

Modena, 21 febbraio 2023

## **Informativa relativa all'esenzione dall'obbligo di scambio di garanzie per le operazioni infragruppo in derivati OTC - Pubblicazione ai sensi dell'art.11 del Regolamento UE n. 648/2012 e dell'art. 20 del Regolamento UE n. 149/2013**

In conformità all'art. 11 paragrafo 3 del Regolamento UE n. 648/2012 (Regolamento EMIR), le controparti finanziarie sono tenute ad adottare procedure di gestione dei rischi che prevedano uno scambio di garanzie relativamente ai contratti derivati OTC non compensati centralmente.

BPER Banca S.p.A. comunica che è stata ottenuta da parte dell'Autorità Competente<sup>1</sup>, ai sensi dell'art. 11, paragrafo 6 del Regolamento EMIR, l'esenzione dall'obbligo di scambio delle garanzie per le operazioni infragruppo in derivati OTC, non compensate centralmente, concluse con la controparte BPER Bank Luxembourg SA.

In conformità alla normativa richiamata in oggetto si rendono pubbliche le seguenti informazioni:

### **1. Controparti interessate**

La presente informativa riguarda le operazioni infragruppo tra:

BPER Banca S.p.A.

Via S. Carlo, 8/20

41121 Modena MO

Codice LEI: N747OI7JINV7RUUH6190

**e**

BPER Bank Luxembourg SA

30 Bd Royal

2449 Lussemburgo

Codice LEI: 549300FOF121DSRG5867

---

Poiché la sede legale di BPER Banca S.p.A. si trova in Italia, l'autorità nazionale competente è Banca d'Italia

## **2. Rapporto tra le controparti**

BPER Banca S.p.A. è la Capogruppo del Gruppo bancario BPER Banca S.p.A. del quale fa parte BPER Bank Luxembourg SA.

## **3. Tipologia di esenzione**

BPER Banca S.p.A è stata autorizzata ad avvalersi dell'esenzione dall'obbligo di scambio di garanzie limitatamente ai margini iniziali e con esclusivo riferimento alle tipologie di operazioni in derivati riportate nel paragrafo che segue, concluse con la predetta controllata BPER Bank Luxembourg SA.

## **4. Importo nozionale aggregato dei contratti derivati OTC oggetto di esenzione**

L'esenzione è relativa alle seguenti tipologie di derivati OTC scambiati tra BPER Banca S.p.A. e BPER Bank Luxembourg SA :

- IRS –Swaps e Forwards, per un importo nozionale aggregato stimato annualmente pari a 20 milioni di euro
- Currency – Swaps e Forwards, per un importo nozionale aggregato stimato annualmente pari a 300 milioni di euro