

**Ai singoli contatti ad hoc indicati dalle
Banche partecipanti**

OGGETTO: Indagine triennale sui mercati dei cambi e derivati OTC– Aprile 2022

Si comunica che è disponibile sul sito internet della Banca (www.bancaditalia.it, sezione: Statistiche – Raccolta dati – Indagine triennale derivati) la seguente documentazione utile per il reporting della parte del *Turnover* dell'indagine sui mercati dei cambi e derivati OTC:

- questo documento come istruzioni segnaletiche per Banca d'Italia;
- gli schemi di rilevazione dei dati sul *turnover*;
- la Guideline e le FAQ della Banca dei Regolamenti Internazionali (BRI).

Si raccomanda di utilizzare il file excel degli schemi di rilevazione dei dati sul turnover disponibile sul sito internet della Banca d'Italia: <https://www.bancaditalia.it/statistiche/raccolta-dati/indagine-derivati/index.html>. In questo template sono aggiunti dei chiarimenti conformi alla Guideline specifici sulle modalità di compilazione e di applicazione delle contro-valutazioni.

Si rammenta che l'indagine, prevista per il prossimo mese di **aprile 2022**, coinvolge i singoli intermediari e concerne la rilevazione del volume (*Turnover*) delle transazioni effettuate sui mercati dei cambi e derivati durante suddetto mese, **su base "locational"**, e cioè non consolidata. Gli schemi di rilevazione complessiva del *turnover* si compongono di:

- una prima parte riferita alle operazioni in valute (formulari¹ A2, A3, A4, A5, A6);
- una seconda parte dedicata ai derivati su tassi di interesse "*single-currency*" (formulario B);
- una parte generale di informazioni complementari (formulario "Info", domande 3 e 5);
- una parte di istruzioni sia della BRI che nazionali.

La "Lista globale dei partecipanti" all'indagine, distribuita ai referenti dei partecipanti all'indagine, deve essere utilizzata per identificare le controparti dei contratti, stipulati durante il periodo di rilevazione, da raggruppare nella categoria "*reporting dealers*". In particolare i reporting dealers italiani saranno di riferimento per la compilazione delle voci associate alla componente "*local*", mentre quelli non italiani dovranno essere di riferimento per la componente "*cross-border*".

Si informa, inoltre, che l'invio alla Banca d'Italia degli **schemi di rilevazione**, compilati secondo le regole segnaletiche previste dalla Guideline della BRI e seguendo le ulteriori istruzioni nazionali, deve avvenire improrogabilmente entro il **6 giugno 2022**. In particolare la trasmissione dei dati deve avvenire via e-mail, all'indirizzo indagine_bri@bancaditalia.it.

¹ Si rammenta che il formulario A1 non deve essere compilato.

Nel richiamare l'attenzione delle banche partecipanti sulla necessità di un'accurata compilazione degli schemi di rilevazione e del rispetto delle scadenze concordate, la Banca d'Italia resta a disposizione per ogni eventuale richiesta di assistenza (da far pervenire alla casella e-mail: indagine_bri@bancaditalia.it).

Roma, 15 Marzo 2022