

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

OGGETTO: Indagine triennale sui mercati dei cambi e derivati OTC – aprile 2025

Si comunica che è disponibile sul sito internet della Banca, al seguente indirizzo <https://www.bancaditalia.it/statistiche/raccolta-dati/indagine-derivati/index.html>, la documentazione utile per il *reporting* dell'indagine triennale della Banca dei Regolamenti Internazionali (BRI) sui mercati dei cambi e derivati OTC. Nella sezione dedicata al 2025 sono presenti tutti i documenti necessari per le due *survey* previste per questa quattordicesima edizione; per distinguere i documenti necessari alla *survey* "FX Settlements", si suggerisce di selezionare solo quelli che nella descrizione contengono la parola "*settlement*". I principali documenti sono:

- Lettera di istruzioni (il presente documento);
- gli schemi di rilevazione dei dati;
- la Guideline e le eventuali FAQ della BRI.

Si raccomanda di utilizzare il file Excel degli schemi di rilevazione dei dati sul *settlement* disponibile sul sito internet della Banca d'Italia che, rispetto al file presente sul sito della BRI, contiene in aggiunta 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 2025**, coinvolge le principali capogruppo apicali italiane e concerne la rilevazione del *settlement* dei derivati su valute. Lo schema di rilevazione prevede un solo template e nel file nazionale è presente una parte di istruzioni aggiuntive 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*".

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 **13 giugno 2025**. In particolare, la trasmissione dei dati deve avvenire via e-mail all'indirizzo indagine_bri@bancaditalia.it.

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, 6 marzo 2025