



**“Operazioni di Mercato Aperto dell’Eurosistema.
Specifiche per gli Operatori”**

giugno 2020

Sommario

INTRODUZIONE.....	5
ASPETTI DI CARATTERE GENERALE	5
A. OPERAZIONI DI MERCATO APERTO - OPERAZIONI DI RIFINANZIAMENTO TEMPORANEE	6
1. CARATTERISTICHE PROCEDURALI NELLE OPERAZIONI DI MERCATO APERTO SVOLTE ATTRAVERSO PROCEDURA DI ASTA	6
1.1 ANNUNCIO DELL'OPERAZIONE DA PARTE DELLA BANCA D'ITALIA E RICEZIONE DELLE PARTECIPAZIONI DELLE CONTROPARTI	7
1.2 COMUNICAZIONE AI PARTECIPANTI DEI RISULTATI DELL'ASTA	7
1.3 COMUNICAZIONE ALLE CONTROPARTI DEL VALORE DA GARANTIRE PER LA SPUNTA E RICEZIONE DALLE CONTROPARTI DELL'ACCETTAZIONE	8
1.4 REGOLAMENTO DELLE OPERAZIONI DI MERCATO APERTO	9
2. DESCRIZIONE DEI MESSAGGI VIA RETE NAZIONALE INTERBANCARIA (RNI).....	10
2.1 ASTA TELEMATICA	10
2.2 SPUNTA TELEMATICA	11
3. PRESUPPOSTI PER L'UTILIZZO DEI MESSAGGI RNI.....	12
4. CONTROLLI EFFETTUATI SUI MESSAGGI RNI	13
5. SPECIFICHE TECNICHE DEI MESSAGGI RNI.....	14
5.1 MESSAGGIO 6E0: ANNUNCIO OPERAZIONE PUBBLICA	14
5.1.1. TRACCIATO.....	14
5.1.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E0	16
5.2 MESSAGGIO 6E1: PARTECIPAZIONE ALL'ASTA.....	20
5.2.1 TRACCIATO.....	20
5.2.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E1	21
5.2.3 VARIAZIONE DELLE PARTECIPAZIONI.....	23
5.2.4 ANNULLAMENTO DELLE PARTECIPAZIONI.....	24
5.2.5 RILIEVI SEGNALATI SUL MESSAGGIO 6E1 A FRONTE DEI CONTROLLI.....	25
5.3 MESSAGGIO 6E2: CONFERMA RICEZIONE PARTECIPAZIONE.....	26
5.3.1 TRACCIATO.....	26
5.3.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E2	27
5.4 MESSAGGIO 6E3: COMUNICAZIONE RISULTATI DI ASTA.....	28
5.4.1 TRACCIATO.....	28
5.4.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E3	29

5.5 MESSAGGIO 6E6: COMUNICAZIONE DI ANNULLAMENTO ASTA	31
5.5.1 TRACCIATO.....	31
5.5.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E6	32
5.6 MESSAGGIO 6E7: DATI ESEGUITO PER LA SPUNTA	33
5.6.1 TRACCIATO.....	33
5.6.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E7	35
5.7 MESSAGGIO 6E8: ACCETTAZIONE DATI ESEGUITO	40
5.7.1 TRACCIATO.....	40
5.7.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E8	41
5.7.3 RILIEVI SEGNALATI SUL MESSAGGIO 6E8 A FRONTE DEI CONTROLLI	42
5.8 MESSAGGIO 6E9: CONFERMA RICEZIONE ACCETTAZIONE DATI ESEGUITO	43
5.8.1 TRACCIATO.....	43
5.8.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E9	44
B. RICHIESTE DI RIMBORSO ANTICIPATO VOLONTARIO SU OPERAZIONI DI RIFINANZIAMENTO A PIU'	
LUNGO TERMINE	45
1. DESCRIZIONE DEI MESSAGGI VIA RNI	45
1.1 PROCEDURA TELEMATICA	45
1.2 SPUNTA TELEMATICA	46
1.2.1 DESCRIZIONE DEI MESSAGGI 6E7 PER RIMBORSO	46
1.2.2 REGOLAMENTO	47
2. MESSAGGIO 6E0: ANNUNCIO	48
2.1 TRACCIATO.....	48
2.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E0	50
3. MESSAGGIO 6E1: RICHIESTA DI RIMBORSO	53
3.1 TRACCIATO.....	53
3.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E1	54
3.3 VARIAZIONE DELLA RICHIESTA	56
3.4 ANNULLAMENTO DELLA RICHIESTA	56
3.5 RILIEVI SEGNALATI SUL MESSAGGIO 6E1 A FRONTE DEI CONTROLLI.....	57
4 MESSAGGIO 6E2: CONFERMA RICEZIONE RICHIESTA.....	58
4.1 TRACCIATO.....	58
4.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E2	59
5 MESSAGGIO 6E7: DATI ESEGUITO PER LA SPUNTA DI RICHIESTA DI RIMBORSO	60
6 MESSAGGIO 6E8: ACCETTAZIONE DATI ESEGUITO PER RICHIESTA DI RIMBORSO	60

7	MESSAGGIO 6E9: CONFERMA RICEZIONE ACCETTAZIONE DATI ESEGUITO PER RICHIESTA DI RIMBORSO	60
C.	CRITTOGRAFIA E AUTENTICAZIONE	61
1.	CRITTOGRAFIA	61
2.	AUTENTICAZIONE	63
3.	ESEMPI	64

INTRODUZIONE

ASPETTI DI CARATTERE GENERALE

La politica monetaria nell'area dell'euro viene condotta dall'Eurosistema in modo unitario, utilizzando strumenti e procedure uniformi (cfr. Capitolo II della Guida operatori).

Il presente documento, allegato al “Contratto quadro per le operazioni di mercato aperto”, costituisce parte integrante delle norme che regolano le operazioni di mercato aperto svolte dalla Banca d'Italia con le controparti insediate nel territorio italiano; le citate operazioni sono disciplinate, altresì dalle “Condizioni generali di contratto per le operazioni di politica monetaria”.

Nel documento è descritta la procedura che viene seguita in Italia per le operazioni di mercato aperto svolte mediante asta - sia di rifinanziamento¹ (es. rifinanziamento principali, di seguito MRO, LTRO e altre operazioni temporanee di immissione di liquidità), sia di drenaggio della liquidità (es. depositi a tempo determinato² e certificati di debito della BCE) - e per i rimborsi anticipati volontari.

Tale procedura è altresì utilizzata, limitatamente ai soli messaggi di spunta, in alcune operazioni a titolo definitivo svolte “*over the counter*” (operazioni OTC).

Le operazioni di mercato aperto svolte tramite asta e le richieste di rimborso anticipato su base volontaria (*early repayment* o ER) sono gestite tramite una procedura telematica che si avvale della Rete Nazionale Interbancaria (di seguito RNI). L'adesione alla RNI è pertanto un requisito obbligatorio stabilito dalla Banca d'Italia, *inter alia*, per l'acquisizione da parte di un intermediario bancario dello *status* di controparte di operazioni di mercato aperto.

È previsto che, nei casi di malfunzionamento generale della RNI o nei casi in cui eccezionalmente la controparte non riesca a comunicare con la Banca d'Italia via RNI, la controparte stessa possa presentare offerte telefoniche, seguite da una conferma secondo quanto previsto dal Capitolo II della Guida operatori e dal Contratto quadro per le operazioni di mercato aperto.

¹ In Italia le operazioni di rifinanziamento sono effettuate mediante la stipula di contratti di finanziamento con garanzia su attività idonee.

² In particolare, per le operazioni di raccolta di depositi a tempo determinato, viene utilizzato un codice convenzionale per l'individuazione del deposito (in analogia a quanto avviene per i titoli) pari a IT7777777774.

A. OPERAZIONI DI MERCATO APERTO - OPERAZIONI DI RIFINANZIAMENTO TEMPORANEE

Le principali caratteristiche che riguardano le operazioni di rifinanziamento temporanee (*liquidity providing*) sono così sintetizzabili:

- Υ le aste possono essere sia a tasso fisso sia a tasso variabile. In quest'ultimo caso saranno, di norma, consentite offerte multiple fino a un massimo di 10;
- Υ la Banca effettua operazioni di finanziamento garantite da attività idonee rispondenti ai criteri e alle regole in materia di valutazione e controllo dei rischi disciplinati nelle Regole per l'attuazione della politica monetaria o in altri atti normativi della BCE;
- Υ l'importo dell'offerta presentata in asta deve essere riferito all'ammontare del finanziamento richiesto³; l'ammontare delle attività idonee costituite in garanzia deve essere sufficiente a garantire i complessivi finanziamenti in essere a nome della controparte. Al finanziamento assegnato può essere inoltre sommato un margine iniziale, la cui misura è determinata in base alla durata dell'operazione e che è calcolato in percentuale dell'importo assegnato;
- Υ con cadenza giornaliera, per ogni controparte, la Banca verifica la congruità del valore complessivo delle garanzie (valore cauzionale del *pool*) presenti nel conto *pool* della controparte. Nel caso in cui il valore cauzionale del *pool* - determinato applicando alle attività idonee le valutazioni più recenti - scenda al di sotto dell'importo complessivo del totale dei finanziamenti in essere, comprensivi degli interessi maturati, la controparte è chiamata a reintegrare il valore delle garanzie.

1. CARATTERISTICHE PROCEDURALI NELLE OPERAZIONI DI MERCATO APERTO SVOLTE ATTRAVERSO PROCEDURA DI ASTA

Le operazioni di mercato aperto svolte attraverso procedura di asta possono essere effettuate attraverso aste standard o aste veloci.

Le procedure di asta per le operazioni regolari sono eseguite in conformità al calendario indicativo delle operazioni di asta regolari dell'Eurosistema. Il calendario indicativo delle operazioni di asta regolari dell'Eurosistema è pubblicato sul sito internet della BCE e della Banca d'Italia almeno tre mesi prima dell'inizio dell'anno civile cui si riferisce; esse si svolgono, di norma, nell'arco di 24 ore dall'ora di annuncio dell'asta da parte della BCE alla fase di annuncio dei risultati. Le aste veloci vengono invece effettuate in giorni ed in orari non noti a priori e si svolgeranno, di norma, nell'arco di 105 minuti. Per i dettagli si rimanda al Capitolo II della presente Guida.

Vengono di seguito illustrate le singole attività di interesse per gli operatori e i tracciati record dei messaggi RNI utilizzati nelle diverse fasi nell'ambito delle operazioni di mercato aperto.

³ Nelle operazioni di impiego basate sulla raccolta dei depositi a tempo l'importo oggetto dell'offerta in asta è quello da regolare e cioè l'importo impiegato dalla controparte; alla scadenza sarà rimborsato il capitale comprensivo dell'interesse maturato. Nel caso di emissione di certificati di debito, oggetto dell'offerta sarà il capitale nominale del titolo.

1.1 ANNUNCIO DELL'OPERAZIONE DA PARTE DELLA BANCA D'ITALIA E RICEZIONE DELLE PARTECIPAZIONI DELLE CONTROPARTI

Questa funzione prevede l'invio da parte della BI del messaggio 6E0, che contiene le informazioni sulle caratteristiche dell'asta, a tutte le controparti autorizzate a partecipare all'operazione. Le stesse informazioni possono essere rese pubbliche dalla BCE e dalla Banca d'Italia attraverso altri mezzi di comunicazione.

Dal momento dell'apertura dell'asta e fino all'ora di *cut-off* comunicata nell'annuncio dell'asta stessa, le controparti possono inviare alla Banca le proprie richieste di partecipazione con il messaggio 6E1.

Le controparti possono variare la partecipazione comunicata inviando un nuovo messaggio di partecipazione, sempre entro l'ora di *cut-off*: i dati dell'ultimo messaggio arrivato sostituiscono quelli precedenti. Più precisamente, per effettuare la variazione la procedura confronta la coppia data/ora di riferimento (inserito a cura della controparte) del nuovo messaggio 6E1 con quella del messaggio 6E1 già pervenuto: se la coppia data/ora dell'ultimo messaggio è maggiore della precedente allora il nuovo messaggio è accettato e i relativi dati sostituiscono quelli del messaggio giunto in precedenza. In caso contrario il nuovo messaggio è trattato come errato.

Ai soli messaggi di partecipazione formalmente corretti la Banca d'Italia invia un messaggio 6E2; le controparti devono verificare tempestivamente la ricezione di tale messaggio al fine di accertare che loro partecipazione sia pervenuta regolarmente. I messaggi di partecipazione errati vengono invece rispediti al mittente in categoria RE01, esplicitando anche il tipo di errore commesso; al riguardo, i messaggi giunti prima dell'annuncio dell'asta e oltre l'ora di *cut-off* sono rifiutati e rispediti in categoria RE01.

Va precisato che in caso di impossibilità per la controparte di utilizzare la RNI, la controparte stessa può presentare alla Banca d'Italia (Servizio OPM – Divisione OPMC) - sempre entro l'orario di *cut-off* – un'offerta per via telefonica con successiva conferma da effettuare secondo quanto previsto dal Capitolo II della Guida operatori e dal Contratto quadro per le operazioni di mercato aperto. In questo caso non saranno accettati eventuali messaggi di partecipazione via RNI pervenuti dopo la presentazione dell'offerta telefonica; saranno invece regolarmente trattati gli altri messaggi (es. quelli relativi alla spunta dei contratti).

In caso di persistente difficoltà nell'utilizzo della RNI, si ricorrerà a procedure manuali anche per i messaggi successivi di spunta dei contratti.

1.2 COMUNICAZIONE AI PARTECIPANTI DEI RISULTATI DELL'ASTA

Alla chiusura dell'operazione seguono varie attività, a carico delle BCN e della BCE, volte alla definizione dei risultati dell'operazione stessa e alla determinazione delle partecipazioni assegnatarie.

I risultati sono comunicati dalla BI, con il messaggio 6E3, a tutte le controparti che hanno partecipato all'asta indipendentemente dal fatto che siano risultate assegnatarie o meno; in quest'ultimo caso l'importo assegnato avrà valore zero.

L'annuncio dei risultati viene, inoltre, divulgato attraverso i mezzi di diffusione al pubblico ritenuti più idonei dalla BCE e dalla Banca d'Italia.

L'eventuale annullamento dell'asta da parte della BCE sarà comunicato dalla Banca d'Italia con il messaggio 6E6 a tutte le controparti alle quali era stato inviato l'annuncio della stessa.

1.3 COMUNICAZIONE ALLE CONTROPARTI DEL VALORE DA GARANTIRE PER LA SPUNTA E RICEZIONE DALLE CONTROPARTI DELL'ACCETTAZIONE

Nel giorno di regolamento previsto per l'operazione di mercato aperto, la Banca d'Italia comunica alle controparti l'importo che deve essere garantito.

Eventuali problemi in questa fase, derivanti dall'incompletezza dei dati, possono comportare la necessità di interventi che richiedono la cooperazione tra gli operatori e la Banca d'Italia per la loro soluzione. In particolare, qualora il valore cauzionale residuo del *pool* di garanzie intestato alla controparte risulti insufficiente a coprire l'importo complessivo dei finanziamenti in essere (comprensivi degli eventuali margini iniziali), la Banca d'Italia contatterà la controparte richiedendo l'integrazione del *pool*.

I dati del valore da garantire vengono trasmessi dalla Banca d'Italia alle controparti con il messaggio 6E7, che riporta tra l'altro anche il parametro di asta (tasso/prezzo) rilevante per i conteggi dell'operazione a termine. Qualora tale parametro non fosse noto al momento dell'asta, il 6E7 riferito al termine dell'operazione di mercato aperto riporterà un valore puramente indicativo. In particolare, per alcune tipologie di LTRO, il tasso effettivo potrà essere reso noto solo al momento del regolamento del termine.

La Banca d'Italia, nel 6E7 inviato entro il giorno del regolamento del pronti, riporterà le specifiche dell'operazione sulla base del parametro di riferimento al momento dell'annuncio. Entro la data della scadenza dell'operazione, quando il parametro effettivo dell'operazione sarà noto, la Banca d'Italia provvederà a inviare un nuovo messaggio 6E7 per il successivo regolamento dell'importo a scadenza determinato sulla base dei parametri modificati. In caso di parametro definito come tasso di interesse, esso è arrotondato alla cifra decimale stabilita per ciascun caso dall'Eurosistema⁴. Tale messaggio 6E7 riporterà il tasso effettivo indicativo troncato alla sesta cifra decimale. Le controparti provvedono a calcolare il tasso effettivo dell'operazione sulla base di tali regole. Nel caso in cui la controparte si avvalga di un intermediario per il regolamento del contante delle operazioni di mercato aperto, il messaggio 6E7 viene inviato, con gli opportuni adattamenti, anche all'intermediario.

La banca e l'eventuale intermediario regolante prendono atto e confermano in via telematica i dettagli dell'operazione trasmessi con il 6E7, inviando l'apposito messaggio 6E8 (laddove previsto). In tal caso la controparte riceverà un messaggio di conferma della ricezione da parte della Banca d'Italia (messaggio 6E9). La struttura dello scambio dei messaggi è la medesima anche per i contratti originati da operazioni bilaterali OTC.

Qualora la controparte rilevi discrepanze nei conteggi rispetto alle proprie evidenze, è tenuta a contattare la Banca d'Italia - Servizio RFP- Divisione Regolamento Operazioni di mercato per esporre le anomalie rilevate.

1.4 REGOLAMENTO DELLE OPERAZIONI DI MERCATO APERTO

Le controparti che partecipano a operazioni di rifinanziamento con la Banca d'Italia devono aver preventivamente costituito, direttamente o indirettamente, sufficienti garanzie nel conto *pool* presso la Banca d'Italia ad esse intestato. Per le caratteristiche e il funzionamento del *pool* di garanzie si veda il documento "Conti di deposito titoli-Guida per gli operatori (Guida CAT)" disponibile sul sito *web* della Banca d'Italia.

⁴ La Decisione ECB/2019/21 del 22 luglio 2019 sulla terza serie di operazioni mirate (TLTRO-III), così come emendata dalle successive Decisioni, stabilisce che il tasso finale sia arrotondato per difetto alla quarta cifra decimale.

Nelle operazioni di mercato aperto di rifinanziamento l'erogazione del contante sul conto PM della controparte, ovvero del suo intermediario, viene effettuata dopo aver verificato la capienza del *pool* di garanzie costituite a nome della controparte. Qualora il valore cauzionale delle garanzie disponibili nel *pool* non vincolate (*pool* residuo) non sia sufficiente a garantire l'operazione, la controparte viene contattata per la necessaria integrazione delle garanzie.

In alcuni casi particolari, il regolamento sarà effettuato dalla Sede di Milano.

2. DESCRIZIONE DEI MESSAGGI VIA RETE NAZIONALE INTERBANCARIA (RNI)

Il capitolo si articola in due sezioni una relativa allo svolgimento dell'asta e l'altra alla spunta dei conteggi; entrambe le fasi di svolgono in maniera telematica, via RNI.

2.1 ASTA TELEMATICA

TIPO MSG	DESCRIZIONE	MITTENTE	NOTE
6E0	Annuncio asta	BI	
6E1	Partecipazione all'asta	OPER	Deve essere ricevuto entro l'orario indicato nel messaggio 6E0.
6E2	Conferma ricezione della partecipazione	BI	Viene inviato a fronte della ricezione di ciascun messaggio 6E1 privo di rilievi.
6E3	Comunicazione risultati di asta	BI	Viene inviato a tutti i partecipanti all'asta.
6E6	Comunicazione di annullamento asta	BI	Viene inviato per segnalare l'avvenuto annullamento dell'operazione di mercato aperto.

La Banca d'Italia comunica agli operatori che possono partecipare all'asta le caratteristiche dell'operazione per mezzo del **messaggio 6E0**; le stesse informazioni, nel caso di asta non riservata, possono essere anche diffuse dalla BCE e dalla Banca d'Italia attraverso i mezzi di comunicazione ritenuti più idonei.

Per partecipare all'asta l'operatore invia un **messaggio 6E1**, crittografato e strutturato per contenere un massimo di 10 partecipazioni (parametro e relativo importo).

Tali messaggi devono pervenire al Centro Applicativo Banca d'Italia (C.A.B.I.) entro l'orario comunicato in precedenza nel messaggio 6E0 (IDC 6G5), altrimenti sono restituiti al mittente in categoria applicativa RE01. Gli operatori possono inviare più di un messaggio 6E1 per ciascuna asta, sostituendo così le partecipazioni eventualmente formulate in precedenza.

Per ciascun messaggio 6E1 ricevuto e privo di errori sia formali che sostanziali, il C.A.B.I. provvede ad inviare al mittente un **messaggio 6E2** di conferma dell'avvenuta ricezione. Viceversa, il messaggio 6E1 con rilievi viene restituito al mittente in categoria applicativa RE01.

Effettuata l'assegnazione, la Banca d'Italia invia a ciascun operatore partecipante il

messaggio 6E3 contenente le risultanze dell'asta. Gli operatori assegnatari troveranno indicato nel messaggio l'importo assegnato per ciascuno dei parametri richiesti. Le controparti non assegnatarie troveranno invece indicato come importo assegnato il valore zero.

Esiste la possibilità di annullamento dell'operazione pubblica da parte della BCE. Le controparti sono avvertite in merito dalla Banca d'Italia per mezzo del **messaggio 6E6**.

2.2 SPUNTA TELEMATICA

TIPO MSG	DESCRIZIONE	MITTENTE	NOTE
6E7	Dati eseguito per la spunta	BI	Segnala alle controparti i conteggi effettuati dalla BI per i contratti stipulati.
6E8	Accettazione dati eseguito	OPER	Inviato dalle controparti a seguito della ricezione di un messaggio 6E7, per segnalare se il conteggio è accettato o ritenuto errato, ove richiesto.
6E9	Conferma ricezione dell'accettazione dati eseguito	BI	Inviato dalla BI per notificare la ricezione del messaggio 6E8.

Lo scambio dei messaggi per la spunta è effettuato tra la Banca d'Italia e le controparti risultate assegnatarie nelle operazioni di mercato aperto.

Il **messaggio 6E7** contiene l'evidenza dei conteggi effettuati per i contratti generati relativi sia a partecipazioni ad operazioni di mercato aperto sia ad operazioni bilaterali; ove richiesto, se l'operatore accetta quanto comunicato invia alla Banca d'Italia il relativo **messaggio 6E8** di accettazione.

Per ciascun messaggio 6E8 ricevuto e privo di errori, il C.A.B.I. provvede a restituire al mittente il **messaggio 6E9** di avvenuta ricezione.

La spunta telematica è utilizzata anche per i contratti che non sono stati originati da partecipazioni ad operazioni in asta.

Non è richiesta la conferma via RNI delle controparti per i 6E7 inviati dalla Banca d'Italia al fine di notificare gli importi a scadenza determinati sulla base dei parametri indicizzati.

3. PRESUPPOSTI PER L'UTILIZZO DEI MESSAGGI RNI

L'utilizzo dei messaggi presuppone l'adesione alla Rete Nazionale Interbancaria e la specifica richiesta alla Banca d'Italia. I messaggi, articolati secondo i tracciati che seguono, verranno scambiati con il C.A.B.I. attraverso il Servizio di "Message-Switching".

L'Applicazione Bancaria per lo scambio dei messaggi è :

01000BI00600 - in ambiente di Produzione;

01000BI006xx - in ambiente di Collaudo, ove xx identifica l'ambiente elaborativo che sarà specificato dalla Banca d'Italia in appositi documenti.

Le Categorie Applicative sono:

BI00 - per i messaggi privi di anomalie;

RE01 - per i messaggi contenenti segnalazioni d'errore.

Allo scopo di assicurare l'integrità e la riservatezza necessarie, alcuni messaggi si avvalgono delle funzioni di crittografia e/o autenticazione applicativa dei dati. Tali funzioni si basano sull'utilizzo delle chiavi bilaterali aziendali già in uso per le applicazioni del C.A.B.I.

E' pertanto necessario che, prima dello scambio di messaggi con l'Applicazione Bancaria "Operazioni di mercato aperto - Asta Telematica" le aziende che non interloquiscono con la Banca d'Italia per altre applicazioni, chiedano lo scambio delle chiavi bilaterali sia di autenticazione sia di crittografia. Le aziende che sono già in possesso delle chiavi devono comunque confermare i nominativi dei responsabili della loro gestione ovvero comunicare i nuovi nominativi qualora debbano essere variati.

4. CONTROLLI EFFETTUATI SUI MESSAGGI RNI

I campi di tipo non numerico (b, x, a) devono essere impostati con allineamento dei caratteri significativi a sinistra e, se a lunghezza fissa, con riempimento di spazi a destra.

I campi di tipo numerico (n) devono essere impostati con allineamento dei caratteri significativi a destra e, se a lunghezza fissa, con riempimento di zeri a sinistra.

Sui messaggi in ricezione viene effettuato un controllo sia formale che sostanziale.

In presenza di errori, la Banca d'Italia provvede a restituire al mittente il messaggio ricevuto (nell'identica struttura e relativi contenuti) con categoria applicativa RE01, aggiungendo alla fine del medesimo messaggio l'IDC 098, secondo il seguente standard di segnalazione degli errori adottato in Rete Interbancaria:

1° spezzone – 098:*** MESSAGGIO ERRATO ***

2° spezzone – 098:XXX – NNN/XXX – NNN/... (max 5 volte)

dove:

XXX = codice IDC errato

NNN = codice sintetico errore.

In presenza di messaggi contenenti più di cinque errori, il quinto campo del secondo spezzone viene valorizzato con i codici fissi "999 – 999".

5. SPECIFICHE TECNICHE DEI MESSAGGI RNI

5.1 MESSAGGIO 6E0: ANNUNCIO OPERAZIONE PUBBLICA

5.1.1. TRACCIATO

TIPO MESSAGGIO: 6E0

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE:

01000BI006YY (1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA:

XXXXXBI006YY (1)

O / F 2)	A / C 3)	IDC	DESCRIZIONE	FORMATO
O		01	Tipo messaggio	"3"b
O		040	Mittente (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		050	Destinatario (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		020	CRO	"11"n
O		D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	"8"n
O		601	Ora di riferimento (hhmmss)	"6"n
O		6G0	Identificativo operazione	
			Anno	"4"n
			Codice	/"4"n
O		6G1	Tipo operazione	
			Nome operazione	"2"a
			Tipo transazione	/"2"a
			Tipo operazione	/"2"a
			Tipo quotazione	("1"a)
			Operazione pubblica	/"1"a
			Tipo asta	/"2"a
			Metodo di assegnazione	/"2"a

O / F 2)	A / C 3)	IDC	DESCRIZIONE	FORMATO
O O F O		6G2 6G3 6G4 6G5	Caratteristiche operazione Data di effettuazione (ggmmaaaa) Numero massimo partecip. Per ctp Importo offerto Importo min. di partecipazione Taglio incrementale di partecip. Importo max. di partecipazione Importo minimo assegnabile Segno parametro Valore parametro Data partenza (ggmmaaaa) Data scadenza (ggmmaaaa) CUT OFF presentazione offerte	"8"n /"2"n (/15n) (/15n) (/15n) (/15n) (/15n) /"1"x /"9"n "8"n "8"n "6"n

(1) XXXXX = Codice A.B.I. YY = identificativo di ambiente (00 per la produzione).

(2) può assumere i valori:

O se il campo è obbligatorio

F se il campo è facoltativo

(3) contiene indicazioni sulle funzioni di sicurezza cui eventualmente è sottoposto il campo; può assumere valori:

A se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo

C se il campo è crittografato

AC se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo ed è crittografato

5.1.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E0

IDC 01 – TIPO MESSAGGIO

Assume il valore 6E0.

IDC 040 – MITTENTE

Identificativo della Banca d'Italia (01000).

IDC 050 – DESTINATARIO

Identificativo dell'operatore destinatario.

IDC 020 – CRO

Codice di riferimento del messaggio, assegnato dal mittente.

IDC D31 – DATA DI RIFERIMENTO

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

IDC 601 – ORA DI RIFERIMENTO

Ora di invio del messaggio nel formato hhmmss.

IDC 6G0 – IDENTIFICATIVO OPERAZIONE

E' l'identificativo dell'operazione di mercato aperto assegnato dalla BCE e da citare in tutti i messaggi relativi all'operazione stessa.

E' composto dai seguenti sottocampi:

“anno”: anno dell'operazione;

“codice operazione”: codice progressivo univoco nell'ambito dell'anno.

IDC 6G1 – TIPO OPERAZIONE

Descrive le caratteristiche dell'operazione ed è composto dai seguenti campi:

“nome operazione” può assumere i valori:

- YMR *Main refinancing operation* (operazioni principali di rifinanziamento)
- YLT *Longer-term refinancing operation* (operazioni di rifinanziamento a più lungo termine)
- YOT *Other operation* (altre operazioni)

“tipo transazione” può assumere i valori:

- YRT *Reverse Transaction* (operazioni temporanee)
- YFD *Fixed Term Deposits* (raccolta di depositi a termine)
- YDC *Debt Certificates* (emissione di Certificati di debito)

“tipo operazione” può assumere i valori:

- YLA *Liquidity absorbing* (operazioni di impiego)
- YLP *Liquidity providing* (operazioni di finanziamento)

“tipo quotazione” può assumere i valori:

- YP *Price* (prezzo)
- YR *Rate* (tasso)

“operazione pubblica” può assumere i valori:

- YY Operazione pubblica
- YN Operazione non pubblica

“tipo asta” può assumere i valori:

- YFR *Fixed rate tender* (asta a riparto)
- YVR *Variable rate tender* (asta a tasso/prezzo variabile)

“metodo di assegnazione”, significativo solo in caso di aste di tipo VR, può assumere i valori:

- YSR *Single rate* (asta marginale)
- YMR *Multiple rate* (asta competitiva)

IDC 6G2 – CARATTERISTICHE OPERAZIONE

Descrive le caratteristiche dell'operazione di mercato aperto oggetto dell'annuncio. E' composto dai seguenti campi:

“data di effettuazione”

è la data di svolgimento dell'operazione nel formato ggmmaaaa.

“numero massimo partecip. Per ctp”

è il numero massimo di partecipazioni (valori diversi del parametro con i relativi importi) esprimibili da un operatore per l'asta.

“importo offerto”

è l'importo offerto nell'operazione espresso in centesimi di euro.

“importo minimo di partecipazione”

è l'importo minimo, espresso in centesimi di euro, con il quale ciascun operatore può partecipare all'asta per singolo tasso di partecipazione.

“taglio incrementale di partecipazione”

è l'importo, espresso in centesimi di euro, di cui devono essere multipli gli incrementi della partecipazione rispetto all'importo minimo.

“importo massimo di partecipazione”

è l'importo massimo, espresso in centesimi di euro, con il quale ciascun operatore può complessivamente partecipare all'asta.

“importo minimo assegnabile”

è l'importo minimo, espresso in centesimi di euro, che la BCE può assegnare a ciascuna partecipazione assegnataria.

“segno parametro”

è il segno relativo al parametro, assume valore '+' per esprimere valori parametro pari a 0 o positivi, assume il valore '-' per esprimere valori parametro negativi.

“valore parametro”

è il valore limite o fisso a seconda del tipo asta; le prime tre cifre rappresentano la parte intera, mentre le ultime sei rappresentano la parte decimale. Può assumere valore 0.

IDC 6G3 – DATA PARTENZA

Riporta la data in cui deve essere effettuato il regolamento dell'operazione a pronti o, nel caso di operazioni di categoria definitiva, l'unica operazione del contratto.

Il campo ha il formato ggmmaaaa.

IDC 6G4 – DATA SCADENZA

Per i contratti temporanei riporta la data in cui deve essere effettuato il regolamento dell'operazione a termine.

Nel caso di emissione di certificati di debito indica la data di scadenza del certificato.

Il campo ha il formato ggmmaaaa.

IDC 6G5 – CUT-OFF PRESENTAZIONE OFFERTE

CUT-OFF PRESENTAZIONE OFFERTE PER OPERAZIONI DI ASTA (ESCLUSE T-LTRO)

Riporta l'orario utile (cut-off) entro e non oltre il quale devono pervenire al C.A.B.I. i messaggi di partecipazione delle controparti, nel formato hhmmss. L'orario è relativo al giorno di effettuazione dell'asta (IDC 6G2, campo "data di effettuazione"). I messaggi pervenuti oltre tale orario sono restituiti al mittente con segnalazione di errore.

CUT-OFF PRESENTAZIONE OFFERTE PER OPERAZIONI MIRATE DI RIFINANZIAMENTO A PIU' LUNGO TERMINE (T-LTRO)

Riporta l'orario utile (cut-off) entro e non oltre il quale devono pervenire al C.A.B.I. i messaggi di partecipazione delle controparti, nel formato hhmmss. L'orario è relativo al giorno precedente l'effettuazione dell'asta (IDC 6G2, campo "data di effettuazione"). I messaggi pervenuti oltre tale orario sono restituiti al mittente con segnalazione di errore.

5.2 MESSAGGIO 6E1: PARTECIPAZIONE ALL'ASTA

5.2.1 TRACCIATO

TIPO MESSAGGIO: 6E1

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE:

XXXXXXBI006YY(1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA:

01000BI006YY(1)

O / F (2)	A / C (3)	IDC	DESCRIZIONE	FORMATO
O		01	Tipo messaggio	"3"b
O		040	Mittente (abi/cab/uff)	"5"n("/5"n/"2"b)
O		050	Destinatario (abi/cab/uff)	"5"n("/5"n/"2"b)
O		020	CRO	"11"n
O		D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	"8"n
O		601	Ora di riferimento (hhmmss)	"6"n
F		010	Cifra di controllo	"5"n
F		012	MAC	"10"x
O		6G0	Identificativo operazione	
			Anno	"4"n
			Codice operazione	/"4"n
O	AC	6G6	Partecipazioni	10 occorrenze
			Segno parametro	"1"x
			Valore parametro	/"9"n
			Importo	/"15"n
O		6GG	Nominativo di riferimento	"15"x
O		6GI	Sede centrale (Head office)	"15"x

(1) XXXXX = Codice A.B.I. YY = identificativo di ambiente (00 per la produzione).

(2) può assumere i valori:

O se il campo è obbligatorio

F se il campo è facoltativo

(3) contiene indicazioni sulle funzioni di sicurezza cui eventualmente è sottoposto il campo; può assumere valori:

A se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo

C se il campo è crittografato

AC se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo ed è crittografato

5.2.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E1

IDC 01 – TIPO MESSAGGIO

Assume il valore 6E1.

IDC 040 – MITTENTE

Identificativo del mittente.

IDC 050 – DESTINATARIO

Identificativo della Banca d'Italia.

IDC 020 – CRO

Codice di riferimento del messaggio assegnato dal mittente.

IDC D31 – DATA DI RIFERIMENTO

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

IDC 601 – ORA DI RIFERIMENTO

Ora di invio del messaggio nel formato hhmmss.

IDC 010 – CIFRA DI CONTROLLO

Codice di controllo calcolato sulla base di un algoritmo e di una chiave bilaterale scambiata tra MITTENTE e DESTINATARIO; deve essere presente se manca l'IDC 012, deve essere assente se presente l'IDC 012.

IDC 012 – MAC

Codice di controllo calcolato dall'applicazione SMTS. I primi otto caratteri contengono l'autenticatore zonato, gli altri due caratteri la versione delle chiavi di autenticazione e di cifratura. Deve essere presente se manca l'IDC 010, deve essere assente se presente l'IDC 010.

IDC 6G0 – IDENTIFICATIVO OPERAZIONE

E' l'identificativo dell'operazione di mercato aperto comunicato con il messaggio 6E0 – IDC 6G0.

IDC 6G6 – PARTECIPAZIONI

Questo IDC è definito obbligatorio e deve essere valorizzato in tutte le occorrenze in quanto soggetto a crittografia.

Dal punto di vista dei contenuti è tuttavia significativo solo nelle occorrenze che contengono i dati di partecipazione all'asta.

Per la descrizione delle modalità con le quali l'IDC deve essere sottoposto al processo di crittografia e di autenticazione si rimanda al capitolo "A.6. CRITTOGRAFIA E AUTENTICAZIONE".

L'IDC si articola nei sottocampi:

- "segno parametro"

è il segno relativo al parametro, assume valore '+' per esprimere valori parametro pari a 0 o positivi, assume il valore '-' per esprimere valori parametro negativi.

- "valore parametro"

indica il valore offerto dall'operatore per partecipare all'asta; le prime tre cifre rappresentano la parte intera, mentre le ultime sei rappresentano la parte decimale. Nel caso in cui esprima un tasso di interesse, l'operatore dovrà valorizzare con cifre significative solo i primi due campi decimali.

Nel caso di operazioni con tecnica "a riparto" deve essere impostato con il tasso contenuto nell'annuncio o valorizzato con caratteri "zero".

- "importo"

è l'importo, espresso in centesimi di euro, richiesto dall'operatore per il parametro associato. Deve essere pari all'"importo minimo" o all'"importo minimo" più un multiplo del "taglio incrementale". Il totale degli importi per ciascun tasso deve essere inferiore all'"importo massimo di partecipazione" eventualmente comunicato nel relativo sottocampo dell'IDC 6G2 del messaggio 6E0 di annuncio operazione pubblica.

IDC 6GG – NOMINATIVO DI RIFERIMENTO

Contiene il nominativo di riferimento dell'operatore con cui il personale della Banca d'Italia deve mettersi in contatto in caso di necessità.

IDC 6GI – SEDE CENTRALE (HEAD OFFICE)

Contiene l'identificativo della capogruppo, se l'operatore fa parte di un gruppo bancario, o della casa madre, se l'operatore è una filiale di banca estera.

Il campo dovrà essere valorizzato con caratteri alfabetici e numerici. La prima posizione dovrà contenere un carattere valido.

5.2.3 VARIAZIONE DELLE PARTECIPAZIONI

Il contenuto degli **IDC D31** e **601** è utilizzato per consentire la variazione delle partecipazioni. La data/ora di riferimento del messaggio pervenuto viene confrontata con la data/ora delle partecipazioni dell'operatore eventualmente già memorizzate: se la data/ora del messaggio appena ricevuto è maggiore del dato memorizzato, le partecipazioni comunicate con il nuovo messaggio sostituiscono quelle in base dati; in caso contrario il messaggio è rispedito in categoria RE01 con il codice di errore 533.

Esempio:

per una certa asta un operatore ha trasmesso un messaggio 6E1 così valorizzato:

- IDC D31: "31031999"
- IDC 601: "113100"
- IDC 6G6: tre tassi e relativi importi:

tasso 1	+7,25	importo	100.000 euro
tasso 2	+7,15	importo	250.000 euro
tasso 3	+6,75	importo	1.125.000 euro

I tre tassi e gli importi sono memorizzati in base dati con la relativa data/ora di riferimento (31031999, 113100).

Successivamente, dallo stesso operatore perviene al C.A.B.I. un nuovo messaggio 6E1 per la medesima asta, con il seguente contenuto:

- IDC D31: "31031999"
- IDC 601: "115025"
- IDC 6G6: due tassi e relativi importi:

tasso 1	+7,25	importo	100.000 euro
tasso 2	+7,00	importo	350.000 euro

Poiché la data/ora di riferimento del nuovo messaggio è maggiore della data/ora di riferimento delle partecipazioni già in base dati (31031999, 113100), si interpreta il nuovo messaggio come un messaggio di variazione delle partecipazioni già pervenute: le partecipazioni dell'operatore già presenti in base dati sono cancellate e al loro posto sono memorizzati i nuovi tassi e importi, con la relativa nuova data/ora di riferimento.

Se il nuovo messaggio 6E1 pervenuto al C.A.B.I. dall'operatore avesse avuto il seguente contenuto:

- IDC D31: "31031999"
- IDC 601: "112702"
- IDC 6G6: due tassi e relativi importi:

tasso 1	+7,25	importo	100.000 euro
tasso 2	+7,00	importo	350.000 euro

ed essendo la data/ora di riferimento del nuovo messaggio non maggiore della data/ora di riferimento delle partecipazioni già in base dati (31031999, 113100), il nuovo messaggio sarebbe stato ritenuto errato (codice errore 533) e sarebbe stato rispedito al mittente in categoria RE01.

5.2.4 ANNULLAMENTO DELLE PARTECIPAZIONI

L'operatore che intenda annullare le partecipazioni comunicate precedentemente invierà un messaggio 6E1 di variazione (cfr. paragrafo precedente) con i sottocampi "valore parametro" e "importo" dell'IDC 6G6 impostati a zero.

5.2.5 RILIEVI SEGNALATI SUL MESSAGGIO 6E1 A FRONTE DEI CONTROLLI

- 500 - Mittente non abilitato
- 501 - Messaggio non autenticato correttamente
- 502 - Data di riferimento del messaggio errata
- 503 - Ora di riferimento errata
- 504 - Identificativo operazione di mercato aperto errato
- 505 - Importo errato o incongruente con quello/i indicato/i nel messaggio 6E0
- 506 - Parametro errato o non multiplo del frazionamento minimo ammesso del parametro
- 508 - Numero partecipazioni superiore al massimo ammesso
- 509 - Applicazione non disponibile
- 512 - Messaggio giunto dopo il cut-off
- 528 - Messaggio giunto dopo un intervento manuale
- 529 - Messaggio non decrittografato correttamente
- 533 - Data/ora di riferimento del messaggio inferiore a quella del messaggio precedentemente pervenuto

5.3 MESSAGGIO 6E2: CONFERMA RICEZIONE PARTECIPAZIONE

5.3.1 TRACCIATO

TIPO MESSAGGIO: 6E2

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE: 01000BI006YY(1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA: XXXXXBI006YY(1)

O / F (2)	A / C (3)	IDC	DESCRIZIONE	FORMATO
O		01	Tipo messaggio	"3"b
O		040	Mittente (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		050	Destinatario (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		020	CRO	"11"n
O		022	CRO originario	16x
O		D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	"8"n
O		601	Ora di riferimento (hhmmss)	"6"n
O		6G0	Identificativo operazione	
			Anno	"4"n
			Codice operazione	/"4"n

(1) XXXXX = Codice A.B.I. YY = identificativo di ambiente (00 per la produzione).

(2) può assumere i valori:

O se il campo è obbligatorio

F se il campo è facoltativo

(3) contiene indicazioni sulle funzioni di sicurezza cui eventualmente è sottoposto il campo; può assumere valori:

A se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo

C se il campo è crittografato

AC se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo ed è crittografato

5.3.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E2

IDC 01 – TIPO MESSAGGIO

Assume il valore 6E2.

IDC 040 – MITTENTE

Identificativo della Banca d'Italia.

IDC 050 – DESTINATARIO

Identificativo del destinatario.

IDC 020 – CRO

Codice di riferimento del messaggio assegnato dal mittente.

IDC 022 – CRO ORIGINARIO

Riporta il contenuto dell'IDC 020 del messaggio 6E1 cui si riferisce: vengono valorizzati i primi 11 caratteri di sinistra, secondo gli standard SIA.

IDC D31 – DATA DI RIFERIMENTO

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

IDC 601 – ORA DI RIFERIMENTO

Ora di invio del messaggio nel formato hhmss.

IDC 6G0 – IDENTIFICATIVO OPERAZIONE

E' l'identificativo dell'operazione di mercato aperto comunicato con il messaggio 6E0 – IDC 6G0.

5.4 MESSAGGIO 6E3: COMUNICAZIONE RISULTATI DI ASTA

5.4.1 TRACCIATO

TIPO MESSAGGIO: 6E3

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE:

01000BI006YY (1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA:

XXXXXBI006YY (1)

O / F (2)	A / C (3)	IDC	DESCRIZIONE	FORMATO
O		01	Tipo messaggio	"3"b
O		040	Mittente (abi/cab/uff)	"5"n(/"5"n/"2"b)
O		050	Destinatario (abi/cab/uff)	"5"n(/"5"n/"2"b)
O		020	CRO	"11"n
O		D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	"8"n
O		601	Ora di riferimento (hhmmss)	"6"n
F		010	Cifra di controllo	"5"n
F		012	MAC	"10"x
O		6G0	Identificativo operazione	
			Anno	"4"n
			Codice operazione	/"4"n
O		022	CRO originario	16x
O	AC	6G9	Risultati di asta	10 occorrenze
			Segno parametro	"1"x
			Valore parametro	/"9"n
			Importo assegnato	/"15"n

(1) XXXXX = Codice A.B.I. YY = identificativo di ambiente (00 per la produzione).

(2) può assumere i valori:

O se il campo è obbligatorio

F se il campo è facoltativo

(3) contiene indicazioni sulle funzioni di sicurezza cui eventualmente è sottoposto il campo; può assumere valori:

A se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo

C se il campo è crittografato

AC se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo ed è crittografato

5.4.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E3

IDC 01 - TIPO MESSAGGIO

Assume il valore 6E3.

IDC 040 - MITTENTE

Identificativo della Banca d'Italia.

IDC 050 - DESTINATARIO

Identificativo del destinatario.

IDC 020 - CRO

Codice di riferimento del messaggio assegnato dal mittente.

IDC D31 - DATA DI RIFERIMENTO

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

IDC 601 - ORA DI RIFERIMENTO

Ora di invio del messaggio nel formato hhmmss.

IDC 010 - CIFRA DI CONTROLLO

Codice di controllo calcolato sulla base di un algoritmo e di una chiave bilaterale scambiata tra mittente e destinatario; deve essere presente se manca l'IDC 012, deve essere assente se presente l'IDC 012.

IDC 012 - MAC

Codice di controllo calcolato dall'applicazione SMTS. I primi otto caratteri contengono l'autenticatore zonato, gli altri due caratteri la versione delle chiavi di autenticazione e di cifratura. Deve essere presente se manca l'IDC 010, deve essere assente se presente l'IDC 010.

IDC 6G0 - IDENTIFICATIVO OPERAZIONE

E' l'identificativo dell'operazione di mercato aperto comunicato con il messaggio 6E0 - IDC 6G0.

IDC 022 - CRO ORIGINARIO

Riporta il contenuto dell'IDC 020 dell'ultimo messaggio 6E1 accettato: vengono valorizzati i primi 11 caratteri di sinistra, secondo gli standard SIA.

Se la partecipazione all'asta non è pervenuta via RNI è valorizzato con 11 caratteri "zero".

IDC 6G9 - RISULTATI DI ASTA

Contiene l'importo assegnato per ciascuno dei parametri richiesti. In caso di mancata assegnazione l'importo è valorizzato con zero. Si compone dei seguenti sottocampi:

"segno parametro"

è il segno relativo al parametro, assume valore '+' per esprimere valori parametro pari a 0 o positivi, assume il valore '-' per esprimere valori parametro negativi.

"valore parametro"

è il valore richiesto nel messaggio 6E1; le prime tre cifre rappresentano la parte intera, mentre le ultime sei rappresentano la parte decimale.

"importo assegnato"

importo assegnato espresso in centesimi di euro; in caso di mancata assegnazione è valorizzato con zero.

In caso di aste marginali il "valore parametro" è impostato con il valore del parametro marginale determinato per l'asta (un solo valore indipendentemente dal numero dei parametri comunicati dall'operatore); il valore dell'"importo assegnato" è impostato con il valore dell'importo assegnato effettivamente all'operatore (un solo valore minore o uguale alla somma degli importi comunicati dall'operatore).

Per esempio, in caso di asta marginale di finanziamento per la quale sia stato trasmesso un messaggio di partecipazione con 3 tassi e relativi importi:

tasso 1	+7,25	importo	100.000 euro
tasso 2	+7,15	importo	250.000 euro
tasso 3	+6,75	importo	1.125.000 euro

Se il tasso marginale dell'asta risulta essere 6,5, l'IDC sarà impostato con i seguenti valori:

tasso 1	+6,5	importo	1.475.000 euro
---------	------	---------	----------------

Per la descrizione delle modalità con le quali l'IDC deve essere sottoposto al processo di crittografia e di autenticazione si rimanda al capitolo "CRITTOGRAFIA E AUTENTICAZIONE".

5.5 MESSAGGIO 6E6: COMUNICAZIONE DI ANNULLAMENTO ASTA

5.5.1 TRACCIATO

TIPO MESSAGGIO: 6E6

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE: 01000BI006YY(1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA: XXXXXBI006YY(1)

O / F (2)	A / C (3)	IDC	DESCRIZIONE	FORMATO
O		01	Tipo messaggio	"3"b
O		040	Mittente (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		050	Destinatario (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		020	CRO	"11"n
O		D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	"8"n
O		601	Ora di riferimento (hhmmss)	"6"n
O		6G0	Identificativo operazione	
			Anno	"4"n
			Codice operazione	/"4"n

(1) XXXXX = Codice A.B.I. YY = identificativo di ambiente (00 per la produzione).

(2) può assumere i valori:

O se il campo è obbligatorio

F se il campo è facoltativo

(3) contiene indicazioni sulle funzioni di sicurezza cui eventualmente è sottoposto il campo; può assumere valori:

A se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo

C se il campo è crittografato

AC se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo ed è crittografato

5.5.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E6

Il messaggio viene inviato alle controparti partecipanti per segnalare l'avvenuto annullamento di una determinata operazione di mercato aperto.

IDC 01 - TIPO MESSAGGIO

Assume il valore 6E6.

IDC 040 - MITTENTE

Identificativo della Banca d'Italia.

IDC 050 – DESTINATARIO

Identificativo del destinatario.

IDC 020 - CRO

Codice di riferimento del messaggio assegnato dal mittente.

IDC D31 - DATA DI RIFERIMENTO

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

IDC 601 - ORA DI RIFERIMENTO

Ora di invio del messaggio nel formato hhmmss.

IDC 6G0 - IDENTIFICATIVO OPERAZIONE

E' l'identificativo dell'operazione di mercato aperto comunicato con il messaggio 6E0 - IDC 6G0.

5.6 MESSAGGIO 6E7: DATI ESEGUITO PER LA SPUNTA

5.6.1 TRACCIATO

TIPO MESSAGGIO: 6E7

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE: 01000BI006YY (1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA: XXXXXBI006YY (1)

O / F (2)	A / C (3)	IDC	DESCRIZIONE	FORMATO
O		01	Tipo messaggio	"3"b
O		040	Mittente (abi/cab/uff)	"5"n("/5"n/"2"b)
O		050	Destinatario (abi/cab/uff)	"5"n("/5"n/"2"b)
O		020	CRO	"11"n
O		D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	"8"n
O		601	Ora di riferimento (hhmmss)	"6"n
F		012	MAC	"10"x
F		6G0	Identificativo operazione	
			Anno	"4"n
			Codice operazione	/"4"n
O	C	6GA	Dati operazione fiscale	
			Operazione fiscale	"7"n
			Operazione fiscale collegata	/"7"n
			Data regolamento (ggmmaaaa)	/"8"n
O	C	6GB	Informazioni per la spunta	6 occorrenze
			Riferimento per B.I.	"6"n
			Riferimento per B.I. originario	/"6"n
			Segno tasso	/"1"x
			Tasso operazione	/"9"n
			Codice titolo ISIN	/"12"b
			Capitale nominale	/"15"n
			Cambio	/"11"n
			Tipo prezzo di contrattazione	/"3"x
			Prezzo di contrattazione	/"12"n
			Tipo prezzo di conteggio	/"3"x
			Prezzo di conteggio	/"12"n
			Dietimi lordi	/"15"n

O / F (2)	A / C (3)	IDC	DESCRIZIONE	FORMATO
O		6GF	Controvalore Totale Imposta Tipo operazione Divisa Importo provvigioni Pagamento provvigioni Filiale regolamento Intermediario regolam.titoli Intermediario regolam. Contanti Concatenamento Progressivo messaggio Indicatore messaggio	/"15"n /"15"n /"15"n /"1"b /"3"x /"15"n /"1"b /"3"x /"6"n /"6"n /"3"n /"1"a

(1) XXXXX = Codice A.B.I. YY = identificativo di ambiente (00 per la produzione).

(2) può assumere i valori:

O se il campo è obbligatorio

F se il campo è facoltativo

(3) contiene indicazioni sulle funzioni di sicurezza cui eventualmente è sottoposto il campo; può assumere valori:

A se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo

C se il campo è crittografato

AC se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo ed è crittografato

5.6.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E7

Il messaggio viene inviato alle controparti per segnalare i dati dei conteggi relativi ai contratti stipulati.

Per ciascuna operazione fiscale viene inviato un singolo messaggio ovvero, se un solo messaggio non è sufficiente a contenere tutti i dati dell'operazione, un "treno" di messaggi tra loro concatenati.

IDC 01 - TIPO MESSAGGIO

Assume il valore 6E7.

IDC 040 - MITTENTE

Identificativo della Banca d'Italia.

IDC 050 - DESTINATARIO

Identificativo del destinatario.

IDC 020 - CRO

Codice di riferimento del messaggio assegnato dal mittente.

IDC D31 - DATA DI RIFERIMENTO

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

IDC 601 - ORA DI RIFERIMENTO

Ora di invio del messaggio nel formato hhmmss.

IDC 012 - MAC

Codice di controllo calcolato dall'applicazione SMTS. I primi otto caratteri contengono l'autenticatore zonato, gli altri due caratteri la versione delle chiavi di autenticazione e di cifratura. Deve essere presente se si utilizza come sistema di sicurezza SMTS.

IDC 6G0 - IDENTIFICATIVO OPERAZIONE

E' l'identificativo dell'operazione di mercato aperto, comunicato con il messaggio 6E0, dalla quale sono stati originati i contratti da spuntare.

IDC 6GA - DATI OPERAZIONE FISCALE

Contiene alcune informazioni sull'operazione fiscale in spunta. E' composto dai seguenti sottocampi:

“operazione fiscale”

numero progressivo assegnato all'operazione fiscale dalla Banca d'Italia.

“operazione fiscale collegata”

identificativo dell'operazione fiscale collegata a quella di cui si inviano i dati; valorizzato solo per il rientro di operazioni pronti contro termine (negli altri casi è impostato a zero).

“data regolamento”.

data di regolamento dell'operazione fiscale, che coincide con la data di regolamento di tutti i contratti che la costituiscono.

IDC 6GB - INFORMAZIONI PER LA SPUNTA

Si compone dei seguenti sottocampi:

“riferimento per B.I.”

è il codice di Prima Nota attribuito dalla Banca d'Italia al movimento.

“riferimento per B.I. originario”

è il codice di Prima Nota attribuito dalla Banca d'Italia al movimento originario di cui si è effettuata la variazione. È impostato solo nel caso di movimenti relativi ad operazioni a termine, anticipate nella chiusura a seguito della richiesta di sostituzione dei titoli. Se non significativo è impostato a zero.

“segno tasso”.

è il segno relativo al tasso, assume valore '+' per esprimere valori del tasso pari a 0 o positivi, assume il valore '-' per esprimere valori parametro negativi.

“tasso operazione”.

è il tasso della operazione temporanea o del deposito a scadenza relativamente ai quali è stato generato il contratto. Il formato del campo è 3 interi e 6 decimali. Se non significativo ha valore zero.

“codice titolo ISIN”

è l'identificativo del titolo in formato ISIN. Per i contratti in *pooling* contiene un codice ISIN fittizio.

“capitale nominale”.

è il capitale nominale espresso nella divisa di denominazione del titolo. Il formato del campo è 15 interi e 2 decimali anche per i titoli espressi in lire, per i quali i centesimi sono impostati a zero. Per i contratti in *pooling* contiene l'importo assegnato.

“cambio”.

è il tasso di cambio della divisa di denominazione del titolo rispetto all'euro. Il formato del campo è 4 interi e 7 decimali. Per i contratti in *pooling* assume il valore 00010000000.

“tipo prezzo di contrattazione”

è il tipo di prezzo con il quale il titolo è stato contrattato. Può assumere i valori:

PSE	prezzo secco
PTL	prezzo tel-quel lordo
PTN	prezzo tel-quel netto
RCL	rendimento composto lordo
RCN	rendimento composto netto
RSL	rendimento semplice lordo
RSN	rendimento semplice netto

Per i contratti in *pooling* assume valore PSE

“prezzo di contrattazione”

è il prezzo di mercato del titolo contrattato, comprensivo del margine iniziale e dello scarto di garanzia, se richiesto dal tipo di operazione.

Per i contratti in *pooling* assume valore 100

“tipo prezzo di conteggio”

è il tipo di prezzo utilizzato nei conteggi del contratto. Può assumere i valori:

PSE	prezzo secco
PTL	prezzo tel-quel lordo
PTN	prezzo tel-quel netto

Per i contratti in *pooling* assume valore PSE

“prezzo di conteggio”

è il prezzo utilizzato nei conteggi del contratto, comprensivo del margine iniziale e dello scarto di garanzia, se richiesto dal tipo di operazione.

Per i contratti in *pooling* non esiste il prezzo di conteggio; il campo è utilizzato per contenere il fattore che, applicato al valore contenuto nel campo “capitale nominale”, consente di ottenere il flusso di contante del movimento.

“dietimi lordi”

è l'importo dei dietimi lordi. Il formato del campo è 15 interi e 2 decimali. Per i contratti *pooling* assume valore 0000000000000000

“controvalore”

è il controvalore del contratto. Il formato del campo è 15 interi e 2 decimali.

Per i contratti in *pooling* contiene il flusso di contante del movimento espresso in centesimi di euro.

“totale”

è il flusso di contante del movimento espresso in centesimi di euro. Comprende, se presenti: provvigioni, dietimi/interessi, ritenute fiscali. Il formato del campo è 15 interi e 2 decimali.

“imposta”

contiene la ritenuta fiscale per i titoli tassati secondo il regime precedente il Decreto Legislativo n.239/1996, ovvero la somma dell'imposta sostitutiva sullo scarto e sulla cedola per i titoli tassati secondo il regime introdotto dal decreto. Il formato del campo è 15 interi e 2 decimali.

“tipo operazione”

indica il tipo di operazione cui si riferiscono i dati del messaggio. Può assumere i valori:

P operazione a pronti

T operazione a termine

D operazioni definitive

“divisa”

contiene la divisa in cui sono espressi gli importi, fatta eccezione per il capitale nominale che è espresso nella divisa di denominazione del titolo; la divisa è espressa nello standard ISO e sarà normalmente l'euro.

“importo provvigioni”

contiene l'importo delle provvigioni. Non utilizzato per le aste effettuate nell'ambito del SEBC. Il formato del campo è 15 interi e 2 decimali.

“pagamento provvigioni”

contiene l'indicazione della parte cui compete il pagamento delle provvigioni (non previste per le aste della BCE). Può assumere valori:

B se il pagamento è a carico della Bancad'Italia

C se il pagamento è a carico della controparte

N non prevista alcuna provvigione

“filiale regolamento”

filiale della Banca d'Italia in cui verrà regolato il contratto (parte titoli e parte contanti).

“intermediario regolamento titoli”

identificativo dell'eventuale intermediario prescelto per il regolamento della parte titoli. Se si tratta del 6E7 inviato all'intermediario, il campo riporta il codice della controparte per cui il soggetto svolge la funzione di intermediario regolamento titoli.

Nella modalità “pooling” assume valore 000000.

“intermediario regolamento contanti”

identificativo dell'eventuale intermediario prescelto per il regolamento della parte contanti. Se si tratta del 6E7 inviato all'intermediario, il campo riporta il codice della controparte per cui il soggetto svolge la funzione di intermediario regolamento contanti.

IDC 6GF - CONCATENAMENTO

Questo campo è sempre presente e indica la sequenza dei messaggi nell'ambito di un "treno" di messaggi.

L'IDC contiene i seguenti sottocampi:

"progressivo messaggio"

Contiene il numero progressivo del messaggio nell'ambito del treno di appartenenza; assume quindi i valori 1, 2, 3, ... n.

"indicatore messaggio" contiene uno dei seguenti valori:

F nel primo messaggio
I nei messaggi intermedi
L nell'ultimo messaggio.

Nel caso di un solo messaggio l'IDC 6GF assume il valore "1L"; nel caso di più messaggi, ad esempio 3, assume rispettivamente i valori "1F", "2I", "3L".

Per la descrizione delle modalità con le quali gli IDC 6GA e 6GB devono essere sottoposti al processo di crittografia si rimanda al Capitolo "CRITTOGRAFIA E AUTENTICAZIONE".

5.7 MESSAGGIO 6E8: ACCETTAZIONE DATI ESEGUITO

5.7.1 TRACCIATO

TIPO MESSAGGIO: 6E8

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE:

XXXXXXBI006YY (1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA:

01000BI006YY (1)

O / F (2)	A / C (3)	IDC	DESCRIZIONE	FORMATO
O		01	Tipo messaggio	"3"b
O		040	Mittente (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		050	Destinatario (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		020	CRO	"11"n
O		D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	"8"n
O		601	Ora di riferimento (hhmmss)	"6"n
O		6GC	Esito spunta	
			Operazione fiscale	"7"n
			Conferma dati per spunta	/"2"a

(1) XXXXX = Codice A.B.I. YY = identificativo di ambiente (00 per la produzione).

(2) può assumere i valori:

O se il campo è obbligatorio

F se il campo è facoltativo

(3) – contiene indicazioni sulle funzioni di sicurezza cui eventualmente è sottoposto il campo; può assumere valori:

A se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo

C se il campo è crittografato

AC se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo ed è crittografato

5.7.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E8

Deve essere inviato dalle controparti un solo messaggio 6E8 a fronte dei dati di ciascuna operazione fiscale trasmessi dalla Banca d'Italia con uno o più di messaggi 6E7.

IDC 01 – TIPO MESSAGGIO

Assume il valore 6E8.

IDC 040 – MITTENTE

Identificativo del mittente.

IDC 050 – DESTINATARIO

Identificativo della Banca d'Italia.

IDC 020 – CRO

Codice di riferimento del messaggio assegnato dal mittente.

IDC D31 – DATA DI RIFERIMENTO

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

IDC 601 – ORA DI RIFERIMENTO

Ora di invio del messaggio nel formato hhmmss.

IDC 6GC – ESITO SPUNTA

E' composto dai seguenti sottocampi

“operazione fiscale”

è l'identificativo dell'operazione fiscale per la quale si invia l'esito del controllo; deve riportare il valore contenuto nell'omonimo sottocampo dell'IDC 6GA del messaggio 6E7.

“conferma dati per spunta” può assumere i valori:

SI se i dati per la spunta sono corretti

NO se i dati per la spunta non risultano corretti; in questo caso occorre contattare immediatamente la Banca d'Italia per segnalare le anomalie riscontrate.

5.7.3 RILIEVI SEGNALATI SUL MESSAGGIO 6E8 A FRONTE DEI CONTROLLI

- 500 - Mittente non abilitato
- 502 - Data di riferimento del messaggio errata
- 503 - Ora di riferimento errata
- 509 - Applicazione non disponibile
- 513 - Identificativo operazione fiscale non trovato oppure operazione fiscale non spuntabile;
- 514 - Conferma dati per spunta errata (diversa da SI/NO)

5.8 MESSAGGIO 6E9: CONFERMA RICEZIONE ACCETTAZIONE DATI ESEGUITO

5.8.1 TRACCIATO

TIPO MESSAGGIO: 6E9

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE: 01000BI006YY(1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA: XXXXXBI006YY(1)

O / F (2)	A / C (3)	IDC	DESCRIZIONE	FORMATO
O		01	Tipo messaggio	"3"b
O		040	Mittente (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		050	Destinatario (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		020	CRO	"11"n
O		022	CRO originario	16x
O		D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	"8"n
O		601	Ora di riferimento (hhmmss)	"6"n

(1) XXXXX = Codice A.B.I. YY = identificativo di ambiente (00 per la produzione).

(2) può assumere i valori:

O se il campo è obbligatorio

F se il campo è facoltativo

(3) - contiene indicazioni sulle funzioni di sicurezza cui eventualmente è sottoposto il campo; può assumere valori:

A se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo

C se il campo è crittografato

AC se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo ed è crittografato

5.8.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E9

Il messaggio viene utilizzato per confermare la ricezione del messaggio 6E8 di accettazione dati eseguito.

IDC 01 - TIPO MESSAGGIO

Assume il valore 6E9.

IDC 040 - MITTENTE

Identificativo della Banca d'Italia.

IDC 050 - DESTINATARIO

Identificativo del destinatario.

IDC 020 - CRO

Codice di riferimento del messaggio assegnato dal mittente.

IDC 022 - CRO ORIGINARIO

Riporta il contenuto dell'IDC 020 del messaggio 6E8 cui si riferisce: vengono valorizzati i primi 11 caratteri di sinistra, secondo gli standard SIA.

IDC D31 - DATA DI RIFERIMENTO

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

IDC 601 - ORA DI RIFERIMENTO

Ora di invio del messaggio nel formato hhmmss.

B. RICHIESTE DI RIMBORSO ANTICIPATO VOLONTARIO SU OPERAZIONI DI RIFINANZIAMENTO A PIU' LUNGO TERMINE

1. DESCRIZIONE DEI MESSAGGI VIA RNI

Il capitolo si articola in due sezioni una relativa alle richieste di rimborso anticipato volontario e l'altra alla spunta dei conteggi; entrambe le fasi di svolgono in maniera telematica, via RNI.

1.1 PROCEDURA TELEMATICA

TIPO MSG	DESCRIZIONE	MITTENTE	NOTE
6E0	Apertura della finestra di rimborso	BI	
6E1	Richiesta di rimborso	OPER	Deve essere ricevuto entro l'orario indicato nel messaggio 6E0.
6E2	Conferma di corretta ricezione	BI	Viene inviato a fronte della ricezione di ciascun messaggio 6E1 formalmente corretto.

La Banca d'Italia comunica l'avvio dell'apertura della finestra temporale per l'invio delle richieste di rimborso volontario anticipato tramite **messaggio 6E0** nei giorni precedenti la scadenza stabilita dall'Eurosistema per la presentazione di tali richieste. La comunicazione verrà inviata alle sole controparti aventi un finanziamento residuo sulla LTRO per cui è possibile presentare richieste di rimborso.

In caso sia possibile rimborsare più di un'operazione nella medesima data, viene inviato un 6E0 per ciascuna operazione.

Per presentare alla Banca d'Italia una richiesta di rimborso, l'operatore invia un **messaggio 6E1**, crittografato, strutturato per contenere un'unica richiesta di rimborso.

Tale messaggio deve pervenire al Centro Applicativo Banca d'Italia (C.A.B.I.) entro l'orario comunicato nel messaggio 6E0 (*cut-off* - IDC 6G5), altrimenti viene restituito al mittente in categoria applicativa RE01. Gli operatori possono inviare più di un messaggio 6E1 per ciascuna operazione da rimborsare, entro l'orario di *cut-off*, che andranno a sostituire/annullare le richieste di rimborso eventualmente formulate in precedenza.

Per ciascun messaggio 6E1 ricevuto e privo di errori formali, il C.A.B.I. provvede a inviare al mittente un **messaggio 6E2** di conferma dell'avvenuta ricezione. Viceversa, il messaggio 6E1 con rilievi viene restituito al mittente in categoria applicativa RE01.

1.2 SPUNTA TELEMATICA

TIPO MSG	DESCRIZIONE	MITTENTE	NOTE
6E7	Dati eseguito per la spunta	BI	Segnala alle controparti i conteggi effettuati dalla BI per l'annullamento dei contratti originari e la partenza dei nuovi
6E8	Accettazione dati eseguito	OPER	Inviato dalle controparti a seguito della ricezione di ciascun messaggio 6E7, per segnalare se il conteggio è accettato o ritenuto errato.
6E9	Conferma ricezione dell'accettazione dati eseguito	BI	Inviato dalla BI per notificare la ricezione del messaggio 6E8.

Lo scambio dei messaggi RNI per la spunta è effettuato, entro il giorno del regolamento⁴ di ciascun rimborso, tra la Banca d'Italia e tutte le controparti che abbiano presentato richieste.

I **messaggi 6E7** (per maggior dettaglio vedi paragrafo seguente) contengono l'evidenza dei conteggi effettuati relativamente ai rimborsi. Se l'operatore accetta quanto comunicato via messaggi 6E7, invia alla Banca d'Italia i relativi **messaggi 6E8** di accettazione. Per ciascun **messaggio 6E8** ricevuto e privo di errori, il C.A.B.I. provvede a restituire al mittente un **messaggio 6E9** di avvenuta ricezione.

1.2.1 DESCRIZIONE DEI MESSAGGI 6E7 PER RIMBORSO

Nel caso di **rimborso totale**, le controparti potranno ricevere fino a 2 messaggi 6E7:

- a. il primo conterrà i dati relativi all'avvio dell'operazione originaria con l'importo del finanziamento iniziale (o il "montante residuo"⁵ nel caso di precedente/i rimborso/i) e l'indicazione della nuova data di regolamento a termine (coincidente con la data di regolamento del rimborso anticipato);
- b. il secondo conterrà i dati relativi al montante maturato alla nuova data di regolamento a termine (coincidente con la data di regolamento del rimborso anticipato), calcolato sulla base del tasso originario d'asta nel caso di asta a tasso predefinito o sulla base del tasso definitivo nel caso di asta a tasso indicizzato.

⁴ Di norma i messaggi 6E7 vengono inviati il giorno lavorativo precedente a quello di regolamento del rimborso.

⁵ Nel caso in cui la controparte abbia già esercitato l'opzione di rimborso in una data precedente, il "montante residuo" esposto nel messaggio è pari all'importo nominale del finanziamento residuo dopo il precedente rimborso comprensivo degli interessi maturati fino al precedente rimborso.

Nel caso di **rimborso parziale**, le controparti potranno ricevere fino a 4 messaggi 6E7:

- c. il primo conterrà i dati relativi all'avvio dell'operazione originaria con l'importo del finanziamento iniziale (o il "montante residuo"⁶, nel caso di precedente/i rimborso/i) e l'indicazione della nuova data di regolamento a termine (coincidente con la data di regolamento del rimborso anticipato);
- d. il secondo conterrà i dati relativi al montante maturato alla data di regolamento del rimborso anticipato, calcolato sulla base del tasso originario dell'asta applicato all'importo di cui al punto precedente nel caso di asta a tasso predefinito o sulla base del tasso definitivo nel caso di asta a tasso indicizzato;
- e. il terzo riporterà l'importo residuo del finanziamento inclusi gli interessi maturati dalla data di regolamento dell'asta alla data di regolamento del rimborso anticipato; la data a pronti coinciderà con la data di regolamento del rimborso anticipato e la data a termine con la data termine dell'asta originaria;
- f. il quarto messaggio riporterà i dati relativi al montante da regolare alla data termine dell'asta originaria, calcolato sulla base del tasso originario dell'asta nel caso di asta a tasso predefinito o sulla base del tasso definitivo nel caso di asta a tasso indicizzato;

Come effetto netto, la controparte - alla data di regolamento del rimborso - dovrà rimborsare l'importo nominale indicato nella richiesta comprensivo degli interessi maturati dalla data di regolamento a pronti dell'asta fino alla data di regolamento del rimborso.

La controparte per ogni messaggio 6E7 ricevuto risponderà con un messaggio di spunta 6E8, a cui seguirà la conferma della Banca d'Italia con messaggio 6E9.

Si precisa che, ai sensi dell'art. 7 del Contratto quadro per le operazioni di mercato aperto, le controparti "spuntano" gli importi da regolare, tenendo presente che i tassi indicati nel messaggio 6E7 (rappresentati su 6 posizioni decimali) sono solo indicativi.

1.2.2 REGOLAMENTO

Il rimborso verrà regolato nelle date indicate dall'Eurosistema. Di norma tale data è stabilita in coincidenza con la giornata di regolamento di un'operazione di rifinanziamento principale.

Gli importi che la Banca d'Italia invierà alle fasi di regolamento terranno conto di tutte le eventuali partecipazioni di ciascuna controparte ad altre operazioni di mercato aperto con data di regolamento nella stessa giornata.

⁶ Cfr. nota 3.

2. MESSAGGIO 6E0: ANNUNCIO

2.1 TRACCIATO

Il formato dei campi è descritto nel paragrafo 5.1.1 del capitolo A.

TIPO MESSAGGIO: 6E0

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE: 01000BI006YY (1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA: XXXXXBI006YY (1)

IDC	Descrizione	Valorizzazione
1	Tipo messaggio	6E0
40	Mittente (abi/cab/uff)	01000
50	Destinatario (abi/cab/uff)	
20	CRO	
D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	
601	Ora di riferimento (hhmmss)	
6G0	Identificativo operazione	
	Anno	
	Codice	
6G1	Tipo operazione	
	Nome operazione	"ER"
	Tipo transazione	"ER"
	Tipo operazione	"LA
	Tipo quotazione	R
	Operazione pubblica	N
	Tipo asta	FR
	Metodo di assegnazione	SR
6G2	Caratteristiche operazione	
	Data di effettuazione (ggmmaaaa)	
	Numero massimo partecip. per ctp	1
	progressivo OPB	
	Importo min. di partecipazione	1 milione euro (in cc)
	Taglio incrementale di partecip.	10 mila euro (in cc)
	Importo max. di rimborso	Capitale originario o residuo dall'ultimo rimborso
	Importo minimo assegnabile	1 milione euro (in cc)

	Segno parametro	Segno del tasso originario operazione
	Valore parametro	Tasso originario dell'operazione
6G3	Data partenza (ggmmaaaa)	
6G4	Data scadenza (ggmmaaaa)	<i>(blank – non valorizzato)</i>
6G5	CUT OFF presentazione offerte (hhmmss)	"6"n

2.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E0

IDC 01 – TIPO MESSAGGIO

Assume il valore 6E0.

IDC 040 – MITTENTE

Identificativo della Banca d'Italia (01000).

IDC 050 – DESTINATARIO

Identificativo dell'operatore destinatario.

IDC 020 – CRO

Codice di riferimento del messaggio, assegnato dal mittente.

IDC D31 – DATA DI RIFERIMENTO

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

IDC 601 – ORA DI RIFERIMENTO

Ora di invio del messaggio nel formato hhmmss.

IDC 6G0 – IDENTIFICATIVO OPERAZIONE

E' l'identificativo del rimborso assegnato dalla BCE e da citare in tutti i messaggi relativi all'operazione stessa.

E' composto dai seguenti sottocampi:

“anno”: anno del rimborso;

“codice operazione”: codice progressivo univoco nell'ambito dell'anno.

IDC 6G1 – TIPO OPERAZIONE

Descrive le caratteristiche del rimborso ed è composto dai seguenti campi:

“**nome operazione**” assume il valore:

ΥER *Early repayment* (rimborso anticipato)

“**tipo transazione**” assume il valore:

ΥER *Early repayment* (rimborso anticipato)

“**tipo operazione**” assume il valore:

ΥLA *Liquidity absorbing* (operazioni di impiego)

“**tipo quotazione**” assume il valore:

ΥR *Rate (tasso)*

“**operazione pubblica**” assume il valore:

ΥN Operazione non pubblica (l’invio del messaggio 6E0 viene effettuato alle sole controparti partecipanti all’operazione LTRO originaria e con importo del finanziamento ancora in essere)

“**tipo asta**” assume il valore:

ΥFR *Fixed rate tender* (asta a riparto)

“**metodo di assegnazione**” assume il valore

ΥSR *Single rate*

IDC 6G2 – CARATTERISTICHE OPERAZIONE

Descrive le caratteristiche del rimborso.

E’ composto dai seguenti campi:

“**data di effettuazione**”

è la data definita dall’Eurosistema entro cui deve essere inviata dall’operatore la richiesta di rimborso.

Il campo ha il formato ggmmaaaa.

“**numero massimo partecip. per ctp**”

è il numero massimo di richieste di rimborso (fisso e pari a 1)

“**progressivo operazione pubblica**” ”

è l’identificativo della operazione pubblica su cui si effettua il rimborso; contiene:

“anno”: anno dell’operazione pubblica

“codice operazione”: codice progressivo univoco nell’ambito dell’anno

“**importo minimo di partecipazione**”

è l’importo minimo, espresso in centesimi di euro, con il quale ciascun operatore può presentare richiesta di rimborso (fisso e pari a 1 milione di euro, espresso in centesimi di euro).

“**taglio incrementale di partecipazione**”

è l’importo, espresso in centesimi di euro, di cui devono essere multipli gli incrementi della richiesta di rimborso rispetto all’importo minimo (fisso e pari a 10.000 euro, espresso

in centesimo di euro).

“importo massimo di partecipazione”

è l'importo massimo, espresso in centesimi di euro, per il quale ciascun operatore può richiedere di effettuare un rimborso e corrisponde all'ammontare ancora in essere per l'operazione LTRO originaria di riferimento.

“importo minimo assegnabile”

è pari all'“importo minimo di partecipazione” (fisso e pari a 1 milione di euro, espresso in centesimi di euro).

“segno parametro”

è il segno del parametro comunicato in sede di annuncio della LTRO originaria di riferimento; assume valore '+' per esprimere valori del tasso pari a 0 o positivi o il valore '-' per esprimere valori parametro negativi.

“valore parametro”

è il parametro comunicato in sede di annuncio della LTRO originaria di riferimento. Le prime tre cifre rappresentano la parte intera, mentre le ultime sei rappresentano la parte decimale. Può assumere il valore 0.

IDC 6G3 – DATA PARTENZA

Riporta la data in cui deve essere effettuato il regolamento del rimborso. Il campo ha il formato ggmmaaaa.

IDC 6G4 – DATA SCADENZA

(non valorizzato)

IDC 6G5 – CUT-OFF PER LA PRESENTAZIONE DI RICHIESTE DI RIMBORSO

Riporta l'orario utile (*cut-off*) entro e non oltre il quale devono pervenire al C.A.B.I. i messaggi di richiesta di rimborso delle controparti, nel formato hhmmss.

L'orario è relativo al giorno di scadenza stabilito dall'Eurosistema (indicato nel campo IG2 – “data di effettuazione”).

I messaggi pervenuti oltre tale orario sono restituiti al mittente con segnalazione di errore.

3. MESSAGGIO 6E1: RICHIESTA DI RIMBORSO

3.1 TRACCIATO

TIPO MESSAGGIO: 6E1

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE:

XXXXXXBI006YY(1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA:

01000BI006YY(1)

O / F (2)	A / C (3)	IDC	DESCRIZIONE	FORMATO
O		01	Tipo messaggio	"3"b
O		040	Mittente (abi/cab/uff)	"5"n(/"5"n/"2"b)
O		050	Destinatario (abi/cab/uff)	"5"n(/"5"n/"2"b)
O		020	CRO	"11"n
O		D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	"8"n
O		601	Ora di riferimento (hhmmss)	"6"n
F		010	Cifra di controllo	"5"n
F		012	MAC	"10"x
O		6G0	Identificativo operazione	
			Anno	"4"n
			Codice operazione	/"4"n
O	AC	6G6	Partecipazioni	10 occorrenze
			Segno parametro	"1"x
			Valore parametro	/"9"n
			Importo	/"15"n
O		6GG	Nominativo di riferimento	"15"x
O		6GI	Sede centrale (Head office)	"15"x

(1) XXXXX = Codice A.B.I. YY = identificativo di ambiente (00 per la produzione).

(2) può assumere i valori:

O se il campo è obbligatorio

F se il campo è facoltativo

(3) contiene indicazioni sulle funzioni di sicurezza cui eventualmente è sottoposto il campo; può assumere valori:

A se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo

C se il campo è crittografato

AC se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo ed è crittografato

3.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E1

IDC 01 – TIPO MESSAGGIO

Assume il valore 6E1.

IDC 040 – MITTENTE

Identificativo del mittente.

IDC 050 – DESTINATARIO

Identificativo della Banca d'Italia.

IDC 020 – CRO

Codice di riferimento del messaggio assegnato dal mittente.

IDC D31 – DATA DI RIFERIMENTO

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

IDC 601 – ORA DI RIFERIMENTO

Ora di invio del messaggio nel formato hhmmss.

IDC 010 – CIFRA DI CONTROLLO

Codice di controllo calcolato sulla base di un algoritmo e di una chiave bilaterale scambiata tra MITTENTE e DESTINATARIO; deve essere presente se manca l'IDC 012, deve essere assente se presente l'IDC 012.

IDC 012 – MAC

Codice di controllo calcolato dall'applicazione SMTS. I primi otto caratteri contengono l'autenticatore zonato, gli altri due caratteri la versione delle chiavi di autenticazione e di cifratura. Deve essere presente se manca l'IDC 010, deve essere assente se presente l'IDC 010.

IDC 6G0 – IDENTIFICATIVO OPERAZIONE

E' l'identificativo dell'operazione di rimborso comunicato con il messaggio 6E0 – IDC 6G0.

IDC 6G6 – PARTECIPAZIONI

Questo IDC è definito obbligatorio e deve essere valorizzato in tutte le occorrenze in quanto soggetto a crittografia

Dal punto di vista dei contenuti è tuttavia significativa solo una occorrenza, poiché la richiesta di ER è unica.

Per la descrizione delle modalità con le quali l'IDC deve essere sottoposto al processo di crittografia e di autenticazione si rimanda al Capitolo "CRITTOGRAFIA E AUTENTICAZIONE".

L'IDC si articola nei sottocampi:

- "segno parametro"

è il segno relativo al parametro, assume valore '+' per esprimere valori parametro pari a 0 o positivi, assume il valore '-' per esprimere valori parametro negativi.

- "valore parametro"

indica il valore offerto dall'operatore per partecipare all'asta; le prime tre cifre rappresentano la parte intera, mentre le ultime sei rappresentano la parte decimale. Nel caso in cui esprima un tasso di interesse, l'operatore dovrà valorizzare con cifre significative solo i primi due campi decimali.

Deve essere valorizzato con il valore parametro indicato nel 6E0, ma non ha alcun effetto sui conteggi inviati tramite 6E7.

- "importo"

è l'importo, espresso in centesimi di euro, richiesto dall'operatore per il parametro associato. Deve essere pari all'"importo minimo" o all'"importo minimo" più un multiplo del "taglio incrementale". Il totale degli importi per ciascun tasso deve essere inferiore o uguale all'"importo massimo di partecipazione" eventualmente comunicato nel relativo sottocampo dell'IDC 6G2 del messaggio 6E0 di annuncio del rimborso.

IDC 6GG – NOMINATIVO DI RIFERIMENTO

Contiene il nominativo di riferimento dell'operatore con cui il personale della Banca d'Italia deve mettersi in contatto in caso di necessità.

IDC 6GI – SEDE CENTRALE (HEAD OFFICE)

Contiene l'identificativo della capogruppo, se l'operatore fa parte di un gruppo bancario, o della casa madre, se l'operatore è una filiale di banca estera. Il campo dovrà essere valorizzato con caratteri alfabetici e numerici. La prima posizione dovrà contenere un carattere valido.

3.3 VARIAZIONE DELLA RICHIESTA

Per la trasmissione della variazione di una richiesta di rimborso già trasmessa con precedente messaggio 6E1 cfr. Capitolo “operazioni di mercato aperto - OPERAZIONI DI RIFINANZIAMENTO TEMPORANEE”, par. 5.2.4.

3.4 ANNULLAMENTO DELLA RICHIESTA

Per la trasmissione dell'annullamento di una richiesta di rimborso già trasmessa con precedente messaggio 6E1 cfr. Capitolo “operazioni di mercato aperto – Operazioni di rifinanziamento temporanee”, par. 5.2.5.

3.5 RILIEVI SEGNALATI SUL MESSAGGIO 6E1 A FRONTE DEI CONTROLLI

- 500 - Mittente non abilitato
- 501 - Messaggio non autenticato correttamente
- 502 - Data di riferimento del messaggio errata
- 503 - Ora di riferimento errata
- 504 - Identificativo operazione di richiesta errata
- 505 - Importo errato o incongruente con quello/i indicato/i nel messaggio 6E0
- 506 - Parametro errato o non multiplo del frazionamento minimo ammesso del parametro
- 508 - Numero partecipazioni superiore al massimo ammesso
- 509 - Applicazione non disponibile
- 512 - Messaggio giunto dopo il cut-off
- 528 - Messaggio giunto dopo un intervento manuale
- 529 - Messaggio non decrittografato correttamente
- 533 - Data/ora di riferimento del messaggio inferiore a quella del messaggio precedentemente pervenuto

4 MESSAGGIO 6E2: CONFERMA RICEZIONE RICHIESTA

4.1 TRACCIATO

TIPO MESSAGGIO: 6E2

APPLICAZIONE BANCARIA MITTENTE:

01000BI006YY(1)

APPLICAZIONE BANCARIA DESTINATARIA:

XXXXXBI006YY(1)

O / F (2)	A / C (3)	IDC	DESCRIZIONE	FORMATO
O		01	Tipo messaggio	"3"b
O		040	Mittente (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		050	Destinatario (abi/cab/uff)	"5"n("/"5"n/"2"b)
O		020	CRO	"11"n
O		022	CRO originario	16x
O		D31	Data di riferimento (ggmmaaaa)	"8"n
O		601	Ora di riferimento (hhmmss)	"6"n
O		6G0	Identificativo operazione	
			Anno	"4"n
			Codice operazione ER	/"4"n

(4) XXXXX = Codice A.B.I. YY = identificativo di ambiente (00 per la produzione).

(5) può assumere i valori:

O se il campo è obbligatorio

F se il campo è facoltativo

(6) contiene indicazioni sulle funzioni di sicurezza cui eventualmente è sottoposto il campo; può assumere valori:

A se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo

C se il campo è crittografato

AC se il campo concorre al calcolo della cifra di controllo ed è crittografato

4.2 GUIDA PER LA COMPOSIZIONE DEL MESSAGGIO 6E2

IDC 01 – TIPO MESSAGGIO

Assume il valore 6E2.

IDC 040 – MITTENTE

Identificativo della Banca d'Italia.

IDC 050 – DESTINATARIO

Identificativo del destinatario.

IDC 020 – CRO

Codice di riferimento del messaggio assegnato dal mittente.

IDC 022 – CRO ORIGINARIO

Riporta il contenuto dell'IDC 020 del messaggio 6E1 cui si riferisce: vengono valorizzati i primi 11 caratteri di sinistra, secondo gli standard SIA.

IDC D31 – DATA DI RIFERIMENTO

Data di invio del messaggio nel formato ggmmaaaa.

IDC 601 – ORA DI RIFERIMENTO

Ora di invio del messaggio nel formato hhmmss.

IDC 6G0 – IDENTIFICATIVO OPERAZIONE

E' l'identificativo del rimborso comunicato con il messaggio 6E0 – IDC 6G0.

5 MESSAGGIO 6E7: DATI ESEGUITO PER LA SPUNTA DI RICHIESTA DI RIMBORSO

I messaggi 6E7 utilizzati per le richieste di rimborso hanno la stessa struttura dei messaggi 6E7 utilizzati per le operazioni di mercato aperto (cfr. Capitolo A).

6 MESSAGGIO 6E8: ACCETTAZIONE DATI ESEGUITO PER RICHIESTA DI RIMBORSO

I messaggi 6E8 utilizzati per le richieste di rimborso hanno la stessa struttura dei messaggi 6E8 utilizzati per le operazioni di mercato aperto (cfr. Capitolo A).

7 MESSAGGIO 6E9: CONFERMA RICEZIONE ACCETTAZIONE DATI ESEGUITO PER RICHIESTA DI RIMBORSO

I messaggi 6E9 utilizzati per le richieste di rimborso hanno la stessa struttura dei messaggi 6E9 utilizzati per le operazioni di mercato aperto (cfr. Capitolo A).

C. CRITTOGRAFIA E AUTENTICAZIONE

Nei messaggi sottoposti a crittografia e autenticazione, i trattamenti sono applicati dal C.A.B.I. nel seguente ordine:

- i messaggi in spedizione sono prima crittografati e quindi autenticati;
- i messaggi in ricezione sono prima sottoposti a verifica dell'autenticità e poi decrittografati.

La sequenza con la quale i singoli IDC ed i relativi sottocampi devono essere passati agli algoritmi di crittografia e autenticazione è quella con la quale gli stessi campi sono elencati nella descrizione dei messaggi.

Tutti i campi degli IDC sottoposti a crittografia e/o autenticazione sono di tipo obbligatorio e a lunghezza fissa.

1. CRITTOGRAFIA

La crittografia/decrittografia applicativa viene realizzata:

- tramite l'algoritmo BYCRIPT, le cui modalità tecnico-operative sono del tutto identiche a quelle già definite per la cifratura dei messaggi all'interno della RNI;
- tramite SMTS. In tal caso il messaggio riporta l'IDC 012 ("MAC End To End").

Nella composizione della stringa da crittografare o decrittografare, nell'ambito del singolo messaggio, valgono le seguenti regole:

- al processo di crittografia/decrittografia devono essere sottoposti i dati applicativi dei campi privi dei caratteri tipici della trasmissione via RNI (IDC, delimitatori, separatori tra sottocampi);
- la crittografia/decrittografia deve essere effettuata in unica soluzione. Pertanto la stringa va composta con tutti i campi che debbono essere sottoposti al processo in questione;
- nel caso di IDC con occorrenze, le occorrenze non utilizzate devono essere valorizzate con zeri.

Per quanto attiene alle chiavi bilaterali di crittografia, in ambiente di produzione, si richiama l'attenzione sulla sostituzione periodica delle stesse. Un aggiornamento non corretto ovvero non tempestivo determina infatti l'esclusione delle domande in sede d'asta. Si raccomanda, quindi, di effettuare la verifica delle nuove chiavi ogni qualvolta si procede alla sostituzione.

A tale scopo, dopo l'entrata in vigore delle nuove chiavi, è opportuno inviare un messaggio 6E1 di prova il cui contenuto informativo deve essere impostato con i seguenti valori:

IDC 6G0 - Identificativo operazione

Anno	impostato a	9999
Codice operazione	impostato a	9999

IDC 6G6 - Partecipazioni

Segno parametro	impostato a	+
Valore parametro	impostato a	999999999
Importo	impostato a	999999999999999

per tutte le 10 occorrenze

IDC 6GG - Nominativo di riferimento

impostato a AAAAAAAAAAAAAAAAAA

IDC 6GI - Sede centrale (Head office)

impostato a AAAAAAAAAAAAAAAAAA

Se la decrittografia è effettuata correttamente viene inviato dal centro applicativo un messaggio 6E2 di conferma ricezione della partecipazione; se si verificano errori il messaggio di prova 6E1 è rispedito al mittente in categoria RE01 con l'evidenza dell'errore riscontrato (codice errore 529 - Messaggio non decrittografato correttamente).

2. AUTENTICAZIONE

L'autenticazione applicativa viene realizzata:

- tramite l'algoritmo MODSIA, le cui modalità tecnico-operative sono del tutto identiche a quelle già definite per la cifratura dei messaggi all'interno della RNI; in tal caso il messaggio riporta l'IDC 010;
- tramite SMTS. In tal caso il messaggio riporta l'IDC 012 ("MAC End ToEnd").

Durante la gestione transitoria dei due sistemi di sicurezza gli IDC 010 e 012 sono mutuamente esclusivi (solo uno dei due deve essere presente).

Per la composizione della stringa da autenticare, nell'ambito del singolo messaggio, valgono le seguenti regole:

- tutti i sottocampi devono riportare il carattere separatore "/";
- la stringa da autenticare deve sempre essere lunga 160 byte; se la sua lunghezza è minore deve essere completata con degli zeri fino alla lunghezza di 160 byte;
- nel caso di IDC con occorrenze, le occorrenze non utilizzate devono essere valorizzate con zeri;
- nel caso di IDC con occorrenze, si determina il numero di occorrenze da sottoporre al processo di autenticazione come il numero massimo intero di occorrenze la cui lunghezza complessiva sia minore o uguale a 160 byte; se la lunghezza è minore, la stringa da passare alla routine di autenticazione deve essere completata, fino alla lunghezza di 160 byte, con un filler composto da caratteri zero (es. se un IDC prevede 5 occorrenze lunghe 50 caratteri ciascuna, saranno passate al processo di autenticazione le prime 3 occorrenze, 150 caratteri, più un filler composto di 10 caratteri zero).

3. ESEMPI

Si riportano nel seguito alcuni esempi relativi alle modalità di passaggio dati alle routine di crittografia e autenticazione.

IDC 6G6 del messaggio 6E1

Si esamina il caso in cui siano impostati 3 tassi diversi con i relativi importi:

tasso 1	+7,250000	importo	100.000 euro
tasso 2	+7,151111	importo	250.000 euro
tasso 2	+6,752222	importo	1.125.000 euro

Il formato con cui questi dati sono passati alla routine di crittografia, tenendo conto che gli importi sui messaggi sono espressi in centesimi e che le occorrenze non utilizzate dell'IDC devono essere impostate a zero, è il seguente:

```
+007250000000000010000000
+007151111000000025000000
+006752222000000112500000
+000000000000000000000000 -+
..... | -> 7 occorrenze
+000000000000000000000000 -+
```

Il formato con cui questi dati sono passati alla routine di autenticazione, tenendo conto che gli importi sui messaggi sono espressi in centesimi, è il seguente:

```
+ /007250000 /000000010000000
+ /007151111 /000000025000000
+ /006752222 /000000112500000
+ /000000000 /000000000000000
+ /000000000 /000000000000000 (5 occorrenze da 27 caratteri, totale 135)
00000000000000000000000000 (filler 25 caratteri)
```

Gli ultimi 25 caratteri sono impostati a zero per completare, fino alla lunghezza di 160 byte, l'area di passaggio dati alla routine di autenticazione.
