

Comunicazione n. DME/9034169 del 16 aprile 2009

Aggiornamento della Comunicazione n. DME/8005271 del 21 gennaio 2008 contenente chiarimenti di natura applicativa in merito al Regolamento Consob n. 16191/2007 in materia di mercati.

Premessa

Il 21 gennaio 2008 la Consob ha emanato la comunicazione DME/8005271 contenente chiarimenti di natura applicativa in merito al Regolamento Consob n. 16191/2007 in materia di mercati. In particolare, tale comunicazione fornisce indicazioni di natura tecnico-operativa relative:

- (i) al sistema di comunicazione alla Consob da parte degli intermediari delle operazioni effettuate su strumenti finanziari ammessi alla negoziazione in un mercato regolamentato (c.d. sistema di *transaction reporting*);
- (ii) alla pubblicazione ed al consolidamento delle informazioni pre-negoziazione e post-negoziazione;
- (iii) all'avvio/cessazione dell'attività di internalizzatore sistematico e al regime transitorio per i sistemi di scambi organizzati;
- (iv) alle misure per la continuità operativa di funzioni essenziali;
- (v) alle comunicazioni alla Consob da parte delle società di gestione dei mercati regolamentati.

Eventi intervenuti dall'emanazione di tale Comunicazione rendono necessario aggiornare alcune indicazioni contenute nei punti sub (i), (iii) e (v). In particolare, esse concernono le questioni di seguito delineate.

Sezione I - Sistema di *transaction reporting*. Introduzione dei codici alternativi (agli ISIN) di identificazione degli strumenti finanziari, denominati AII (*Alternative Instrument Identifier*).

Sezione II - Sistema di *transaction reporting*. Previsione della possibilità per gli intermediari di avvalersi dei sistemi multilaterali di negoziazione italiani per l'invio alla Consob delle segnalazioni.

Sezione III - Attività di internalizzazione sistematica. Introduzione di uno schema per standardizzare il contenuto delle informazioni da inviare alla Consob in occasione di nuove ammissioni di strumenti finanziari alle negoziazioni ovvero di cessazioni da quest'ultime.

Sezione IV - Comunicazioni alla Consob da parte delle società di gestione dei mercati regolamentati. Invio di informazioni anagrafiche relative agli strumenti finanziari ammessi a negoziazione.

Fatto salvo quanto espressamente indicato nella presente comunicazione, tutte le indicazioni contenute nella comunicazione DME/8005271 sono da intendersi non interessate da alcuna modifica e pertanto in vigore.

L'entrata in vigore delle indicazioni contenute nella presente comunicazione, che è *complementare* alla sopra citata comunicazione DME/8005271, è fissata al **22 maggio 2009**.

Sezione I

Sistema di *transaction reporting*. Introduzione dei codici alternativi (agli ISIN) di identificazione degli strumenti finanziari, denominati AII (*Alternative Instrument Identifier*)

La versione attuale del sistema di *transaction reporting* consente lo scambio di informazioni relative a strumenti finanziari ammessi a negoziazione in uno dei mercati regolamentati rilevanti ai fini del *transaction reporting*¹ che dispongono del codice identificativo internazionalmente utilizzato denominato codice ISIN (*International Securities Identifying Number*).

Tuttavia, esistono alcuni mercati regolamentati europei che trattano strumenti finanziari derivati (opzioni e *futures*) privi di codice ISIN².

La Comunicazione DME/8005271 del 21 gennaio 2008 specifica al riguardo che “*le operazioni aventi ad oggetto strumenti finanziari derivati ammessi a negoziazione in un mercato regolamentato ... che non utilizza il codice ISIN come codice di identificazione per tali strumenti finanziari non dovranno essere comunicate alla Consob fino a quando non saranno stati adeguati i tracciati record per la gestione di codici alternativi di identificazione*”.

Al fine di aumentare l’esaustività delle informazioni scambiate mediante il sistema di *transaction reporting* fra le diverse autorità, il CESR ha di recente rivisto alcune specifiche tecniche del sistema. In particolare, il CESR ha previsto la possibilità di gestire *anche* lo scambio di operazioni su strumenti finanziari derivati che *non* dispongono del codice ISIN, introducendo un codice alternativo di identificazione per tali strumenti, denominato codice AII (*Alternative Instrument Identifier*).

Alla luce di tali modifiche, è stato aggiornato anche il sistema nazionale di *transaction reporting* al fine di consentire l’invio alla Consob da parte degli intermediari anche delle operazioni relative a strumenti finanziari derivati identificati dal codice AII. Tale nuova versione del sistema è già disponibile per il collaudo con gli intermediari e continuerà ad esserlo fino al 15 maggio 2009³.

Ciò comporta, da un punto di vista pratico, la necessità di un adeguamento delle specifiche tecniche dei tracciati *record* finalizzato alla gestione dei codici AII ed alla conseguente introduzione di controlli di qualità anche su tali segnalazioni. Per i dettagli delle nuove specifiche si rinvia all’**Allegato I**, che è da considerarsi parte integrante della presente comunicazione.

Per quanto concerne le segnalazioni relative alle operazioni pregresse⁴, gli intermediari che hanno posto in essere in tale periodo operazioni su strumenti identificati dal codice AII potranno essere esonerati dall’invio nei flussi del *transaction reporting*, previa comunicazione alla Consob della scelta di avvalersi di tale facoltà⁵. Al riguardo, si sottolinea comunque che tali intermediari saranno tenuti a riscontrare tempestivamente e puntualmente eventuali richieste *ad hoc* che la Consob potrebbe effettuare per necessità di vigilanza proprie e/o provenienti da altre Autorità relative alle suddette operazioni pregresse.

¹ Si ricorda che i mercati regolamentati rilevanti ai fini del *transaction reporting* - come definiti nella comunicazione DME/8005271 - sono i mercati regolamentati dei 29 paesi rilevanti, ovvero dei 27 paesi dell’Unione europea, nonché dell’Islanda e della Norvegia.

² Ad esempio alcuni di essi sono (i) l’inglese “The London International Financial Future and Options Exchanges (Liffe)”, (ii) il belga “Liffe Brussels”, (iii) il tedesco “Eurex Deutschland” e (iv) il portoghese “Nyse Euronext-Mercado de Futuros e Opcoes”. Gli strumenti finanziari ammessi a negoziazione nei mercati regolamentati italiani invece sono tutti identificati dal codice ISIN.

³ I soggetti interessati al collaudo possono prenotarsi inviando un’email al seguente indirizzo di posta elettronica: transaction.reporting@consob.it.

⁴ Ovvero delle operazioni concluse nel periodo fra il 3 novembre 2008 e la data di avvio delle segnalazioni.

⁵ La comunicazione di tale facoltà dovrà essere indirizzata a CONSOB - Divisione Mercati - Via G. B. Martini, n. 3 - 00198 ROMA, oppure al seguente indirizzo di posta elettronica: transaction.reporting@consob.it.

Sezione II

Sistema di *transaction reporting*. Previsione della possibilità per gli intermediari di avvalersi dei sistemi multilaterali di negoziazione italiani per l'invio alla Consob delle segnalazioni

L'art. 25 della MiFID prevede che l'autorità competente riceva dagli intermediari i dettagli delle operazioni che hanno avuto per oggetto strumenti finanziari ammessi a negoziazione in un mercato regolamentato, sia nel caso in cui esse siano state concluse in mercati regolamentati, sia qualora siano state concluse al di fuori di essi. Tuttavia, al comma 5 del medesimo articolo, la direttiva prevede che nei casi in cui le operazioni *pervengano già* all'autorità competente da un mercato regolamentato, da un sistema multilaterale di negoziazione o da un sistema di confronto degli ordini (*trade matching system*) o di notifica, gli intermediari possono essere esonerati dall'obbligo in parola, al fine di evitare una duplicazione delle informazioni e dei connessi oneri a carico di quest'ultimi.

Al riguardo, la Consob, in occasione dell'emanazione del proprio regolamento in materia di mercati, ha espressamente esercitato tale facoltà consentendo agli intermediari di non dover comunicare le operazioni concluse in un mercato regolamentato *italiano*.

Con la comunicazione del 21 gennaio 2008 la Consob ha chiarito quindi che "*intende ricevere direttamente dagli intermediari presenti in Italia soltanto le segnalazioni relative alle operazioni concluse al di fuori dei mercati regolamentati italiani*".

Pertanto attualmente la Consob riceve dagli intermediari presenti in Italia le comunicazioni relative alle operazioni concluse **(i)** sui mercati regolamentati esteri; **(ii)** sui sistemi multilaterali di negoziazione sia nazionali sia esteri; **(iii)** al di fuori sia dei mercati regolamentati sia dei sistemi multilaterali di negoziazione.

Al riguardo, la Consob ritiene utile introdurre la *possibilità* per gli intermediari presenti in Italia di avvalersi dei sistemi multilaterali di negoziazione italiani per l'invio alla Consob delle segnalazioni relative alle operazioni ivi concluse e aventi per oggetto strumenti finanziari ammessi a negoziazione in uno dei mercati regolamentati rilevanti ai fini del *transaction reporting*.

In tal caso i sistemi multilaterali di negoziazione e gli intermediari partecipanti a tali sistemi si devono impegnare a rispettare le seguenti condizioni:

(i) i sistemi multilaterali di negoziazione devono effettuare tali segnalazioni per conto di *tutti* gli intermediari partecipanti ai propri sistemi di negoziazione;

(ii) i sistemi multilaterali di negoziazione devono raccogliere dagli intermediari partecipanti ai propri sistemi di negoziazione l'impegno di questi ultimi a non inviare alla Consob le segnalazioni già effettuate per loro conto dal sistema multilaterale di negoziazione;

(iii) i sistemi multilaterali di negoziazione devono inviare alla Consob le informazioni relative soltanto alle operazioni aventi per oggetto strumenti finanziari ammessi a negoziazione in uno dei mercati regolamentati rilevanti ai fini del *transaction reporting*;

(iv) i sistemi multilaterali di negoziazione devono in questo caso inviare alla Consob flussi di dati aventi le caratteristiche di quelli rivenienti dalle piattaforme di negoziazione, purché di contenuto analogo a quello previsto dall'art. 15, comma 2, del Regolamento Consob n. 16191/2007 in materia di mercati, come integrato dalla comunicazione n. DME/8005271 e dalla presente comunicazione nella successiva Sezione IV.

Sezione III

Attività di internalizzazione sistematica. Introduzione di uno schema per standardizzare il contenuto delle informazioni da inviare alla Consob in occasione di nuove ammissioni di strumenti finanziari alle negoziazioni ovvero di cessazioni da quest'ultime

L'esigenza di introdurre uno schema standardizzato origina dall'esperienza maturata nel corso dell'anno appena trascorso durante il quale, anche attraverso incontri diretti con alcuni degli internalizzatori e contatti informali con altri, è emersa l'opportunità di pervenire ad una uniformità delle informazioni da inviare alla Consob relative agli strumenti finanziari che vengono ammessi ovvero cancellati dalle negoziazioni sui sistemi di internalizzazione.

Nella Sezione III della precedente comunicazione del 21 gennaio 2008 la Commissione ha fornito:

- al punto 1: chiarimenti e indicazioni per l'applicazione delle norme concernenti l'attività di internalizzazione sistematica sia quando questa ha ad oggetto le azioni ammesse a negoziazione nei mercati regolamentati sia quando riguarda strumenti finanziari diversi dalle azioni;
- al punto 2: chiarimenti e indicazioni in merito al regime transitorio per i sistemi di scambi organizzati.
- al punto 3: indicazioni circa l'effettuazione dei calcoli e delle stime per le azioni ammesse a negoziazione sui mercati regolamentati ai fini di quanto stabilito dall'art. 27 della MiFID, recepito nell'art. 27 del Regolamento Consob in materia di mercati.

Al riguardo si osserva che in merito all'informativa fornita nell'ambito del punto 3, *“L'elenco delle azioni ammesse a negoziazione nei mercati regolamentati dell'Unione Europea e, fra queste, delle azioni considerate liquide ai fini dell'adempimento degli obblighi di cui all'art. 27 della MiFID, è reso disponibile dal CESR, sulla base delle informazioni comunicate da ciascuna autorità competente”*.

Per quanto concerne poi i chiarimenti e le indicazioni forniti al suddetto punto 2, essi si intendono oramai superati, considerato che il termine del regime transitorio per i sistemi di scambi organizzati era il 31 marzo 2008 e che come, più volte ribadito, il recepimento della MiFID ha comportato la soppressione della figura dei sistemi in parola.

Con riferimento infine all'attività di internalizzazione sistematica, la Consob intende confermare i chiarimenti di cui al punto 1 della precedente comunicazione, e al contempo richiamare l'attenzione degli internalizzatori sulla opportunità di pervenire ad una uniformità delle informazioni inviate alla Consob relative agli strumenti finanziari che vengono ammessi ovvero, cancellati dalle negoziazioni sui sistemi di internalizzazione.

Nella precedente comunicazione, in relazione all'obbligo di cui all'art. 21, comma 1, lettera c) del regolamento Consob in materia di mercati, era stato stabilito che: *“Le informazioni relative all'avvio/cessazione dell'attività di internalizzazione sistematica su uno o più strumenti finanziari sono trasmesse alla Consob all'indirizzo e-mail internalizzatori@consob.it”*.

In proposito, considerata l'esperienza maturata nel corso del precedente anno, durante la quale si è avuto modo di osservare che quasi quotidianamente si verificano variazioni nei listini dovute soprattutto a nuovi ingressi di strumenti finanziari, la Consob ritiene utile introdurre uno schema contenente la standardizzazione del formato e del tipo di informazioni concernenti gli strumenti finanziari che entrano nei listini dei sistemi di internalizzazione, ovvero cessano di essere trattati dagli stessi sistemi.

Lo schema, accluso alla presente comunicazione (*Allegato 2*), contiene l'indicazione del tipo di

formato che deve essere utilizzato, nonché l'indicazione specifica delle singole informazioni da fornire. Si forniscono altresì alcuni chiarimenti per la sua corretta compilazione.

Lo schema dovrà essere inviato, da parte dell'intermediario internalizzatore sistematico accompagnato da una nota di trasmissione inviata via *email* all'indirizzo sopra ribadito.

Sezione IV

Comunicazioni alla Consob da parte delle società di gestione dei mercati regolamentati. Invio di informazioni anagrafiche relative agli strumenti finanziari ammessi a negoziazione

L'articolo 15, comma 6, del Regolamento Consob in materia di mercati richiede alle società di gestione la trasmissione alla Consob di periodici flussi informativi elettronici in cui i dati relativi ai mercati gestiti sono organizzati o elaborati secondo le modalità stabilite dalla Consob stessa.

Al riguardo, con il presente documento, si intende altresì fornire indicazione in merito alla corretta compilazione del flusso informativo che giornalmente le società di gestione inviano alla Consob. In particolare, esse sono tenute ad inviare, per ogni strumento finanziario ammesso nei mercati gestiti, almeno le seguenti informazioni⁶:

- a) codice ISIN (ISO 6166 - *International Securities Identification Number*): identifica lo strumento finanziario;
- b) codice MIC del mercato (ISO 10383 - *Market Identifier Code*): identifica il mercato nel quale lo strumento finanziario è ammesso a negoziazione;
- c) denominazione dello strumento finanziario espressa possibilmente in conformità allo standard ISO 18477 FISN;
- d) codice ISIN del sottostante;
- e) codice CFI (ISO 10962 - *Classification of Financial Instrument*): identifica la tipologia di strumento finanziario;
- f) data di scadenza;
- g) *strike price*;
- h) codice valuta in cui è espresso lo *strike price* (ISO 4217 - *Currency Code*);
- i) moltiplicatore: numero di unità dello strumento finanziario contenuti in un "*trading lot*";
- j) valore del punto indice;
- k) valore nominale;
- l) codice valuta in cui è espresso il valore nominale (ISO 4217 - *Currency Code*);
- m) data di ammissione a quotazione sul mercato;
- n) codice paese della casa madre dell'emittente⁷ (ISO 3166 *Country Code*);

⁶ Resta fermo in capo alle società di gestione l'obbligo di invio alla Consob *anche* di tutte le altre informazioni, attualmente inviate, non incluse nel presente elenco.

⁷ Ultimo soggetto della catena; nelle more del reperimento di tale informazione si può fornire in tale campo il codice paese di registrazione della controllante diretta.

- o) codice paese dell'indice (ISO 3166 - *Country Code*); il paese emittente degli strumenti finanziari costituenti il paniere, solo se è unico;
- p) data inizio validità dell'insieme informativo, cioè la data in cui l'insieme dei dati anagrafici relativo allo strumento finanziario è entrato in vigore;
- q) data fine validità dell'insieme informativo, cioè la data a partire dalla quale l'insieme di dati anagrafici relativo allo strumento finanziario non è più valido.

Nel dettaglio, la seguente tabella descrive per quali tipologie di strumenti finanziari è necessario fornire le suddette informazioni:

	Azioni	Obbligazioni	Derivati	Derivati su Indici
Codice ISIN ISO 6166 - International Securities Identification Number (ISIN)	O	O	O	O
Mercato (MIC) Identifica il mercato nel quale lo strumento finanziario è listato	O	O	O	O
Denominazione	O	O	O ⁸	O
Codice ISIN del sottostante	N/A	N/A	O	C
ISO 10962 - Classification of Financial Instrument (CFI)	O	O	O	O
Data Scadenza	N/A	O	O	O
Strike Price	N/A	N/A	C ⁹	O
Codice valuta dello Strike Price	N/A	N/A	C ¹⁰	O
Moltiplicatore	1	1	O	O
Valore del punto indice	N/A	N/A	N/A	O
Valore nominale	N/A	O	N/A	N/A
Codice Valuta del valore nominale	N/A	O	N/A	N/A
Data di ammissione a quotazione sul mercato	O	O	O	O
Codice Paese della casa madre	N/A	O	N/A	N/A

⁸ Obbligatorio nei casi in cui l'Agenzia di Codifica assegna il codice ISIN allo strumento finanziario sottostante.

⁹ Obbligatorio per opzioni e *warrant*.

¹⁰ Obbligatorio per opzioni e *warrant*.

Codice paese dell'indice (il paese degli strumenti finanziari costituenti il paniere, solo se è unico)	N/A	N/A	N/A	C
Data Inizio Validità dell'insieme informativo	O	O	O	O
Data fine validità dell'insieme informativo	O	O	O	O

O = Obbligatorio

C = Condizionale

N/A = Non applicabile

1 = Uno

IL PRESIDENTE

Lamberto Cardia

xsd nazionale v2.0

MiFID - TREM v2.0 per interfaccia locale

1. Invio di transazioni su strumenti finanziari identificati dal codice alternativo di identificazione (AII)

Gli strumenti finanziari possono essere identificati mediante due diverse codifiche, a seconda del mercato sul quale sono ammessi a negoziazione:

1. il codice ISIN (standard ISO6166);
2. il codice AII, composto dai seguenti 6 elementi obbligatori:
 - **Exchange Code** - Codice identificativo del Mercato che ha ammesso a negoziazione lo strumento finanziario, espresso secondo il formato standard ISO 10383 (MIC code);
 - **Exchange Product Code** - Codice generato e gestito dai mercati dei prodotti derivati. Il codice ha una lunghezza variabile tra 1 e 12 caratteri ed è associato in modo univoco ad un particolare strumento sottostante e ad un tipo di “settlement” o altre caratteristiche del contratto;
 - **Derivative Type** - Identifica se il prodotto derivato è di tipo “*option*” o di tipo “*future*”;
 - **Put/Call Identifier** - Un carattere che identifica, in caso di *option* , se essa è di tipo Put o Call. E’ sempre valorizzato con F in caso di future.
 - **Expiry/Delivery/Prompt Date** - Data di scadenza o di esercizio di un contratto derivato, espresso secondo il formato standard ISO 8601 (YYYY-MM-DD) .
 - **Strike Price** - Il prezzo d’esercizio di un’opzione o di un altro strumento finanziario. I future non hanno prezzo d’esercizio.

Il formato del codice alternativo di identificazione è il seguente:

Campo	Formato	Contenuto valido
Exchange Code	4 caratteri alfanumerici	
Exchange Product Code	Da 1 a 12 caratteri alfanumerici	
Derivative Type	1 carattere	“O” (Option) – “F” (Future)
Put/Call Identifier	1 carattere	“P” (Put) – “C” (Call) – “F” (Future)
Expiry/Delivery/Prompt Date	ISO 8601 YYYY-MM-DD	
Strike Price	Numero di lunghezza max 19 caratteri con al più 5 cifre decimali separate dalla parte intera da un punto e senza zeri né in testa né in coda	Lo strike price vale “0” nel caso di un future.

Tutte le transazioni concluse in una giornata di negoziazione, siano esse su strumenti finanziari identificati da ISIN o su strumenti finanziari identificati da AII, devono essere incluse in un unico file.

Il formato del file è definito nello schema MiFID.xsd pubblicato congiuntamente al presente documento.

2. *Variazione dello schema xml*

La nuova versione dello schema (xsd v2.0) permette di specificare se una transazione è stata conclusa su uno strumento finanziario identificato da un codice ISIN o identificato da un codice AII.

Gli intermediari che *non concludono* operazioni su strumenti finanziari identificati dal codice AII sono tenuti a modificare soltanto il numero di versione del file in formato *xml* che producono per Consob (che passa da v1.0 a v2.0)¹¹; il contenuto del file che inviano alla Consob invece non subirà alcuna ulteriore modifica.

Gli intermediari che *concludono* operazioni su strumenti finanziari identificati dal codice AII, oltre a dover modificare il numero di versione dello schema (che passa sempre da v1.0 a v2.0), dovranno segnalare tali operazioni secondo le specifiche tecniche riportate in appendice.

¹¹ In particolare la riga del file xml:

<xs:attribute name="Version" type="xs:string" use="required" fixed="1.0"/>;

diventa :

<xs:attribute name="Version" type="xs:string" use="required" fixed="2.0"/>

Appendice

Struttura e formato dello schema xml

Nello schema XML per le transazioni, l'AII è rappresentato dal complex type **<AIIInstrumentIdentification>**, formato da 6 campi obbligatori: **<AIIExchangeCode>**, **<AIIProductCode>**, **<AIIDerivativeType>**, **<AIIPutCallIdentifier>**, **<AIIExpiryDate>**, **<AIIStrikePrice>**

<AIIInstrumentIdentification>	Identificativo del codice AII. Formato da 6 campi obbligatori: <ol style="list-style-type: none"> 1) Market code 2) Exchange product code 3) Derivative type 4) Put/Call identifier 5) Expiry/Delivery/Prompt date 6) Strike price
<pre> <xs:complexType name="AIIInstrumentIdentificationType"> <xs:sequence> <xs:element name="AIIExchangeCode" type="AIIExchangeCodeType"/> <xs:element name="AIIProductCode" type="AIIProductCodeType"/> <xs:element name="AIIDerivativeType" type="AIIDerivativeTypeType"/> <xs:element name="AIIPutCallIdentifier" type="AIIPutCallIdentifierType"/> <xs:element name="AIIExpiryDate" type="xs:date"/> <xs:element name="AIIStrikePrice" type="AIIStrikePriceType"/> </xs:sequence> </pre>	
<AIIExchangeCode>	Identificativo del mercato regolamentato che ammette lo strumento alla contrattazione.
<pre> <xs:simpleType name="AIIExchangeCodeType"> <xs:annotation> <xs:documentation> ISO 10383 MIC - Format 4(x) </xs:documentation> </xs:annotation> <xs:restriction base="xs:string"> <xs:whiteSpace value="collapse"/> <xs:pattern value="([A-Z][0-9]){4}"/> </xs:restriction> </xs:simpleType> </pre>	

<AIProductCode>	Codice gestito dai mercati dei prodotti derivati. Lunghezza da 1 a 12.
<pre> <xs:simpleType name="AIProductCodeType"> <xs:annotation> <xs:documentation> AII product code type - Format: Max12(x) </xs:documentation> </xs:annotation> <xs:restriction base="xs:string"> <xs:minLength value="1"/> <xs:maxLength value="12"/> <xs:whiteSpace value="collapse"/> <xs:pattern value="([A-Z][0-9])*"/> </xs:restriction> </xs:simpleType> </pre>	
<AIIDerivativeType>	Un solo carattere che indica se lo strumento è un'option o un future.
<pre> <xs:simpleType name="AIIDerivativeTypeType"> <xs:annotation> <xs:documentation> O: Option F: Future </xs:documentation> </xs:annotation> <xs:restriction base="xs:string"> <xs:whiteSpace value="collapse"/> <xs:pattern value="O F"/> </xs:restriction> </xs:simpleType> </pre>	
<AIIPutCallIdentifier>	Un solo carattere che indica se si tratta di put o call (NOTA: questo campo deve valere "F" nel caso di future).
<pre> <xs:simpleType name="AIIPutCallIdentifierType"> <xs:annotation> <xs:documentation> P: Put C: Call F: Future </xs:documentation> </xs:annotation> </pre>	

<pre> <xs:restriction base="xs:string"> <xs:whiteSpace value="collapse"/> <xs:pattern value="P C F"/> </xs:restriction> </xs:simpleType> </pre>	
<AIIExpiryDate>	La data di scadenza di un contratto su prodotto derivato. Formato: type="xs:date"
<AIIStrikePrice>	Il prezzo d'esercizio di un'option o di un altro strumento finanziario
<pre> <xs:simpleType name="AIIStrikePriceType"> <xs:annotation> <xs:documentation>Format: Max 19(d) and max 5 decimals numbers. Negative values are not allowed </xs:documentation> </xs:annotation> <xs:restriction base="xs:decimal"> <xs:totalDigits value="19"/> <xs:fractionDigits value="5"/> <xs:minInclusive value="0"/> </xs:restriction> </xs:simpleType> </pre>	

Esempio

Stralcio di un file di transazioni relative ad AII:

```

<AIIInstrumentIdentification>
  <AIIExchangeCode>ECAG</AIIExchangeCode>
  <AIIProductCode>ABC12345678X</AIIProductCode>
  <AIIDerivativeType>O</AIIDerivativeType>
  <AIIPutCallIdentifier>P</AIIPutCallIdentifier>
  <AIIExpiryDate>2007-12-30</AIIExpiryDate>
  <AIIStrikePrice>12.4</AIIStrikePrice>
</AIIInstrumentIdentification>

```

TRACCIATO DATI PER ANAGRAFICHE TITOLI INTERMEDIARI

Per uniformare l’invio delle informazioni sui titoli trattati presso gli internalizzatori sistematici si propone l’invio di un file in formato Excel strutturato secondo la seguente tabella:

NOME DELLA COLONNA	FORMATO	CONTENUTO	OBBLIGATORIO
internalizzatore	alfanumerico	denominazione dell’internalizzatore	Si
codice isin	alfanumerico	codice isin del titolo	Si
titolo	alfanumerico	denominazione del titolo	Si
emittente	alfanumerico	denominazione emittente	Si
valuta	alfanumerico	codice valuta di emissione [ISO 4217 - <i>Currency Code</i>]	Si
tipo	alfanumerico	codice tipologia titolo [ISO 10962 - <i>Classification of Financial Instrument(CFI)</i>]	No
quotazione	si /no	indicatore eventuale della quotazione su mercati regolamentati italiani e riconosciuti dall’ordinamento comunitario	Si
mercato	alfanumerico	codice mercato regolamentato principale di quotazione [ISO 10383 - <i>Market Identifier Code (MIC)</i>]	Da avvalorare solo se il titolo è quotato
data inizio	data gg/mm/aaaa	data inizio trattazione sull’internalizzatore	Si
data fine	data gg/mm/aaaa	data fine trattazione sull’internalizzatore	Da avvalorare solo quando il titolo viene escluso dalla trattazione

Al primo invio è facoltà dell’internalizzatore optare tra la segnalazione dell’intera anagrafica degli strumenti finanziari dall’avvio dell’attività, quindi con il campo data fine avvalorato per gli strumenti finanziari non più trattati, oppure inviare l’intera anagrafica dei soli strumenti trattati quel

momento, quindi con il campo data fine vuoto.

Per gli invii successivi al primo, dovuti ad una o più modifiche dell'elenco degli strumenti finanziari trattati, occorrerà far pervenire l'intera ultima versione inviata, modificata come di seguito indicato:

- con l'aggiunta di una nuova riga per ogni nuovo strumento finanziario trattato,
- con la valorizzazione del campo data fine per ogni strumento finanziario non più trattato.

Il file così trasmesso costituirà la base per le eventuali successive modifiche e conseguenti invii.

Per ogni combinazione codice isin / data inizio occorrerà inserire una sola riga, quindi nel caso in cui un titolo venga nuovamente riammesso alla trattazione dopo tale periodo, il file conterrà, con riferimento al suddetto codice, una riga avente la data inizio e la data fine avvalorate e una nuova riga con la sola data inizio avvalorata.