banca d'Italia" aggiornamento 42 del 30 marzo 2023. Il numero di un programma approvato è disponibile nel report "Lista dei programmi di obbligazioni garantite europee autorizzati" dell'inquiry GIAVA (<https://infostat.bancaditalia.it/GIAVAInquiry-public/ng/>).

Negli altri casi il campo è da lasciare vuoto.

## **Garanzie**

#### **SF024 TIPO GARANZIA**

Indicare se il titolo è garantito e, nel caso, il tipo di garanzia presente.

Assume i valori

- 0 NON GARANTITO
- 1 STATO
- 2 FONDO DI GARANZIA DEGLI OBBLIGAZIONISTI - BCC
- 4 SOGGETTI DIVERSI DALL'EMITTENTE, DALLO STATO E DA ORG. INTERNAZIONALI
- 5 SPECIFICHE ATTIVITÀ
- 6 PREVISTA GARANZIA FONDO DEGLI OBBLIGAZIONISTI – BCC
- 7 ORGANISMI INTERNAZIONALI

#### **0 NON GARANTITO**

Titolo privo di garanzie.

#### **1 STATO**

Titolo emesso dallo Stato o da enti pubblici il cui rimborso è assistito da garanzia statale.

#### **2 FONDO DI GARANZIA DEGLI OBBLIGAZIONISTI - BCC**

Il valore 2 non può essere selezionato dal Partner, poichè viene comunicato direttamente alla Banca d'Italia dal Fondo di Garanzia degli Obbligazionisti all'atto della concessione della garanzia.

#### **4 SOGGETTI DIVERSI DALL'EMITTENTE, DALLO STATO E DA ORG. INTERNAZIONALI**

La garanzia di tipo 4 si applica ai titoli non ricompresi nei punti precedenti.

#### **5 SPECIFICHE ATTIVITÀ**

La garanzia di tipo 5 si applica a titoli di debito (ad es. Covered Bond) che vincolano una parte dell'attivo patrimoniale destinandolo esclusivamente alla remunerazione ed al rimborso dell'emissione.

Per i Covered Bond (Obbligazioni Bancarie Garantite) è obbligatorio inserire il valore 5 ed indicare nel campo "Garante Residente" o "Garante Non Residente" il codice identificativo del soggetto al quale sono state trasferite le attività poste a garanzia dell'emissione.

#### **6 PREVISTA GARANZIA FONDO DEGLI OBBLIGAZIONISTI - BCC**

Il valore 6 deve essere impostato per i titoli di debito emessi dalle Banche di Credito Cooperativo per i quali gli emittenti richiedono la garanzia al Fondo di Garanzia degli Obbligazionisti (FGO).

## 7 ORGANISMI INTERNAZIONALI

### SF025 CODICE GARANZIA FONDO BCC

Indica, limitatamente alle obbligazioni emesse da Banche di Credito Cooperative aderenti al Fondo di Garanzia degli Obbligazionisti (FGO), il codice di garanzia che viene attribuito da FGO. Il codice di garanzia viene acquisito dal Fondo, viene visualizzato solo nei messaggi di comunicazione dati definitivi e **non è modificabile**.

### SF026 (\*) GARANTE RESIDENTE

**Codice fiscale** del garante finale.

Effettuare la ricerca del soggetto inserendo il codice fiscale, la denominazione o il Settore di Attività Economica.

Nel caso in cui il soggetto non sia presente all'interno della base dati disponibile è possibile effettuare il censimento tramite la funzione "Attiva Censimento" (si veda Riquadro 1 a pag. 56).

### SF027 (\*) GARANTE NON RESIDENTE

**Codice soggetto** del garante finale attribuito dalla Banca d'Italia.

Effettuare la ricerca del soggetto inserendo il codice soggetto, la denominazione, il Settore di Attività Economica o il paese di residenza.

Nel caso in cui il soggetto non sia presente all'interno della base dati disponibile è possibile effettuare il censimento tramite la funzione "Attiva Censimento" (si veda Riquadro 1 a pag. 56).

### SF028 (\*) SAE GARANTE

Si veda il campo SF007.

### SF029 (\*) CODICE CAPOGRUPPO GARANTE RESIDENTE

**Codice fiscale** del capogruppo del garante finale.

Se il garante è controllato o soggetto a "direzione e coordinamento" da parte di un altro soggetto, si intende il codice identificativo della persona giuridica al vertice della catena del controllo. Per i soggetti diversi dai soggetti vigilati capogruppo fare eventualmente riferimento alle relazioni di controllo di cui all'art. 2 della direttiva 2013/34/UE.

La valorizzazione del campo varia a seconda della tipologia di garante (SF026 e SF027):

- se il garante appartiene ad un gruppo bancario residente il campo viene valorizzato automaticamente al momento del salvataggio ed è modificabile;
- negli altri casi il campo viene valorizzato automaticamente al momento del salvataggio, se disponibile, altrimenti occorre effettuare la ricerca del soggetto inserendo il codice fiscale, la denominazione o il Settore di Attività Economica.

Nel caso in cui il soggetto non sia presente all'interno della base dati disponibile è possibile effettuare il censimento tramite la funzione "Attiva Censimento" (si veda Riquadro 1 a pag. 56).

### SF030 (\*) CODICE CAPOGRUPPO GARANTE NON RESIDENTE

**Codice soggetto** del capogruppo del garante finale attribuito dalla Banca d'Italia.

Se il garante è controllato o soggetto a "direzione e coordinamento" da parte di un altro soggetto, si intende il codice identificativo della persona giuridica al vertice della catena del controllo. Per i soggetti diversi dai soggetti vigilati capogruppo fare eventualmente riferimento alle relazioni di controllo di cui all'art. 2 della direttiva 2013/34/UE.

Effettuare la ricerca del soggetto inserendo il codice soggetto, la denominazione, il Settore di Attività Economica o il paese di residenza.

Nel caso in cui il soggetto non sia presente all'interno della base dati disponibile è possibile effettuare il censimento tramite la funzione "Attiva Censimento" (si veda Riquadro 1 a pag. 56).

<b>SF031 (*) SAE CAPOGRUPPO GARANTE</b>
---

Si veda il campo SF007.



## Restrizioni

### SF032 RESTRIZIONI

Indicare se l'emissione è stata effettuata in accordo con le specifiche regolamentazioni REGS o 144A.

Assume i valori:

- 0 NON ASSOGGETTATO A RESTRIZIONI REGS O 144A
- 1 144A
- 2 REGS

### SF033 RESTRIZIONI ALLA TRASFERIBILITÀ

Indicare se l'emissione prevede o meno restrizioni alla trasferibilità del titolo.

Assume i valori:

- 0 NESSUNA RESTRIZIONE
- 1 TITOLO NON TRASFERIBILE

### SF034 (\*) RESTRIZIONI ALLA VENDITA

Indicare se l'emissione prevede o meno restrizioni alla vendita sul mercato primario o secondario.

Assume i valori:

- P RESTRIZIONI ALLA VENDITA SOLO SUL MERCATO PRIMARIO
- S RESTRIZIONI ALLA VENDITA ESTESE AL MERCATO SECONDARIO
- N NESSUNA RESTRIZIONE ALLA VENDITA

## Regime Fiscale

### SF035 TRATTAMENTO FISCALE

Indicare se il titolo è soggetto a tassazione.

Assume i valori:

- E ESENTE
- T TASSATO

### SF036 ASSOGGETTAMENTO AL DLGS 239-96

Se il titolo è soggetto a tassazione, indicare se è sottoposto al regime previsto dal Decreto Legislativo n. 239 del 1 aprile 1996 e s.m.i.

Assume i valori:

- 0 NO
- 1 SI

## Quotazione su Mercati Regolamentati e MFT

### SF037 STATO QUOTAZIONE

Indicare lo stato di quotazione dello strumento finanziario.

Assume i valori:

- 1 PREVISTA QUOTAZIONE
- 2 IN ATTESA DI QUOTAZIONE
- 3 QUOTATO

Selezionare “1” se il prospetto di emissione prevede l’ammissione a quotazione presso un mercato regolamentato, ma al momento della comunicazione il titolo non è ancora stato ammesso a quotazione, “2” se suddetta ammissione è stata ottenuta ed il titolo risulta in attesa di essere quotato e “3” se il titolo risulta quotato.

### SF038 (\*) CODICE MERCATO REGOLAMENTATO

Indicare il mercato regolamentato di quotazione dello strumento finanziario secondo la codifica MIC. Se quotato su più mercati esteri, indicare il più significativo. Il mercato più significativo è individuato tenendo conto ad esempio del numero di transazioni, dei volumi scambiati, della liquidità del mercato anche in termini di spread bid-ask.

Effettuare la ricerca del mercato inserendo il codice mercato, il codice MIC, la descrizione, il paese o la città. Qualora il mercato non risultasse presente in Anagrafe, inviare messaggio di “Comunicazione generica” per richiederne l’inserimento.

### SF039 MERCATO PRINCIPALE

Si intende per mercato principale:

- se il titolo è quotato su un solo mercato, il mercato regolamentato di quotazione;
- se su più mercati, di cui uno è un mercato regolamentato italiano, quello italiano;
- se su più mercati esteri, quello che verrà individuato come principale dal richiedente (si veda SF038).

Assume i valori:

- 0 MERCATO NON PRINCIPALE
- 1 MERCATO PRINCIPALE

Utilizzando i messaggi di **richiesta/censimento ISIN** è possibile inserire un solo mercato, il quale di default viene classificato come “mercato principale” al momento del salvataggio.

### SF040 (\*) CODICE MTF

Indicare il codice MIC dei sistemi multilaterali di negoziazione (MTF) dove è prevista la negoziazione dello strumento alla sua emissione. Se il titolo è negoziato in Italia, indicare tutte le MTF; se è negoziato su MTF estere, indicare la più significativa. L’MTF più significativo è individuato tenendo conto ad esempio del numero di transazioni, dei volumi scambiati, della liquidità del mercato anche in termini di spread bid-ask.

Effettuare la ricerca del mercato inserendo il codice mercato, il codice MIC, la descrizione, il paese o la città.

**Al momento dell’invio di messaggi di richiesta e censimento ISIN è possibile inserire:**

- un solo mercato regolamentato di quotazione, di norma quello principale
- tutte le MTF italiane e la MTF estera più significativa.

**Per inserire ulteriori mercati regolamentati di quotazione utilizzare l’apposito messaggio di “Comunicazione quotazione”.**

## Collocamento

### CO001 (\*) DATA INIZIO GODIMENTO

Per i titoli di debito di nuova emissione indicare il giorno dal quale si inizia a calcolare il rateo d'interesse. In tutti gli altri casi si intende la data di emissione.

### CO002 (\*) DATA SCADENZA

Per i **titoli di debito**:

- Giorno (“maturity date”) in cui l'emittente è obbligato a rimborsare il capitale e l'eventuale ultima cedola d'interessi.

Per i **warrant**:

- Ultimo giorno in cui il warrant può essere esercitato. Coincide con la massima data di esercizio.

Per gli altri titoli indicare la data di scadenza.

### CO003 (\*) VALUTA

Indicare il codice ISO della valuta in cui è denominato lo strumento finanziario.

### CO004 (\*) PREZZO RIMBORSO

Il campo deve essere valorizzato solo per i titoli diversi da covered warrant e leverage certificates, certificates, ETC ed ETN. Indicare il **valore nominale** garantito alla data di rimborso in valore percentuale su base 100. Nel caso di titoli rivenienti da operazioni di cartolarizzazione, si intende il valore contrattuale di rimborso, a prescindere dalla natura di “ricorso limitato” dei titoli.

### CO005 VALORE NOMINALE UNITARIO

Per i **titoli di capitale**:

- Frazione di capitale sociale rappresentata da un'azione. La valorizzazione del campo è obbligatoria se il campo TC011 “Assenza Valore Nominale Unitario” è uguale a “0”.

Per gli **altri strumenti**:

- Valore nominale del singolo strumento espresso in unità.

### CO006 TAGLIO MINIMO SOTTOSCRIZIONE

Indicare il valore nominale del numero minimo di strumenti sottoscrivibili all'emissione.

## Tranche di Collocamento

**CO007 NUMERO SERIE**

Indicare a quale linea di emissione appartiene lo strumento finanziario. Una linea di emissione è caratterizzata da caratteristiche di rendimento e/o opzionali simili e viene indicata da un numero e/o lettera progressiva.

**CO008 NUMERO TRANCHE****CO009 DATA APERTURA COLLOCAMENTO****CO010 DATA CHIUSURA COLLOCAMENTO****CO011 IMPORTO DELIBERATO**

Indicare l'importo massimo deliberato all'emissione.

**CO012 IMPORTO COLLOCATO**

Indicare, alla chiusura del collocamento, l'importo effettivamente collocato.

**CO013 PREZZO EMISSIONE O OFFERTA**

Indicare, in valore percentuale su base 100, il prezzo da corrispondere per sottoscrivere uno strumento finanziario quando questo viene collocato ovvero offerto per la prima volta.

**CO014 DATA REGOLAMENTO**

Indicare la data in cui le operazioni di regolamento dell'operazione finanziaria devono essere soddisfatte da entrambe le parti. La data di regolamento non è la data di scadenza dei titoli.

## Modalita' di Collocamento

### CO015 TIPO COLLOCAMENTO

Assume i valori:

- 1 EMISSIONE CON PROSPETTO BASE (sotto programma)
- 2 EMISSIONE CON PROSPETTO ORDINARIO
- 3 EMISSIONE CON PROSPETTO SEMPLIFICATO
- 4 EMISSIONE RIVOLTA A INVESTITORI QUALIFICATI
- 5 EMISSIONE ESENTE PROSPETTO
- 6 PIAZZAMENTO PRIVATO
- 7 ALTRO
- X NON CONOSCIUTO

Il valore "X" può essere utilizzato solo per i messaggi di censimento ISIN.

### CO016 METODO COLLOCAMENTO - OFFERTA

#### FEAT

Assume i valori:

- 1 NON SINDACATO
- 2 SINDACATO CON LEAD MANAGER NOTO
- 4 SINDACATO CON LEAD MANAGER NON CONOSCIUTO
- X ALTRO O NON CONOSCIUTO

#### FE129

Assume i valori:

- 1 COLLOCAMENTO NON SINDACATO
- 2 COLLOCAMENTO SINDACATO, UNICO COLLOCATORE IN ITALIA, CON POT SYSTEM
- 3 COLLOCAMENTO SINDACATO, UNICO COLLOCATORE IN ITALIA, SENZA POT SYSTEM, CON RESP. REGOLAMENTO
- 4 COLLOCAMENTO SINDACATO, UNICO COLLOCATORE IN ITALIA, SENZA POT SYSTEM, SENZA RESP. REGOLAMENTO
- 5 COLLOCAMENTO SINDACATO, PIÙ DI UN COLLOCATORE IN ITALIA O NUMERO NON CONOSCIUTO, CON POT SYSTEM
- 6 COLLOCAMENTO SINDACATO, PIÙ DI UN COLLOCATORE IN ITALIA O NUMERO NON CONOSCIUTO, SENZA POT SYSTEM, CON RESP. REGOLAMENTO
- 7 COLLOCAMENTO SINDACATO, PIÙ DI UN COLLOCATORE IN ITALIA O NUMERO NON CONOSCIUTO, SENZA POT SYSTEM, SENZA RESP. REGOLAMENTO
- 8 OFFERTA
- 9 COLLOCAMENTO SINDACATO, NESSUN COLLOCATORE IN ITALIA
- X ALTRO O NON CONOSCIUTO

La valorizzazione del campo varia a seconda del ruolo selezionato dal Partner:

- "Emittente" e "Capogruppo": è possibile selezionare il valore del campo da un menù a tendina
- "Collocatore": la valorizzazione del campo avviene prima dell'apertura della schermata di data-entry, tramite la risposta ad un breve questionario (si veda Riquadro 2 a pag. 72).

### CO017 SEGMENTO MERCATO

Assume i valori:

- DOM EMISSIONE DOMESTICA
- INT EMISSIONE INTERNAZIONALE
- X NON CONOSCIUTO

Il valore "X" può essere utilizzato solo per i messaggi di censimento ISIN.

#### **DOM EMISSIONE DOMESTICA**

Emissioni effettuate in un unico paese, a prescindere che sia o meno il paese di residenza dell'emittente.

**QUESTIONARIO PER IL RUOLO COLLOCATORE**

In FE129, per i soggetti segnalanti (Partner) operanti con ruolo Collocatore, la valorizzazione dei campi CO017 "Metodo di Collocamento" e CO020 "Funzione" avviene attraverso la risposta ad un questionario contenente una o più delle seguenti domande:

- Collocamento o Offerta?
- E' presente un Sindacato-Consortio di collocamento per il titolo?
- Quanti sono i soggetti collocatori del titolo in Italia?
- E' presente una struttura di *pot system*?
- Il Partner è Lead Manager B&D per il sindacato di collocamento?
- E' presente un Responsabile del regolamento nei confronti dell'emittente?
- Il Partner è Responsabile del regolamento nei confronti dell'emittente?

A seconda delle risposte fornite, il campo Metodo di Collocamento viene valorizzato come segue.

➤ **METODO DI COLLOCAMENTO = 1**

**Risposte fornite:**

- *Collocatore-Offerente* → *Collocatore*
- *Tipo collocamento* → *Non in Sindacato-Consortio*

In questo caso il primo soggetto segnalante deve completare tutte le sezioni da 1 a 4, mentre eventuali ulteriori segnalanti potranno inviare solamente la sezione 4.

➤ **METODO DI COLLOCAMENTO = 2**

**Risposte fornite:**

- *Collocatore-Offerente* → *Collocatore*
- *Tipo collocamento* → *Sindacato-Consortio*
- *Numero di collocatori in Italia* → *Uno*
- *Struttura pot system* → *Presente*
- *Sei il Lead Manager B&D* → *Si/No*

In questo caso l'unico collocatore in Italia è l'unico soggetto che deve inviare le segnalazioni, indipendentemente dalle caratteristiche del Sindacato / consorzio di collocamento.

➤ **METODO DI COLLOCAMENTO = 3**

**Risposte fornite:**

- *Collocatore-Offerente* → *Collocatore*
- *Tipo collocamento* → *Sindacato-Consortio*
- *Numero di collocatori in Italia* → *Uno*
- *Struttura pot system* → *Non presente*
- *Responsabile del regolamento verso l'emittente* → *Presente*
- *Sei il Responsabile del regolamento verso l'emittente* → *Si/No*

In questo caso l'unico collocatore in Italia è l'unico soggetto che deve inviare le segnalazioni, indipendentemente dalle caratteristiche del Sindacato / consorzio di collocamento.

➤ **METODO DI COLLOCAMENTO = 4**

**Risposte fornite:**

- *Collocatore-Offerente* → *Collocatore*
- *Tipo collocamento* → *Sindacato-Consortio*

- Numero di collocatori in Italia → Uno
- Struttura pot system → Presente
- Responsabile del regolamento verso l'emittente → Non presente

In questo caso l'unico collocatore in Italia è l'unico soggetto che deve inviare le segnalazioni, indipendentemente dalle caratteristiche del Sindacato / consorzio di collocamento.

➤ **METODO DI COLLOCAMENTO = 5**

**Risposte fornite:**

- Collocatore-Offerente → Collocatore
- Tipo collocamento → Sindacato-Consortio
- Numero di collocatori in Italia → Più di uno o informazione sconosciuta
- Struttura pot system → Presente
- Sei il Lead Manager – Responsabile B&D → Si/No

Il Lead Manager B&D dovrà rispondere "Si" all'ultima domanda, mentre gli altri soggetti collocatori dovranno rispondere "No". In questo caso le segnalazioni 129 ricadono sul soggetto Lead Manager B&D a prescindere dal fatto che questo sia o meno un soggetto che colloca in Italia. Per tale ragione, l'applicazione è stata inizialmente disegnata per consentire l'invio di tutte le segnalazioni solo da parte di tale soggetto. Tuttavia, poiché il Lead Manager B&D potrebbe non essere a conoscenza di tutte le informazioni richieste, l'applicazione FE129 è stata resa più flessibile e modificata affinché:

1. per un soggetto diverso dal Lead Manager B&D (soggetto che risponde "No" all'ultima domanda) sia possibile:
  - segnalare le sezioni 1 e 2-3 (informazioni anagrafiche), qualora il Lead Manager B&D non abbia una propria quota di collocato in Italia e non abbia ancora inviato le segnalazioni di sezione 1;
  - segnalare la propria quota di sezione 4 (informazioni quantitative);
  - segnalare la propria quota di sezione 4, qualora per ragioni di opportunità parte del proprio collocato in Italia non sia transitato per il pot-system (cosiddette *exceptions*);

2. per il Lead Manager B&D (soggetto che risponde "Si" all'ultima domanda) sia possibile:

- segnalare anche nel caso in cui non conosca il numero di collocatori in Italia.

Si noti che: se il Lead Manager B&D prova ad inviare una segnalazione anagrafica che è già stata inviata da un collocatore, allora non deve effettuare il questionario e può visualizzare e modificare le informazioni fornite dal collocatore (purchè quest'ultimo lo abbia correttamente segnalato nel campo Lead Manager B&D). Si precisa inoltre che l'invio di un messaggio di sezione 1 o 2-3 da parte del Lead Manager B&D impedisce al collocatore che per primo ha inviato la sezioni 1 e/o 2-3 di poter visualizzare e modificare le informazioni fornite.

Inoltre, per effetto delle suddette modifiche, nei messaggi di "Comunicazione collocato di sezione 4" sarà necessario valorizzare il campo AQ019 "Tipologia importi segnalati", che può assumere i seguenti valori:

- 1 – Importo totale collocato/offerto in Italia registrato in pot-system;
- 2 – Importo totale collocato/offerto in Italia dal segnalante;
- 3 – Importo collocato/offerto in Italia dal segnalante non registrato nel pot-system (*exceptions*).

Le informazioni segnalate dovranno seguire una delle seguenti logiche:

- i. se il Lead Manager B&D segnala 1, allora tutti gli altri collocatori dovranno segnalare 3;
- ii. se il Lead Manager B&D segnala 2, allora anche tutti gli altri collocatori dovranno segnalare 2.

**NOTA BENE:** risulta pertanto di fondamentale importanza che i diversi membri del sindacato / consorzio si accordino preventivamente sulla logica segnaletica da adottare (i) o (ii).

➤ **METODO DI COLLOCAMENTO = 6**

**Risposte fornite:**

- Collocatore-Offerente → Collocatore



- *Tipo collocamento* → *Sindacato-Consorzio*
- *Numero di collocatori in Italia* → *Più di uno o informazione sconosciuta*
- *Struttura pot system* → *Non presente*
- *Responsabile del regolamento verso l'emittente* → *Presente*
- *Sei il Responsabile del regolamento verso l'emittente* → *Si/No*

Il Responsabile del regolamento verso l'emittente dovrà rispondere "Si" all'ultima domanda, mentre gli altri soggetti collocatori dovranno rispondere "No". In questo caso il Responsabile del regolamento verso l'emittente deve inviare le sezioni anagrafiche 1 e 2-3 e qualora abbia effettivamente collocato in Italia deve inviare anche la sezione 4 limitatamente ai propri importi collocati. Tutti gli altri soggetti che collocano in Italia il medesimo titolo dovranno segnalare solo le informazioni di sezione 4.

➤ **METODO DI COLLOCAMENTO = 7**

**Risposte fornite:**

- *Collocatore-Offerente* → *Collocatore*
- *Tipo collocamento* → *Sindacato-Consorzio*
- *Numero di collocatori in Italia* → *Più di uno o informazione sconosciuta*
- *Struttura pot system* → *Non presente*
- *Responsabile del regolamento verso l'emittente* → *Non presente*

In questo caso il primo soggetto segnalante deve completare tutte le sezioni da 1 a 4, mentre eventuali ulteriori segnalanti potranno inviare solamente la sezione 4.

➤ **METODO DI COLLOCAMENTO = 8**

**Risposte fornite:**

- *Collocatore-Offerente* → *Offerente*

In questo caso il primo soggetto segnalante deve completare tutte le sezioni da 1 a 4, mentre eventuali ulteriori segnalanti potranno inviare solamente la sezione 4.

## Collocatori

### FEAT

Inserire i collocatori nella "Lista collocatori". Se il campo CO016 "Metodo Collocamento - Offerta" è uguale a "2 - Sindacato con Lead manager noto" un soggetto nella lista deve avere la funzione di Lead Manager.

### FE129

La modalità di compilazione della lista dei collocatori varia a seconda del ruolo selezionato dal Partner:

- "Emittente" e "Capogruppo": è obbligatorio aggiungere almeno un soggetto nella lista dei collocatori se il campo CO016 "Metodo Collocamento - Offerta" è uguale a 2, 3, 5 o 6 vale a dire in caso di collocamento sindacato, con uno/più collocatori in Italia, in presenza di Pot System o in sua assenza a patto che il Lead Manager o il responsabile del regolamento sia un soggetto identificato.
- "Collocatore": a valle della risposta ad un breve questionario il Partner ed eventuali altri soggetti da esso comunicati saranno automaticamente inseriti nella lista dei collocatori (si veda Riquadro 2 a pag. 72). Per richiedere la modifica della lista dei collocatori occorre inviare messaggio di "Comunicazione generica".

**Quando il campo viene valorizzato nella scheda "Informazioni sullo strumento finanziario", la sua valorizzazione verrà riportata in automatico anche in questa sezione della scheda "Informazioni sul collocamento". Per cancellare o modificare, è necessario intervenire su entrambe le schede.**

### **CO018 COLLOCATORE RESIDENTE**

**Codice fiscale** del collocatore.

Se editabile, effettuare la ricerca del soggetto inserendo il codice fiscale, la denominazione, il Settore di Attività Economica o il codice LEI.

Nel caso in cui il soggetto non sia presente all'interno della base dati disponibile è possibile richiederne il censimento inserendo il codice fiscale, se noto, o inviando un messaggio di "Comunicazione generica" in caso contrario.

### **CO019 COLLOCATORE NON RESIDENTE**

**Codice soggetto** del collocatore attribuito dalla Banca d'Italia.

Se editabile, effettuare la ricerca del soggetto inserendo il codice soggetto, la denominazione, il Settore di Attività Economica, il paese di residenza o il codice LEI.

Nel caso in cui il soggetto non sia presente all'interno della base dati disponibile è possibile richiederne il censimento inviando un messaggio di "Comunicazione generica".

### **CO020 FUNZIONE**

FEAT e FE129 con Ruolo "Emittente" o "Capogruppo"

Assume i valori:

- 0 COLLOCATORI DEL SINDACATO
- 1 LEAD MANAGER
- 2 COLLOCATORE UNICO
- 3 OFFERENTE

FE129 con Ruolo "Collocatore"

Assume i valori:

- C COLLOCATORE
- Cbis COLLOCATORE (segnalante solo Sez.4)
- L LEAD MANAGER
- R RESPONSABILE DEL REGOLAMENTO
- O OFFERENTE
- Obis OFFERENTE (segnalante solo Sez.4)

## Rendimento

La presente sezione deve essere compilata al momento dell'invio di messaggi di richiesta del codice ISIN per tutti i campi per i quali l'informazione è conosciuta.

La valorizzazione dei seguenti campi varia a seconda della tipologia di tasso che caratterizza il titolo. Si riportano di seguito, per ciascuna tipologia di tasso, le istruzioni sui campi da valorizzare al momento dell'invio di messaggi di richiesta ISIN con dati definitivi, comunicazione dati definitivi o censimento ISIN.

### **TASSO FISSO**

Titolo che corrisponde, sotto forma di cedole periodiche, un rendimento calcolato in base ad un tasso di interesse costante per tutta la durata del prestito, titolo *zero coupon* o titolo *one coupon* con cedola finale il cui rendimento è predeterminato all'emissione.

Per i titoli che prevedono il pagamento di cedole periodiche devono essere valorizzati i campi RE002 "Tasso emissione", RE003 "Tasso prima cedola", RE004 "Data prima cedola", RE005 "Periodicità cedola", RE008 "Base calcolo interessi" e RE009 "Struttura rendimento".

Per i titoli *zero coupon*, privi di cedole, devono essere valorizzati i campi RE005 "Periodicità cedola", RE008 "Base calcolo interessi" e RE009 "Struttura rendimento".

Per i titoli *one coupon*, che pagano a scadenza una sola cedola di valore predeterminato all'emissione, devono essere valorizzati i campi RE003 "Tasso prima cedola", RE004 "Data prima cedola", RE005 "Periodicità cedola", RE008 "Base calcolo interessi" e RE009 "Struttura rendimento".

### **TASSO VARIABILE**

Titolo che corrisponde, sotto forma di cedole periodiche, un rendimento calcolato in base ad un tasso di interesse variabile per tutta la durata del prestito o titolo *one coupon* con cedola finale il cui rendimento non è predeterminato all'emissione, ma viene calcolato nel corso della vita del prestito sulla base di un tasso di interesse monetario secondo una relazione di tipo lineare.

Il tasso di interesse variabile può essere:

- Indicizzato ad un tasso di interesse monetario secondo una relazione di tipo lineare;
- Predeterminato (obbligazioni stepped).

Per i titoli a tasso variabile indicizzato devono essere valorizzati i campi RE004 "Data prima cedola", RE005 "Periodicità cedola", RE008 "Base calcolo interessi" e RE009 "Struttura rendimento", occorre inoltre compilare la sezione TITOLI A TASSO VARIABILE. Qualora al momento dell'invio del messaggio sia stato già determinato il tasso della prima cedola, questo va comunicato nel relativo campo (RE003 "Tasso prima cedola"), in caso contrario deve essere comunicato, non appena determinato, tramite il messaggio di "Comunicazione cedole". Lo stesso messaggio deve inoltre essere utilizzato per comunicare, al momento delle loro determinazioni, i valori cedolari relativi a ciascun periodo nel corso della vita del prestito.

Per i titoli a tasso variabile predeterminato (stepped) devono essere valorizzati i campi RE004 "Data prima cedola", RE005 "Periodicità cedola", RE007 "Titoli stepped", RE008 "Base calcolo interessi" e RE009 "Struttura rendimento", occorre inoltre compilare la sezione PIANO RENDIMENTO. Qualora il titolo abbia una struttura "Stepped spread" va compilata la sezione TITOLI A TASSO VARIABILE anziché la sezione PIANO RENDIMENTO.

Per i titoli *one coupon*, che pagano a scadenza una sola cedola di valore non predeterminato all'emissione, devono essere valorizzati i campi RE004 "Data prima cedola", RE005 "Periodicità cedola", RE008 "Base calcolo interessi" e RE009 "Struttura rendimento", va inoltre compilata la sezione TITOLI A TASSO VARIABILE. Il valore della cedola andrà comunicato, non appena determinato, tramite il messaggio di "Comunicazione cedole".

### **TASSO STRUTTURATO**

Titolo con una o più delle seguenti caratteristiche:

- le cedole sono indicizzate ad un parametro diverso da un tasso monetario;
- le cedole dipendono da una componente derivativa;
- le cedole non possono essere indicizzate secondo una relazione di tipo lineare con il parametro di riferimento.

Per questa categoria di titoli devono essere valorizzati i campi RE005 "Periodicità cedola", RE008 "Base calcolo interessi" e RE009 "Struttura rendimento", va inoltre compilata la sezione TITOLI STRUTTURATI e, nel caso in cui siano presenti una o più cedole fisse, anche la sezione PIANO RENDIMENTO. Occorre inoltre

comunicare periodicamente, tramite il messaggio di "Comunicazione cedole", le determinazioni dei valori cedolari di volta in volta disponibili.

#### **TASSO MISTO**

Titolo che corrisponde, sotto forma di cedole periodiche, un rendimento calcolato in base ad un tasso di interesse che nel corso della durata del prestito risulta essere sia fisso che variabile.

Per questa categoria di titoli devono essere valorizzati i campi RE004 "Data prima cedola", RE005 "Periodicità cedola", RE008 "Base calcolo interessi" e RE009 "Struttura rendimento", vanno inoltre compilate le sezioni TITOLI A TASSO VARIABILE e PIANO RENDIMENTO. Limitatamente alla struttura di rendimento a tasso variabile, occorre inoltre comunicare periodicamente, tramite il messaggio di "Comunicazione cedole", le determinazioni dei valori cedolari di volta in volta disponibili.

#### **TASSO VARIABILE CON CAP E/O FLOOR**

Titolo a tasso variabile dotato di cap e/o floor al valore cedolare.

Per questa categoria di titoli fare riferimento alle istruzioni sui titoli a tasso variabile. In aggiunta a quanto sopra riportato occorre alimentare almeno uno dei due campi RE017 "Cedola Cap" e RE018 "Cedola Floor" nella sezione TITOLI STRUTTURATI.

#### **RE001 (\*) TIPO TASSO**

Assume i valori:

- 0 TASSO FISSO
- 1 TASSO VARIABILE
- 3 STRUTTURATO
- 4 TASSO MISTO
- 5 TASSO VARIABILE CON CAP E/O FLOOR
- X NON APPLICABILE

#### **RE002 (\*) TASSO EMISSIONE**

Indicare il valore della cedola espressa in percentuale sul valore nominale su base annua.

#### **RE003 TASSO PRIMA CEDOLA**

Indicare il valore della prima cedola espressa in percentuale sul valore nominale rispetto al periodo cedolare di riferimento.

#### **RE004 DATA PRIMA CEDOLA**

Se il titolo prevede la corresponsione di cedole periodiche, indicare la data di pagamento della prima cedola. Se il titolo prevede un'unica cedola a scadenza, indicare la data di scadenza dello strumento finanziario.

#### **RE005 (\*) PERIODICITÀ CEDOLA**

Assume i valori:

- Z ZERO COUPON
- C ONE COUPON
- D BIENNALE
- A ANNUALE
- S SEMESTRALE
- Q QUADRIMESTRALE
- T TRIMESTRALE
- B BIMESTRALE
- M MENSILE
- O ALTRO
- X NON APPLICABILE
- Y MISTA

Il valore Y (Mista) deve essere usato quando durante la vita del titolo sono presenti strutture con diverse periodicità cedole (ad es.: titoli con durata pari a 8 anni che prevede per i primi tre anni periodicità semestrale e successivi 5 anni periodicità trimestrale)

#### **RE006 TASSO RENDIMENTO EFFETTIVO**

Indicare il tasso di rendimento effettivo alla scadenza (yield to maturity) calcolato all'emissione.

Il tasso di rendimento effettivo a scadenza tiene conto del prezzo d'acquisto del titolo (comprensivo del rateo d'interesse - cd. prezzo *tel quel*), della somma dei flussi di cassa futuri attualizzati, del valore di rimborso dell'obbligazione. Il tasso di rendimento effettivo a scadenza è quel tasso di attualizzazione che rende uguali il prezzo d'acquisto *tel quel* e la somma dei flussi finanziari del titolo (le cedole) più il valore di rimborso dell'obbligazione.

#### **RE007 TITOLO STEPPED**

Per titoli stepped si intendono quei titoli che presentano cedole predeterminate con valore crescente e/o decrescente durante la vita del titolo.

Assume i valori:

- SU STEP UP
- SD STEP DOWN
- SS STEPPED SPREAD
- UD PRIMA STEP UP POI STEP DOWN
- DU PRIMA STEP DOWN POI STEP UP

#### **RE008 BASE CALCOLO INTERESSI**

Assume i valori:

- 01 ACT/ACT
- 02 ACT/360
- 03 ACT/365
- 04 30/360
- 99 ALTRO
- X NON CONOSCIUTA

#### **RE009 STRUTTURA RENDIMENTO**

Indicare per un titolo che presenta una combinazione di più strutture di rendimento (ad es. fisso/variabile) quale tra quelle indicate ne rappresenta lo sviluppo temporale. Per i titoli che non presentano diverse combinazioni di rendimento deve essere indicato il valore "X". Qualora il campo assuma valore diverso da "X" dovrà essere compilata la sezione PIANO RENDIMENTO.

Assume i valori:

- A PRIMA FISSO DOPO VARIABILE
- B PRIMA FISSO DOPO ZERO COUPON
- C PRIMA FISSO DOPO ONE COUPON
- D PRIMA VARIABILE DOPO FISSO
- E PRIMA VARIABILE DOPO STEPPED
- F PRIMA VARIABILE DOPO ZERO COUPON
- G PRIMA VARIABILE DOPO ONE COUPON
- H PRIMA STEPPED DOPO VARIABILE
- I PRIMA STEPPED DOPO ZERO COUPON
- L PRIMA STEPPED DOPO ONE COUPON
- M PRIMA ZERO COUPON DOPO FISSO
- N PRIMO ZERO COUPON DOPO VARIABILE
- O PRIMA ZERO COUPON DOPO STEPPED
- P PRIMA ZERO COUPON DOPO ONE COUPON
- Z ALTRO
- X NESSUNA STRUTTURA

**RE010 DATA VARIAZIONE TIPO TASSO**

Indicare la data di variazione della struttura di rendimento del titolo quando il campo RE009 "Struttura rendimento" assume un valore diverso da "X".

**Titoli a Tasso Variabile****RE011 DATA INIZIO APPLICAZIONE SPREAD**

Indicare la data a partire dalla quale si applica lo spread. Se rimane costante per tutta la durata del titolo, indicare la data inizio godimento. Se nel corso della vita del titolo lo spread varia, indicare per ciascun livello di spread la data di inizio.

**RE012 DATA FINE APPLICAZIONE SPREAD**

Indicare la data fino alla quale si applica lo spread. Se rimane costante per tutta la durata del titolo, indicare la data fine godimento. Se nel corso della vita del titolo lo spread varia, indicare per ciascun livello di spread la data di fine.

**RE013 OPERATORE MATEMATICO**

Indicare l'operatore matematico da applicare allo spread per il calcolo del tasso di rendimento.

Assume i valori:

- - SOTTRARRE
- + AGGIUNGERE
- \* MOLTIPLICARE
- 9 FLAT

Nel caso di titolo con spread assente selezionare il valore "9 - Flat".

**RE014 SPREAD**

Indicare il valore dello spread applicato al parametro di indicizzazione in **punti percentuali**. Nel caso di tasso senza spread (flat) deve essere indicato '0' (zero).

**RE015 PERIODO DI CALCOLO CEDOLA VARIABILE**

Indicare se la cedola è calcolata sulla base dei valori assunti dal parametro di indicizzazione prima dell'inizio o nel corso del periodo cedolare di riferimento.

Assume i valori:

- VPO VARIABILE A CEDOLA POSTFISSATA
- VPR VARIABILE A CEDOLA PREFISSATA

**RE016 (\*) CODICE ISIN PARAMETRO**

Indicare il codice ISIN assegnato al parametro di riferimento.

**Titoli Strutturati****RE017 (\*) CEDOLA CAP**

Limite massimo che può assumere la cedola su base annua. Il campo deve essere valorizzato in **punti percentuali** e non in basis points.

**RE018 (\*) CEDOLA FLOOR**

Limite minimo che può assumere la cedola su base annua. Il campo deve essere in **punti percentuali** e non in basis points.

**RE019 (\*) INDICIZZAZIONE CEDOLA**

Indicare il tipo di parametro di indicizzazione di riferimento.

Assume i valori:

- 01 Euribor
- 02 Libor
- 03 Bot
- 04 Eonia
- 05 Tasso Swap Euro
- 06 Rendistato
- 07 Rendiob
- 08 Tasso d'interesse: Altro
- 09 Azione quotata: Italia
- 10 Azione quotata: Europa
- 11 Azione quotata: USA
- 12 Azione quotata: Asia
- 13 Azione quotata: Altro
- 14 Azione non quotata: Italia
- 15 Azione non quotata: Europa
- 16 Azione non quotata: USA
- 17 Azione non quotata: Asia
- 18 Azione non quotata: Altro
- 19 Basket azioni: Italia
- 20 Basket azioni: Europa
- 21 Basket azioni: USA
- 22 Basket azioni: Asia
- 23 Basket azioni: OCSE
- 24 Basket azioni: Altro
- 25 Indice azionario: Italia
- 26 Indice azionario: Europa
- 27 Indice azionario: USA
- 28 Indice azionario: Asia
- 29 Indice azionario: Altro
- 30 Basket indice azionario: Italia
- 31 Basket indice azionario: Europa
- 32 Basket indice azionario: USA
- 33 Basket indice azionario: Asia
- 34 Basket indice azionario: OCSE
- 35 Basket indice azionario: Altro
- 36 Fondo comune armonizzato: Italia
- 37 Fondo comune armonizzato: Europa
- 38 Fondo comune non armonizzato: Italia
- 39 Fondo comune non armonizzato: Europa
- 40 Fondo comune non armonizzato: Altro
- 41 Basket fondi comuni armonizzati: Italia
- 42 Basket fondi comuni armonizzati: Europa
- 43 Basket fondi comuni non armonizzati: Italia
- 44 Basket fondi comuni non armonizzati: Europa
- 45 Basket fondi comuni non armonizzati: Altro
- 46 Merce
- 47 Basket di Merci
- 48 Indice di prezzi: prezzi al consumo Italia
- 49 Indice di prezzi: prezzi al consumo Europa
- 50 Indice di prezzi: prezzi al consumo Europa escluso tabacco
- 51 Indice di prezzi: Altro

- 52 Tasso di cambio valute OCSE
- 53 Tasso di cambio valute non OCSE
- 54 Tasso swap valuta
- 55 Tasso swap merci
- 56 Tasso swap altro
- 99 Altro

### **Piano di Rendimento**

La presente sezione deve essere valorizzata quando:

- il titolo è stepped con campo RE007 “Titoli stepped” diverso da “SS – Stepped spread”;
- campo RE009 “Struttura rendimento” diversa da “X – Nessuna struttura”;
- campo RE005 “Periodicità cedola” uguale a “I - Irregolare”, “O - Altro” o “Y - Mista”.

I seguenti campi (da RE020 a RE028) devono essere valorizzati con i dati relativi a ciascun sottoperiodo di riferimento, anziché all’intera vita dello strumento.

**RE020 DATA INIZIO GODIMENTO**

**RE021 DATA FINE GODIMENTO**

**RE022 DATA PAGAMENTO**

**RE023 TASSO CEDOLA**

**RE024 TASSO ANNUO**

**RE025 BASE CALCOLO**

Si veda il campo RE008 “Base calcolo interessi”.

**RE026 TIPO TASSO**

Assume i valori:

- 0 TASSO FISSO
- 1 TASSO VARIABILE
- 3 TASSO STRUTTURATO

**RE027 PERIODICITÀ**

Assume i valori:

- Z ZERO COUPON
- C ONE COUPON
- D BIENNALE
- A ANNUALE



- S SEMESTRALE
- Q QUADRIMESTRALE
- T TRIMESTRALE
- B BIMESTRALE
- M MENSILE
- O ALTRO

#### **RE028 CEDOLA REGOLARE**

Assume i valori:

- 0 CEDOLA IRREGOLARE
- 1 CEDOLA REGOLARE

### **Rimborso**

#### **RI001 TIPO RIMBORSO**

Assume i valori:

- F A SCADENZA FISSA
- G A SCADENZA FISSA CON OPZIONE CALL
- C A SCADENZA FISSA CON OPZIONE PUT
- D A SCADENZA FISSA CON OPZIONE CALL E PUT
- E A SCADENZA CON OPZIONE DI PROROGABILITÀ
- A CON AMMORTAMENTO
- B CON AMMORTAMENTO E OPZIONE CALL
- T CON AMMORTAMENTO E OPZIONE PUT
- L CON AMMORTAMENTO E OPZIONE CALL E PUT
- P IRREDIMIBILE
- Q IRREDIMIBILE CON OPZIONE CALL
- R IRREDIMIBILE CON OPZIONE PUT

Se il rimborso dell'importo sottoscritto avviene secondo un piano di ammortamento (campo valorizzato con "A", "B", "T" o "L") deve essere compilata anche la sezione 15. TITOLI CON AMMORTAMENTO.

Se è prevista l'opzione di rimborso anticipato (campo RI002 "Opzione rimborso anticipato" uguale a "1 – Prevista") sono ammessi solo i valori: "G", "C", "D", "B", "T", "L", "Q" e "R".

Se l'emissione non prevede rimborso il campo deve essere valorizzato con "P", "Q" o "R".

#### **RI002 (\*) OPZIONE RIMBORSO ANTICIPATO**

Indicare la clausola opzionale in base alla quale l'emittente e/o il sottoscrittore possono recedere anticipatamente dall'obbligazione sottoscritta rispetto alla data di scadenza contrattualmente prevista. Comprende il caso in cui il rimborso sia previsto al verificarsi di un determinato evento (es. raggiungimento di un valore per un dato parametro), ma non quello in cui il rimborso sia previsto solo in caso di eventi straordinari (es. modifiche fiscali, insolvenza dell'emittente).

Assume i valori:

- 0 ASSENTE
- 1 PREVISTA

Se il campo è valorizzato a "1 – Prevista" vanno compilati anche i campi previsti nella sezione 16. ALTRE OPZIONI.

#### **RI003 (\*) INDICIZZAZIONE CAPITALE**

Si veda il campo RE019 "Indicizzazione cedola".

## Titoli con Ammortamento

Questa sezione è riservata alle emissioni obbligazionarie che prevedano l'estinzione del debito in forma graduale mediante rimborsi periodici secondo un piano di ammortamento predefinito all'emissione (campo RI001 "Tipo rimborso" uguale a "A", "B", "T" o "L").

Per tutte i titoli con piano di ammortamento devono essere valorizzati i campi AM001 "Tipo ammortamento", AM002 "Modalità ammortamento", AM003 "Periodicità ammortamento" e AM004 "Data prima rata ammortamento".

La modalità di comunicazione del piano di ammortamento varia a seconda della tipologia di piano di ammortamento che caratterizza il titolo.

### A CAPITALE COSTANTE

Titolo che prevede il rimborso del capitale sotto forma di pagamenti periodici di valore costante nel corso della durata del prestito. Il piano di ammortamento viene sviluppato automaticamente dal sistema sulla base della valorizzazione dei suddetti campi.

### A CAPITALE CRESCENTE O ATIPICO

Titolo che prevede il rimborso del capitale sotto forma di pagamenti periodici di valore crescente o di pagamenti di valore/periodicità non regolare nel corso della durata del prestito. Per questa tipologia di titoli, a seguito della chiusura del periodo di collocamento, occorre trasmettere il piano di ammortamento inviando un messaggio di "Comunicazione generica". Nel caso di piano di ammortamento a capitale crescente deve essere valorizzato anche il campo AM005 "Tasso sviluppo ammortamento".

Qualora durante la vita del titolo vengano apportate modifiche al piano di ammortamento precedentemente comunicato (ad es. a seguito di rimborsi anticipati o rinegoziazione del prestito) occorre trasmettere il nuovo piano completo delle rate passate e future inviando un messaggio di "Comunicazione generica".

Gli importi devono essere segnalati per la **sola quota capitale**, nella valuta di denominazione.

### NON PREDETERMINATO

Tipologia di ammortamento riservata ai soli titoli rivenienti da operazioni di cartolarizzazione e CDO.

#### AM001 TIPO AMMORTAMENTO

Assume i valori:

- 1 A CAPITALE COSTANTE
- 2 A CAPITALE CRESCENTE
- 3 ATIPICO
- 4 NON PREDETERMINATO

#### AM002 MODALITÀ AMMORTAMENTO

Assume i valori:

- 01 PER RIDUZIONE DEL TAGLIO MINIMO
- 02 PER ESTRAZIONE
- 03 POOL FACTOR
- 04 ALTRO

##### 01 PER RIDUZIONE DEL TAGLIO MINIMO

Il numero dei titoli collocati resta costante per tutta la durata del prestito, mentre il valore nominale varia di una percentuale pari all'importo della rata.

##### 02 PER ESTRAZIONE

Il valore nominale non varia per tutta la durata del titolo, mentre il numero dei titoli collocati diminuisce sulla base del numero dei titoli estratti.

##### 03 POOL FACTOR

Coefficiente di rettifica (in forma decimale: 1 intero e 8 decimali) del valore nominale di un ABS e CDO in un piano di ammortamento. Il Pool Factor è un fattore che viene utilizzato per indicare il capitale residuo di un titolo ABS o CDO.

#### **04    ALTRO**

Da usare esclusivamente per modalità diverse dalle precedenti.

<b>AM003 PERIODICITÀ AMMORTAMENTO</b>
---------------------------------------

Assume i valori:

- D    BIENNALE
- A    ANNUALE
- S    SEMESTRALE
- Q    QUADRIMESTRALE
- T    TRIMESTRALE
- B    BIMESTRALE
- M    MENSILE
- X    ATIPICO

<b>AM004 DATA PRIMA RATA AMMORTAMENTO</b>
---

Indicare la data a partire dalla quale il titolo rimborsa il debito residuo in linea capitale.

<b>AM005 TASSO SVILUPPO AMMORTAMENTO</b>
--

Indicare il tasso in base al quale viene sviluppato il piano di ammortamento "a capitale crescente".

## Altre Opzioni

Questa sezione deve essere valorizzata qualora il regolamento di emissione preveda una o più opzioni a favore dell'emittente o del sottoscrittore. Per ogni opzione prevista deve essere inserita una riga con valorizzazione degli attributi propri di ciascuna opzione. Per tutte le opzioni inserite è obbligatorio valorizzare i campi AO001 "Tipo opzione", AO002 "Data inizio esercizio" e AO003 "Data fine esercizio", la valorizzazione degli altri campi dipende dalla tipologia di opzione selezionata (si veda tabella sotto).

CAMPI DA VALORIZZARE AO001 - TIPO OPZIONE	AO002	AO003	AO004	AO005	AO006	AO007	AO008	AO009	AO010
	DATA INIZIO ESERCIZIO	DATA FINE ESERCIZIO	TIPO ESERCIZIO	PREZZO ESERCIZIO OPZIONE	STRIKE TIPO TASSO	STRIKE DATA SCADENZA	STRIKE PERIODICITA'	TITOLO OFFERTO IN CAMBIO	RAPPORTO DI CAMBIO
1 RIMBORSO ANTICIPATO	X	X	X						
2 RIMBORSO PER MOTIVI FISCALI	X	X	X						
3 VARIAZIONE TIPO TASSO	X	X	X		X				
4 VARIAZIONE DATA SCADENZA	X	X	X			X			
5 RIACQUISTO SUL MERCATO	X	X	X						
6 VARIAZIONE PERIODICITA' CEDOLA	X	X	X				X		
7 CONVERSIONE/SCAMBIO	X	X	X					X	
8 DUAL CURRENCY	X	X	X						X
9 VARIAZIONE SPREAD	X	X	X						
10 VARIAZIONE PARAMETRO DI RIFERIMENTO	X	X	X						
11 PREMIO FEDELTA'	X	X	X						
12 VARIAZIONE TASSO FISSO	X	X	X						

### AO001 TIPO OPZIONE

- 1 RIMBORSO ANTICIPATO
- 2 RIMBORSO PER MOTIVI FISCALI
- 3 VARIAZIONE TIPO TASSO
- 4 VARIAZIONE DATA SCADENZA
- 5 RIACQUISTO SUL MERCATO
- 6 VARIAZIONE PERIODICITÀ CEDOLA
- 7 CONVERSIONE/SCAMBIO
- 8 DUAL CURRENCY
- 9 VARIAZIONE SPREAD
- 10 VARIAZIONE PARAMETRO DI RIFERIMENTO
- 11 PREMIO FEDELTA'
- 12 VARIAZIONE TASSO FISSO

### AO002 DATA INIZIO ESERCIZIO

### AO003 DATA FINE ESERCIZIO

Nel caso di una opzione senza fine esercizio di un titolo irredimibile, indicare il 2099-12-31

**AO004 TIPO ESERCIZIO**

Indicare il soggetto (emittente e/o sottoscrittore) a cui è attribuito il diritto di esercizio dell'opzione. Nel caso sia presente più di un tipo di diritto di esercizio occorre indicare ciascuno di essi separatamente.

Assume i valori:

- C CALL (ESERCITABILE DALL'EMITTENTE)
- P PUT (ESERCITABILE DAL SOTTOSCRITTORE)
- A AUTOCALLABLE

**AO005 PREZZO ESERCIZIO OPZIONE****AO006 STRIKE TIPO TASSO**

Indicare il "Tipo tasso" che il titolo assumerebbe in caso di esercizio dell'opzione.

Assume i valori:

- 0 TASSO FISSO
- 1 TASSO VARIABILE
- 3 STRUTTURATO
- 4 TASSO MISTO

**AO007 STRIKE DATA SCADENZA**

Indicare la nuova data di scadenza che il titolo assumerebbe in caso di esercizio dell'opzione.

**AO008 STRIKE PERIODICITÀ**

Indicare la nuova data periodicità cedolare che il titolo assumerebbe in caso di esercizio dell'opzione.

Assume i valori:

- Z ZERO COUPON
- C ONE COUPON
- D BIENNALE
- A ANNUALE
- S SEMESTRALE
- Q QUADRIMESTRALE
- T TRIMESTRALE
- B BIMESTRALE
- M MENSILE
- I IRREGOLARE
- U SCONOSCIUTO
- O ALTRO

**AO009 TITOLO OFFERTO IN CAMBIO**

Indicare il codice ISIN del titolo (azione, obbligazione, warrant) che verrà offerto in conversione o in scambio in caso di esercizio dell'opzione.

**AO010 RAPPORTO DI CAMBIO**

Indicare il rapporto di cambio in base al quale il titolo viene convertito/scambiato.

## Sezioni 2-3 delle Disposizioni 129

### AA001 (\*) DURATA ATTESA

Per i titoli **diversi da** covered warrants, leverage certificates, certificates, ETC e ETN:

- indicare la durata attesa del titolo espressa in mesi. Per la generalità dei titoli, essa è pari alla media ponderata delle scadenze previste per il rimborso del capitale con pesi pari alle relative rate di rimborso. Nel caso di titoli rivenienti da operazioni di cartolarizzazione essa è pari alla durata attesa della tranche stimata dall'emittente. Nel calcolare la durata attesa non si tiene conto dell'ipotesi di esercizio della facoltà di rimborso anticipato in capo all'emittente e/o al sottoscrittore.

Per i covered warrants, leverage certificates, certificates, ETC e ETN:

- il campo non deve essere valorizzato.

### AA002 (\*) TASSO DI RENDIMENTO EFFETTIVO ALL'EMISSIONE - COMPONENTE GARANTITA

Per i titoli **diversi da** covered warrants, leverage certificates, certificates, ETC e ETN:

- indicare la componente garantita del rendimento annuo effettivo tra emissione e scadenza, al lordo della ritenuta fiscale.

Si noti che:

- in caso di titoli a tasso variabile con indicizzazione a tassi di interesse di mercato monetario e/o finanziario, si intende l'eventuale spread (se positivo) composto fino a scadenza;
- in caso di rendimenti strutturati più complessi si intende il tasso minimo garantito, composto fino a scadenza;
- in caso di presenza di clausola floor, il limite minimo va considerato come componente garantita.

Il campo deve essere valorizzato in **punti percentuali** e non in basis points.

Per i covered warrants, leverage certificates, certificates, ETC e ETN:

- il campo non deve essere valorizzato.

### AA003 (\*) TASSO DI RENDIMENTO EFFETTIVO ALL'EMISSIONE - COMPONENTE VARIABILE

Per i titoli **diversi da** covered warrants, leverage certificates, certificates, ETC e ETN:

- indicare la componente variabile del rendimento annuo effettivo tra emissione e scadenza, al lordo della ritenuta fiscale e al netto dell'eventuale componente garantita indicata nel precedente punto, calcolato in corrispondenza del valore assunto dai parametri di riferimento al momento dell'emissione, ipotizzando la loro costanza nel tempo.

Il campo deve essere valorizzato in **punti percentuali** e non in basis points.

Per i covered warrants, leverage certificates, certificates, ETC e ETN:

- il campo non deve essere valorizzato.

### AA004 (\*) BASE VALUTAZIONE DEL COSTO DELLA RACCOLTA

Indicare la tipologia di valore inserito nel campo costo della raccolta.

Assume i valori:

- F COSTO PERCENTUALE TOTALE
- V SPREAD RISPETTO EURIBOR 3M

Selezionare "F" se il costo della raccolta è determinato sulla base di un tasso fisso, "V" se è determinato sulla base di un tasso variabile.

### AA005 (\*) COSTO DELLA RACCOLTA

Indicare il costo teorico percentuale su base annua sostenuto dall'emittente, calcolato sulla base del netto ricavo, detratte le commissioni e tenuto conto del costo dell'eventuale copertura. Il campo può assumere anche valori negativi.

Si noti che:

- Nel caso in cui il costo della raccolta sia determinato sulla base di un tasso fisso, si intende il costo percentuale totale;
- Nel caso in cui il costo della raccolta sia determinato sulla base di un tasso variabile, si intende lo spread (in punti percentuali) rispetto al tasso Euribor 3m. Nel caso in cui il parametro di indicizzazione del tasso variabile sia diverso dal tasso Euribor 3m, lo spread va comunque calcolato rispetto al tasso Euribor 3m.

Le commissioni pagate dal sottoscrittore e corrisposte a soggetti terzi rispetto all'emittente devono essere detratte poiché non sono un costo per l'emittente. Il costo della raccolta va calcolato a livello di gruppo. Bisogna distinguere quindi il caso in cui le commissioni sono retrocesse a soggetti del gruppo dal caso in cui le commissioni sono retrocesse a soggetti non del gruppo. Tali commissioni vanno detratte dal netto ricavo solo se il soggetto a cui vengono retrocesse non appartiene al gruppo.

L'eventuale costo (strategia) di copertura deve invece essere considerato: se la strategia di copertura modifica i flussi di cassa, ad esempio coperture back-to-back ovvero coperture di tasso, bisogna tenerne conto nel calcolo, poiché potrebbero modificare il costo per l'emittente.

Si precisa che il costo della raccolta è, in alcuni casi, teorico poiché i flussi di cassa futuri e la stessa strategia di copertura potrebbero essere non completamente noti all'emissione. Si precisa che il calcolo di tale costo è una stima poiché, ad esempio, non è detto che le strategie di copertura siano a livello di singolo deal, ma potrebbero essere a livello di "portafoglio".

#### **AA006 (\*) NUMERO DI SOTTOSTANTI COMPONENTE DERIVATIVA**

Tipologia di derivato inclusa nello strumento finanziario. Indicare se si tratta di un derivato con un unico sottostante o con almeno due sottostanti.

Assume i valori:

- 1 UNICO SOTTOSTANTE
- 2 ALMENO DUE SOTTOSTANTI

#### **AA007 (\*) COMPONENTE DERIVATIVA PATH DEPENDENT**

Tipologia di derivato inclusa nello strumento finanziario. Indicare se il payoff sia determinato dal valore del/dei sottostante/i ad una data predeterminata (ad esempio: a scadenza) oppure sia *path dependent*.

Assume i valori:

- 1 PATH DEPENDENT
- 2 NON PATH DEPENDENT

#### **AA008 (\*) TIPO ESERCIZIO DEL DERIVATO**

Tipologia di esercizio della componente derivativa (call, put o altro).

Per i titoli di debito assume i valori:

- C CALL
- P PUT
- A ALTRO

Per covered warrants "esotici", certificates, ETC ed ETN si veda il campo AD001.

Per i covered warrant "plain vanilla":

- il campo non deve essere valorizzato.

#### **AA009 (\*) TIPO LEVA**

Per titoli a leva si intendono gli strumenti per cui la variazione del capitale investito dipende dalla performance del sottostante moltiplicata per un numero/i maggiore/i, in valore assoluto, di 1. Tali valori devono essere noti all'emissione.

Assume i valori:

- 1 RIALZISTA
- 2 RIBASSISTA
- 3 ALTRO

Per ETC, ETN, leverage certificates e covered warrant “esotici”:

- indicare il tipo di leva del titolo.

Per gli altri titoli:

- il campo non deve essere valorizzato.

#### **AA010 (\*) LEVA MASSIMA**

Per ETC, ETN, leverage certificates e covered warrant “esotici”:

- indicare, sia per i titoli a leva fissa che per quelli a leva dinamica, con il relativo segno il rapporto massimo tra il rendimento del titolo e il rendimento del sottostante. Nel caso di titoli il cui valore dipende dall’andamento di più sottostanti, va considerata la leva massima tra tutti i sottostanti. Nel caso in cui lo strumento replica un indice a leva, indicare la leva rispetto all’indice di mercato di riferimento, non necessariamente a leva. Per i titoli a leva fissa, la leva massima e quella minima coincidono.

Per gli altri titoli:

- il campo non deve essere valorizzato.

#### **AA011 (\*) LEVA MINIMA**

Per ETC, ETN, leverage certificates e covered warrant “esotici”:

- indicare, sia per i titoli a leva fissa che per quelli a leva dinamica, con il relativo segno il rapporto minimo tra il rendimento del titolo e il rendimento del sottostante. Nel caso di titoli il cui valore dipende dall’andamento di più sottostanti, va considerata la leva minima tra tutti i sottostanti. Nel caso in cui lo strumento replica un indice a leva, indicare la leva rispetto all’indice di mercato di riferimento, non necessariamente a leva. Per i titoli a leva fissa, la leva massima e quella minima coincidono.

Per gli altri titoli:

- il campo non deve essere valorizzato.

#### **AA012 (\*) BASE CALCOLO LEVA**

Assume i valori:

- G GIORNALIERA
- M MENSILE
- A ALTRO

Per ETC, ETN, leverage certificates e covered warrant “esotici”:

- indicare la base di calcolo della leva.

Per gli altri titoli:

- il campo non deve essere valorizzato.



## Sezione 4 delle Disposizioni 129

### CERTIFICATI IN CIRCOLAZIONE

I campi da AQ001 a AQ005 devono essere valorizzati solo per covered warrants, leverage certificates, certificates, ETC e ETN. La valorizzazione dei campi da AQ002 a AQ005 è obbligatoria per ciascun trimestre per cui è dovuta la segnalazione sul numero di certificati in circolazione (si veda il campo AQ001).

### COLLOCAMENTO E RIMBORSI

I campi da AQ006 a AQ025 devono essere valorizzati solo per gli strumenti finanziari diversi da covered warrants, leverage certificates, certificates, ETC e ETN.

La valorizzazione dei campi da AQ006 a AQ019 varia a seconda del ruolo selezionato dal Partner:

- “Emittente”: la segnalazione è dovuta per tutti i campi
- “Collocatore” e “Capogruppo” la segnalazione è dovuta solo per i campi relativi ai soggetti residenti.

La valorizzazione dei campi dal AQ020 al AQ025 varia a seconda del ruolo selezionato dal Partner:

- “Emittente” e “Capogruppo”: la segnalazione è obbligatoria
- “Collocatore”: la segnalazione non è dovuta.

Si ricorda che la segnalazione dell'importo collocato e dell'ammontare dei rimborsi anticipati non deve essere effettuata in relazione ai titoli emessi o offerti da banche italiane, che effettuano analoga segnalazione ai sensi delle Circ. n. 154 e n. 272.

#### AQ001 (\*) NUMERO DI CERTIFICATI IN CIRCOLAZIONE

Indicare il numero di certificati in circolazione alla fine del trimestre di riferimento.

La valorizzazione del campo varia a seconda del ruolo selezionato dal Partner:

- “Emittente” e “Capogruppo”: il campo deve essere valorizzato con il numero complessivo di certificati in circolazione alla fine di ogni trimestre. Si segnala convenzionalmente “0” se i titoli vengono ritirati dal mercato nel trimestre di riferimento e non più negoziati. La segnalazione non sarà più dovuta per i trimestri successivi;
- “Collocatore”: il campo deve essere valorizzato con il numero di strumenti in circolazione di propria competenza solamente al termine del trimestre in cui si sia dato inizio alle negoziazioni, per i titoli destinati alla quotazione, o al termine dei trimestri all'interno dei quali sia avvenuto il collocamento, per i titoli non destinati alla quotazione.

#### AQ002 (\*) DATA FINE TRIMESTRE DI RIFERIMENTO

Indicare la data di riferimento di fine trimestre.

#### AQ003 (\*) PREZZO DI NEGOZIAZIONE

Indicare il prezzo di negoziazione alla fine del trimestre di riferimento in unità di valuta di negoziazione.

Se il titolo è negoziato su più mercati o MTF indicare il più significativo. Per gli strumenti non quotati, indicare il prezzo relativo all'ultima transazione conosciuta. Il mercato più significativo è individuato tenendo conto, ad esempio, del numero di transazioni, dei volumi scambiati, della liquidità del mercato anche in termini di spread bid-ask.

#### AQ004 (\*) STATO NEGOZIAZIONE

Assume i valori:

- 1 IN CORSO
- 0 CHIUSURA ANTICIPATA

#### AQ005 (\*) VALUTA PREZZO DI NEGOZIAZIONE

Indicare il codice ISO della valuta di negoziazione dello strumento finanziario.

#### AQ006 (\*) DATA FINE COLLOCAMENTO

Indicare la data in cui si è chiusa la sottoscrizione dei titoli oggetto della segnalazione.

**AQ007 (\*) IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO BANCHE RESIDENTI****AQ008 (\*) IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO BANCHE NON RESIDENTI****AQ009 (\*) IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO AMMIN.ZIONI PUBBLICHE RESIDENTI****AQ0010 (\*) IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO AMM.ZIONI PUBBLICHE NON RESIDENTI**

Indicare l'importo collocato presso o sottoscritto da amministrazioni pubbliche o organismi internazionali non residenti.

**AQ0011 (\*) IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO FINANZIARIE RESIDENTI**

Indicare l'importo collocato presso o sottoscritto da operatori appartenenti al settore finanziario residente, inclusi gli ausiliari ed escluse le banche.

**AQ0012 (\*) IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO FINANZIARIE NON RESIDENTI**

Indicare l'importo collocato presso o sottoscritto da operatori appartenenti al settore finanziario non residente, inclusi gli ausiliari ed escluse le banche.

**AQ0013 (\*) IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO SOCIETÀ NON FINANZIARIE RESIDENTI**

Indicare l'importo collocato presso o sottoscritto da società non finanziarie residenti.

**AQ0014 (\*) IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO SOCIETÀ NON FINANZIARIE NON RESIDENTI**

Indicare l'importo collocato presso o sottoscritto da società non finanziarie non residenti.

**AQ0015 (\*) IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO FAMIGLIE RESIDENTI**

Indicare l'importo collocato presso o sottoscritto da famiglie residenti ed enti al servizio delle famiglie residenti.

**AQ0016 (\*) IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO FAMIGLIE NON RESIDENTI**

Indicare l'importo collocato presso o sottoscritto da famiglie non residenti ed enti al servizio delle famiglie non residenti.

**AQ0017 (\*) IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO ALTRO RESIDENTI**

Indicare l'importo collocato presso o sottoscritto da soggetti residenti diversi da quelli descritti nei campi precedenti (ad esempio per il direct listing, in presenza dei cosiddetti conti "X" - quando il lead manager di un sindacato di collocamento non conosce il nome e/o il paese del cliente presentato da un altro membro del sindacato - e per altri .possibili casi residuali).

**AQ0018 (\*) IMPORTO COLLOCATO O SOTTOSCRITTO ALTRO NON RESIDENTI**

Indicare l'importo collocato presso o sottoscritto da soggetti non residenti diversi da quelli descritti nei campi precedenti (ad esempio per il direct listing, in presenza dei cosiddetti conti "X" - quando il lead manager di un sindacato di collocamento non conosce il nome e/o il paese del cliente presentato da un altro membro del sindacato - e per altri .possibili casi residuali).

**AQ0019 (\*) TIPOLOGIA IMPORTI SEGNALATI**

Assume i valori:

- 1 Importo totale collocato/offerto in Italia registrato in pot-system;
- 2 Importo totale collocato/offerto in Italia dal segnalante;
- 3 Importo collocato/offerto in Italia dal segnalante non registrato nel pot-system (exceptions).

**AQ0020 (\*) DATA RIMBORSO**

Indicare la data di regolamento dell'importo rimborsato.

**AQ021 (\*) CAPITALE RIMBORSATO**

**AQ022 (\*) CAUSALE RIMBORSO**

Assume i valori:

- RAT RIMBORSO ANTICIPATO TOTALE
- RAP RIMBORSO ANTICIPATO PARZIALE
- RRT RIMBORSO PER RIACQUISTO TOTALE
- RRP RIMBORSO PER RIACQUISTO PARZIALE
- CVP RIMBORSO PER CONVERSIONE PARZIALE
- CVT RIMBORSO PER CONVERSIONE TOTALE
- DEF TITOLO IN DEFAULT
- RCP RIMBORSO PER CONCAMBIO PARZIALE
- RCT RIMBORSO PER CONCAMBIO TOTALE
- ASS ASSIMILAZIONE TRANCHE
- ATA AMMORTAMENTO ATIPICO PER ALTRA MODALITA AMMORTAMENTO
- ATE AMMORTAMENTO ATIPICO PER ESTRAZIONE
- ATR AMMORTAMENTO ATIPICO PER RIDUZIONE DEL VALORE NOMINALE
- CAA AMMORTAMENTO A CAPITALE CRESCENTE PER ALTRA MODALITA AMM.NTO
- CAE AMMORTAMENTO A CAPITALE CRESCENTE PER ESTRAZIONE
- CAR AMMORTAMENTO A CAPITALE CRESCENTE PER RIDUZIONE DEL VAL. NOMINALE
- COA AMMORTAMENTO A CAPITALE COSTANTE PER ALTRO
- COE AMMORTAMENTO A CAPITALE COSTANTE PER ESTRAZIONE
- COR AMMORTAMENTO A CAPITALE COSTANTE PER RIDUZIONE DEL VALORE NOMINALE
- INC CHIUSURA PER INCAPENZA FONDIALT ALTRO
- NAT ABS - AMMORTAMENTO TOTALE POOL FACTOR
- NPA ABS - AMMORTAMENTO PARZIALE POOL FACTOR

**AQ023 (\*) PREZZO RIMBORSO EFFETTIVO**

Indicare il prezzo di rimborso quando diverso dal prezzo di rimborso definito all'emissione.

**AQ024 (\*) POOL FACTOR**

Indicare, per le sole operazioni di cartolarizzazione (ABS e CDO), la percentuale di quota capitale del titolo ancora da rimborsare. Il valore espresso nel formato 1 intero e 8 decimali deve avere un valore compreso tra 0 e 1.

**AQ025 (\*) CIRCOLANTE DOPO RIMBORSO**

## Dati Specifici Cartolarizzazioni

### CA001 DESCRIZIONE CARTOLARIZZAZIONE

Indicare il nome attribuito all'operazione di cartolarizzazione (ad es. "Colosseo Finance").

### CA002 TIPOLOGIA CARTOLARIZZAZIONE

Assume i valori:

- 604 TRADIZIONALE
- 605 SINTETICA
- 608 RISCHI ASSICURATIVI
- 609 ALTRO

### CA003 TIPO ATTIVITÀ SOTTOSTANTE LA CARTOLARIZZAZIONE

Assume i valori:

- 22 LEASING
- 801 PRESTITI EMESSI O GARANTITI DA STATI
- 802 MUTUI RESIDENZIALI
- 803 MUTUI NON RESIDENZIALI
- 804 MUTUI DIVERSI
- 805 TITOLI A LUNGO TERMINE "INVESTMENT GRADE" (esclusi Titoli di Stato)
- 806 TITOLI A BREVE TERMINE "INVESTMENT GRADE" (esclusi Titoli di Stato)
- 807 TITOLI DIVERSI "INVESTMENT GRADE"
- 808 TITOLI DERIVANTI DA ALTRE CARTOLARIZZAZIONI (ABS)
- 809 TITOLI AD ALTO RENDIMENTO
- 810 TITOLI DETERIORATI
- 811 CREDITI AL CONSUMO NON FINALIZZATI (PERSONALI)
- 812 CREDITI AL CONSUMO FINALIZZATI (diversi da 814)
- 813 FINANZIAMENTI A IMPRESE
- 814 CREDITI AL CONSUMO FINALIZZATI PER ACQUISTO AUTOVEICOLI
- 815 FINANZIAMENTI SU CARTE DI CREDITO
- 816 CREDITI COMMERCIALI
- 818 FINANZIAMENTI DIVERSI
- 819 CREDITI
- 820 IMMOBILI
- 821 ALTRE ATTIVITÀ

Se l'operazione di cartolarizzazione prevede più attività indicare l'attività prevalente.

### CA004 ESIGIBILITÀ CREDITO CARTOLARIZZATO

Assume i valori:

- 550001 CREDITI DETERIORATI DIVERSI DA SOFFERENZE
- 550010 CREDITI IN BONIS
- 551000 CREDITI IN SOFFERENZA
- 9 NON CONOSCIUTO

Se l'operazione di cartolarizzazione prevede crediti con diverso grado di esigibilità indicare la casistica prevalente.

### CA005 REVOLVING

Assume i valori:

- 1 SI
- 2 NO

**CA006 MASTER TRUST**

Assume i valori:

- 1 SI
- 2 NO

**CA007 WAREHOUSE**

Assume i valori:

- 1 SI
- 2 NO

**CA008 FLAG REPACKAGING**

Assume i valori:

- 0 NO REPACKAGING
- 1 REPACKAGING TITOLI ITALIANI (emittente residente in Italia)
- 2 REPACKAGING TITOLI ESTERI (emittente non residente in Italia)

**CA010 PARTLY PAID**

Assume i valori:

- 1 SI
- 2 NO

**CA011 CREDITI PUBBLICA AMMINISTRAZIONE**

Indicare se le attività cartolarizzate sono in prevalenza formate da crediti verso la Pubblica Amministrazione.

Assume i valori:

- 1 SI
- 2 NO

**CA012 INDIRIZZO E-MAIL SVC****CA013 DATA CHIUSURA OPERAZIONE****CA014 MOTIVO CHIUSURA OPERAZIONE**

Assume i valori:

- 01 LIQUIDAZIONE TOTALE ATTIVI-PASSIVI DELLA OPERAZIONE
- 02 CESSIONE DEL PORTAFOGLIO RESIDUO A TERZI
- 99 ALTRO

**ORIGINATOR**

I campi da CA015 a CA020 dovranno essere valorizzati per ciascun originator con i relativi dati nominativi. Nel caso in cui un'originator ceda attività denominate in più di una valuta dovranno essere inseriti separatamente i dati relativi a ciascuna valuta.

Nel caso di operazione di cartolarizzazione multioriginator in cui i cedenti non sono soggetti vigilati e sono in numero superiore a 20, ovvero nel caso in cui l'originator sia un soggetto estero, il campo CA015 "Codice controparte cedente" deve essere impostato al valore convenzionale "9999999999" e gli altri campi andranno compilati con riferimento all'intera operazione e non ai singoli originator.

**CA015 CODICE CONTROPARTE CEDENTE**

Indicare il codice fiscale dell'originator.

**CA016 VALUTA ATTIVITÀ CEDUTE**

Indicare la valuta di denominazione in cui sono espressi valori delle attività cedute.

**CA017 VALORE ATTIVITÀ**

Indicare il valore delle attività cedute al momento della cessione iniziale, ossia al lordo delle eventuali svalutazioni (per le operazioni revolving o warehouse indicare l'ammontare iniziale delle attività cedute).

**CA018 DATA CESSIONE**

Indicare la data di cessione delle attività.

**CA019 VALORE CESSIONE**

Indicare il prezzo effettivo delle attività al momento della cessione iniziale (per le operazioni revolving o warehouse indicare il valore iniziale delle attività cedute).

**CA020 INDIRIZZO E-MAIL ORIGINATOR**

Il campo può non essere valorizzato se il campo CA015 "Codice controparte cedente" è uguale a "999999999995".

**SERVICER**

Il servicer è il soggetto incaricato dei servizi di cassa e di pagamento nonché della riscossione dei crediti ceduti. Le informazioni relative al servicer sono facoltative all'interno di questo messaggio, tali informazioni potranno essere comunicate successivamente, entro i termini previsti dal provvedimento della Banca d'Italia sulle cartolarizzazioni, attraverso il messaggio di "Comunicazione aggiornamento".

**CA021 CODICE SERVICER**

Codice fiscale del servicer.

**CA022 INDIRIZZO E-MAIL SERVICER****CA023 DATA INIZIO ATTIVITÀ**

Indicare la data di inizio dell'attività di servicing. La data di inizio attività di servicing deve essere successiva alla minima data di cessione dei crediti.

**CA024 DATA FINE ATTIVITÀ**

Indicare la data di fine dell'attività di servicing. La data di fine attività di servicing deve essere precedente alla data chiusura della cartolarizzazione.

**REPACKAGING****CA023 NUMERO OPERAZIONE REPACKAGING**

Indicare il numero operazione assegnato alle cartolarizzazioni i cui titoli sono oggetto di repackaging. Il campo deve essere valorizzato solo per i titoli ABS emessi da SVC residenti in Italia.

**DATI SPECIFICI ABS****AB001 NUMERO OPERAZIONE**

Solo per emittente residenti, indicare il numero operazione che identifica l'operazione di cartolarizzazione.

Il numero operazione per un'operazione di cartolarizzazione può essere richiesto dalle società veicolo regolarmente registrate nel relativo albo di vigilanza inviando l'apposito messaggio.

Tale codice identificativo permette di collegare tra loro i differenti codici ISIN associati ai differenti ranking (junior, mezzanine, senior) di una stessa operazione di cartolarizzazione.

#### **AB002 TRIGGER EVENT**

Indicare la presenza di clausole che consentono di chiudere anticipatamente le operazioni al verificarsi di eventi contrattualmente predefiniti.

Assume i valori :

- 0      CLAUSOLA NON PREVISTA
- 1      CLAUSOLA PREVISTA

#### **AB003 CALL OPTION**

Indicare se il veicolo di cartolarizzazione e/o il soggetto cedente gli attivi (originator) abbiano un'opzione che consenta di chiudere l'operazione prima della scadenza contrattuale.

Assume i valori:

- 0      OPZIONE NON PREVISTA
- 1      OPZIONE PREVISTA

#### **AB004 CLASSE**

#### **AB005 (\*) RANKING**

Assume i valori:

- 1      SENIOR
- 2      MEZZANINE
- 3      JUNIOR

## Dati Specifici Titoli di Capitale

### TC001 TIPOLOGIA AZIONI

Assume i valori:

- 03 AZIONI ORDINARIE
- 04 AZIONI SOCIO SOVVENTORE
- 05 AZIONI DI PARTECIPAZIONE COOPERATIVA
- 06 AZIONI SOCIO FINANZIATORE
- 07 AZIONI ORDINARIE CONVERTIBILI
- 08 AZIONI SPECIALI
- 09 AZIONI DI RISPARMIO
- 10 AZIONI DI RISPARMIO CONVERTIBILI
- 11 AZIONI PRIVILEGIATE
- 12 AZIONI PRIVILEGIATE CONVERTIBILI
- 13 STRUMENTI FINANZIARI DI PARTECIPAZIONE
- 14 STRUMENTI FINANZIARI EX ART 12 DL 185/2008
- 99 ALTRI TITOLI DI CAPITALE

### TC002 CATEGORIA AZIONI

Indicare, se presente, il nome identificativo della categoria di azioni quando per una stessa "tipologia azione" siano presenti titoli con diritti patrimoniali e/o amministrativi diversi (es. CAT A e CAT B).

### TC003 ASSENZA VALORE NOMINALE UNITARIO

Assume i valori:

- 0 VALORE NOMINALE UNITARIO PRESENTE
- 1 VALORE NOMINALE UNITARIO NON PRESENTE

### TC004 NUMERO AZIONI

Indicare il numero dei titoli azionari "**sottoscritti**" per ciascun titolo azionario identificato da un codice ISIN. Qualora il numero dei titoli sia stato deliberato ma non ancora sottoscritto deve essere indicato "0". Per i titoli di capitale non **quotati** su di un mercato regolamentato italiano l'emittente deve comunicare con messaggio di aggiornamento il numero dei titoli in circolazione e successive variazioni (aumenti o diminuzioni a seguito di eventi societari).

### TC005 VALORE NOMINALE COMPLESSIVO

Indicare il capitale sociale "**sottoscritto**" per ciascun titolo azionario identificato da un codice ISIN. Il valore nominale complessivo deve essere uguale al prodotto tra valore nominale unitario (se presente) e numero di azioni. Qualora il valore nominale complessivo sia stato deliberato ma non ancora sottoscritto deve essere indicato "0".

### TC006 DIRITTO DI VOTO

Indicare la tipologia di diritto di voto spettante al detentore del titolo azionario.

Quando il campo TC004 è uguale a "03 – AZIONI ORDINARIE" il diritto di voto viene impostato per default a "V", eventualmente modificabile.

Assume i valori:

- V AZIONE CON DIRITTO AD UN SOLO VOTO
- N AZIONE SENZA DIRITTO DI VOTO
- R AZIONE CON DIRITTO DI VOTO INFERIORE A UNO
- E AZIONE CON DIRITTO DI VOTO SUPERIORE A UNO
- X NON CONOSCIUTO O NON APPLICABILE

### TC007 QUOTA DI CAPITALE VERSATO



Assume i valori:

- F INTERAMENTE VERSATO
- O NON VERSATO
- P PARZIALMENTE VERSATO
- X NON CONOSCIUTO

#### **TC008 TIPO DIVIDENDO**

Per le azioni privilegiate e di risparmio convertibili o non convertibili e per le azioni ordinarie convertibili indicare il tipo di dividendo che viene distribuito (campo TC004 valorizzato uguale a "07", "09", "10", "11" o "12"). L'attributo riguarda il diritto sia alla ripartizione degli utili che al rimborso. Per le altre tipologie di azioni il tipo di dividendo viene impostato di default a "X".

Assume i valori:

- F DIVIDENDO PRESTABILITO PERIODICO
- C DIVIDENDO PRESTABILITO E RECUPERO  
(Azione che da diritto a dividendi prestabiliti e, per gli anni in cui non sono pagati, al recupero degli stessi in data futura comunque prima di pagare dividendi alle azioni ordinarie)
- P DIVIDENDO FISSO E PARTECIPAZIONE ULTERIORI DIVIDENDI E QUOTE DI CAPITALE  
(Azione che, in aggiunta al dividendo fisso, partecipa, con i possessori di azioni ordinarie, alla distribuzione di ulteriori dividendi e quote di capitale)
- Q DIVIDENDO PRESTABILITO, ULTERIORI DIVIDENDI IN PRESENZA DI SPECIFICHE CONDIZIONI E RECUPERO  
(Azione che da diritto a ulteriori dividendi, oltre a quello prestabilito, in presenza di specifiche condizioni. Per gli anni in cui non sono pagati, da diritto al recupero degli stessi in data futura comunque prima di pagare dividendi alle azioni ordinarie)
- A DIVIDENDO VARIABILE IN RELAZIONE AD UN CERTO RENDIMENTO
- N DIVIDENDO AZIONI ORDINARIE E ALTRI PRIVILEGI PER SCIoglimento SOCIETÀ  
(Azione che da diritto allo stesso dividendo delle azioni ordinarie ma con altri privilegi in caso di scioglimento della società)
- X NON CONOSCIUTO

#### **TC009 TIPO GODIMENTO**

Indicare se il possessore del titolo azionario beneficia dei diritti patrimoniali e amministrativi per l'intero esercizio contabile ("godimento regolare") o per una sua frazione, calcolata dalla data di attribuzione dei certificati azionari alla data di chiusura dell'esercizio contabile ("godimento non regolare").

Assume i valori:

- 0 GODIMENTO REGOLARE
- 1 GODIMENTO NON REGOLARE
- 9 NON CONOSCIUTO

#### **TC010 DATA INIZIO GODIMENTO PRO RATA**

Indicare, per le sole azioni a godimento non regolare (campo TC009 uguale a "1"), il giorno a partire dal quale il possessore del titolo azionario beneficia dei diritti patrimoniali e amministrativi.

#### **TC011 CONVERTIBILITÀ**

Assume i valori:

- 0 NON CONVERTIBILE
- 1 CONVERTIBILE

#### **TC012 RESTRIZIONI AL POSSESSO-TRASFERIMENTO**

Indicare se il titolo presenta restrizioni al possesso e/o al trasferimento.

Quando il campo TC004 è uguale a “03 – AZIONI ORDINARIE” o “07 – AZIONI ORDINARIE CONVERTIBILI” la valorizzazione del campo è obbligatoria. Per le altre tipologie di azioni il campo assume per default il valore “X”, eventualmente modificabile.

Assume i valori:

- T PRESENZA DI RESTRIZIONI
- U NON PRESENZA DI RESTRIZIONI
- X NON CONOSCIUTO

#### **TC013 DATA FINE RESTRIZIONE**

Indicare la data a partire dalla quale il detentore del titolo risulta liberato dalle restrizioni presenti.

#### **TC014 PREMIO FEDELTA' (BONUS SHARE)**

Indicare la presenza di premi legati al mantenimento della proprietà del titolo per un determinato periodo di tempo.

Assume i valori:

- 0 SENZA BONUS
- 1 CON BONUS

#### **TC015 DATA BONUS SHARE**

Indicare la data fino a cui il detentore del titolo deve mantenere senza soluzione di continuità la proprietà del titolo per aver diritto al premio fedeltà (c.d. bonus share).

## Dati Specifici Diritti

### DI001 TIPOLOGIA DIRITTO

Assume i valori:

- A DIRITTO DI ASSEGNAZIONE
- P DIRITTO DI ACQUISTO
- S DIRITTO DI SOTTOSCRIZIONE
- M ALTRI DIRITTI

Selezionare "A" quando il detentore ha diritto all'assegnazione gratuita di nuovi titoli in emissione, "P" quando ha diritto prioritario all'acquisto di titoli già emessi, "S" quando ha diritto prioritario alla sottoscrizione di nuovi titoli in emissione, "M" negli altri casi (es. diritto su azioni rivenienti da recesso, di attribuzione stock option, di assegnazione azioni proprie per distribuzione dividendi in azioni, di assegnazione di altro strumento finanziario, di vendita).

### DI002 DATA INIZIO ESERCIZIO

### DI003 DATA FINE ESERCIZIO

### DI004 RAPPORTO DI ESERCIZIO

Indicare il numero di diritti necessari per l'acquisizione di un'attività sottostante. Il rapporto deve essere espresso in formato alfanumerico con lunghezza massima di 19 caratteri (es. 3 obb cv X 2 dir).

### DI005 CEDOLA RAPPRESENTATIVA DEL DIRITTO

Indicare il numero della cedola corrente che rappresenta l'operazione societaria nell'ambito della quale il diritto viene emesso.

## Dati Specifici Warrant

### **WA001 NUMERO WARRANT EMESSI**

Indicare, se conosciuto al momento dell'emissione, il numero dei warrant offerti ai sottoscrittori alla data di emissione. Qualora al momento della richiesta ISN il numero dei warrant non sia conosciuto, il richiedente dovrà con successiva "Comunicazione di aggiornamento" indicare il numero dei warrant effettivamente emessi.

### **WA002 NUMERO TITOLI DI COMPENDIO**

Indicare, se conosciuto al momento dell'emissione, il numero dei titoli emessi al servizio dell'esercizio dei warrant qualora lo strumento finanziario di compendio (attività sottostante) sia rappresentato da titoli di capitale o di debito.

## Dati Specifici Investment Certificates

### CE001 CLASSE INVESTIMENTO

Assume i valori:

- A CLASSE A
- B CLASSE B

Selezionare "A" se il certificate replica l'andamento dell'attività sottostante (tracker o benchmark certificate), "B" altrimenti.

### CE002 MODALITÀ DI RIMBORSO

Assume i valori:

- E PAGAMENTO DETERMINATO AL MOMENTO DEL REGOLAMENTO
- F PAGAMENTO FISSO IN CONTANTI
- V PAGAMENTO VARIABILE IN CONTANTI
- S PAGAMENTO IN ATTIVITÀ
- C PAGAMENTO IN ATTIVITÀ E CONTANTI
- T PAGAMENTO IN ATTIVITÀ O CONTANTI
- M ALTRO
- X NON CONOSCIUTO/NON APPLICABILE

### CE003 DIVIDEND COUPON

Assume i valori:

- 0 NO
- 1 SI

Indicare se il titolo restituisce il rendimento dovuto all'erogazione di dividendi dal titolo sottostante.

### CE004 BARRIER OPTION

Assume i valori:

- KI KNOCK IN
- KO KNOCK OUT
- CO CORRIDOR
- AL ALTRO

## Dati Specifici Leverage Certificate e Covered Warrant

<b>LV001 TIPO DIPENDENZA DELLA BARRIERA</b>
---

Assume i valori:

- N BARRIERA LEGATA ALLO STRUMENTO
- T BARRIERA LEGATA AL SOTTOSTANTE
- M ALTRO

## Altri Dati Specifici

### AD001 TIPOLOGIA FACOLTÀ

Assume i valori:

- C CALL
- P PUT
- E ESOTICI
- BEAR BEAR
- BULL BULL
- CERT CERTIFICATES
- X NON CONOSCIUTO

Per la corretta valorizzazione del campo si veda il campo SF013 "Tipologia Strumento Finanziario".

### AD002 (\*) EUSIPA

Indicare la categoria EUSIPA di classificazione del titolo.

Per gli **investment certificates** assume i valori:

- 1100 UNCAPPED CAPITAL PROTECTION
- 1110 EXCHANGEABLE CERTIFICATES
- 1120 CAPPED CAPITAL PROTECTED
- 1130 CAPITAL PROTECTION WITH KNOCK-OUT
- 1140 CAPITAL PROTECTION WITH COUPON
- 1199 MISCELLANEOUS CAPITAL PROTECTION
- 1200 DISCOUNT CERTIFICATES
- 1210 BARRIER DISCOUNT CERTIFICATES
- 1220 REVERSE CONVERTIBLES
- 1230 BARRIER REVERSE CONVERTIBLES
- 1240 CAPPED OUTPERFORMANCE CERTIFICATES
- 1250 CAPPED BONUS CERTIFICATES
- 1260 EXPRESS CERTIFICATES
- 1299 MISCELLANEOUS YIELD ENHANCEMENT
- 1300 TRACKER CERTIFICATES
- 1310 OUTPERFORMANCE CERTIFICATES
- 1320 BONUS CERTIFICATES
- 1330 OUTPERFORMANCE BONUS CERTIFICATES
- 1340 TWIN-WIN CERTIFICATES
- 1399 MISCELLANEOUS PARTICIPATION
- 1440 CREDIT LINKED LINEAR
- 1450 CREDIT LINKED EQUITY TRANCHE
- 1460 CREDIT LINKED MEZZ/SENIOR TRANCHE

Per i **leverage certificates** assume i valori:

- 2200 KNOCK-OUT WARRANTS
- 2205 OPEN-END KNOCK-OUT WARRANTS
- 2210 MINI-FUTURES
- 2299 MISCELLANEOUS LEVERAGE WITH KNOCK-OUT
- 2300 CONSTANT LEVERAGE CERTIFICATES
- 2399 MISCELLANEOUS CONSTANT LEVERAGE PRODUCTS

Per i **covered warrant** assume i valori:

- 2100 WARRANTS
- 2110 SPREAD WARRANTS
- 2199 MISCELLANEOUS LEVERAGE WITHOUT KNOCK-OUT
- 2230 DOUBLE KNOCK-OUT WARRANTS
- 2299 MISCELLANEOUS LEVERAGE WITH KNOCK-OUT

### AD003 MODALITÀ ESERCIZIO

Assume i valori:

- A AMERICANO
- E EUROPEO
- P PERIODICO/BERMUDAN

**AD005 (\*) ATTIVITÀ SOTTOSTANTE**

Indicare l'attività sottostante da cui dipende il prezzo dello strumento finanziario.

Per gli investment **certificates** assume i valori:

- S AZIONI
- D TITOLI DI DEBITO
- O TITOLI DI STATO
- R PARTI DI OICR
- C VALUTE E TASSI DI CAMBIO
- I INDICI
- T MERCI
- F ALTRI STRUMENTI FINANZIARI
- M ALTRE ATTIVITÀ
- Z PANIERE DI AZIONI E INDICI
- N PANIERE DI TITOLI DI DEBITO
- V PANIERE VALUTE E TASSI DI CAMBIO
- B PANIERE DI ATTIVITÀ
- Y TASSI DI INTERESSE
- X NON CONOSCIUTO

Per i **leverage certificates** e i **covered warrant** assume i valori:

- S AZIONI
- D TITOLI DI DEBITO E TASSI DI INTERESSE
- O TITOLI DI STATO
- R PARTI DI OICR
- C VALUTE E TASSI DI CAMBIO
- I INDICI
- T MERCI
- F ALTRI STRUMENTI FINANZIARI
- M ALTRE ATTIVITÀ
- Z PANIERE DI AZIONI E INDICI
- N PANIERE DI TITOLI DI DEBITO
- V PANIERE VALUTE E TASSI DI CAMBIO
- B PANIERE DI ATTIVITÀ
- X NON CONOSCIUTO

Per i **diritti** assume i valori:

- S AZIONI ORDINARIE
- C AZIONI ORDINARIE CONVERTIBILI
- P AZIONI PRIVILEGIATE E DI RISPARMIO (PREFERRED/PREFERENCE SHARES)
- F AZIONI PRIVILEGIATE E DI RISPARMIO CONVERTIBILI (PREFERRED/PREFERENCE CV SHARES)
- B TITOLI DI DEBITO
- I STRUMENTI MISTI
- O ALTRO
- X NON APPLICABILE

Per i **warrant** assume i valori:

- S AZIONI
- D TITOLI DI DEBITO E TASSI DI INTERESSE
- O TITOLI DI STATO
- R PARTI DI OICR
- T MERCI
- X NON CONOSCIUTO



**AD006 DESCRIZIONE ATTIVITÀ SOTTOSTANTE**

Indicare la descrizione dello strumento finanziario sottostante.

**AD007 CODICE ISIN TITOLO COLLEGATO**

Indicare il codice ISIN dell'attività sottostante quando il campo AD005 "Attività sottostante" è pari a "S", "C", "O" o "D".

Qualora l'attività sottostante non risulti presente in base dati, se la Banca d'Italia è Agenzia Nazionale di Codifica competente per il sottostante<sup>13</sup> va inviato messaggio di "Richiesta codifica ISIN", in caso contrario va inviata una richiesta di inserimento in base dati tramite email alla casella FE129@bancaditalia.it.

**AD008 MULTIPLIO**

Indicare, se applicabile, il numero di strumenti finanziari associati all'esercizio dell'opzione.

**AD009 (\*) DATA EMISSIONE**

Per i **warrant** indicare la data in cui il warrant viene emesso o in alternativa la minima data di esercizio. Per gli altri titoli indicare la data di emissione.

**AD010 (\*) VALUTA EMISSIONE**

Indicare la valuta in cui è espresso il prezzo di offerta del titolo sul mercato primario.

**AD011 (\*) PREZZO EMISSIONE**

Indicare il prezzo di offerta del titolo sul mercato primario secondo il campo AD012 "Base Quotazione".

**AD012 BASE QUOTAZIONE**

Indicare l'unità di misura in cui è espresso il prezzo di emissione.

Assume i valori:

- P PERCENTUALE
- U UNITÀ

**AD013 NUMERO CERTIFICATI EMESSI****AD014 VALUTA PREZZO ESERCIZIO-DENOMINAZIONE**

Indicare la valuta in cui è espresso il prezzo di esercizio.

**AD015 PREZZO ESERCIZIO**

Per i **warrant** indicare, se previsto all'emissione, il prezzo che verrà regolato all'esercizio del warrant per acquistare l'attività sottostante. Per gli altri titoli indicare il prezzo al quale è possibile esercitare la facoltà associata a un'opzione.

**AD016 ESERCIZIO ANTICIPATO**

Assume i valori:

- 0 ASSENTE
- 1 PREVISTA

**AD017 DATA INIZIO DIFFUSIONE**

Indicare la data a decorrere dalla quale le informazioni sul titolo sono diffondibili.

<sup>13</sup> Per approfondimenti si rinvia al documento "[Condizioni di utilizzo del Servizio di Codifica](#)" disponibile sul sito web della Banca d'Italia.

Quando "Tipo documentazione" è uguale a "1- Documentazione provvisoria" la data è posta per default uguale a "31/12/2099" (codice non diffondibile).

Quando "Tipo documentazione" è uguale a "2- Documentazione definitiva", il richiedente deve indicare la data a partire dalla quale il titolo è diffondibile.

**Il codice ISIN viene diffuso solo in presenza di documentazione definitiva.**

## Altri Campi

### ME001 TIPO AGGIORNAMENTO

Assume i valori:

- 2 VARIAZIONE
- 5 CORREZIONE

Selezionare: "2 - VARIAZIONE" se la modifica che si intende comunicare ha effetto a partire da una specifica data di decorrenza (da indicare obbligatoriamente nel campo ME002 "Decorrenza variazione"), "5 - CORREZIONE" se la modifica ha effetto su tutta la vita del titolo.

### ME002 DECORRENZA VARIAZIONE

Si veda il campo ME001.

### ME003 STATO 129

Il campo viene valorizzato automaticamente dall'applicazione e riporta lo stato di avanzamento delle segnalazioni 129 per il titolo selezionato.

Nei messaggi di richiesta/censimento ISIN il valore del campo viene determinato al momento del salvataggio sulla base dei dati forniti, nei messaggi di aggiornamento il valore mostrato è quello risultante dall'ultima comunicazione precedentemente effettuata.

Assume i valori:

- 0 NON DOVUTA
- 1 DA INIZIARE
- 2 SEZIONI COMPLETATE: 1
- 3 SEZIONI COMPLETATE: 1, 2-3
- 4 SEZIONI COMPLETATE: 1, 2-3, 4
- 9 NON CONOSCIUTO
- X SEZIONI COMPLETATE: SOLO 4

## Compilazione messaggi tramite caricamento file

Entrambe le applicazioni FEAT e FE129 in determinati casi consentono all'utente il caricamento dei dati anche attraverso l'importazione di file csv. La predisposizione di un file csv formalmente corretto può essere effettuata scaricando, modificando e importando nell'applicazione il tracciato relativo ad un'attività precedentemente predisposta manualmente e salvata senza errori.

Per assicurare la correttezza formale del file csv si consiglia di seguire i seguenti step<sup>14</sup>:

1. selezionare una delle attività già consegnate o in corso di lavorazione;
2. scaricare l'attività in formato csv (solo per messaggi non massivi);
3. modificare/integrare i dati in essa contenuti;
4. importare il file opportunamente modificato mantenendone il formato originale (csv).

In aggiunta, in alternativa a quanto appena detto, per talune categorie di messaggi esiste anche la possibilità di generare il csv utilizzando un tool excel chiamato '*csv-txt generator*' scaricabile dalle applicazioni FEAT o FE129.

Si riporta nelle seguenti tabelle la mappatura dei messaggi compilabili tramite importazione csv per le differenti tipologie di strumento finanziario e ruolo.

Legenda:

- **Y**: csv importabile;
- **N**: csv non importabile;
- **Y (+gen)**: csv importabile e generabile attraverso il '*csv-txt generator*';
- **N (+gen)**: csv non importabile ma txt generabile attraverso il '*csv-txt generator*' per essere allegato ad un messaggio di 'Comunicazione generica'<sup>15</sup>.

### Messaggi FEAT compilabili con csv

#### TITOLI DI DEBITO

TIPO MESSAGGIO	Emittente	Collocatore	Segnalante
Richiesta ISIN	Y	Y	
Richiesta ISIN con dati definitivi	Y		Y
Censimento ISIN	Y		
Comunicazione dati definitivi	N	N	
Comunicazione aggiornamento	N	N	
Comunicazione cedole	Y	Y	
Comunicazione aggiornamento informazioni sul collocamento	N		
Comunicazione rimborsi	Y	Y	

#### TITOLI DI DEBITO: ABS e CDO

TIPO MESSAGGIO	Emittente	Collocatore	Segnalante
Richiesta ISIN	Y	Y	
Censimento ISIN	Y	Y	
Comunicazione dati definitivi	N	N	
Comunicazione aggiornamento	N	N	
Comunicazione collocato	Y	Y	
Comunicazione cedole	Y	Y	
Comunicazione aggiornamento informazioni sul collocamento	N		
Comunicazione rimborsi	Y	Y	

<sup>14</sup> Per le modalità della funzione di esportazione/importazione si rinvia al "[Manuale Operativo FEAT/FE129](#)".

<sup>15</sup> Per maggiori informazioni contattare l'helpdesk.

**TITOLI DI CAPITALE**

TIPO MESSAGGIO	Emittente	Collocatore	Segnalante
Richiesta ISIN	Y		Y
Comunicazione aggiornamento	N		N

**DIRITTI**

TIPO MESSAGGIO	Emittente	Collocatore	Segnalante
Richiesta ISIN	Y		Y
Comunicazione aggiornamento	N		N

**WARRANT**

TIPO MESSAGGIO	Emittente	Collocatore	Segnalante
Richiesta ISIN	Y		Y
Comunicazione aggiornamento	N		N

**INVESTMENT CERTIFICATES**

TIPO MESSAGGIO	Emittente	Collocatore	Segnalante
Richiesta ISIN	Y	Y	
Censimento ISIN	Y	Y	
Comunicazione dati definitivi	N	N	
Comunicazione aggiornamento	N	N	
Comunicazione cedole	Y	Y	

**COVERED WARRANT, LEVERAGE CERTIFICATES, ETC, ETN**

TIPO MESSAGGIO	Emittente	Collocatore	Segnalante
Richiesta ISIN massiva	Y (+gen)		
Comunicazione dati definitivi massiva	Y (+gen)		
Comunicazione aggiornamento singolo	N		

**NUMERO OPERAZIONE CARTOLARIZZAZIONE**

TIPO MESSAGGIO	Emittente	Collocatore	Segnalante
Richiesta numero operazione	Y		
Comunicazione aggiornamento	Y		
Comunicazione chiusura operazione	N		

**QUOTAZIONE**

TIPO MESSAGGIO	Emittente	Collocatore	Segnalante
Comunicazione quotazione	Y	Y	Y

## Messaggi FE129 compilabili con csv

### TITOLI DI DEBITO

TIPO MESSAGGIO	Emittente	Collocatore	Capogruppo
Richiesta ISIN	Y		Y
Richiesta ISIN con dati definitivi e info anagrafiche 129 (sez. 1)	Y		Y
Censimento ISIN per segnalazione 129 - sezione 4		Y	
Censimento ISIN e info anagrafiche 129 (sez. 1)	Y	N	Y
Comunicazione dati definitivi e info anagrafiche 129 (sez. 1)	N	N	N
Comunicazione info anagrafiche 129 (sez. 1)	N	N	N
Comunicazione info anagrafiche 129 (sez. 2-3)	N	N	N
Comunicazione cedole	Y	Y	Y
Comunicazione aggiornamento informazioni sul collocamento	N		
Comunicazione collocato (sez. 4)	Y	N	Y
Comunicazione rimborsi anticipati (sez. 4)	Y		Y

### TITOLI DI DEBITO: ABS e CDO

TIPO MESSAGGIO	Emittente	Collocatore	Capogruppo
Richiesta ISIN	Y		Y
Censimento ISIN per segnalazione 129 - sezione 4		Y	
Censimento ISIN e info anagrafiche 129 (sez. 1)	Y	N	Y
Comunicazione dati definitivi e info anagrafiche 129 (sez. 1)	N	N	N
Comunicazione info anagrafiche 129 (sez. 1)	N	N	N
Comunicazione info anagrafiche 129 (sez. 2-3)	N	N	N
Comunicazione cedole	Y	Y	Y
Comunicazione aggiornamento informazioni sul collocamento	N		
Comunicazione collocato (sez. 4)	Y	N	Y
Comunicazione rimborsi anticipati (sez. 4)	N (+gen)		N (+gen)

### INVESTMENT CERTIFICATES

TIPO MESSAGGIO	Emittente	Collocatore	Capogruppo
Richiesta ISIN massiva	Y (+gen)		
Censimento ISIN massivo e info anagrafiche 129 (sez. 1)	Y (+gen)	N	Y (+gen)
Comunicazione massiva dati definitivi e info anagrafiche 129 (sez. 1)	Y (+gen)		
Comunicazione massiva info anagrafiche 129 (sez. 1)	Y (+gen)	N	Y (+gen)
Comunicazione massiva info anagrafiche 129 (sez. 2-3)	Y (+gen)	Y (+gen)	Y (+gen)
Comunicazione cedole	Y	Y	Y

### COVERED WARRANT, LEVERAGE CERTIFICATES, ETC, ETN

TIPO MESSAGGIO	Emittente	Collocatore	Capogruppo
Richiesta ISIN massiva	Y (+gen)		
Censimento ISIN massivo e info anagrafiche 129 (sez. 1)	Y (+gen)	Y (+gen)	Y (+gen)
Comunicazione massiva dati definitivi e info anagrafiche 129 (sez. 1)	Y (+gen)		
Comunicazione massiva info anagrafiche 129 (sez. 1)	Y (+gen)	Y (+gen)	Y (+gen)
Comunicazione massiva info anagrafiche 129 (sez. 2-3)	Y (+gen)	Y (+gen)	Y (+gen)

## SEGNALAZIONE TRIMESTRALE

TIPO MESSAGGIO	Emittente	Collocatore	Capogruppo
Comunicazione informazioni quantitative Certificates, CW, ETC e ETN (sez. 4)	Y (+gen)	N (+gen)	Y (+gen)

Segnalazioni trimestrali con ruolo emittente o capogruppo per più di 50 titoli devono essere inviate tramite comunicazione generica.

## QUOTAZIONE

TIPO MESSAGGIO	Emittente	Collocatore	Capogruppo
Comunicazione quotazione	Y	Y	Y

## NUMERO OPERAZIONE CARTOLARIZZAZIONE

TIPO MESSAGGIO	Emittente	Collocatore	Capogruppo
Richiesta numero operazione	Y		
Comunicazione aggiornamento	Y		
Comunicazione chiusura operazione	N		

Le tipologie di flussi generabili attraverso il 'csv-txt generator' sono riportati nella seguente tabella.

Tipologia Strumento Finanziario	Applicazione	Codice Flusso	Messaggi
<b>TITOLI DI DEBITO</b>	FE129	FEAT_219	Comunicazione rimborsi anticipati 129 (sez. 4)
<b>INVESTMENT CERTIFICATES</b>	FE129	FEAT_209	Richiesta ISIN
		FEAT_205	Censimento ISIN e info anagrafiche 129 (sez. 1)
		FEAT_206	Comunicazione dati definitivi e info anagrafiche 129 (sez. 1)
		FEAT_216	Comunicazione info anagrafiche 129 (sez. 1)
		FEAT_217	Comunicazione info anagrafiche 129 (sez. 2-3)
<b>COVERED WARRANTS, LEVERAGE CERTIFICATES, ETC, ETN</b>	FEAT	FEAT_421	Richiesta ISIN
		FEAT_423	Comunicazione dati definitivi
	FE129	FEAT_401	Richiesta ISIN
		FEAT_402	Censimento ISIN e info anagrafiche 129 (sez. 1)
		FEAT_403	Comunicazione dati definitivi e info anagrafiche 129 (sez. 1)
		FEAT_405	Comunicazione info anagrafiche 129 (sez. 1)
		FEAT_417	Comunicazione info anagrafiche 129 (sez. 2-3)
<b>SEGNAL. TRIMESTRALE</b>	FE129	FEAT_98	Comunicazione informazioni quantitative Certificates, CW, ETC e ETN (sez. 4)