

**REGOLAMENTO DELEGATO (UE) 2017/1800 DELLA COMMISSIONE****del 29 giugno 2017****che modifica il regolamento delegato (UE) n. 151/2013 che integra il regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio****(Testo rilevante ai fini del SEE)**

LA COMMISSIONE EUROPEA,

visto il trattato sul funzionamento dell'Unione europea,

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 <sup>(1)</sup>, in particolare l'articolo 81, paragrafo 5,

considerando quanto segue:

- (1) L'applicazione del regolamento delegato (UE) n. 151/2013 della Commissione <sup>(2)</sup> ha dimostrato che la mancanza di norme specifiche in materia di accesso ai dati e di aggregazione e raffronto dei dati dà luogo a carenze strutturali. La mancanza di dati standardizzati, di funzionalità uniformi e di formati standard per la messaggistica ha ostacolato l'accesso diretto e immediato ai dati, impedendo di conseguenza ai soggetti elencati all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012 di valutare efficacemente il rischio sistemico e di assolvere pertanto le responsabilità e i mandati rispettivi.
- (2) Per rimuovere tali ostacoli, è necessario modificare il regolamento delegato (UE) n. 151/2013, specificando gli standard operativi richiesti per aggregare e comparare i dati tra repertori di dati sulle negoziazioni, in modo da assicurare che i soggetti elencati all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012 possano accedere alle informazioni necessarie per assolvere le responsabilità e i mandati rispettivi.
- (3) Per consentire l'aggregazione e il raffronto efficaci ed efficienti dei dati tra repertori di dati sulle negoziazioni, per l'accesso ai dati e per la comunicazione tra i soggetti di cui all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012 e i repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero essere utilizzati modelli di formato XML e messaggi XML sviluppati secondo la metodologia ISO 20022. Non dovrebbe tuttavia essere esclusa la possibilità che i repertori di dati sulle negoziazioni e i soggetti competenti possano concordare per l'accesso ai dati o per la loro comunicazione l'uso di un formato diverso, in aggiunta all'XML.
- (4) I modelli di formato XML dovrebbero essere utilizzati per fornire i dati ai soggetti competenti in un formato che ne faciliti l'aggregazione, mentre i messaggi XML dovrebbero essere utilizzati per semplificare il processo di scambio dei dati tra i repertori di dati sulle negoziazioni e i soggetti competenti. Il regolamento delegato (UE) n. 151/2013 non esclude l'uso aggiuntivo e distinto di modelli, in formati diversi dal formato XML, quali file nel formato csv (*comma separated values* valori separati da virgola) o txt (testo), nella misura in cui questi ultimi consentono ai soggetti competenti di assolvere le responsabilità e i mandati rispettivi. I repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero pertanto essere autorizzati a continuare a utilizzare detti formati in aggiunta ai modelli in formato XML, ma mai in sostituzione. Per tutte le segnalazioni e gli scambi dovrebbero essere utilizzati, come minimo, i modelli in formato XML e i messaggi XML basati sulla metodologia ISO 20022, in modo da assicurare la comparabilità e l'aggregazione dei dati tra repertori di dati sulle negoziazioni.
- (5) I soggetti elencati all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012 possono delegare compiti e responsabilità all'ESMA ai sensi dell'articolo 28 del regolamento (UE) n. 1095/2010 <sup>(3)</sup>, compreso l'accesso ai dati segnalati ai repertori di dati sulle negoziazioni. L'uso di tale delega non dovrebbe in alcun modo incidere sull'obbligo dei repertori di dati sulle negoziazioni di dare ai soggetti elencati all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012 accesso diretto e immediato ai dati.
- (6) Per assicurare la riservatezza, qualsiasi tipo di scambio di dati tra repertori di dati sulle negoziazioni e soggetti competenti dovrebbe essere effettuato tramite una connessione tra macchine (*machine-to-machine*) sicura e

<sup>(1)</sup> GUL 201 del 27.7.2012, pag. 1.

<sup>(2)</sup> 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 (GUL 52 del 23.2.2013, pag. 33).

<sup>(3)</sup> 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), modifica la decisione n. 716/2009/CE e abroga la decisione 2009/77/CE della Commissione (GU L 331 del 15.12.2010, pag. 84).

utilizzando protocolli di cifratura dei dati. Per assicurare norme minime comuni, tra i repertori di dati sulle negoziazioni e i soggetti elencati all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012 dovrebbe essere utilizzato un protocollo di trasferimento dei file SSH (SFTP). Non dovrebbe tuttavia essere esclusa la possibilità che i repertori di dati sulle negoziazioni e i soggetti competenti possano effettuare connessioni tra macchine sicure utilizzando canali aggiuntivi distinti dall'SFTP. I repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero pertanto essere autorizzati a continuare a utilizzare connessioni tra macchine sicure in aggiunta all'uso dell'SFTP, ma mai in sostituzione.

- (7) I dati relativi alla situazione più recente delle operazioni sui contratti derivati non ancora scaduti (*open interest*) sono essenziali per monitorare la stabilità finanziaria e il rischio sistemico. Pertanto, i soggetti competenti dovrebbero avere accesso a tali dati.
- (8) È fondamentale agevolare l'accesso diretto e immediato a dati specifici e definire a tal fine un insieme di richieste *ad hoc* combinabili, riguardanti le parti dell'operazione, le condizioni economiche, la classificazione e l'individuazione del contratto derivato, i tempi di esecuzione, la segnalazione, la scadenza, e gli eventi relativi a ciclo di vita e attività.
- (9) I termini entro i quali i repertori di dati sulle negoziazioni devono fornire i dati ai soggetti competenti dovrebbero essere armonizzati, per migliorare l'accesso diretto e immediato ai dati dei repertori di dati sulle negoziazioni e consentire ai soggetti competenti e ai repertori di dati di migliorare la programmazione delle procedure interne di trattamento dei dati.
- (10) Pertanto, il regolamento delegato (UE) n. 151/2013 dovrebbe essere modificato per specificare e migliorare ulteriormente il quadro operativo in materia di accesso, aggregazione e raffronto dei dati dei repertori di dati sulle negoziazioni.
- (11) L'applicazione delle disposizioni di cui al presente regolamento delegato dovrebbe essere rinviata per consentire gli adeguamenti dei sistemi da parte dei repertori di dati sulle negoziazioni alle specifiche di cui al presente regolamento delegato.
- (12) Il presente regolamento si basa sui progetti di norme tecniche di regolamentazione presentati alla Commissione dall'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (ESMA).
- (13) Ai sensi dell'articolo 10 del regolamento (UE) n. 1095/2010, l'ESMA ha anche condotto consultazioni pubbliche aperte sul progetto di norme tecniche di regolamentazione alla base del presente regolamento ed ha analizzato i potenziali costi e benefici collegati. Le consultazioni hanno consentito all'ESMA di avere il parere delle autorità competenti e dei membri del Sistema europeo delle banche centrali (SEBC), che sono stati presentati dalla BCE. Inoltre, l'ESMA ha chiesto il parere del gruppo delle parti interessate nel settore degli strumenti finanziari e dei mercati istituito dall'articolo 37 del regolamento (UE) n. 1095/2010,

HA ADOTTATO IL PRESENTE REGOLAMENTO:

#### Articolo 1

### Modifiche del regolamento delegato (UE) n. 151/2013

1. L'articolo 4 è così modificato:

a) il paragrafo 1 è sostituito dal seguente:

«1. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dà ai soggetti elencati all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012 accesso immediato e diretto ai dati sui contratti derivati conformemente agli articoli 2 e 3 del presente regolamento, anche nei casi di delega ai sensi dell'articolo 28 del regolamento (UE) n. 1095/2010.

Ai fini del primo comma, il repertorio di dati sulle negoziazioni utilizza il formato XML e un modello elaborato secondo la metodologia ISO 20022. Il repertorio di dati sulle negoziazioni può inoltre, previo accordo del soggetto competente, concedere l'accesso alle informazioni relative ai contratti derivati in altro formato convenuto reciprocamente.»;

b) il paragrafo 2 è soppresso.

2. All'articolo 5 sono aggiunti i seguenti paragrafi da 3 a 9:

«3. I repertori di dati sulle negoziazioni stabiliscono e mantengono le disposizioni tecniche necessarie per consentire ai soggetti elencati all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012 di connettersi utilizzando un'interfaccia tra macchine sicure per la trasmissione delle richieste e il ricevimento dei dati.

Ai fini del primo comma, il repertorio di dati sulle negoziazioni utilizza il protocollo di trasferimento di file SSH. Per comunicare mediante la predetta interfaccia, il repertorio di dati sulle negoziazioni utilizza messaggi XML standardizzati secondo la metodologia ISO 20022. In aggiunta, il repertorio di dati sulle negoziazioni può, previo accordo del soggetto competente, effettuare la connessione utilizzando un altro protocollo concordato reciprocamente.

4. Ai sensi degli articoli 2 e 3, i repertori di dati sulle negoziazioni danno ai soggetti elencati all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012 accesso alle seguenti informazioni:

- a) tutte le segnalazioni sui contratti derivati;
- b) la situazione più recente delle operazioni sui contratti derivati non ancora scaduti o che non sono stati ancora segnalati con tipo di azione "E", "C", "P" o "Z" di cui al campo 93 della tabella 2 dell'allegato del regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012 della Commissione (\*).

5. I repertori di dati sulle negoziazioni stabiliscono e mantengono le disposizioni tecniche necessarie per consentire ai soggetti elencati all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012 di predisporre richieste periodiche predefinite di accesso ai dati sui contratti derivati, come stabilito al paragrafo 4, necessari a detti soggetti per assolvere le responsabilità e i mandati rispettivi.

6. Su richiesta, il repertorio di dati sulle negoziazioni dà ai soggetti elencati all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012, accesso alle informazioni sui contratti derivati secondo una qualsiasi delle combinazioni possibili dei seguenti dati di cui all'allegato del regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012:

- a) data e ora della segnalazione;
- b) identificativo della controparte segnalante;
- c) identificativo dell'altra controparte;
- d) settore di attività della controparte segnalante;
- e) natura della controparte segnalante;
- f) identificativo dell'intermediario;
- g) identificativo del soggetto segnalante;
- h) identificativo del beneficiario;
- i) classe di attività;
- j) classificazione del prodotto;
- k) identificazione del prodotto;
- l) identificazione del sottostante;
- m) sede di esecuzione;
- n) data e ora di esecuzione;
- o) data di scadenza;
- p) data di cessazione;
- q) controparte centrale (CCP) e
- r) tipo di azione.

7. I repertori di dati sulle negoziazioni stabiliscono e mantengono le capacità tecniche per dare accesso diretto e immediato alle informazioni relative ai contratti derivati ai soggetti elencati all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012 per consentire loro di assolvere le responsabilità e i mandati rispettivi. L'accesso viene dato secondo le seguenti modalità:

- a) quando i soggetti elencati all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012 richiedono l'accesso alle informazioni sui contratti derivati in essere o sui contratti derivati scaduti o per i quali la segnalazione con tipo di azione "E", "C", "Z" o "P" di cui al campo 93 della tabella 2 dell'allegato del regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012 è stata effettuata meno di un anno prima della data di presentazione della richiesta, i repertori di dati sulle negoziazioni soddisfano la richiesta entro le ore 12:00 UCT del primo giorno lavorativo successivo al giorno in cui la richiesta di accesso è stata presentata;

- b) quando i soggetti elencati all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012 richiedono l'accesso alle informazioni sui contratti derivati scaduti o per i quali la segnalazione con tipo di azione "E", "C", "Z" o "P" di cui al campo 93 della tabella 2 dell'allegato del regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012 è stata effettuata più di un anno prima della data di presentazione della richiesta, i repertori di dati sulle negoziazioni soddisfano la richiesta entro i tre giorni lavorativi successivi al giorno in cui la richiesta di accesso è stata presentata;
- c) quando la richiesta di accesso ai dati da parte dei soggetti elencati all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012 si riferisce a contratti derivati rientranti in entrambi le lettere a) e b), il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce le informazioni su tali contratti derivati entro i tre giorni lavorativi successivi al giorno in cui la richiesta di accesso è stata presentata.

8. I repertori di dati sulle negoziazioni confermano e verificano l'esattezza e la completezza delle richieste di accesso ai dati presentate dai soggetti elencati all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012. Essi comunicano ai predetti soggetti il risultato della verifica entro e non oltre sessanta minuti dalla presentazione della richiesta.

9. I repertori di dati sulle negoziazioni usano la firma elettronica e protocolli di cifratura dei dati per garantire la riservatezza, l'integrità e la protezione dei dati messi a disposizione dei soggetti elencati all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012.

(\*) Regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012 della Commissione, del 19 dicembre 2012, che stabilisce norme tecniche di attuazione per quanto riguarda il formato e la frequenza delle segnalazioni sulle negoziazioni ai repertori di dati sulle negoziazioni 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 (GU L 352 del 21.12.2012, pag. 20) come modificato dal regolamento di esecuzione (UE) 2017/105 (GU L 17 del 21.1.2017, pag. 17).»

## Articolo 2

### Entrata in vigore e applicazione

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

Esso si applica a decorrere dal 1° novembre 2017.

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

Fatto a Bruxelles, il 29 giugno 2017

Per la Commissione

Il presidente

Jean-Claude JUNCKER