

REGOLAMENTO DELEGATO (UE) N. 151/2013 DELLA COMMISSIONE

del 19 dicembre 2012

che integra il 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 per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione che specificano le informazioni da pubblicare e mettere a disposizione in tali repertori e gli standard operativi richiesti per aggregare e comparare i dati tra i repertori e accedervi

(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 81, paragrafo 5,

considerando quanto segue:

- (1) È essenziale individuare chiaramente i contratti interessati e le relative controparti. In un approccio funzionale occorre considerare i soggetti che accedono alle informazioni detenute dai repertori di dati sulle negoziazioni in base alle loro competenze e funzioni.
- (2) Occorre che l'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (Aesfem) abbia accesso a tutte le informazioni a livello di operazione detenute dai repertori di dati sulle negoziazioni, per poter esercitare la supervisione su di essi, presentare richieste di informazioni, adottare adeguate misure di vigilanza, nonché verificare se la registrazione del repertorio debba essere mantenuta o revocata.
- (3) Date le competenze ad essa attribuite dal 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⁾ e dal regolamento (UE) n. 648/2012, è opportuno accordare all'Aesfem l'accesso in funzione dei diversi mandati conferitile. I membri del suo personale devono disporre di un accesso consono a ciascuno di tali mandati specifici.
- (4) Poiché sono incaricati di monitorare e salvaguardare la stabilità finanziaria nell'Unione, per assolvere i rispettivi compiti al riguardo il Comitato europeo per il rischio sistemico (CERS), l'Aesfem e i pertinenti membri del Sistema europeo di banche centrali (SEBC), comprese determinate banche centrali nazionali e le pertinenti autorità degli strumenti finanziari e dei mercati dell'Unione, devono poter accedere alle informazioni a livello di operazione relative a tutte le controparti.
- (5) Per poter adempiere efficacemente ai propri compiti, i soggetti incaricati della supervisione e della sorveglianza

delle controparti centrali (CCP) devono avere accesso a tutte le informazioni a tal fine necessarie.

- (6) I pertinenti membri del SEBC devono avere accesso alle informazioni per assolvere i loro compiti fondamentali, in particolare le funzioni di banca centrale di emissione, il mandato inerente alla stabilità finanziaria e, in determinati casi, la vigilanza prudenziale su alcune controparti. Poiché la normativa nazionale conferisce a taluni membri del SEBC mandati diversi, occorre dare loro accesso alle informazioni in funzione dei diversi mandati, in conformità all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012.
- (7) Dato che il loro compito principale è la tutela degli investitori nella rispettiva giurisdizione, le pertinenti autorità degli strumenti finanziari e dei mercati dell'Unione devono poter accedere alle informazioni a livello di operazione relativamente ai mercati, ai partecipanti, ai prodotti e ai sottostanti che rientrano nel rispettivo mandato di vigilanza e controllo del rispetto delle regole.
- (8) L'autorità designata a norma dell'articolo 4 della direttiva 2004/25/CE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 21 aprile 2004, concernente le offerte pubbliche di acquisto ⁽⁴⁾ deve poter accedere alle informazioni a livello di operazione relativamente ai derivati azionari quando il sottostante è un titolo emesso da una società ammessa alla negoziazione su un mercato regolamentato che rientra nella sua giurisdizione o che ha sede legale nella sua giurisdizione ovvero è un offerente per siffatte società e il corrispettivo offerto include titoli.
- (9) Occorre dare accesso all'Agenzia per la cooperazione fra i regolatori nazionali dell'energia (ACER) per permetterle di monitorare i mercati dell'energia all'ingrosso, al fine di rilevare e scoraggiare gli abusi di mercato in cooperazione con le autorità nazionali di regolamentazione e a norma del regolamento (UE) n. 1227/2011 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 25 ottobre 2011, concernente l'integrità e la trasparenza del mercato dell'energia all'ingrosso (REMIT) ⁽⁵⁾. Occorre quindi che l'ACER possa accedere a tutte le informazioni detenute dai repertori di dati sulle negoziazioni relativamente ai derivati sull'energia.

⁽¹⁾ Non ancora pubblicato nella Gazzetta ufficiale.⁽²⁾ GU L 201 del 27.7.2012, pag. 1.⁽³⁾ GU L 331 del 15.12.2010, pag. 84.⁽⁴⁾ GU L 142 del 30.4.2004, pag. 12.⁽⁵⁾ GU L 326 dell'8.12.2011, pag. 1.

- (10) Il regolamento (UE) n. 648/2012 contempla soltanto i dati sulle negoziazioni e non, come invece richiede il regolamento (UE) n. 1227/2011, anche quelli inerenti alla fase di pre-negoziazione quali gli ordini di compravendita. I repertori di dati sulle negoziazioni non devono quindi essere considerati dall'ACER la fonte d'informazione appropriata al riguardo.
- (11) In un approccio funzionale all'accesso alle informazioni detenute dai repertori di dati sulle negoziazioni, la vigilanza prudenziale è una componente essenziale. Anche in questo settore, è possibile che il mandato di vigilanza prudenziale sia conferito ad autorità diverse. Occorre pertanto permettere a tutte le autorità elencate all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012 di accedere alle informazioni a livello di operazione relativamente ai soggetti pertinenti.
- (12) I soggetti che, a norma dell'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012, accedono ai repertori di dati sulle negoziazioni devono predisporre e attuare politiche atte ad assicurare che l'accesso a tali informazioni sia riservato alle persone pertinenti e a fini precisi giustificati da obblighi di legge, indicando altresì le eventuali altre persone autorizzate ad accedervi.
- (13) Occorre prevedere un accesso alle informazioni a tre diversi livelli di aggregazione: le informazioni sulle operazioni devono riportare i particolari delle singole operazioni; le informazioni sulle posizioni devono riportare dati aggregati sulla posizione per sottostante o prodotto delle singole controparti; le informazioni nozionali aggregate devono riportare la posizione complessiva per sottostante o prodotto senza indicare la controparte. L'accesso alle informazioni sulle operazioni implica anche l'accesso a quelle sulle posizioni e ai dati aggregati; l'accesso alle informazioni sulle posizioni implica l'accesso ai dati aggregati, ma non alle informazioni relative alle operazioni; per converso, l'accesso alle informazioni nozionali aggregate, che costituisce la categoria meno capillare, non deve permettere l'accesso né alle informazioni sulle posizioni né a quelle sulle operazioni.
- (14) Il presente regolamento si basa sui progetti di norme tecniche di regolamentazione che l'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati ha presentato alla Commissione.
- (15) A norma dell'articolo 10 del regolamento (UE) n. 1095/2010, l'Aesfem ha consultato le autorità competenti e i membri del SEBC prima di presentare i progetti di norme tecniche di regolamentazione su cui si basa il presente regolamento. Ha inoltre effettuato consultazioni pubbliche su tali progetti di norme tecniche di regolamentazione, ne ha analizzato i potenziali costi e benefici e ha chiesto il parere del gruppo delle parti interessate nel settore bancario istituito a norma dell'articolo 37 di detto regolamento,
- a) la seguente ripartizione dell'aggregato delle posizioni aperte per categoria di derivati:
- i) merci;
 - ii) crediti;
 - iii) valute;
 - iv) azioni;
 - v) tassi d'interesse;
 - vi) altro;
- b) la seguente ripartizione dell'aggregato dei volumi delle operazioni per categoria di derivati:
- i) merci;
 - ii) crediti;
 - iii) valute;
 - iv) azioni;
 - v) tassi d'interesse;
 - vi) altro;
- c) la seguente ripartizione dell'aggregato dei valori per categoria di derivati:
- i) merci;
 - ii) crediti;
 - iii) valute;
 - iv) azioni;
 - v) tassi d'interesse;
 - vi) altro.
2. I dati sono pubblicati su un sito web o un portale online facilmente accessibile per il pubblico e sono aggiornati a cadenza almeno settimanale.

HA ADOTTATO IL PRESENTE REGOLAMENTO:

Articolo 1

Pubblicazione di informazioni aggregate

1. Il repertorio di dati sulle negoziazioni pubblica le informazioni previste dall'articolo 81, paragrafo 1, del regolamento (UE) n. 648/2012, che comprendono almeno:

Articolo 2

Accesso ai dati da parte delle pertinenti autorità

1. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dà all'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (Aesfem) accesso a tutte le informazioni sulle operazioni per permetterle di esercitare le sue competenze di vigilanza.

2. L'Aesfem attiva procedure interne atte ad assicurare che il personale abbia l'accesso adeguato e che siano applicate le eventuali limitazioni dell'accesso relativamente alle attività estranee alla vigilanza incluse nel suo mandato.

3. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dà all'Agenzia per la cooperazione fra i regolatori nazionali dell'energia (ACER) accesso a tutte le informazioni sulle operazioni relative a derivati il cui sottostante è l'energia o le quote di emissione.

4. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dà all'autorità competente per la vigilanza sulla controparte centrale (CCP), e, ove applicabile, al pertinente membro del Sistema europeo di banche centrali (SEBC) che esercita la vigilanza sulla CCP, accesso a tutte le informazioni sulle operazioni compensate o segnalate dalla CCP.

5. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dà all'autorità competente per la vigilanza della sede di esecuzione del contratto accesso a tutte le informazioni sulle operazioni relative al contratto eseguito in tale sede.

6. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dà all'autorità di vigilanza nominata a norma dell'articolo 4 della direttiva 2004/25/CE accesso a tutte le informazioni sulle operazioni relative ai derivati il cui sottostante è un titolo emesso da una società che soddisfa una delle seguenti condizioni:

- a) è ammessa alla negoziazione su un mercato regolamentato nella giurisdizione dell'autorità;
- b) ha sede legale o, in mancanza, sede centrale nella giurisdizione dell'autorità;
- c) è un offerente per i soggetti di cui alla lettera a) o b) e il corrispettivo da essa offerto include titoli.

7. Le informazioni che devono essere fornite a norma del paragrafo 6 comprendono informazioni su:

- a) titoli sottostanti;
- b) categoria dei derivati;
- c) segno della posizione;
- d) numero dei titoli di riferimento;
- e) parti del contratto derivato.

8. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dà all'autorità competente degli strumenti finanziari e dei mercati dell'Unione, di

cui all'articolo 81, paragrafo 3, lettera h), del regolamento (UE) n. 648/2012, accesso a tutte le informazioni sulle operazioni relative a mercati, partecipanti, contratti e sottostante che rientrano nella sfera di competenza di tale autorità, in funzione delle sue responsabilità di vigilanza e del suo mandato.

9. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dà al Comitato europeo per il rischio sistemico (CERS), all'Aesfem e ai pertinenti membri del SEBC accesso alle informazioni a livello di operazione relative a:

- a) tutte le controparti che rientrano nella rispettiva giurisdizione;
- b) contratti derivati il cui soggetto di riferimento è ubicato nella rispettiva giurisdizione o la cui obbligazione di riferimento è un titolo di debito pubblico della rispettiva giurisdizione.

10. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dà al pertinente membro del SEBC accesso alle informazioni sulle posizioni relative ai contratti derivati espressi nella moneta da esso emessa.

11. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dà ai soggetti competenti elencati all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012, ai fini della vigilanza prudenziale sulle controparti soggette all'obbligo di segnalazione, accesso a tutte le informazioni sulle operazioni relative a tali controparti.

Articolo 3

Autorità dei paesi terzi

1. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dà all'autorità competente del paese terzo che ha concluso con l'Unione un accordo internazionale di cui all'articolo 75 del regolamento (UE) n. 648/2012, accesso alle informazioni in funzione del mandato e delle responsabilità dell'autorità del paese terzo e in conformità alle disposizioni del pertinente accordo internazionale.

2. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dà all'autorità competente del paese terzo che ha concluso con l'Aesfem un accordo di cooperazione di cui all'articolo 76 del regolamento (UE) n. 648/2012, accesso alle informazioni in funzione del mandato e delle responsabilità dell'autorità del paese terzo e in conformità alle disposizioni del pertinente accordo di cooperazione.

Articolo 4

Standard operativi per l'aggregazione e il raffronto delle informazioni

1. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dà ai soggetti elencati all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012, accesso in conformità alle procedure di comunicazione, agli standard in materia di messaggistica e ai dati di riferimento di uso comune a livello internazionale.

2. Le controparti dell'operazione generano un identificativo unico per ogni contratto derivato, affinché i repertori di dati sulle negoziazioni possano aggregare e comparare le informazioni tra diversi repertori.

*Articolo 5***Standard operativi per l'accesso ai dati**

1. Il repertorio di dati sulle negoziazioni registra le informazioni relative all'accesso dato ai soggetti di cui all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012.
2. Le informazioni di cui al paragrafo 1 comprendono:
 - a) portata dei dati interessati dall'accesso;

- b) riferimento alle disposizioni giuridiche che permettono l'accesso ai dati in questione a norma del regolamento (UE) n. 648/2012 e del presente regolamento.

*Articolo 6***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
