

## **Informativa relativa all'esenzione dall'obbligo di scambio di garanzie per le operazioni infragruppo in derivati OTC concluse con la controparte (Socio unico) Dexia Crédit Local S.A. ai sensi del Regolamento (UE) n. 648/2012 (EMIR)**

In conformità al Regolamento (UE) n. 648/2012 (EMIR), le controparti sono in generale tenute a scambiare attività in garanzia per i derivati OTC non compensati.

Dexia Crediop S.p.A. comunica che, con provvedimento della Banca d'Italia – Dipartimento Vigilanza Bancaria e Finanziaria, Prot.n. 1048331/21 del 9/7/2021, è stata autorizzata, ai sensi dell'art. 11, paragrafo 6 del Regolamento EMIR, l'esenzione dall'obbligo di scambio delle garanzie per le operazioni infragruppo in derivato OTC concluse con la Capogruppo Dexia Crédit Local S.A.

In conformità all'art. 11, paragrafo 6 del Regolamento EMIR e all'art. 20 del Regolamento Delegato (UE) n. 149/2013, con riferimento all'esenzione rilasciata vengono rese pubbliche le seguenti informazioni:

### **1) Controparti interessate**

La presente informativa riguarda le transazioni infragruppo tra:

- Dexia Crediop S.p.A.  
Via A. Salandra n. 18  
00187 ROMA

LEI –Code: 7W1YVM9WWP2JJTSRTZ96

e

- Dexia Crédit Local S.A.  
Passerelle des Reflets  
La Defense  
92919 PARIS  
France

LEI-Code: F46136OIPBYND1F41110

### **2) Tipologia di esenzione**

L'esenzione dall'obbligo di scambio di garanzie ai sensi dell'art. 11, paragrafo 6 del Regolamento EMIR riguarda tutte le operazioni in derivati OTC concluse infragruppo, con riferimento all'obbligo di costituzione delle garanzie a copertura dei margini iniziali.

### 3) Tipologia di contratti derivati OTC

I derivati OTC scambiati tra Dexia Crediop S.p.A. e la Capogruppo sono IRS – Interest Rate Swap e Currency Swap, conclusi per la copertura dal rischio di tasso di interesse o di cambio:

Informazioni sulle operazioni oggetto della richiesta di esenzione							
Categoria di attività	Tipologia di contratti	Tipologia di sottostanti	Valute nozionali derivati	Valute di regolamento	Durata massima (anni)	Tipologia di regolamento	Volumi annui (milioni di euro)
Interest Rate	Swaps	EURIBOR, Other	EUR	EUR	30	Cash	1.300,00
Interest Rate	Swaps	OIS	EUR	EUR	1	Cash	1.700,00
Currency	Swaps	EUR/USD	USD	EUR	1	Cash	60,00