

21 June 2021

## CC&G: EMIR Reporting

All'attenzione di:	<b>GCM e ICM sui Mercati Derivati</b>
Priorità:	<b>Alta</b>
Argomento:	<b>EMIR Reporting – CCP Harmonised File</b>

Gentile Cliente,

con la presente desideriamo aggiornarla circa alcune novità che verranno introdotte a partire dal 5 luglio 2021.

La prima riguarda la precedente comunicazione del [24 febbraio 2021](#): il CCP Harmonised File sarà disponibile in ambiente di produzione a partire dal 05-07-2021 via SFTP con la stessa naming convention.

Ulteriori informazioni di carattere tecnico e funzionale sono inoltre disponibili consultando le [CCP HF FAQ](#).

Inoltre, a partire dal 5 luglio 2021, CC&G implementerà una diversa suddivisione dei margini iniziali segnalati per la normativa EMIR, in ottemperanza alle indicazioni ESMA. In particolare, sarà introdotta una separazione dei margini basata sulla tipologia di prodotto:

- soltanto i margini di Derivati e l'Equity saranno riportati nei tracciati EMIR. Tale informazione viene fornita nel flusso **D15F**, il mapping è disponibile nella versione aggiornata del [manuale di reporting EMIR](#);
- i margini di obbligazioni ed il cash continueranno ad esseri riportati nelle segnalazioni SFTR.

Un'ulteriore novità che sarà introdotta a partire dalla medesima data riguarda la modifica delle Action type utilizzate nell'ambito del Valuation Report a livello di Posizione. Per allinearci alle indicazioni dell'ESMA ([Question 3B – Reporting valuations](#)), a partire dal 5 luglio 2021 le variazioni dei livelli di margini saranno riportate con l'Action type Variation (V) a livello di posizione mentre l'Action type Modification (M) verrà utilizzata solo in sede di variazione dei quantitativi negoziati.

Per eventuali ulteriori informazioni si prega di contattare:

E-MAIL: [cgc-regulatory.reporting@euronext.com](mailto:cgc-regulatory.reporting@euronext.com)