

Bruxelles, 31 ottobre 2025
(OR. en)

14785/25
ADD 1

EF 360
ECOFIN 1447
DELECT 166
ECB

NOTA DI TRASMISSIONE

Origine:	Segretaria generale della Commissione europea, firmato da Martine DEPREZ, direttrice
Data:	29 ottobre 2025
Destinatario:	Thérèse BLANCHET, segretaria generale del Consiglio dell'Unione europea
n. doc. Comm.:	C(2025) 7124 annex
Oggetto:	ALLEGATI del REGOLAMENTO DELEGATO (UE) .../... DELLA COMMISSIONE che integra il regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione che specificano le condizioni operative, l'obbligo di rappresentatività e gli obblighi di segnalazione connessi all'obbligo del conto attivo

Si trasmette in allegato, per le delegazioni, il documento C(2025) 7124 annex.

All.: C(2025) 7124 annex



COMMISSIONE
EUROPEA

Bruxelles, 29.10.2025
C(2025) 7124 final

ANNEXES 1 to 3

ALLEGATI

del

REGOLAMENTO DELEGATO (UE) .../... DELLA COMMISSIONE

**che integra il regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio per
quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione che specificano le condizioni
operative, l'obbligo di rappresentatività e gli obblighi di segnalazione connessi
all'obbligo del conto attivo**

ALLEGATO I

Categorie di derivati e relative sottocategorie ai fini dell'obbligo di rappresentatività

Tabella 1

Sottocategorie per Fixed-to-float in EUR

	Dimensione delle negoziazioni (in milioni di EUR)		
Scadenza	[0-25M]	[25M-50M]	[50M+]
[0-5A]			
[5A-10A]			
[10A-15A]			
[15A+]			

Tabella 2

Sottocategorie per OIS in EUR

	Dimensione delle negoziazioni (in milioni di EUR)		
Scadenza	[0-25M]	[25M-100M]	[100M+]
[0-1A]			
[1A-2A]			
[2A-5A]			
[5A+]			

Tabella 3

Sottocategorie per FRA in EUR

	Dimensione delle negoziazioni (in milioni di EUR)		
Scadenza	[0-75M]	[75M-200M]	[200M+]
[0-6M]			
[6M-12M]			
[12M-18M]			
[18M+]			

Tabella 4

Sottocategorie per Fixed-to-float in PLN

	Dimensione delle negoziazioni (in milioni di PLN)
Scadenza	Qualsiasi dimensione delle negoziazioni
Qualsiasi scadenza	

Tabella 5

Sottocategorie per FRA in PLN

	Dimensione delle negoziazioni (in milioni di PLN)
Scadenza	Qualsiasi dimensione delle negoziazioni
Qualsiasi scadenza	

Tabella 6

Categorie di derivati per STIR in EUR

Esecuzione	Sottostante	Indice di riferimento	Valuta di regolamento	Tipo di valuta di regolamento	Opzionalità
Borse UE o di paesi terzi	Tasso di interesse a 3 mesi	Euribor	EUR	Valuta unica	Esclusa
Borse UE o di paesi terzi	Tasso di interesse a 3 mesi	€STR	EUR	Valuta unica	Esclusa

Tabella 7

Sottocategorie per STIR in EUR collegati all'Euribor

	Dimensione delle negoziazioni (in milioni di EUR)
Scadenza	Qualsiasi dimensione delle negoziazioni
[0-6M]	
[6M-12M]	
[12M-24M]	
[24M+]	

Tabella 8

Sottocategorie per STIR in EUR collegati allo €STR

	Dimensione delle negoziazioni (in milioni di EUR)
Scadenza	Qualsiasi dimensione delle negoziazioni
[0-6M]	
[6M-12M]	
[12M-24M]	
[24M+]	

ALLEGATO II

Modelli di cui all'articolo 7

Tabella 1

Informazioni sulla controparte

	Campo	Dettagli da segnalare
1	Data di segnalazione	Data di presentazione della segnalazione all'autorità competente
2	Controparte soggetta ai requisiti relativi al conto attivo	L'identificativo della persona giuridica (LEI) della controparte di un'operazione su derivati che adempie l'obbligo di segnalazione mediante la segnalazione in questione. Nel caso di un'operazione su derivati allocata eseguita da un gestore di fondi per conto di un fondo, è segnalato come controparte il fondo e non il gestore di fondi.
3	Natura della controparte	Indicare se la controparte è una CCP, una controparte finanziaria o una controparte non finanziaria ai sensi dell'articolo 2, punti 1), 8) e 9) rispettivamente, del regolamento (UE) n. 648/2012, o un soggetto di cui all'articolo 1, paragrafo 5, di detto regolamento.
4	Entità all'interno del gruppo	Un elenco degli identificativi delle persone giuridiche (LEI) delle entità all'interno del gruppo.
5	Entità controllante capogruppo	L'identificativo della persona giuridica (LEI) dell'entità controllante capogruppo.
6	Partecipante diretto	L'identificativo della persona giuridica (LEI) del partecipante diretto.

Tabella 2

Attività ed esposizioni al rischio

	Campo	Dettagli da segnalare	Totale								
1	Importo nozionale lordo in essere della posizione media a fine mese aggregata per i 12 mesi precedenti nelle categorie di contratti derivati compensati di cui all'articolo 7 bis, paragrafo 6, del regolamento (UE) n. 648/2012	La somma aggregata dell'importo nozionale della gamba 1 e, se del caso, dell'importo nozionale della gamba 2 per i contratti derivati che rientrano nell'ambito di applicazione della presente segnalazione, di cui all'articolo 5 del regolamento (UE) 2022/1855 della Commissione									
2	Dimensione 1 — Ripartizione del totale per categoria di derivati		IRD OTC IN EUR			IRD OTC IN PLN			STIR IN EUR		
3	Dimensione 2 — Ripartizione per CCP (UE/classe 2/classe 1) (segnalazione a livello del LEI della CCP)		CCP1	CCP2	...	CCP1	CCP2	...	CCP1	CCP2	...

ALLEGATO III

Segnalazione in merito all'obbligo di rappresentatività

** Da compilare con il numero di negoziazioni per sottocategoria, per ciascuna categoria di contratti derivati e per il periodo di riferimento applicabile*

Tabella 1

Sottocategorie per Fixed-to-float in EUR

Periodo di riferimento							
Servizio di compensazione di rilevanza sistemica significativa a norma dell'articolo 25, paragrafo 2 quater				CCP autorizzata a norma dell'articolo 14			
	Dimensione delle negoziazioni (in milioni di EUR)				Dimensione delle negoziazioni (in milioni di EUR)		
Scadenza	[0-25M]	[25M-50M]	[50M+]	Scadenza	[0-25M]	[25M-50M]	[50M+]
[0-5A]				[0-5A]			
[5A-10A]				[5A-10A]			
[10A-15A]				[10A-15A]			
[15A+]				[15A+]			

Tabella 2

Sottocategorie per OIS in EUR

Periodo di riferimento							
Servizio di compensazione di rilevanza sistemica significativa a norma dell'articolo 25, paragrafo 2 quater				CCP autorizzata a norma dell'articolo 14			
	Dimensione delle negoziazioni (in milioni di EUR)				Dimensione delle negoziazioni (in milioni di EUR)		
Scadenza	[0-25M]	[25M-100M]	[100M+]	Scadenza	[0-25M]	[25M-100M]	[100M+]
[0-1A]				[0-1A]			
[1A-2A]				[1A-2A]			

[2A-5A]				[2A-5A]			
[5A+]				[5A+]			

Tabella 3

Sottocategorie per FRA in EUR

Periodo di riferimento							
Servizio di compensazione di rilevanza sistemica significativa a norma dell'articolo 25, paragrafo 2 quater				CCP autorizzata a norma dell'articolo 14			
	Dimensione delle negoziazioni (in milioni di EUR)				Dimensione delle negoziazioni (in milioni di EUR)		
Scadenza	[0-75M]	[75M-200M]	[200M+]	Scadenza	[0-25M]	[25M-100M]	[100M+]
[0-6M]				[0-6M]			
[6M-12M]				[6M-12M]			
[12M-18M]				[12M-18M]			
[18M+]				[18M+]			

Tabella 4

Sottocategorie per Fixed-to-float in PLN

Servizio di compensazione di rilevanza sistemica significativa a norma dell'articolo 25, paragrafo 2 quater		CCP autorizzata a norma dell'articolo 14	
	Dimensioni delle negoziazioni (in milioni di PLN)		Dimensioni delle negoziazioni (in milioni di PLN)
Scadenza	Qualsiasi dimensione delle negoziazioni	Scadenza	Qualsiasi dimensione delle negoziazioni
Qualsiasi scadenza		Qualsiasi scadenza	

Tabella 5

Sottocategorie per FRA in PLN

Servizio di compensazione di rilevanza sistemica significativa a norma dell'articolo 25, paragrafo 2 quater		CCP autorizzata a norma dell'articolo 14	
	Dimensioni delle negoziazioni (in milioni di PLN)		Dimensioni delle negoziazioni (in milioni di PLN)
Scadenza	Qualsiasi dimensione delle negoziazioni	Scadenza	Qualsiasi dimensione delle negoziazioni
Qualsiasi scadenza		Qualsiasi scadenza	

Tabella 6

Sottocategorie per STIR in EUR collegati all'Euribor

Periodo di riferimento			
Servizio di compensazione di rilevanza sistemica significativa a norma dell'articolo 25, paragrafo 2 quater		CCP autorizzata a norma dell'articolo 14	
	Dimensione delle negoziazioni (in milioni di EUR)		Dimensione delle negoziazioni (in milioni di EUR)
Scadenza	Qualsiasi dimensione delle negoziazioni	Scadenza	Qualsiasi dimensione delle negoziazioni
[0-6M]		[0-6M]	
[6M-12M]		[6M-12M]	
[12M-24M]		[12M-24M]	
[24M+]		[24M+]	

Tabella 7

Sottocategorie per STIR in EUR collegati allo €STR

Periodo di riferimento			
Servizio di compensazione di rilevanza sistemica significativa a norma dell'articolo 25, paragrafo 2 quater		CCP autorizzata a norma dell'articolo 14	
	Dimensione delle negoziazioni (in milioni di EUR)		Dimensione delle negoziazioni (in milioni di EUR)
Scadenza	Qualsiasi dimensione delle negoziazioni	Scadenza	Qualsiasi dimensione delle negoziazioni
[0-6M]		[0-6M]	
[6M-12M]		[6M-12M]	
[12M-24M]		[12M-24M]	
[24M+]		[24M+]	