

REGOLAMENTO DI ESECUZIONE (UE) N. 1249/2012 DELLA COMMISSIONE

del 19 dicembre 2012

che stabilisce norme tecniche di attuazione per quanto riguarda il formato dei dati che le controparti centrali sono tenute a conservare ai sensi del regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio sugli strumenti derivati OTC, le controparti centrali e i repertori di dati sulle negoziazioni

(Testo rilevante ai fini del SEE)

LA COMMISSIONE EUROPEA,

visto il trattato sul funzionamento dell'Unione europea,

visto il parere della Banca centrale europea ⁽¹⁾,visto il regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 4 luglio 2012, sugli strumenti derivati OTC, le controparti centrali e i repertori di dati sulle negoziazioni ⁽²⁾, in particolare l'articolo 29, paragrafo 5,

considerando quanto segue:

- (1) Ai sensi dell'articolo 29, paragrafo 4, del regolamento (UE) n. 648/2012 e degli articoli 13, 14 e 15 dell'atto delegato riguardante le norme tecniche di regolamentazione che specificano in dettaglio i dati e le informazioni che le controparti centrali sono tenute a conservare, adottato ai sensi dell'articolo 29, paragrafo 4, del regolamento (UE) n. 648/2012, occorre stabilire anche norme per specificare il formato dei dati e delle informazioni conservate ai sensi dei predetti articoli.
- (2) Per assolvere le loro funzioni in maniera efficace e uniforme, le autorità competenti devono disporre di dati comparabili tra controparti centrali. L'uso di formati comuni facilita anche la riconciliazione dei dati tra controparti centrali.
- (3) Occorre che le controparti centrali siano tenute a conservare i dati in un formato compatibile con il formato in cui i dati sono conservati dai repertori di dati sulle negoziazioni, tenendo conto del fatto che in determinate circostanze le controparti centrali e i repertori di dati sulle negoziazioni sono tenuti a conservare o a segnalare le stesse informazioni. L'uso di un formato comune in tutte le infrastrutture del mercato finanziario promuove il più ampio uso di detti formati da parte di un'ampia gamma di partecipanti al mercato, promuovendo in tal modo la standardizzazione.
- (4) Per facilitare il trattamento diretto e ridurre i costi a carico dei partecipanti al mercato, è importante che tutte le controparti centrali utilizzino quanto più possibile procedure e formati di dati standardizzati.
- (5) Il sottostante deve essere identificato mediante un identificatore unico; tuttavia non esiste al momento un codice standardizzato per tutto il mercato di identificazione delle attività sottostanti all'interno di un paniere. Pertanto, occorre che le controparti centrali indichino almeno che il sottostante è un paniere e utilizzino i numeri internazionali di identificazione dei titoli (*International Securities Identification number* – ISIN) per gli indici standardizzati, laddove possibile.
- (6) Il presente regolamento si basa sui progetti di norme tecniche di attuazione che l'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (AESFEM) ha presentato alla Commissione.
- (7) Ai sensi dell'articolo 15 del regolamento (UE) n. 1095/2010 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 24 novembre 2010, che istituisce l'Autorità europea di vigilanza (Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati) ⁽³⁾, l'AESFEM ha condotto una consultazione pubblica prima di presentare i progetti di norme tecniche di attuazione sui quali si basa il presente regolamento, ha analizzato i potenziali costi e benefici collegati e ha chiesto il parere del gruppo delle parti interessate nel settore degli strumenti finanziari e dei mercati istituito dall'articolo 37 dello stesso regolamento,

HA ADOTTATO IL PRESENTE REGOLAMENTO:

Articolo 1

Formato dei dati

1. Le controparti centrali conservano i dati di cui all'articolo 13 dell'atto delegato riguardante le norme tecniche di regolamentazione che specificano in dettaglio i dati e le informazioni che le controparti centrali sono tenute a conservare, adottato ai sensi dell'articolo 29, paragrafo 4, del regolamento (UE) n. 648/2012, per ogni contratto da esse trattato, nel formato di cui alla tabella 1 dell'allegato.

2. Le controparti centrali conservano i dati di cui all'articolo 14 dell'atto delegato riguardante le norme tecniche di regolamentazione che specificano in dettaglio i dati e le informazioni che le controparti centrali sono tenute a conservare, adottato ai sensi dell'articolo 29, paragrafo 4, del regolamento (UE) n. 648/2012, per ogni posizione, nel formato di cui alla tabella 2 dell'allegato.

⁽¹⁾ Non ancora pubblicata nella Gazzetta ufficiale.

⁽²⁾ GU L 201 del 27.7.2012, pag. 1.

⁽³⁾ GU L 331 del 15.12.2010, pag. 84.

3. Le controparti centrali conservano i dati di cui all'articolo 15 dell'atto delegato riguardante le norme tecniche di regolamentazione che specificano in dettaglio i dati e le informazioni che le controparti centrali sono tenute a conservare, adottato ai sensi dell'articolo 29, paragrafo 4, del regolamento (UE) n. 648/2012, per le attività connesse all'attività d'impresa e all'organizzazione interna, nel formato di cui alla tabella 3 dell'allegato.

4. Le controparti centrali trasmettono all'autorità competente i dati e le informazioni di cui ai paragrafi 1, 2 e 3 in un

formato che consenta la trasmissione diretta dei dati tra la controparte centrale e l'autorità competente. Le controparti centrali instaurano la trasmissione diretta dei dati entro sei mesi dalla richiesta dell'autorità competente.

Articolo 2

Entrata in vigore

Il presente regolamento entra in vigore il ventesimo giorno successivo alla pubblicazione nella *Gazzetta ufficiale dell'Unione europea*.

Il presente regolamento è obbligatorio in tutti i suoi elementi e direttamente applicabile in ciascuno degli Stati membri.

Fatto a Bruxelles, il 19 dicembre 2012

Per la Commissione

Il presidente

José Manuel BARROSO

ALLEGATO

Tabelle dei campi relativi ai dati da segnalare ai sensi dell'articolo 1

Tabella 1
dati sulle operazioni trattate

	Campo	Formato	Descrizione
1	Data e ora della segnalazione	<i>Formato della data secondo ISO 8601, formato dell'ora secondo UTC.</i>	Data e ora della segnalazione.
2	Prezzo/tasso	<i>Fino a 20 caratteri numerici nel formato xxxx.yyyyy.</i>	Il prezzo del titolo o del contratto derivato, esclusi commissioni e (se del caso) interessi maturati. Nel caso degli strumenti di debito, il prezzo può essere espresso o in termini monetari o in termini percentuali
2a	Notazione del prezzo	<i>Ad es. codice valuta secondo ISO 4217, 3 caratteri alfabetici, percentuale.</i>	Il modo in cui è espresso il prezzo.
3	Valuta nozionale	<i>Codice valuta secondo ISO 4217, 3 caratteri alfabetici.</i>	La valuta in cui è espresso il prezzo. Se, nel caso delle obbligazioni o di altro titolo di debito il prezzo è espresso in termini percentuali, la percentuale viene inclusa
3a	Valuta di consegna	<i>Codice valuta secondo ISO 4217, 3 caratteri alfabetici.</i>	La valuta da consegnare
4	Quantitativo	<i>Fino a 10 caratteri numerici.</i>	Il numero di unità degli strumenti finanziari, il valore nominale delle obbligazioni o il numero di contratti derivati oggetto dell'operazione
5	Misura del quantitativo	<i>Fino a 10 caratteri numerici.</i>	Indica se il quantitativo rappresenta il numero di unità degli strumenti finanziari, il valore nominale delle obbligazioni o il numero di contratti derivati
6	Lato della controparte centrale	<i>B = acquirente / S = venditore.</i>	
7	Identificativo del prodotto	<i>Tassonomia temporanea conformemente alle informazioni di cui all'articolo 4 del regolamento (UE) n. XX/2012 [progetto di norma tecnica di attuazione per quanto riguarda il formato e la frequenza delle segnalazioni sulle negoziazioni ai repertori di dati sulle negoziazioni], ISIN o identificativo univoco del prodotto (Unique Product Identifier - UPI).</i>	Il contratto viene identificato mediante l'identificativo del prodotto, se disponibile.
8	Identificativo del partecipante diretto	<i>Identificativo della persona giuridica (legal Entity identifier - LEI) (20 caratteri alfanumerici), identificativo temporaneo della persona giuridica (20 caratteri alfanumerici), BIC (11 caratteri alfanumerici) o codice cliente (50 caratteri alfanumerici).</i>	Nel caso in cui la controparte segnalante non sia un partecipante diretto, il rispettivo partecipante diretto è individuato in questo campo mediante un codice unico. Nel caso delle persone fisiche, si utilizza il codice cliente attribuito dalla controparte centrale.

	Campo	Formato	Descrizione
9	Identificativo del beneficiario	<i>Identificativo della persona giuridica (LEI) (20 caratteri alfanumerici), identificativo temporaneo della persona giuridica (20 caratteri alfanumerici), BIC (11 caratteri alfanumerici) o codice cliente (50 caratteri alfanumerici).</i>	Il beneficiario del contratto che non è una controparte del contratto è identificato con un codice unico o, nel caso delle persone fisiche, dal codice cliente attribuitogli dal soggetto giuridico a cui la persona fisica ha fatto ricorso.
10	Parte che ha trasferito il contratto (in caso di give-up)	<i>Identificativo della persona giuridica (LEI) (20 caratteri alfanumerici), identificativo temporaneo della persona giuridica (20 caratteri alfanumerici), BIC (11 caratteri alfanumerici) o codice cliente (50 caratteri alfanumerici).</i>	
11	Sede di esecuzione	<i>Se pertinente, codice identificativo del mercato (Market Identifier Code – MIC) secondo ISO 10383, XOFF per i derivati quotati negoziati fuori dai mercati regolamentati o XXXX per i derivati OTC.</i>	Identificativo della sede in cui l'operazione è stata eseguita. Nel caso di contratti OTC, occorre verificare se il relativo strumento è ammesso alla negoziazione ma negoziato fuori dai mercati regolamentati o non ammesso alla negoziazione e negoziato fuori dai mercati regolamentati.
12	Data di interposizione	<i>Formato della data secondo ISO 8601.</i>	Data in cui è avvenuta l'interposizione della controparte centrale nel contratto.
13	Ora di interposizione	<i>Formato dell'ora secondo UTC.</i>	Ora in cui è avvenuta l'interposizione della controparte centrale, indicata nell'ora locale dell'autorità competente a cui l'operazione verrà segnalata, e fuso orario in cui l'operazione è segnalata, espresso in tempo universale coordinato (UTC) +/- ore
14	Data di cessazione del contratto	<i>Formato della data secondo ISO 8601.</i>	Giorno in cui il contratto prende fine.
15	Ora di cessazione del contratto	<i>Formato dell'ora secondo UTC.</i>	Ora a cui il contratto prende fine, indicata nell'ora locale dell'autorità competente a cui l'operazione verrà comunicata e fuso orario in cui l'operazione è segnalata, espresso in tempo universale coordinato (UTC) +/- ore
16	Tipo di consegna	<i>C = contante, P = fisica, O = a scelta della controparte.</i>	Se il contratto viene regolato fisicamente o in contante.
17	Data del regolamento	<i>Formato della data secondo ISO 8601.</i>	Data in cui viene effettuato il regolamento o il buy-in del contratto. Se più di una, aggiungere altri campi.
18	Ora del regolamento o del buy-in del contratto	<i>Formato dell'ora secondo UTC.</i>	Ora in cui è effettuato il regolamento o il buy-in del contratto, indicata nell'ora locale dell'autorità competente a cui l'operazione verrà segnalata, e fuso orario in cui l'operazione è segnalata, espresso in tempo universale coordinato (UTC) +/- ore

	Campo	Formato	Descrizione
Dati sulle condizioni originarie dei contratti compensati, da fornire nella misura in cui sono applicabili			
19	Data	<i>Formato della data secondo ISO 8601.</i>	La data alla quale il contratto è stato originariamente concluso.
20	Ora	<i>Formato dell'ora secondo UTC.</i>	L'ora in cui il contratto è stato originariamente concluso, indicata nell'ora locale dell'autorità competente a cui l'operazione verrà segnalata e fuso orario in cui l'operazione è segnalata, espresso in tempo universale coordinato (UTC) +/- ore
21	Identificativo del prodotto	<i>Tassonomia temporanea conformemente alle informazioni di cui all'articolo 4 del regolamento (UE) n. XX/2012 [progetto di norma tecnica di attuazione per quanto riguarda il formato e la frequenza delle segnalazioni sulle negoziazioni ai repertori di dati sulle negoziazioni], ISIN o identificativo univoco del prodotto (Unique Product Identifier - UPI).</i>	Il contratto è identificato mediante l'identificativo unico del prodotto, se disponibile.
22	Sottostante	<i>Identificativo unico del prodotto, ISIN (12 caratteri alfanumerici) e CFI (6 caratteri alfanumerici). Identificativo della persona giuridica (LEI) (20 caratteri alfanumerici), identificativo temporaneo della persona giuridica (20 caratteri alfanumerici), B = paniere, o I = indice.</i>	Identificativo dello strumento applicabile al titolo che costituisce il sottostante di un contratto derivato, nonché al valore mobiliare di cui all'articolo 4, paragrafo 1, punto 18, lettera c), della direttiva 2004/39/CE
23	Tipo di derivato (in caso di contratto derivato)	La descrizione armonizzata del tipo di derivato dovrebbe essere conforme ad una delle categorie di livello superiore di una norma uniforme, internazionalmente accettata di classificazione degli strumenti finanziari	
24	Inclusione dello strumento nel registro dell'AESFEM dei contratti soggetti all'obbligo di compensazione (in caso di contratto derivato)	<i>S = sì / N = no.</i>	
Altre informazioni da trasmettere nella misura in cui sono applicabili			
25	Identificazione della controparte centrale interoperabile che compensa una gamba dell'operazione	<i>Identificativo della persona giuridica (LEI) (20 caratteri alfanumerici), identificativo temporaneo della persona giuridica (20 caratteri alfanumerici), BIC (11 caratteri alfanumerici) o codice cliente (50 caratteri alfanumerici).</i>	

Tabella 2
dati sulle posizioni

	Campo	Formato
1	Identificativo del partecipante diretto	Identificativo della persona giuridica (LEI), identificativo temporaneo della persona giuridica o BIC
2	Identificativo del beneficiario	Identificativo della persona giuridica (LEI), identificativo temporaneo della persona giuridica, BIC o codice cliente
3	Controparte centrale interoperabile che detiene la posizione	Identificativo della persona giuridica (LEI), identificativo temporaneo della persona giuridica, BIC o codice cliente
4	Segno della posizione	B = acquirente / S = venditore.
5	Valore della posizione	Fino a 10 caratteri numerici (xxxx,yy).
6	Prezzo al quale i contratti sono valutati	Fino a 10 caratteri numerici (xxxx,yy).
7	Valuta	Codice valuta ISO.
8	Altre informazioni pertinenti	Testo libero
9	Importo dei margini richiesti dalla controparte centrale	Fino a 10 caratteri numerici (xxxx,yy).
10	Importo dei contributi del fondo di garanzia in caso di inadempimento richiesti dalla controparte centrale	Fino a 10 caratteri numerici (xxxx,yy).
11	Importo di altre risorse finanziarie richieste dalla controparte centrale	Fino a 10 caratteri numerici (xxxx,yy).
12A	Importo dei margini forniti dal partecipante diretto con riferimento al conto cliente A	Fino a 10 caratteri numerici (xxxx,yy).
13A	Importo dei contributi del partecipante diretto al fondo di garanzia in caso di inadempimento con riferimento al conto cliente A	Fino a 10 caratteri numerici (xxxx,yy).
14A	Importo di altre risorse finanziarie fornite dal partecipante diretto con riferimento al conto cliente A	Fino a 10 caratteri numerici (xxxx,yy).
15B	Importo dei margini forniti dal partecipante diretto con riferimento al conto cliente B	Fino a 10 caratteri numerici (xxxx,yy).
16B	Importo dei contributi del partecipante diretto al fondo di garanzia in caso di inadempimento con riferimento al conto cliente B	Fino a 10 caratteri numerici (xxxx,yy).
17B	Importo di altre risorse finanziarie fornite dal partecipante diretto con riferimento al conto cliente B	Fino a 10 caratteri numerici (xxxx,yy).

Tabella 3

Documenti aziendali

	Campo	Formato	Descrizione
1	Organigramma	Testo libero	Consiglio e pertinenti comitati, unità di compensazione, unità di gestione dei rischi, e tutte le altre unità o divisioni pertinenti.

Azionisti o soci che detengono partecipazioni qualificate (campi da aggiungere per ognuno degli azionisti/soci)

2	Tipo	S = azionista / M = socio.	
3	Tipo di partecipazione qualificata	D = diretta / I = indiretta.	
4	Tipo di soggetto	N = persona fisica / L = persona giuridica.	
5	Importo della partecipazione:	Fino a 10 caratteri numerici (xxxx,yyyyyy).	

Altri documenti

6	Politiche, procedure, processi prescritti dai requisiti organizzativi	Documenti	
7	Verbali delle riunioni del consiglio e, se del caso, delle riunioni dei sottocomitati del consiglio e dei comitati dell'alta dirigenza	Documenti	
8	Verbali delle riunioni del comitato dei rischi	Documenti	
9	Verbali dei gruppi di consultazione con i partecipanti diretti e i clienti, se esistenti	Documenti	
10	Relazioni degli audit interni ed esterni, sulla gestione dei rischi, sulla conformità e dei consulenti	Documenti	
11	Politica di continuità operativa e piano di ripristino in caso di disastro	Documenti	
12	Piano di liquidità e relazioni giornaliere sulla liquidità	Documenti	
13	Documenti che riprendono tutte le attività e passività e i conti di capitale	Documenti	

	Campo	Formato	Descrizione
14	Reclami ricevuti	<i>Testo libero</i>	Per ciascun reclamo: nome dell'autore del reclamo, suo indirizzo e numero di conto; data di ricevimento del reclamo; nome di tutte le persone identificate nel reclamo; descrizione della natura del reclamo; trattamento del reclamo; data in cui il reclamo è stato risolto.
15	Informazioni su interruzioni del servizio o disfunzioni	<i>Testo libero</i>	Informazioni sulle interruzioni del servizio o sulle disfunzioni, compresa una relazione dettagliata sui tempi, gli effetti e le azioni correttive.
16	Risultati delle prove di stress e delle prove a posteriori eseguite	<i>Testo libero</i>	
17	Comunicazioni scritte con le autorità competenti, l'AE-SFEM e i membri pertinenti del SEBC	<i>Documenti</i>	
18	Pareri giuridici ricevuti in conformità alle disposizioni in materia di organizzazione	<i>Documenti</i>	
19	Accordi di interoperabilità con altre controparti centrali (se applicabile)	<i>Documenti</i>	
20	Elenco di tutti i partecipanti diretti (articolo 10 del regolamento (UE) n. XXX/2012)	<i>Testo libero/documenti</i>	Elenco ai sensi dell'articolo 10 del regolamento (UE) n. XXX/2012
21	Informazioni richieste ai sensi dell'articolo 10 del regolamento (UE) n. XXX/2012	<i>Testo libero/documenti</i>	Leggi e regolamenti che disciplinano i) l'accesso alla controparte centrale, ii) i contratti stipulati dalla controparte centrale con i partecipanti diretti e, ove possibile, i clienti, iii) i contratti che la controparte centrale accetta di compensare, iv) gli accordi di interoperabilità, v) l'uso delle garanzie reali e dei contributi al fondo di garanzia in caso di inadempimento, ivi compresa la liquidazione delle posizioni e delle garanzie reali e la misura in cui la garanzia reale è tutelata contro la rivalsa di terzi (livello di separazione).
22	Sviluppi relativi ai processi su nuove iniziative	<i>Testo libero</i>	In caso di prestazione di nuovi servizi.