



### Sommario

#### II Atti non legislativi

##### REGOLAMENTI

- ★ **Regolamento delegato (UE) 2019/356 della Commissione, del 13 dicembre 2018, che integra il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione che precisano le informazioni sulle operazioni di finanziamento tramite titoli da segnalare ai repertori di dati sulle negoziazioni <sup>(1)</sup> ..... 1**
- ★ **Regolamento delegato (UE) 2019/357 della Commissione, del 13 dicembre 2018, che integra il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione sull'accesso alle informazioni sulle operazioni di finanziamento tramite titoli registrate nei repertori di dati sulle negoziazioni <sup>(1)</sup> ..... 22**
- ★ **Regolamento delegato (UE) 2019/358 della Commissione, del 13 dicembre 2018, che integra il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione per la raccolta, verifica, aggregazione, comparazione e pubblicazione dei dati sulle operazioni di finanziamento tramite titoli (SFT) da parte dei repertori di dati sulle negoziazioni <sup>(1)</sup> ..... 30**
- ★ **Regolamento delegato (UE) 2019/359 della Commissione, del 13 dicembre 2018, che integra il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione che specificano i dettagli della domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni e della domanda di estensione della registrazione <sup>(1)</sup> ..... 45**
- ★ **Regolamento delegato (UE) 2019/360 della Commissione, del 13 dicembre 2018, che integra il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le commissioni imposte ai repertori di dati sulle negoziazioni dall'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati <sup>(1)</sup> ..... 58**
- ★ **Regolamento delegato (UE) 2019/361 della Commissione, del 13 dicembre 2018, che modifica il regolamento delegato (UE) n. 151/2013 per quanto riguarda l'accesso ai dati in possesso dei repertori di dati sulle negoziazioni <sup>(1)</sup> ..... 69**

<sup>(1)</sup> Testo rilevante ai fini del SEE.

- ★ Regolamento delegato (UE) 2019/362 della Commissione, del 13 dicembre 2018, che modifica il regolamento delegato (UE) n. 150/2013 della Commissione per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione che specificano i dettagli della domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni <sup>(1)</sup> ..... 74
- ★ Regolamento di esecuzione (UE) 2019/363 della Commissione, del 13 dicembre 2018, che stabilisce norme tecniche di attuazione per quanto riguarda il formato e la frequenza delle segnalazioni delle informazioni sulle operazioni di finanziamento tramite titoli (SFT) ai repertori di dati sulle negoziazioni a norma del regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio e che modifica il regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012 della Commissione relativamente all'utilizzo di codici per la segnalazione dei contratti derivati <sup>(1)</sup> 85
- ★ Regolamento di esecuzione (UE) 2019/364 della Commissione, del 13 dicembre 2018, che stabilisce norme tecniche di attuazione per quanto riguarda il formato della domanda di registrazione e della domanda di estensione della registrazione dei repertori di dati sulle negoziazioni a norma del regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(1)</sup> ..... 125
- ★ Regolamento di esecuzione (UE) 2019/365 della Commissione, del 13 dicembre 2018, che stabilisce norme tecniche di attuazione per quanto riguarda le procedure e i formulari per lo scambio di informazioni sulle sanzioni, sulle misure e sulle indagini ai sensi del regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(1)</sup> ..... 128

---

<sup>(1)</sup> Testo rilevante ai fini del SEE.

## II

(Atti non legislativi)

## REGOLAMENTI

## REGOLAMENTO DELEGATO (UE) 2019/356 DELLA COMMISSIONE

del 13 dicembre 2018

**che integra il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione che precisano le informazioni sulle operazioni di finanziamento tramite titoli da segnalare ai repertori di dati sulle negoziazioni**

(Testo rilevante ai fini del SEE)

LA COMMISSIONE EUROPEA,

visto il trattato sul funzionamento dell'Unione europea,

visto il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 25 novembre 2015, sulla trasparenza delle operazioni di finanziamento tramite titoli e del riutilizzo e che modifica il regolamento (UE) n. 648/2012 <sup>(1)</sup>, in particolare l'articolo 4, paragrafo 9,

considerando quanto segue:

- (1) Per aumentare l'efficienza e sfruttare le analogie tra la segnalazione dei derivati e la segnalazione delle operazioni di finanziamento tramite titoli (SFT), l'obbligo di segnalare le informazioni sulle operazioni di finanziamento tramite titoli ai repertori di dati sulle negoziazioni a norma dell'articolo 4 del regolamento (UE) 2015/2365 dovrebbe essere allineato con l'obbligo di segnalare le operazioni su derivati ai repertori di dati sulle negoziazioni a norma dell'articolo 9 del regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(2)</sup>. Le disposizioni in materia di segnalazione che specificano le informazioni sulle SFT da segnalare dovrebbero pertanto essere simili a quelle riguardanti i contratti derivati.
- (2) Al fine di garantire l'efficienza e l'utilità delle informazioni da segnalare sulle SFT, i dati specifici da segnalare dovrebbero essere adattati ai diversi tipi di SFT definiti nel regolamento (UE) 2015/2365. Per quanto riguarda la segnalazione delle operazioni di finanziamento con margini, l'obiettivo del regolamento (UE) 2015/2365 è di disciplinare le operazioni che perseguono la stessa finalità delle operazioni di vendita con patto di riacquisto, delle operazioni di buy-sell back o delle operazioni di concessione di titoli in prestito e quindi presentano analoghi rischi per la stabilità finanziaria in quanto consentono l'aumento della leva finanziaria, della prociclicità e dell'interconnessione nei mercati finanziari o contribuiscono alla trasformazione della liquidità e delle scadenze. Il finanziamento con margini comprende pertanto le operazioni oggetto di accordi di garanzia tra gli enti finanziari e i loro clienti in cui gli enti finanziari forniscono ai loro clienti servizi di prime brokerage, ma non altri prestiti come quelli per la ristrutturazione delle imprese, che, anche qualora fossero in gioco titoli, non contribuiscono ai rischi sistemici disciplinati dal regolamento (UE) 2015/2365.
- (3) È importante che le informazioni relative alle SFT compensate mediante controparte centrale siano segnalate in maniera corretta e possano essere facilmente identificate, indipendentemente dal fatto che l'SFT sia stata compensata alla stessa data o a una data successiva a quella in cui è stata conclusa.
- (4) Al fine di garantire una comunicazione completa laddove i dati specifici sulla garanzia non sono noti il giorno della negoziazione, le controparti dovrebbero aggiornare le informazioni sulle garanzie reali non appena dispongono delle informazioni, e al più tardi il giorno lavorativo seguente la data di valuta della SFT.

<sup>(1)</sup> GUL 337 del 23.12.2015, pag. 1.

<sup>(2)</sup> 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 (GUL 201 del 27.7.2012, pag. 1).

- (5) Per fornire informazioni più utili alle autorità che accedono ai dati delle SFT nei repertori di dati sulle negoziazioni, le controparti dovrebbero segnalare ai repertori di dati sulle negoziazioni il numero internazionale di identificazione dei titoli (codice ISIN) del paniere di garanzie reali che utilizzano per garantire una SFT, se tale paniere ha un codice ISIN.
- (6) Se le controparti forniscono una garanzia reale sulla base dell'esposizione netta derivante dalla compensazione di una serie di SFT tra due controparti, l'allocazione specifica di una garanzia ad una singola SFT è spesso impossibile, e quindi l'allocazione della garanzia può non essere nota. In tali circostanze le controparti dovrebbero poter segnalare la garanzia indipendentemente dal prestito sottostante.
- (7) Il presente regolamento si basa sui progetti di norme tecniche di regolamentazione che l'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (ESMA) ha presentato alla Commissione conformemente alla procedura di cui all'articolo 10 del regolamento (UE) n. 1095/2010 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(3)</sup>.
- (8) L'ESMA ha effettuato consultazioni pubbliche aperte sui 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 degli strumenti finanziari e dei mercati istituito dall'articolo 37 del regolamento (UE) n. 1095/2010,

HA ADOTTATO IL PRESENTE REGOLAMENTO:

#### *Articolo 1*

### **Informazioni sulle SFT da segnalare**

1. La segnalazione a norma dell'articolo 4, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2015/2365 include le informazioni complete e precise indicate nelle tabelle 1, 2, 3 e 4 dell'allegato che riguardano la SFT in questione.
2. Quando segnala la conclusione di una SFT, la controparte indica nella sua segnalazione l'azione «New» (Nuova) nel campo 98 (Tipo di azione) della tabella 2 di cui all'allegato. Eventuali successive segnalazioni delle informazioni riguardanti tale SFT indicano l'azione pertinente nel campo 98 della tabella 2 di cui all'allegato.

#### *Articolo 2*

### **SFT compensate da controparti centrali**

1. L'SFT di cui sono già state comunicate le informazioni a norma dell'articolo 4, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2015/2365 che è successivamente compensata da una CCP è segnalata, una volta compensata, come cessata, specificando nel campo 98 della tabella 2 di cui all'allegato l'azione «Termination/Early Termination» (Cessazione/Cessazione anticipata), mentre sono segnalate le nuove SFT risultanti dalla compensazione.
2. L'SFT che è conclusa in una sede di negoziazione ed è compensata lo stesso giorno da una controparte centrale è segnalata soltanto dopo la sua compensazione.
3. La controparte segnala, per il margine fornito o ricevuto per una SFT compensata, le informazioni indicate nella tabella 3 di cui all'allegato e specifica la pertinente azione di cui al campo 20 di tale tabella.

#### *Articolo 3*

### **Segnalazione della garanzia reale**

1. Le controparti di operazioni di assunzione di titoli o merci in prestito e di operazioni di concessione di titoli o merci in prestito che convengono di non fornire alcuna garanzia lo specificano nel campo 72 della tabella 2 di cui all'allegato.
2. Se la garanzia reale di una SFT è collegata a un singolo prestito e le informazioni sulla garanzia sono note alla controparte entro il termine della segnalazione, la controparte specifica le informazioni complete e precise di tutti i singoli componenti della garanzia nei campi da 75 a 94 della tabella 2 di cui all'allegato quando segnala tale SFT per la prima volta con l'azione «New» (Nuova) nel campo 98 della tabella 2.

<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).

3. Se la garanzia reale di una SFT è collegata a un singolo prestito ma le informazioni sulla garanzia non sono note alla controparte entro il termine della segnalazione, la controparte specifica, con l'azione «Collateral update» (Aggiornamento della garanzia reale) nel campo 98 della tabella 2 di cui all'allegato, le informazioni complete e precise relative a tutti i singoli componenti della garanzia di tale SFT nei campi da 75 a 94 della tabella 2 di cui all'allegato non appena note e comunque entro il giorno lavorativo seguente la data di valuta specificata nel campo 13 della tabella 2.
4. La controparte che garantisce una o più SFT con un paniere di garanzie identificato da un codice ISIN specifica tale codice nel campo 96 della tabella 2 di cui all'allegato quando segnala l'SFT con l'azione «New» (Nuova) nel campo 98 della tabella 2.
5. La controparte che garantisce una o più SFT con un paniere di garanzie non identificato da un codice ISIN specifica il codice «NTAV» nel campo 96 della tabella 2 di cui all'allegato quando segnala l'SFT con l'azione «New» (Nuova) nel campo 98 della tabella 2.
6. Ai fini dei paragrafi 4 e 5, la controparte specifica altresì, con l'azione «Collateral update» (Aggiornamento della garanzia reale) nel campo 98 della tabella 2 di cui all'allegato, le informazioni complete e precise relative a tutti i singoli componenti della garanzia della SFT nei campi da 75 a 94 della tabella 2 non appena note e comunque entro il giorno lavorativo seguente la data di valuta specificata nel campo 13 della tabella 2.
7. La controparte che garantisce diverse SFT sulla base dell'esposizione netta specifica il codice «True» (Vero) nel campo 73 della tabella 2 di cui all'allegato. Tale controparte specifica altresì, con l'azione «Collateral update» (Aggiornamento della garanzia reale) nel campo 98 della tabella 2 di cui all'allegato, le informazioni complete e precise relative a tutti i singoli componenti della garanzia delle SFT nei campi da 75 a 94 della tabella 2 non appena note e comunque entro il giorno lavorativo seguente la data di valuta specificata nel campo 13 della tabella 2.

#### Articolo 4

##### **Segnalazione del riutilizzo delle garanzie reali**

1. La controparte che riceve uno o più strumenti finanziari come garanzia in una SFT specifica le informazioni complete e precise in merito a qualsiasi riutilizzo di ciascuno di tali strumenti finanziari nei campi 7, 8 e 9 della tabella 4 di cui all'allegato.
2. La controparte che riceve contante come garanzia in una SFT specifica le informazioni complete e precise in merito a qualsiasi reinvestimento di tale contante per ciascuna valuta nei campi 11, 12 e 13 della tabella 4 di cui all'allegato.

#### Articolo 5

##### **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 13 dicembre 2018

*Per la Commissione*  
*Il presidente*  
Jean-Claude JUNCKER

## ALLEGATO

Tabella 1

**Dati sulla controparte**

N.	Campo	Informazioni da segnalare	Operazioni di vendita con patto di riacquisto (repo)	BSB	SL	ML
1	Data e ora della segnalazione	Data e ora della trasmissione della segnalazione al repertorio di dati sulle negoziazioni.	Y	Y	Y	Y
2	Soggetto che trasmette la segnalazione	Codice unico di identificazione del soggetto che trasmette la segnalazione. Se la trasmissione della segnalazione è stata delegata ad un terzo o all'altra controparte, il codice unico di identificazione di tale soggetto.	Y	Y	Y	Y
3	Controparte segnalante	Codice unico di identificazione della controparte segnalante.	Y	Y	Y	Y
4	Natura della controparte segnalante	Indicare se la controparte segnalante è una controparte finanziaria o non finanziaria.	Y	Y	Y	Y
5	Settore della controparte segnalante	Uno o più codici che classificano la natura delle attività della controparte segnalante. Se la controparte segnalante è una controparte finanziaria, tutti i codici pertinenti inclusi nella tassonomia delle controparti finanziarie che si applicano a tale controparte. Se la controparte segnalante è una controparte non finanziaria, tutti i codici pertinenti inclusi nella tassonomia delle controparti non finanziarie che si applicano a tale controparte. Se è segnalata più di un'attività, i codici sono forniti in ordine di importanza relativa delle corrispondenti attività.	Y	Y	Y	Y
6	Classificazione settoriale supplementare	Se la controparte segnalante è un organismo di investimento collettivo in valori mobiliari (OICVM) o un fondo di investimento alternativo (FIA), un codice che indica se si tratta di un fondo indicizzato quotato (ETF) o di un fondo del mercato monetario (MMF) Se la controparte segnalante è un fondo di investimento alternativo (FIA) o una controparte non finanziaria che svolge attività finanziarie e assicurative o attività immobiliari, un codice che indica se si tratta di un fondo comune di investimento immobiliare (REIT)	Y	Y	Y	Y
7	Succursale della controparte segnalante	Se la controparte segnalante conclude una SFT tramite una succursale, il codice di identificazione della succursale.	Y	Y	Y	Y
8	Succursale dell'altra controparte	Se l'altra controparte conclude una SFT tramite una succursale, il codice di identificazione della succursale.	Y	Y	Y	Y

N.	Campo	Informazioni da segnalare	Operazioni di vendita con patto di riacquisto (repo)	BSB	SL	ML
9	Lato della controparte	Indicare se la controparte segnalante è un datore o un beneficiario della garanzia in conformità dell'articolo 4 del regolamento di esecuzione (UE) 2019/363 della Commissione <sup>(1)</sup>	Y	Y	Y	Y
10	Soggetto responsabile della segnalazione	Se la controparte finanziaria è responsabile della segnalazione per conto dell'altra controparte a norma dell'articolo 4, paragrafo 3, del regolamento (UE) 2365/2015 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(2)</sup> , il codice unico che identifica la controparte finanziaria. Se la società di gestione è responsabile della segnalazione per conto di un organismo di investimento collettivo in valori mobiliari (OICVM) a norma dell'articolo 4, paragrafo 3, del predetto regolamento, il codice unico che identifica la società di gestione. Se il gestore di un fondo di investimento alternativo (GEFIA) è responsabile della segnalazione per conto del fondo di investimento alternativo (FIA) a norma dell'articolo 4, paragrafo 3, del regolamento (UE) 2365/2015, il codice unico che identifica il GEFIA.	Y	Y	Y	Y
11	Altra controparte	Codice unico di identificazione del soggetto con cui la controparte segnalante ha concluso l'SFT. In caso di persone fisiche, specificare il codice cliente, in maniera coerente.	Y	Y	Y	Y
12	Paese dell'altra controparte	Codice del paese in cui ha sede l'altra controparte o, se l'altra controparte è una persona fisica, codice del paese di residenza.	Y	Y	Y	Y
13	Beneficiario	Se il beneficiario del contratto non è una controparte del contratto, la controparte segnalante deve identificarlo con un codice unico o, per le persone fisiche, con il codice cliente, utilizzato in maniera coerente, attribuitogli dalla persona giuridica a cui la persona fisica ha fatto ricorso.	Y	Y	Y	N
14	Agente triparty	Codice unico di identificazione del terzo a cui la controparte segnalante ha esternalizzato il trattamento post-negoziazione di una SFT (se del caso).	Y	Y	Y	N
15	Intermediario (broker)	Codice unico del soggetto che agisce come intermediario per conto della controparte segnalante senza diventare esso stesso una controparte della SFT. Per le operazioni di concessione di titoli in prestito, l'agente mutuante non è considerato un intermediario.	Y	Y	Y	N

<sup>(1)</sup> Regolamento di esecuzione (UE) 2019/363 della Commissione, del 13 dicembre 2018, che stabilisce norme tecniche di attuazione per quanto riguarda il formato e la frequenza delle segnalazioni delle informazioni sulle operazioni di finanziamento tramite titoli (SFT) ai repertori di dati sulle negoziazioni a norma del regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio e che modifica il regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012 della Commissione relativamente all'utilizzo di codici per la segnalazione dei contratti derivati (Cfr. pag. 85 della presente Gazzetta ufficiale)

<sup>(2)</sup> Regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 25 novembre 2015, sulla trasparenza delle operazioni di finanziamento tramite titoli e del riutilizzo e che modifica il regolamento (UE) n. 648/2012 (GU L 337 del 23.12.2015, pag. 1).

N.	Campo	Informazioni da segnalare	Operazioni di vendita con patto di riacquisto (repo)	BSB	SL	ML
16	Partecipante diretto	Se l'operazione è compensata, codice unico di identificazione del partecipante diretto responsabile della controparte segnalante.	Y	Y	Y	N
17	Partecipante o partecipante indiretto del depositario centrale di titoli («CSD»)	Codice unico del partecipante o partecipante indiretto del CSD della controparte segnalante. Se sia il partecipante che il partecipante indiretto del CSD sono coinvolti nell'operazione, il codice del partecipante indiretto. Questo campo non è applicabile alle merci.	Y	Y	Y	N
18	Agente mutuante	Codice unico dell'agente mutuante coinvolto nell'operazione di concessione di titoli in prestito.	Y	N	Y	N

Tabella 2

**Dati sul prestito e sulla garanzia reale**

N.	Campo	Informazioni da segnalare	Operazioni di vendita con patto di riacquisto (repo)	BSB	SL	ML
1	Identificativo unico dell'operazione («UTI»)	Riferimento unico assegnato alla SFT al fine di identificare l'operazione.	Y	Y	Y	Y
2	Numero di tracciamento della segnalazione	In caso di operazioni risultanti da compensazione, va segnalato il precedente UTI, ovvero l'UTI dell'operazione bilaterale originaria. Tuttavia, l'UTI precedente non deve essere segnalato dalle controparti che sono controparti centrali («CCP») che hanno compensato l'SFT. Se l'SFT è stata eseguita in una sede di negoziazione e compensata lo stesso giorno, un numero generato dalla sede di negoziazione e specifico a tale esecuzione.	Y	Y	Y	N
3	Data dell'evento	Data in cui si è svolto l'evento da segnalare relativo all'SFT e rilevato dalla segnalazione. Nel caso di azioni del tipo «Valuation update» (Aggiornamento della valutazione), «Collateral update» (Aggiornamento della garanzia reale), «Reuse update» (Aggiornamento del riutilizzo), «Margin update» (Aggiornamento del margine), la data per la quale sono fornite le informazioni contenute nella segnalazione.	Y	Y	Y	Y
4	Tipo di SFT	Tipo di SFT ai sensi dell'articolo 3, punti da 7 a 10, del regolamento (UE) 2365/2015.	Y	Y	Y	Y
5	Compensata	Indicare se la compensazione ha avuto luogo.	Y	Y	Y	N
6	Data e ora della compensazione	Data e ora in cui la compensazione ha avuto luogo.	Y	Y	Y	N
7	Controparte centrale (CCP)	Se il contratto è stato compensato, il codice unico della CCP che ha compensato il contratto.	Y	Y	Y	N

N.	Campo	Informazioni da segnalare	Operazioni di vendita con patto di riacquisto (repo)	BSB	SL	ML
8	Sede di negoziazione	Codice unico di identificazione della sede di negoziazione della SFT. Se la SFT è stata conclusa over the counter ed è ammessa alla negoziazione, il codice MIC «XOFF». Se la SFT è stata conclusa over the counter e non è ammessa alla negoziazione, il codice MIC «XXXX».	Y	Y	Y	N
9	Tipo di accordo quadro	Riferimento al tipo di accordo quadro con il quale le controparti hanno concluso l'SFT.	Y	Y	Y	N
10	Altro tipo di accordo quadro	Nome dell'accordo quadro. Questo campo deve essere compilato solo se «OTHR» (Altro) è indicato nel campo 9.	Y	Y	Y	N
11	Versione dell'accordo quadro	L'anno dell'accordo quadro pertinente per l'operazione segnalata, se del caso.	Y	Y	Y	N
12	Data e ora di esecuzione	Data e ora di esecuzione della SFT.	Y	Y	Y	Y
13	Data di valuta (data di inizio)	Data concordata contrattualmente tra le controparti per lo scambio di contanti, titoli o merci contro garanzie reali per l'opening leg (spot leg) della SFT.	Y	Y	Y	N
14	Data di scadenza (data di fine)	Data concordata contrattualmente tra le controparti per lo scambio di contanti, titoli o merci contro garanzie reali per la closing leg (forward leg) della SFT. Tali informazioni non devono essere comunicate per le operazioni di vendita con patto di riacquisto con scadenza aperta.	Y	Y	Y	N
15	Data di cessazione	Data di cessazione in caso di cessazione anticipata della SFT.	Y	Y	Y	Y
16	Preavviso minimo	Numero minimo di giorni lavorativi di anticipo con cui una delle controparti deve informare l'altra controparte della cessazione dell'operazione.	Y	N	N	N
17	Prima data di richiamo (call-back)	Prima data alla quale il prestatore di contante ha il diritto di ritirare una parte dei fondi o cessare l'operazione.	Y	N	N	N
18	Indicatore delle garanzie generiche (general collateral)	Indicare se l'SFT è soggetta ad un contratto di garanzia generica. Nel caso di un'operazione di concessione di titoli in prestito, il campo fa riferimento ai titoli forniti come garanzia e non al titolo dato in prestito.	Y	Y	Y	N

N.	Campo	Informazioni da segnalare	Operazioni di vendita con patto di riacquisto (repo)	BSB	SL	ML
		<p>Il codice «GENE» deve essere specificato per una SFT soggetta a un contratto di garanzia generica. Il contratto di garanzia generica indica il contratto di garanzia per un'operazione in cui il datore della garanzia può scegliere il titolo da fornire come garanzia tra una gamma relativamente ampia di titoli che soddisfano criteri predefiniti.</p> <p>Il codice «SPEC» deve essere specificato per una SFT soggetta a un contratto di garanzia specifica. Il contratto di garanzia specifica indica il contratto di garanzia per un'operazione in cui il beneficiario della garanzia chiede che il datore della garanzia fornisca uno specifico numero internazionale di identificazione dei titoli («ISIN»).</p>				
19	Indicatore della consegna per valore (Delivery by value, DBV)	Indicare se l'operazione è stata regolata tramite il meccanismo DBV.	Y	N	Y	N
20	Metodo utilizzato per fornire le garanzie reali	<p>Indicare se la garanzia reale nella SFT è soggetta ad un contratto di garanzia con trasferimento del titolo di proprietà, un contratto di garanzia finanziaria con costituzione di garanzia reale o un contratto di garanzia finanziaria con costituzione di garanzia reale con diritto di uso.</p> <p>In caso di utilizzo di più di un metodo, in questo campo va specificato il contratto di garanzia principale.</p>	Y	N	Y	Y
21	Scadenza aperta	<p>Indicare se l'SFT è a scadenza aperta (non ha data di scadenza determinata) o a scadenza fissa con una data di scadenza stabilita contrattualmente.</p> <p>Il codice «True» (Vero) deve essere specificato per le SFT a scadenza aperta, e il codice «False» (Falso) per le SFT a scadenza fissa.</p>	Y	N	Y	N
22	Opzione di chiusura	Indicare se l'SFT è evergreen o prorogabile.	Y	N	Y	N

Nel caso di finanziamenti con margini, i campi da 23 a 34 devono essere ripetuti e compilati per ciascuna valuta utilizzata nel prestito su margine.

23	Tasso fisso	<p>Nel caso delle operazioni di vendita con patto di riacquisto, il tasso di interesse annualizzato sul capitale dell'operazione di vendita con patto di riacquisto conformemente alla convenzione sul conteggio dei giorni.</p> <p>Nel caso di finanziamenti con margini, il tasso di interesse annualizzato sul valore del prestito che il prestatore paga al prestatore.</p>	Y	N	N	Y
----	-------------	---	---	---	---	---

N.	Campo	Informazioni da segnalare	Operazioni di vendita con patto di riacquisto (repo)	BSB	SL	ML
24	Convenzione sul conteggio dei giorni	Metodo di calcolo degli interessi maturati sull'importo del capitale per un tasso.	Y	N	N	Y
25	Tasso variabile	Indicare il tasso di interesse di riferimento utilizzato, rivisto a intervalli prestabiliti con riferimento ad un tasso di riferimento di mercato, se applicabile.	Y	N	N	Y
26	Periodo di riferimento del tasso variabile - periodo	Periodo che descrive il periodo di riferimento per il tasso variabile.	Y	N	N	Y
27	Periodo di riferimento del tasso variabile - moltiplicatore	Moltiplicatore per il periodo che descrive il periodo di riferimento per il tasso variabile specificato nel campo 26.	Y	N	N	Y
28	Frequenza di pagamento per il tasso variabile - periodo	Periodo che descrive la frequenza dei pagamenti soggetti al tasso variabile.	Y	N	N	Y
29	Frequenza di pagamento per il tasso variabile - moltiplicatore	Moltiplicatore per il periodo che descrive la frequenza di pagamento per il tasso variabile specificato nel campo 28.	Y	N	N	Y
30	Frequenza di revisione del tasso variabile - periodo	Periodo che descrive la frequenza delle revisioni del tasso variabile.	Y	N	N	Y
31	Frequenza di revisione del tasso variabile - moltiplicatore	Moltiplicatore per il periodo che descrive la frequenza di revisione del tasso variabile specificato nel campo 30.	Y	N	N	Y
32	Differenziale	Numero di punti base da aggiungere o sottrarre dal tasso di interesse variabile per determinare il tasso d'interesse del prestito.	Y	N	N	Y
33	Importo in valuta dei finanziamenti con margini	Importo di un prestito su margine in una determinata valuta.	N	N	N	Y
34	Valuta dei finanziamenti con margini	Valuta del prestito su margine.	N	N	N	Y

I campi 35 e 36 devono essere ripetuti e compilati per ciascuna rettifica del tasso d'interesse variabile.

35	Tasso rettificato	Tasso determinato in base alla griglia dei tassi.	Y	N	N	N
----	-------------------	---	---	---	---	---

N.	Campo	Informazioni da segnalare	Operazioni di vendita con patto di riacquisto (repo)	BSB	SL	ML
36	Data di applicazione del tasso	Data a partire dalla quale il tasso è effettivo	Y	N	N	N
37	Importo del capitale alla data di valuta	Valore in contanti da regolare alla data di valuta dell'operazione.	Y	Y	N	N
38	Importo del capitale alla data di scadenza	Valore in contanti da regolare alla data di scadenza dell'operazione.	Y	Y	N	N
39	Valuta dell'importo del capitale	Valuta dell'importo del capitale.	Y	Y	N	N
40	Tipo di attività	Indicare il tipo di attività oggetto dell'SFT.	N	N	Y	N
41	Identificativo del titolo	Identificazione del titolo oggetto dell'SFT. Questo campo non è applicabile alle merci.	N	N	Y	N
42	Classificazione del titolo	Codice CFI (Classification of Financial Instruments - Classificazione degli strumenti finanziari) del titolo oggetto dell'SFT. Questo campo non è applicabile alle merci.	N	N	Y	N

Se una merce è stata concessa o assunta in prestito, la classificazione di tale merce è specificata nei campi 43, 44 e 45.

43	Categoria di prodotti	Categoria di prodotti come specificata nella classificazione delle merci della tabella 5 di cui all'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2019/363 della Commissione.	N	N	Y	N
44	Sottocategoria di prodotti	Sottocategoria di prodotti come specificata nella classificazione delle merci della tabella 5 di cui all'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2019/363 della Commissione. Questo campo presuppone l'indicazione di una specifica categoria di prodotti nel campo 43.	N	N	Y	N
45	Ulteriore sottocategoria di prodotti	Ulteriore sottocategoria come specificata nella classificazione della tabella delle merci. Questo campo presuppone l'indicazione di una specifica sottocategoria di prodotti nel campo 44.	N	N	Y	N
46	Quantità o importo nominale	Quantità o importo nominale del titolo o della merce oggetto dell'SFT. Nel caso di un'obbligazione, l'importo nominale totale che equivale al numero di obbligazioni moltiplicato per il loro valore facciale. Nel caso di altri titoli o merci, la loro quantità.	N	N	Y	N
47	Unità di misura	L'unità di misura in cui è espressa la quantità. Questo campo è applicabile alle merci.	N	N	Y	N
48	Valuta dell'importo nominale	Nel caso in cui è indicato l'importo nominale, la valuta dell'importo nominale.	N	N	Y	N

N.	Campo	Informazioni da segnalare	Operazioni di vendita con patto di riacquisto (repo)	BSB	SL	ML
49	Prezzo del titolo o della merce	In caso di concessione e assunzione in prestito di titoli e merci, il prezzo del titolo o della merce utilizzato per calcolare il valore del prestito. Nel caso di un buy-sell back, il prezzo del titolo o della merce utilizzato per calcolare l'importo dell'operazione per la spot leg del buy-sell back.	N	Y	Y	N
50	Valuta del prezzo	Valuta in cui è denominato il prezzo del titolo o della merce.	N	N	Y	N
51	Qualità del titolo	Codice che classifica il rischio di credito del titolo.	N	N	Y	N
52	Scadenza del titolo	Scadenza del titolo. Questo campo non è applicabile alle merci.	N	N	Y	N
53	Giurisdizione dell'emittente	Giurisdizione dell'emittente del titolo. In caso di titoli emessi da una controllata estera, la giurisdizione dell'impresa madre ultima o, se quest'ultima non è nota, la giurisdizione della controllata. Questo campo non è applicabile alle merci.	N	N	Y	N
54	LEI dell'emittente	LEI dell'emittente del titolo. Questo campo non è applicabile alle merci.	N	N	Y	N
55	Tipo di titolo	Codice che classifica il tipo di titolo.	N	N	Y	N
56	Valore del prestito	Valore del prestito, vale a dire la quantità o l'importo nominale del prestito moltiplicato per il prezzo indicato nel campo 49.	N	N	Y	N
57	Valore di mercato	Valore di mercato dei titoli o delle merci assunti o concessi in prestito.	N	N	Y	N
58	Tasso di rimborso fisso	Tasso di interesse fisso (tasso che il prestatore ha convenuto di pagare per il reinvestimento della garanzia in contante meno le commissioni di prestito) corrisposto dal prestatore del titolo o della merce al prenditore (tasso di rimborso positivo) o dal prenditore al prestatore (tasso di rimborso negativo) sul saldo della garanzia in contante fornita.	N	N	Y	N
59	Tasso di rimborso variabile	Tasso di interesse di riferimento utilizzato per calcolare il tasso di rimborso (tasso che il prestatore ha convenuto di pagare per il reinvestimento della garanzia in contante meno le commissioni di prestito) corrisposto dal prestatore del titolo o della merce al prenditore (tasso di rimborso positivo) o dal prenditore al prestatore (tasso di rimborso negativo) sul saldo della garanzia in contante fornita.	N	N	Y	N
60	Periodo di riferimento del tasso di rimborso variabile - periodo	Periodo che descrive il periodo di riferimento per il tasso di rimborso variabile.	N	N	Y	N

N.	Campo	Informazioni da segnalare	Operazioni di vendita con patto di riacquisto (repo)	BSB	SL	ML
61	Periodo di riferimento del tasso di rimborso variabile - moltiplicatore	Moltiplicatore per il periodo che descrive il periodo di riferimento per il tasso di rimborso variabile specificato nel campo 60.	N	N	Y	N
62	Frequenza di pagamento per il tasso di rimborso variabile - periodo	Periodo che descrive la frequenza dei pagamenti per il tasso di rimborso variabile.	N	N	Y	N
63	Frequenza di pagamento per il tasso di rimborso variabile - moltiplicatore	Moltiplicatore per il periodo che descrive la frequenza di pagamento per il tasso di rimborso variabile specificato nel campo 62.	N	N	Y	N
64	Frequenza di revisione del tasso di rimborso variabile - periodo	Periodo che descrive la frequenza delle revisioni del tasso di rimborso variabile.	N	N	Y	N
65	Frequenza di revisione del tasso di rimborso variabile - moltiplicatore	Moltiplicatore per il periodo che descrive la frequenza di revisione del tasso di rimborso variabile specificato nel campo 64.	N	N	Y	N
66	Differenziale del tasso di rimborso	Differenziale del tasso di rimborso variabile espresso in punti base.	N	N	Y	N
67	Commissione sul prestito	Commissione che il prenditore del titolo o della merce paga al prestatore.	N	N	Y	N
68	Accordi di esclusiva	In caso di assunzione e concessione in prestito di titoli, indicare se il prenditore ha accesso esclusivo per assumere in prestito dal portafoglio di titoli del prestatore. Questo campo non è applicabile alle merci.	N	N	Y	N
69	Prestito su margine in essere	Importo totale dei prestiti su margine, nella valuta di base.	N	N	N	Y
70	Valuta di base del prestito su margine in essere	Valuta di base dei prestiti su margine in essere.	N	N	N	Y
71	Valore di mercato della posizione corta	Valore di mercato della posizione corta, nella valuta di base.	N	N	N	Y

N.	Campo	Informazioni da segnalare	Operazioni di vendita con patto di riacquisto (repo)	BSB	SL	ML
----	-------	---------------------------	--	-----	----	----

## Dati sulla garanzia reale

72	Contrassegno Prestito titoli («Securities Lending» - «SL») non garantito	Indicare se l'operazione SL non è assistita da garanzia reale. Questo campo non va utilizzato se le controparti convengono di garantire l'operazione ma l'allocazione specifica della garanzia non è ancora nota.	N	N	Y	N
73	Copertura dell'esposizione netta	Indicare se la garanzia reale è stata fornita in base all'esposizione netta, piuttosto che per un'operazione unica.	Y	Y	Y	N
74	Data di valuta della garanzia	Se le operazioni sono state garantite sulla base dell'esposizione netta, l'ultima data di valuta con riferimento all'insieme di attività soggette a compensazione delle SFT, tenuto conto di tutte le operazioni per le quali è stata fornita la garanzia.	Y	Y	Y	N

Se è stata utilizzata una garanzia reale specifica, i campi da 75 a 94 devono essere ripetuti e compilati per ogni componente della garanzia, se del caso.

75	Tipo di componente della garanzia reale	Indicare il tipo di componente della garanzia reale.	Y	Y	Y	Y
----	---	--	---	---	---	---

Se è stato utilizzato il contante come garanzia, ciò viene specificato nei campi 76 e 77.

76	Importo delle garanzie in contante	Importo dei fondi forniti come garanzia per l'assunzione in prestito di titoli o merci.	Y	Y	Y	N
77	Valuta della garanzia in contante	Valuta delle garanzie in contante.	Y	Y	Y	N
78	Identificazione del titolo utilizzato come garanzia	Identificazione del titolo utilizzato come garanzia. Questo campo non è applicabile alle merci.	Y	Y	Y	Y
79	Classificazione del titolo utilizzato come garanzia	Codice CFI del titolo utilizzato come garanzia. Questo campo non è applicabile alle merci.	Y	Y	Y	Y

Se una merce è stata usata come garanzia, la classificazione di tale merce è specificata nei campi 80, 81 e 82.

80	Categoria di prodotti	Categoria di prodotti come specificata nella classificazione delle merci della tabella 5 di cui all'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2019/363 della Commissione.	Y	Y	Y	N
81	Sottocategoria di prodotti	Sottocategoria di prodotti come specificata nella classificazione delle merci della tabella 5 di cui all'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2019/363 della Commissione. Questo campo presuppone l'indicazione di una specifica categoria di prodotti nel campo 80.	Y	Y	Y	N
82	Ulteriore sottocategoria di prodotti	Ulteriore sottocategoria di prodotti come specificata nella classificazione delle merci della tabella 5 di cui all'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2019/363 della Commissione. Questo campo presuppone l'indicazione di una specifica sottocategoria di prodotti nel campo 81.	Y	Y	Y	N

N.	Campo	Informazioni da segnalare	Operazioni di vendita con patto di riacquisto (repo)	BSB	SL	ML
83	Quantità o importo nominale della garanzia	Quantità o importo nominale del titolo o della merce usati come garanzia. Nel caso di un'obbligazione, l'importo nominale totale che equivale al numero di obbligazioni moltiplicato per il valore facciale. Nel caso di altri titoli o merci, la loro quantità.	Y	Y	Y	Y
84	Unità di misura della garanzia reale	L'unità di misura in cui è specificata la quantità della garanzia. Questo campo è applicabile alle merci.	Y	Y	Y	N
85	Valuta dell'importo nominale della garanzia reale	Nel caso in cui è indicato l'importo nominale della garanzia reale, la valuta dell'importo nominale.	Y	Y	Y	Y
86	Valuta del prezzo	Valuta del prezzo della componente della garanzia reale.	Y	Y	Y	Y
87	Prezzo unitario	Prezzo unitario per la componente della garanzia reale, compresi gli interessi maturati per i titoli fruttiferi utilizzati per valutare il titolo o la merce.	Y	Y	Y	Y
88	Valore di mercato della garanzia reale	Valore di mercato della singola componente della garanzia reale espressa nella valuta del prezzo.	Y	Y	Y	Y
89	Scarto o margine	Per operazioni di vendita con patto di riacquisto e buy-sell back, l'eventuale scarto della garanzia reale è specificato con riferimento a qualsiasi misura per il controllo dei rischi applicata alla garanzia sottostante, a livello ISIN, dove il valore della garanzia sottostante è calcolato come il valore di mercato delle attività decurtato di una determinata percentuale. Per il prestito titoli, la percentuale dell'eventuale scarto della garanzia reale è specificato con riferimento a qualsiasi misura per il controllo dei rischi applicata alla garanzia sottostante, a livello ISIN o di portafoglio, dove il valore della garanzia sottostante è calcolato come il valore di mercato delle attività decurtato di una determinata percentuale. Per i finanziamenti con margini, la percentuale del requisito di margine applicato all'intero portafoglio di garanzie detenuto nel conto di prime brokerage del cliente. In questo campo devono essere specificati i valori effettivi, in opposizione a quelli stimati o per default.	Y	Y	Y	Y
90	Qualità della garanzia reale	Codice che classifica il rischio del titolo utilizzato come garanzia.	Y	Y	Y	Y
91	Data di scadenza del titolo	Data di scadenza del titolo utilizzato come garanzia. Questo campo non è applicabile alle merci.	Y	Y	Y	Y

N.	Campo	Informazioni da segnalare	Operazioni di vendita con patto di riacquisto (repo)	BSB	SL	ML
92	Giurisdizione dell'emittente	Giurisdizione dell'emittente del titolo utilizzato come garanzia. In caso di titoli emessi da una controllata estera, va indicata la giurisdizione dell'impresa madre ultima o, se quest'ultima non è nota, la giurisdizione della controllata. Questo campo non è applicabile alle merci.	Y	Y	Y	Y
93	LEI dell'emittente	LEI dell'emittente del titolo utilizzato come garanzia. Questo campo non è applicabile alle merci.	Y	Y	Y	Y
94	Tipo di garanzia reale	Codice che classifica il tipo di titolo utilizzato come garanzia.				
95	Possibilità di riutilizzare la garanzia reale	Indicare se il beneficiario della garanzia può riutilizzare i titoli forniti come garanzia.	Y	Y	Y	Y

Compilare il campo 96 in caso di utilizzo di un paniere di garanzie. Nei campi da 75 a 94 va specificata l'allocazione dettagliata delle garanzie reali per le SFT concluse a fronte di un aggregato di garanzie, se disponibile.

96	Identificativo del paniere di garanzie reali	Se il paniere di garanzie reali può essere identificato con un codice ISIN, indicare l'ISIN del paniere. Se il paniere di garanzie reali non può essere identificato con un codice ISIN, questo campo deve essere compilato con il codice «NTAV».	Y	Y	Y	N
97	Codice del portafoglio	Se l'operazione è compensata ed inclusa in un portafoglio di operazioni per le quali sono scambiati margini, il portafoglio è identificato con un codice unico determinato dalla controparte segnalante. Se il portafoglio di operazioni include anche contratti derivati da segnalare a norma del regolamento (UE) n. 648/2012, il codice del portafoglio è lo stesso indicato nella segnalazione a norma del regolamento (UE) n. 648/2012.	Y	Y	Y	N
98	Tipo di azione	La segnalazione deve contenere uno dei seguenti tipi di azione: a) l'SFT segnalata per la prima volta va identificata come «New» (Nuova); b) la modifica dell'SFT segnalata precedentemente va identificata come «Modification» (Modifica). Rientra in questo tipo di azione l'aggiornamento di una precedente segnalazione che indica una posizione nel caso in cui vengano incluse nuove operazioni; c) la valutazione del titolo o della merce oggetto di operazioni di concessione in prestito di titoli o merci è identificata come «Valuation Update» (Aggiornamento della valutazione);	Y	Y	Y	Y

N.	Campo	Informazioni da segnalare	Operazioni di vendita con patto di riacquisto (repo)	BSB	SL	ML
		<p>d) la modifica dei dati sulla garanzia, compresa la valutazione, va identificata come «Collateral update» (Aggiornamento della garanzia);</p> <p>e) la cancellazione integrale di una segnalazione erroneamente trasmessa (l'SFT non è mai entrata in vigore o non è soggetta agli obblighi di segnalazione per le SFT ma è stata segnalata per errore ad un repertorio di dati sulle negoziazioni) va indicata come «Error» (Errore);</p> <p>f) la correzione di campi di dati che sono stati compilati erroneamente in una segnalazione precedente va indicata come «Correction» (Correzione);</p> <p>g) la cessazione di una SFT a scadenza aperta o la cessazione anticipata di una SFT a scadenza fissa va identificata come «Termination/Early termination» (Cessazione/Cessazione anticipata);</p> <p>h) l'SFT che deve essere segnalata come nuova operazione ed essere anche inclusa in una segnalazione separata della posizione lo stesso giorno va indicata come «Position component» (Componente della posizione).</p>				
99	Livello	<p>Indicare se la segnalazione è effettuata a livello di operazione o di posizione.</p> <p>La segnalazione a livello di posizione può essere utilizzata solo come integrazione della segnalazione a livello di operazione, per segnalare eventi post-negoziazione e solo se le singole operazioni in prodotti fungibili sono state sostituite dalla posizione.</p>	Y	Y	Y	N

Tabella 3

**Dati sui margini**

N.	Campo	Informazioni da segnalare	Operazioni di vendita con patto di riacquisto (repo)	BSB	SL	ML
1	Data e ora della segnalazione	Data e ora della trasmissione della segnalazione al repertorio di dati sulle negoziazioni.	Y	Y	Y	N
2	Data dell'evento	Data in cui si è svolto l'evento da segnalare relativo all'SFT e rilevato dalla segnalazione. Nel caso di azioni del tipo «Valuation update» (Aggiornamento della valutazione), «Collateral update» (Aggiornamento della garanzia reale), «Reuse update» (Aggiornamento del riutilizzo), «Margin update» (Aggiornamento del margine), la data per la quale sono fornite le informazioni contenute nella segnalazione.	Y	Y	Y	N
3	Soggetto che trasmette la segnalazione	Codice unico di identificazione del soggetto che trasmette la segnalazione. Se la trasmissione della segnalazione è stata delegata ad un terzo o all'altra controparte, il codice unico di identificazione di tale soggetto.	Y	Y	Y	N

N.	Campo	Informazioni da segnalare	Operazioni di vendita con patto di riacquisto (repo)	BSB	SL	ML
4	Controparte segnalante	Codice unico di identificazione della controparte segnalante.	Y	Y	Y	N
5	Soggetto responsabile della segnalazione	<p>Se la controparte finanziaria è responsabile della segnalazione per conto dell'altra controparte a norma dell'articolo 4, paragrafo 3, del regolamento (UE) 2365/2015, il codice unico che identifica la controparte finanziaria.</p> <p>Se la società di gestione è responsabile della segnalazione per conto di un organismo di investimento collettivo in valori mobiliari (OICVM) a norma dell'articolo 4, paragrafo 3, del regolamento (UE) 2365/2015, il codice unico che identifica la società di gestione.</p> <p>Se il gestore di un fondo di investimento alternativo (GEFIA) è responsabile della segnalazione per conto del fondo di investimento alternativo (FIA) a norma dell'articolo 4, paragrafo 3, del regolamento (UE) 2365/2015, il codice unico che identifica il GEFIA.</p>	Y	Y	Y	Y
6	Altra controparte	Codice unico che identifica il soggetto con cui la controparte segnalante ha concluso l'SFT.	Y	Y	Y	N
7	Codice del portafoglio	<p>Il portafoglio di operazioni per le quali sono scambiati margini è identificato con un codice unico determinato dalla controparte segnalante.</p> <p>Se il portafoglio di operazioni include anche contratti derivati da segnalare a norma del regolamento (UE) n. 648/2012, il codice del portafoglio è lo stesso indicato nella segnalazione a norma del regolamento (UE) n. 648/2012.</p>	Y	Y	Y	N
8	Margine iniziale costituito	<p>Valore del margine iniziale costituito dalla controparte segnalante a favore dell'altra controparte.</p> <p>Se il margine iniziale è costituito sulla base di un portafoglio, includere nel campo il valore complessivo del margine iniziale costituito per il portafoglio.</p>	Y	Y	Y	N
9	Valuta del margine iniziale costituito	Valuta del margine iniziale costituito.	Y	Y	Y	N
10	Margine di variazione costituito	<p>Valore del margine di variazione, compreso il valore del regolamento in contante, costituito dalla controparte segnalante a favore dell'altra controparte.</p> <p>Se il margine di variazione è costituito sulla base di un portafoglio, includere nel campo il valore globale del margine di variazione costituito per il portafoglio.</p>	Y	Y	Y	N

N.	Campo	Informazioni da segnalare	Operazioni di vendita con patto di riacquisto (repo)	BSB	SL	ML
11	Valuta del margine di variazione costituito	Valuta del margine di variazione costituito.	Y	Y	Y	N
12	Margine iniziale ricevuto	Valore del margine iniziale che la controparte segnalante ha ricevuto dall'altra controparte. Se il margine iniziale è ricevuto sulla base di un portafoglio, includere nel campo il valore globale del margine iniziale ricevuto per il portafoglio.	Y	Y	Y	N
13	Valuta del margine iniziale ricevuto	Valuta del margine iniziale ricevuto.	Y	Y	Y	N
14	Margine di variazione ricevuto	Valore del margine di variazione, compreso il valore del regolamento in contante, che la controparte segnalante ha ricevuto dall'altra controparte. Se il margine di variazione è ricevuto sulla base di un portafoglio, includere nel campo il valore globale del margine di variazione ricevuto per il portafoglio.	Y	Y	Y	N
15	Valuta del margine di variazione ricevuto	Valuta del margine di variazione ricevuto.	Y	Y	Y	N
16	Garanzia costituita in eccesso	Valore della garanzia costituita in eccesso rispetto alla garanzia richiesta.	Y	Y	Y	N
17	Valuta della garanzia costituita in eccesso	Valuta della garanzia costituita in eccesso.	Y	Y	Y	N
18	Garanzia ricevuta in eccesso	Valore della garanzia ricevuta in eccesso rispetto alla garanzia richiesta.	Y	Y	Y	N
19	Valuta della garanzia ricevuta in eccesso	Valuta della garanzia ricevuta in eccesso.	Y	Y	Y	N
20	Tipo di azione	La segnalazione deve contenere uno dei seguenti tipi di azione: a) il nuovo saldo di margine va indicato come «New» (Nuovo); b) la modifica dei dettagli dei margini va indicata come «Margin update» (Aggiornamento del margine);	Y	Y	Y	N

N.	Campo	Informazioni da segnalare	Operazioni di vendita con patto di riacquisto (repo)	BSB	SL	ML
		c) la cancellazione integrale di una segnalazione erroneamente trasmessa va indicata come «Error» (Errore); d) la correzione di campi di dati che sono stati compilati erroneamente in una segnalazione precedente va indicata come «Correction» (Correzione);				

Tabella 4

**Dati sul riutilizzo, sul reinvestimento del contante e sulle fonti di finanziamento**

N.	Campo	Informazioni da segnalare	Operazioni di vendita con patto di riacquisto (repo)	BSB	SL	ML
1	Data e ora della segnalazione	Data e ora della trasmissione della segnalazione al repertorio di dati sulle negoziazioni.	Y	Y	Y	Y
2	Data dell'evento	Data in cui si è svolto l'evento da segnalare relativo all'SFT e rilevato dalla segnalazione. Nel caso di azioni del tipo «Valuation update» (Aggiornamento della valutazione), «Collateral update» (Aggiornamento della garanzia reale), «Reuse update» (Aggiornamento del riutilizzo), «Margin update» (Aggiornamento del margine), la data per la quale sono fornite le informazioni contenute nella segnalazione.	Y	Y	Y	Y
3	Soggetto che trasmette la segnalazione	Codice unico di identificazione del soggetto che trasmette la segnalazione. Se la trasmissione della segnalazione è stata delegata ad un terzo o all'altra controparte, il codice unico di identificazione di tale soggetto.	Y	Y	Y	Y
4	Controparte segnalante	Codice unico di identificazione della controparte segnalante.	Y	Y	Y	Y
5	Soggetto responsabile della segnalazione	Se la controparte finanziaria è responsabile della segnalazione per conto dell'altra controparte a norma dell'articolo 4, paragrafo 3, del regolamento (UE) 2365/2015, il codice unico che identifica la controparte finanziaria.  Se la società di gestione è responsabile della segnalazione per conto di un organismo di investimento collettivo in valori mobiliari (OICVM) a norma dell'articolo 4, paragrafo 3, del regolamento (UE) 2365/2015, il codice unico che identifica la società di gestione.  Se il gestore di un fondo di investimento alternativo (GEFIA) è responsabile della segnalazione per conto del fondo di investimento alternativo (FIA) a norma dell'articolo 4, paragrafo 3, del regolamento (UE) 2365/2015, il codice unico che identifica il GEFIA.	Y	Y	Y	Y
Il campo 6 deve essere ripetuto e compilato per ciascuna componente della garanzia.						
6	Tipo di componente della garanzia reale	Indicare il tipo di componente della garanzia reale.	Y	Y	Y	Y

N.	Campo	Informazioni da segnalare	Operazioni di vendita con patto di riacquisto (repo)	BSB	SL	ML
----	-------	---------------------------	--	-----	----	----

I campi 7, 8, 9 e 10 devono essere ripetuti e compilati per ciascun titolo.

7	Componente della garanzia reale	Identificazione del titolo utilizzato come garanzia.	Y	Y	Y	Y
8	Valore della garanzia riutilizzata	Valore totale della garanzia reale riutilizzata quando può essere calcolato a livello di operazione SFT.	Y	Y	Y	Y
9	Riutilizzo stimato della garanzia reale	Se il valore effettivo della garanzia reale riutilizzata è ignoto o non può essere calcolato, è calcolata una stima del valore del riutilizzo a livello di singolo strumento finanziario come indicato nella relazione dell'FSB «Transforming Shadow Banking into Resilient Market-based Finance, Non-Cash Collateral Re-Use: Measure and Metrics» del 25 gennaio 2017.	Y	Y	Y	Y
10	Valuta della garanzia riutilizzata	Valuta del valore reale o stimato della garanzia riutilizzata.	Y	Y	Y	Y
11	Tasso di reinvestimento	Tasso d'interesse medio percepito dal reinvestimento di una garanzia in contante realizzato dal prestatore.	N	N	Y	N

I campi 12, 13 e 14 devono essere ripetuti e compilati per ogni investimento se la garanzia in contante è stata reinvestita e per ciascuna valuta.

12	Tipo di reinvestimento del contante	Tipo di reinvestimento.	N	N	Y	N
13	Importo del contante reinvestito	Importo del contante reinvestito in una determinata valuta.	N	N	Y	N
14	Valuta del contante reinvestito	Valuta del contante reinvestito.	N	N	Y	N

Nel caso di finanziamenti con margini, la controparte ripete e compila i campi 15, 16 e 17 per ciascuna fonte di finanziamento e fornisce le informazioni in questi campi a livello di soggetto.

15	Fonti di finanziamento	Fonti di finanziamento utilizzate per finanziare prestiti su margine.	N	N	N	Y
16	Valore di mercato delle fonti di finanziamento	Valore di mercato delle fonti di finanziamento di cui al campo 15.	N	N	N	Y
17	Valuta delle fonti di finanziamento	Valuta del valore di mercato delle fonti di finanziamento	N	N	N	Y
18	Tipo di azione	La segnalazione deve contenere uno dei seguenti tipi di azione: a) il nuovo saldo di riutilizzo è indicato come «New» (Nuovo);	Y	Y	Y	Y

N.	Campo	Informazioni da segnalare	Operazioni di vendita con patto di riacquisto (repo)	BSB	SL	ML
		b) la modifica dei dati sul riutilizzo è indicata come «Reuse update» (Aggiornamento del riutilizzo); c) la cancellazione integrale di una segnalazione erroneamente trasmessa va indicata come «Error» (Errore); d) la correzione di campi di dati che sono stati compilati erroneamente in una segnalazione precedente va indicata come «Correction» (Correzione).				

**REGOLAMENTO DELEGATO (UE) 2019/357 DELLA COMMISSIONE****del 13 dicembre 2018****che integra il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione sull'accesso alle informazioni sulle operazioni di finanziamento tramite titoli registrate nei repertori di dati sulle negoziazioni****(Testo rilevante ai fini del SEE)**

LA COMMISSIONE EUROPEA,

visto il trattato sul funzionamento dell'Unione europea,

visto il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 25 novembre 2015, sulla trasparenza delle operazioni di finanziamento tramite titoli e del riutilizzo e che modifica il regolamento (UE) n. 648/2012 <sup>(1)</sup>, in particolare l'articolo 12, paragrafo 3, lettere c) e d),

considerando quanto segue:

- (1) L'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365 prevede che le entità elencate nell'articolo stesso abbiano accesso alle informazioni sulle SFT in modo che possano assolvere le responsabilità e i mandati rispettivi. È pertanto essenziale che i repertori di dati sulle negoziazioni siano in grado di individuare con precisione le controparti e le operazioni in questione. L'accesso fornito dai repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbe comprendere l'accesso alle informazioni sulle SFT concluse da una controparte, a prescindere dal fatto che la controparte sia l'impresa madre o una filiazione di un'altra impresa, o che le informazioni riguardino le operazioni concluse da una particolare succursale di una controparte, a condizione che l'accesso richiesto riguardi informazioni necessarie ai fini dell'assolvimento delle responsabilità e dei mandati dell'entità interessata.
- (2) Molte delle entità elencate all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365 hanno mandati ed esigenze numerosi e diversi. Al fine di evitare che i repertori di dati sulle negoziazioni debbano costantemente verificare sulla base di quale mandato e per quale specifica necessità un'entità richiede l'accesso, e quindi evitare loro oneri amministrativi inutili, è opportuno consentire ai repertori di dati sulle negoziazioni di fornire a ciascuna entità un accesso unico, che dovrebbe coprire i mandati e le esigenze specifiche di ciascuna entità.
- (3) I mandati e le responsabilità dell'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (ESMA) per quanto riguarda i repertori di dati sulle negoziazioni sono stabiliti dagli articoli da 5 a 11 del regolamento (UE) 2015/2365 e riguardano, tra l'altro, la registrazione e la vigilanza dei repertori. Una vigilanza efficace presuppone che l'ESMA abbia pieno accesso a tutte le informazioni su tutte le STF registrate in tutti i repertori di dati sulle negoziazioni.
- (4) L'Autorità bancaria europea (ABE), l'Autorità europea delle assicurazioni e delle pensioni aziendali e professionali (EIOPA) e il Comitato europeo per il rischio sistemico (CERS) fanno parte del Sistema europeo di vigilanza finanziaria e hanno, in materia di stabilità finanziaria e rischio sistemico, mandati e responsabilità molto simili a quelli dell'ESMA. È pertanto importante che queste autorità abbiano, come l'ESMA, accesso a tutte le informazioni su tutte le SFT.
- (5) In ragione dello stretto legame tra le SFT e la politica monetaria, i membri del Sistema europeo di banche centrali (SEBC), di cui all'articolo 12, paragrafo 2, lettera f), del regolamento (UE) 2015/2365, dovrebbero avere accesso a tutte le informazioni sulle SFT relative alla valuta da essi emessa e, più specificamente, a tutte le informazioni sulle SFT per le quali il prestito o la garanzia reale sono espressi nella valuta da essi emessa.
- (6) Alcune delle entità di cui all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365 sono responsabili della sorveglianza dei rischi sistemici per la stabilità finanziaria. Il corretto svolgimento dei loro compiti correlati alla stabilità del sistema finanziario richiede che tali entità abbiano accesso alla più ampia gamma di partecipanti al mercato e di sedi di negoziazione e a informazioni quanto più possibile complete e granulari delle SFT disponibili per i rispettivi ambiti di responsabilità, che possono essere, a seconda dell'entità in questione, uno Stato membro, la zona euro o l'Unione.

<sup>(1)</sup> GUL 337 del 23.12.2015, pag. 1.

- (7) Il regolamento (UE) n. 1024/2013 del Consiglio <sup>(2)</sup> ha istituito il meccanismo di vigilanza unico. I repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero assicurare che la Banca centrale europea (BCE) abbia accesso alle informazioni su tutte le SFT concluse da controparti soggette, nell'ambito del meccanismo di vigilanza unico, alla vigilanza della BCE a norma del regolamento (UE) n. 1024/2013.
- (8) Il mandato e le specifiche esigenze delle autorità degli strumenti finanziari e dei mercati dell'Unione, di cui all'articolo 12, paragrafo 2, lettera i), del regolamento (UE) 2015/2365, impongono che tali autorità abbiano accesso a tutte le informazioni sulle SFT rappresentative di operazioni o relative a mercati, titoli dati o presi in prestito o forniti come garanzia reale, parametri usati come riferimento e controparti che rientrano nell'ambito delle responsabilità e dei mandati di vigilanza di tali autorità.
- (9) Conformemente alla direttiva 2014/59/UE del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(3)</sup>, le autorità di risoluzione devono disporre di mezzi di intervento efficaci nei confronti delle entità di cui all'articolo 1, paragrafo 1, della stessa direttiva al fine di evitare il contagio. Ciascuna autorità di risoluzione dovrebbe pertanto avere accesso alle informazioni sulle SFT segnalate da tali entità.
- (10) A norma del regolamento (UE) n. 806/2014 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(4)</sup>, il Comitato di risoluzione unico è responsabile del funzionamento efficace e coerente del meccanismo di risoluzione unico, tra l'altro mediante l'elaborazione di piani di risoluzione per le entità di cui all'articolo 2 del medesimo regolamento. Per consentire al Comitato di risoluzione unico di elaborare tali piani di risoluzione, i repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero fornire al Comitato l'accesso alle informazioni sulle SFT concluse dalle controparti che rientrano nell'ambito di applicazione del regolamento (UE) n. 806/2014.
- (11) Le autorità di cui all'articolo 12, paragrafo 2, lettera m), del regolamento (UE) 2015/2365 comprendono, tra l'altro, le autorità competenti per il meccanismo di vigilanza unico e per la vigilanza prudenziale di enti creditizi, imprese di investimento, imprese di assicurazione e riassicurazione, OICVM, GEFIA, fondi pensionistici aziendali e professionali, depositari centrali di titoli e controparti non finanziarie. Per consentire a dette autorità di esercitare le loro responsabilità e i loro mandati in maniera efficace, esse devono avere accesso alle informazioni sulle SFT segnalate dalle controparti che ricadono sotto la loro responsabilità.
- (12) Le autorità di cui all'articolo 12, paragrafo 2, lettera m), del regolamento (UE) 2015/2365 comprendono, tra l'altro, le autorità responsabili dell'autorizzazione e della vigilanza delle controparti centrali. Per consentire a tali autorità di espletare i loro compiti in modo efficace, esse dovrebbero avere accesso alle informazioni sulle SFT relative alle controparti centrali soggette alla loro vigilanza.
- (13) Al fine di garantire la standardizzazione e la coerenza dell'accesso alle informazioni sulle SFT e ridurre l'onere amministrativo sia per le autorità che hanno accesso a tali informazioni sia per i repertori di dati sulle negoziazioni che le detengono, i repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero seguire una procedura specifica per stabilire i termini e le condizioni in base ai quali l'accesso sarà fornito, e più specificamente per quanto riguarda la predisposizione dell'accesso e le disposizioni operative permanenti.
- (14) Per assicurare la riservatezza delle informazioni sulle SFT, qualsiasi tipo di scambio di dati tra repertori di dati sulle negoziazioni e autorità interessate dovrebbe essere effettuato tramite una connessione macchina a macchina (*machine-to-machine*) sicura e utilizzando protocolli di cifratura dei dati.

<sup>(2)</sup> Regolamento (UE) n. 1024/2013 del Consiglio, del 15 ottobre 2013, che attribuisce alla Banca centrale europea compiti specifici in merito alle politiche in materia di vigilanza prudenziale degli enti creditizi (GU L 287 del 29.10.2013, pag. 63).

<sup>(3)</sup> Direttiva 2014/59/UE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 15 maggio 2014, che istituisce un quadro di risanamento e risoluzione degli enti creditizi e delle imprese di investimento e che modifica la direttiva 82/891/CEE del Consiglio, e le direttive 2001/24/CE, 2002/47/CE, 2004/25/CE, 2005/56/CE, 2007/36/CE, 2011/35/UE, 2012/30/UE e 2013/36/UE e i regolamenti (UE) n. 1093/2010 e (UE) n. 648/2012, del Parlamento europeo e del Consiglio (GU L 173 del 12.6.2014, pag. 190).

<sup>(4)</sup> Regolamento (UE) n. 806/2014 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 15 luglio 2014, che fissa norme e una procedura uniformi per la risoluzione degli enti creditizi e di talune imprese di investimento nel quadro del meccanismo di risoluzione unico e del Fondo di risoluzione unico e che modifica il regolamento (UE) n. 1093/2010 (GU L 225 del 30.7.2014, pag. 1).

- (15) Per permettere il confronto e l'aggregazione efficaci ed efficienti delle informazioni sulle SFT tra repertori di dati, per fornire l'accesso alle informazioni e per la comunicazione tra le autorità e i repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero essere usati modelli in formato XML e messaggi XML sviluppati secondo la metodologia ISO 20022.
- (16) Per consentire alle autorità di cui all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365 di effettuare indagini mirate, è indispensabile facilitare l'accesso diretto e immediato a dataset specifici e stabilire così una serie di domande ad hoc combinabili in riferimento alle controparti dell'SFT, al tipo di SFT, all'orizzonte temporale dell'esecuzione, alla scadenza e alla cessazione dell'SFT, nonché alla fase del ciclo di vita dell'SFT.
- (17) Per consentire l'accesso diretto e immediato alle informazioni sulle SFT e facilitare per le autorità interessate e i repertori di dati sulle negoziazioni la programmazione dei loro processi interni sui dati, i termini entro cui i repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero fornire alle autorità l'accesso alle informazioni sulle SFT dovrebbero essere armonizzati.
- (18) Il presente regolamento si basa sui progetti di norme tecniche di regolamentazione trasmessi dall'ESMA alla Commissione conformemente alla procedura di cui all'articolo 10 del regolamento (UE) n. 1095/2010 <sup>(5)</sup>.
- (19) L'ESMA ha effettuato consultazioni pubbliche aperte sui 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 degli strumenti finanziari e dei mercati istituito dall'articolo 37 del regolamento (UE) n. 1095/2010,

HA ADOTTATO IL PRESENTE REGOLAMENTO:

#### Articolo 1

### Informazioni sulle SFT da rendere accessibili

Il repertorio di dati sulle negoziazioni provvede affinché le informazioni sulle SFT rese accessibili a ciascuna delle entità di cui all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365 a norma dell'articolo 3 comprendano i dati seguenti:

- a) le segnalazioni sulle SFT effettuate in conformità delle tabelle da 1 a 4 dell'allegato del regolamento delegato (UE) 2019/356 della Commissione <sup>(6)</sup>, compresa la situazione di negoziazione più recente delle SFT che non sono scadute o che non sono state oggetto di segnalazione con tipi di azione «Errore», «Cessazione/Cessazione anticipata», «Componente di posizione» di cui al campo 98 della tabella 2 dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2019/363 della Commissione <sup>(7)</sup>;
- b) le informazioni pertinenti relative alle segnalazioni sulle SFT respinte dal repertorio di dati sulle negoziazioni, comprese le segnalazioni sulle SFT respinte durante il precedente giorno lavorativo e i motivi del rigetto, conformemente alla tabella 2 dell'allegato I del regolamento delegato (UE) 2019/358 della Commissione <sup>(8)</sup>;

<sup>(5)</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).

<sup>(6)</sup> Regolamento delegato (UE) 2019/356 della Commissione, del 13 dicembre 2018, che integra il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione che precisano le informazioni sulle operazioni di finanziamento tramite titoli da segnalare ai repertori di dati sulle negoziazioni (Cfr. pag. 1 della presente Gazzetta ufficiale).

<sup>(7)</sup> Regolamento di esecuzione (UE) 2019/363 della Commissione, del 13 dicembre 2018, che stabilisce norme tecniche di attuazione per quanto riguarda il formato e la frequenza delle segnalazioni delle informazioni sulle operazioni di finanziamento tramite titoli (SFT) ai repertori di dati sulle negoziazioni a norma del regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio e che modifica il regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012 della Commissione relativamente all'utilizzo di codici per la segnalazione dei contratti derivati (Cfr. pag. 85 della presente Gazzetta ufficiale).

<sup>(8)</sup> Regolamento delegato (UE) 2019/358 della Commissione, del 13 dicembre 2018, che integra il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione per la raccolta, verifica, aggregazione, comparazione e pubblicazione dei dati sulle operazioni di finanziamento tramite titoli (SFT) da parte dei repertori di dati sulle negoziazioni (Cfr. pag. 30 della presente Gazzetta ufficiale).

- c) lo stato di riconciliazione di tutte le SFT segnalate per le quali il repertorio di dati sulle negoziazioni ha svolto il processo di riconciliazione in conformità del regolamento delegato (UE) 2019/358, ad eccezione delle SFT scadute o per le quali sono state ricevute segnalazioni con tipi di azione «Errore», «Cessazione/Cessazione anticipata» o «Componente di posizione» oltre un mese prima della data in cui avviene il processo di riconciliazione.

#### Articolo 2

##### **Accesso unico**

Il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce alle entità di cui all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365 che hanno responsabilità o mandati diversi un accesso unico alle informazioni su tutte le SFT che ricadono nell'ambito delle responsabilità e dei mandati.

#### Articolo 3

##### **Accesso alle informazioni sulle SFT conformemente al mandato e alle specifiche esigenze di ciascuna autorità interessata**

1. Il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce all'ESMA l'accesso a tutte le informazioni su tutte le SFT ai fini dell'esercizio delle sue competenze di vigilanza conformemente alle sue responsabilità e ai suoi mandati.
2. Il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce all'ABE, all'EIOPA e al CERS l'accesso a tutte le informazioni su tutte le SFT.
3. Il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce alle autorità che esercitano la vigilanza sulle sedi di negoziazione l'accesso alle informazioni su tutte le SFT eseguite in tali sedi.
4. Il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce ai membri del SEBC il cui Stato membro ha come valuta l'euro e alla BCE l'accesso alle informazioni su tutte le SFT:
  - a) quando i titoli dati o presi in prestito o forniti come garanzia reale sono stati emessi o offerti a nome di un'entità stabilita in uno Stato membro la cui moneta è l'euro;
  - b) quando i titoli dati o presi in prestito o forniti come garanzia reale sono titoli di debito sovrano di uno Stato membro la cui valuta è l'euro;
  - c) quando la valuta data o presa in prestito o fornita come garanzia reale è l'euro.
5. Il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce ai membri del SEBC il cui Stato membro non abbia come valuta l'euro l'accesso alle informazioni su tutte le SFT:
  - a) quando i titoli dati o presi in prestito o forniti come garanzia reale sono stati emessi da od offerti per conto di un'entità stabilita nello Stato membro del membro del SEBC;
  - b) quando i titoli dati o presi in prestito o forniti come garanzia reale sono titoli di debito sovrano dello Stato membro del membro del SEBC;
  - c) quando la valuta data o presa in prestito o fornita come garanzia reale è la valuta emessa dal membro del SEBC.
6. Il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce alle autorità di cui all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365, incaricate della sorveglianza dei rischi sistemici per la stabilità finanziaria nella zona euro, l'accesso alle informazioni su tutte le SFT concluse in sedi di negoziazione o da controparti che rientrano nell'ambito delle responsabilità e dei mandati di tale autorità ai fini della sorveglianza dei rischi sistemici per la stabilità finanziaria della zona euro. Il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce inoltre a tali autorità l'accesso alle informazioni sulle SFT di tutte le succursali delle controparti stabilite in un paese terzo che operano in uno Stato membro la cui valuta è l'euro.

7. Il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce alle autorità di cui all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365, incaricate della sorveglianza dei rischi sistemici per la stabilità finanziaria e il cui Stato membro non ha come valuta l'euro, l'accesso alle informazioni su tutte le SFT concluse in sedi di negoziazione o da controparti che rientrano nell'ambito delle responsabilità e dei mandati di tali autorità ai fini della sorveglianza dei rischi sistemici per la stabilità finanziaria in uno Stato membro la cui valuta non è l'euro. Il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce inoltre a dette autorità l'accesso alle informazioni su tutte le SFT di tutte le succursali delle controparti stabilite in un paese terzo che operano nello Stato membro dell'autorità interessata.

8. Il repertorio di dati fornisce alla BCE, nello svolgimento dei compiti che le sono assegnati nell'ambito del meccanismo di vigilanza unico ai sensi del regolamento (UE) n. 1024/2013, l'accesso alle informazioni su tutte le SFT concluse da tutte le controparti che, nell'ambito del meccanismo di vigilanza unico, sono soggette alla vigilanza della BCE a norma del regolamento (UE) n. 1024/2013.

9. Il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce all'autorità di un paese terzo rispetto a cui è stato adottato un atto di esecuzione a norma dell'articolo 19, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2015/2365 l'accesso alle informazioni su tutte le SFT che rientrano nell'ambito del mandato e delle responsabilità dell'autorità del paese terzo, in linea con le disposizioni dell'atto di esecuzione.

10. Il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce all'autorità designata a norma dell'articolo 4 della direttiva 2004/25/CE del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(9)</sup> l'accesso alle informazioni su tutte le SFT per le quali i titoli dati o presi in prestito o forniti come garanzia reale sono titoli emessi da una società che soddisfa una o più delle seguenti condizioni:

- a) la società è ammessa alla negoziazione in un mercato regolamentato stabilito nello Stato membro dell'autorità e le offerte pubbliche di acquisto dei titoli della società rientrano nell'ambito delle responsabilità e dei mandati dell'autorità;
- b) la società ha la sede legale o la sede principale nello Stato membro dell'autorità e le offerte pubbliche di acquisto dei titoli della società rientrano nell'ambito delle responsabilità e dei mandati dell'autorità;
- c) la società è un offerente, ai sensi dell'articolo 2, paragrafo 1, lettera c), della direttiva 2004/25/CE, per le società di cui alle lettere a) o b), e il corrispettivo da essa offerto include titoli.

11. Il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce alle autorità di cui all'articolo 12, paragrafo 2, lettera i), del regolamento (UE) 2015/2365 l'accesso alle informazioni su tutte le SFT rappresentative di operazioni o relative a mercati, titoli dati o presi in prestito o forniti come garanzia reale, parametri usati come riferimento e controparti che rientrano nell'ambito delle responsabilità e dei mandati di tali autorità. Il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce inoltre a dette autorità l'accesso alle informazioni sulle SFT di tutte le succursali delle controparti stabilite in un paese terzo che operano nello Stato membro delle autorità.

12. Il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce all'Agenzia per la cooperazione fra i regolatori nazionali dell'energia (ACER) l'accesso alle informazioni su tutte le SFT in cui la merce data o presa in prestito o fornita come garanzia reale è l'energia.

13. Il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce alle autorità di risoluzione di cui all'articolo 12, paragrafo 2, lettera k), del regolamento (UE) 2015/2365 l'accesso alle informazioni su tutte le SFT concluse da:

- a) una controparte che rientra nell'ambito delle responsabilità e dei mandati di dette autorità;
- b) una succursale di una controparte stabilita in un paese terzo che opera nello Stato membro delle autorità di risoluzione e rientra nell'ambito delle loro responsabilità e dei loro mandati.

14. Il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce al Comitato di risoluzione unico l'accesso alle informazioni su tutte le SFT concluse da controparti che rientrano nell'ambito di applicazione del regolamento (UE) n. 806/2014.

<sup>(9)</sup> Direttiva 2004/25/CE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 21 aprile 2004, concernente le offerte pubbliche di acquisto (GUL 142 del 30.4.2004, pag. 12).

15. Il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce alle autorità di risoluzione di cui all'articolo 12, paragrafo 2, lettera m), del regolamento (UE) 2015/2365 l'accesso alle informazioni su tutte le SFT concluse da:

- a) una controparte che rientra nell'ambito delle responsabilità e dei mandati di dette autorità;
- b) una succursale di una controparte stabilita in un paese terzo che opera nello Stato membro delle autorità di risoluzione e che rientra nell'ambito delle loro responsabilità e dei loro mandati.

16. Il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce alle autorità che vigilano su una controparte centrale e al membro del SEBC che vigila su detta controparte centrale l'accesso alle informazioni su tutte le SFT compensate o concluse dalla controparte centrale.

#### Articolo 4

### Predisposizione dell'accesso alle informazioni sulle SFT

1. Il repertorio di dati sulle negoziazioni:

- a) designa una persona o le persone responsabili del collegamento con le entità di cui all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365;
- b) pubblica sul suo sito web le istruzioni che le entità di cui all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365 devono seguire per accedere alle informazioni sulle SFT;
- c) fornisce alle entità di cui all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365 il modulo di cui al paragrafo 2;
- d) predispone l'accesso alle informazioni sulle SFT da parte delle entità di cui all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365 unicamente sulla base delle informazioni contenute nel modulo fornito;
- e) predispone le disposizioni tecniche necessarie affinché le entità di cui all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365 possano accedere alle informazioni sulle SFT conformemente all'articolo 5;
- f) fornisce alle entità di cui all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365 l'accesso diretto e immediato alle informazioni delle SFT entro trenta giorni di calendario dalla presentazione da parte dell'entità della richiesta di predisposizione di tale accesso.

2. Il repertorio di dati sulle negoziazioni prepara il modulo che le entità di cui all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365 sono tenute ad utilizzare per presentare la richiesta di predisposizione dell'accesso alle informazioni sulle SFT. Il modulo contiene i seguenti elementi:

- a) il nome dell'entità;
- b) la persona di contatto presso l'entità;
- c) le responsabilità e i mandati giuridici dell'entità;
- d) l'elenco degli utilizzatori autorizzati delle informazioni richieste sulle SFT;
- e) le credenziali per la connessione SSH FTP sicura;
- f) ogni altra informazione tecnica pertinente ai fini dell'accesso dell'entità alle informazioni sulle SFT;
- g) se l'entità è competente per le controparti nel suo Stato membro, nella zona euro o nell'Unione;
- h) i tipi di controparti per le quali l'entità è competente secondo la classificazione di cui alla tabella 1 dell'allegato I al regolamento di esecuzione (UE) 2019/363;
- i) i tipi di SFT soggette alla vigilanza dell'entità;
- j) tutti gli Stati membri in cui l'emittente dei titoli dati o presi in prestito o forniti come garanzia reale è soggetto alla vigilanza dell'entità, se del caso;
- k) tutti gli Stati membri in cui le merci date o prese in prestito o fornite come garanzia reale sono soggette alla vigilanza dell'entità;

- l) le sedi di negoziazione soggette alla vigilanza dell'entità, se del caso;
- m) le controparti centrali soggette alla vigilanza o alla sorveglianza dall'entità, se del caso;
- n) la valuta emessa dall'entità, se del caso;
- o) i parametri di riferimento utilizzati nell'Unione, il cui amministratore rientra nell'ambito della vigilanza dell'entità, se del caso.

#### Articolo 5

#### **Modalità operative per l'accesso alle informazioni sulle SFT**

1. Il repertorio di dati sulle negoziazioni stabilisce e mantiene le disposizioni tecniche necessarie per consentire alle entità di cui all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365 di collegarsi al repertorio di dati sulle negoziazioni avvalendosi di un'interfaccia macchina a macchina sicura.

Ai fini del primo comma, per comunicare mediante tale interfaccia, il repertorio di dati sulle negoziazioni utilizza il protocollo di trasferimento dei file SSH e i messaggi XML standardizzati sviluppati conformemente alla metodologia ISO 20022.

2. Il repertorio di dati sulle negoziazioni stabilisce e mantiene le disposizioni tecniche necessarie per consentire alle entità di cui all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365 di predisporre, conformemente agli articoli 1, 2 e 3, richieste periodiche predefinite di accesso alle informazioni sulle SFT di cui hanno bisogno per assolvere le responsabilità e i mandati rispettivi.

3. Su richiesta, il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce alle entità di cui all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365 l'accesso a tutte le SFT che rientrano nell'ambito delle loro responsabilità e dei loro mandati in conformità dell'articolo 3, sulla base di qualsiasi combinazione dei seguenti campi di cui all'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2019/363:

- a) data e ora della segnalazione;
- b) controparte segnalante;
- c) altre controparti;
- d) succursale della controparte segnalante;
- e) succursale dell'altra controparte;
- f) settore della controparte segnalante;
- g) natura della controparte segnalante;
- h) intermediario;
- i) entità segnalante;
- j) beneficiario;
- k) tipo di SFT;
- l) tipo di componente della garanzia;
- m) sede di negoziazione;
- n) data e ora di esecuzione;
- o) data di scadenza;
- p) data di cessazione;
- q) controparte centrale;
- r) tipo di azione.

4. Il repertorio di dati sulle negoziazioni stabilisce e mantiene le capacità tecniche per dare accesso diretto e immediato alle informazioni sulle SFT necessarie alle entità di cui all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365 per assolvere le responsabilità e i mandati rispettivi. L'accesso alle informazioni sulle SFT è fornito secondo i seguenti termini:

- a) se è richiesto l'accesso alle informazioni su SFT in essere o su SFT che sono scadute o che sono state oggetto di segnalazione con tipi di azione «Errore», «Cessazione/Cessazione anticipata» o «Componente di posizione» di cui al campo 98 della tabella 2 dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2019/363 non più di un anno prima della data di presentazione della richiesta: entro le 12:00 UTC il primo giorno lavorativo successivo al giorno in cui è stata presentata la richiesta di accesso;

- b) se è richiesto l'accesso alle informazioni su SFT che sono scadute o che sono state oggetto di segnalazione con tipi di azione «Errore», «Cessazione/Cessazione anticipata» o «Componente di posizione» di cui al campo 98 della tabella 2 dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2019/363 più di un anno prima della data di presentazione della richiesta: entro tre giorni lavorativi dalla presentazione della richiesta di accesso;
- c) se è richiesto l'accesso alle informazioni su SFT rientranti in entrambe le lettere a) e b): entro tre giorni lavorativi dalla presentazione della richiesta di accesso.
5. Il repertorio di dati sulle negoziazioni conferma il ricevimento e verifica la correttezza e la completezza di tutte le richieste di accesso alle informazioni sulle SFT trasmesse dalle entità di cui all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365 e comunica a tali entità il risultato della verifica entro sessanta minuti dalla presentazione della richiesta.
6. Il repertorio di dati sulle negoziazioni usa protocolli di firma elettronica e di cifratura dei dati per garantire la riservatezza, l'integrità e la protezione dei dati messi a disposizione delle entità di cui all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365.

#### *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 13 dicembre 2018

*Per la Commissione*

*Il presidente*

Jean-Claude JUNCKER

---

**REGOLAMENTO DELEGATO (UE) 2019/358 DELLA COMMISSIONE****del 13 dicembre 2018****che integra il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione per la raccolta, verifica, aggregazione, comparazione e pubblicazione dei dati sulle operazioni di finanziamento tramite titoli (SFT) da parte dei repertori di dati sulle negoziazioni****(Testo rilevante ai fini del SEE)**

LA COMMISSIONE EUROPEA,

visto il trattato sul funzionamento dell'Unione europea,

visto il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 25 novembre 2015, sulla trasparenza delle operazioni di finanziamento tramite titoli e del riutilizzo e che modifica il regolamento (UE) n. 648/2012 <sup>(1)</sup>, in particolare l'articolo 5, paragrafo 7, lettera a), e l'articolo 12, paragrafo 3, lettera a) e b),

considerando quanto segue:

- (1) Per garantire la qualità delle informazioni sulle SFT segnalate loro, i repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero verificare l'identità delle entità che trasmettono le segnalazioni, l'integrità logica dell'ordine in cui le informazioni sulle SFT sono segnalate e la completezza e la correttezza di tali informazioni.
- (2) Per lo stesso motivo, i repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero riconciliare le informazioni contenute nelle singole segnalazioni di SFT ricevute. È opportuno precisare una procedura standardizzata per consentire ai repertori di riconciliare i dati in modo coerente e per ridurre il rischio di mancata riconciliazione di alcune informazioni sulle SFT. Tuttavia, è possibile che certe informazioni sulle SFT non siano identiche a causa delle specificità dei sistemi tecnologici usati dalle entità che trasmettono le segnalazioni. Occorre pertanto applicare alcune tolleranze per evitare che divergenze minori nelle informazioni segnalate sulle SFT impediscano alle autorità di analizzare i dati con una certa sicurezza.
- (3) Si prevede che le entità che trasmettono le segnalazioni possano migliorare col tempo le segnalazioni, sia in termini di riduzione del numero di rifiuti che in termini di riconciliazioni. Dovrebbero, tuttavia, disporre di tempo sufficiente per adeguarsi agli obblighi di segnalazione, in particolare per impedire l'accumulo di negoziazioni non riconciliate immediatamente dopo l'entrata in vigore dell'obbligo di segnalazione. È pertanto opportuno che in un primo tempo debba essere riconciliato solo un numero limitato di campi.
- (4) Le entità che trasmettono le segnalazioni e, se del caso, quelle responsabili delle segnalazioni dovrebbero essere in grado di monitorare il rispetto dei propri obblighi di segnalazione di cui al regolamento (UE) 2015/2365. Dovrebbero pertanto avere la possibilità di accedere a determinate informazioni, su base giornaliera, in relazione a tali segnalazioni, incluso l'esito della verifica delle segnalazioni, e all'andamento della riconciliazione dei dati segnalati. È pertanto necessario specificare le informazioni che il repertorio di dati sulle negoziazioni dovrebbe mettere a disposizione di tali entità al termine di ogni giornata lavorativa.
- (5) Per facilitare l'integrità delle informazioni sulle SFT, l'accesso diretto e immediato di cui all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365 dovrebbe essere fornito in modo armonizzato e coerente. Per standardizzare il processo di segnalazione, ridurre al minimo i costi per il settore finanziario e garantire la comparabilità e la coerente aggregazione dei dati tra i repertori, è opportuno che tutte le segnalazioni e tutti gli scambi avvengano in formato XML e seguano una metodologia ampiamente utilizzata nel settore.
- (6) L'accesso ai dati a livello di posizione sulle esposizioni tra due determinate controparti è fondamentale per consentire alle entità di cui all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365 di determinare le potenziali fonti di rischi sistemici o non sistemici per la stabilità finanziaria.
- (7) Per offrire un adeguato livello di trasparenza in merito alle SFT, i criteri utilizzati per l'aggregazione delle posizioni dovrebbero consentire al grande pubblico di comprendere il funzionamento dei mercati delle SFT, senza

<sup>(1)</sup> GUL 337 del 23.12.2015, pag. 1.

compromettere la riservatezza dei dati segnalati ai repertori di dati sulle negoziazioni. La frequenza e i dettagli della pubblicazione da parte di un repertorio delle posizioni aggregate a norma dell'articolo 12, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2015/2365 andrebbero specificati rifacendosi al collegato quadro previsto dal regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(2)</sup> per i contratti derivati.

- (8) Il presente regolamento si basa sui progetti di norme tecniche di regolamentazione che l'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (ESMA) ha presentato alla Commissione conformemente alla procedura di cui all'articolo 10 del regolamento (UE) n. 1095/2010 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(3)</sup>.
- (9) Le disposizioni del presente regolamento riguardano gli standard operativi per la raccolta, aggregazione e comparazione dei dati da parte dei repertori di dati sulle negoziazioni e le procedure che i repertori devono applicare per verificare la completezza e la correttezza delle informazioni sulle SFT loro segnalate. Per garantire la coerenza tra tali disposizioni e per offrire una visione globale ai repertori di dati sulle negoziazioni, è opportuno inserire le relative norme tecniche di regolamentazione in un unico regolamento.
- (10) L'ESMA ha condotto 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 degli strumenti finanziari e dei mercati istituito dall'articolo 37 del regolamento (UE) n. 1095/2010,

HA ADOTTATO IL PRESENTE REGOLAMENTO:

#### Articolo 1

### Verifica delle segnalazioni delle SFT da parte dei repertori di dati sulle negoziazioni

1. Quando riceve una segnalazione di SFT, il repertorio di dati sulle negoziazioni verifica quanto segue:
- a) l'identità dell'entità che trasmette la segnalazione, quale indicata nella tabella 1, campo 2, dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2019/363 della Commissione <sup>(4)</sup>;
  - b) che il modello XML utilizzato per segnalare l'SFT sia conforme alla metodologia ISO 20022, in linea con il regolamento di esecuzione (UE) 2019/363 della Commissione;
  - c) che l'entità che trasmette la segnalazione, se diversa dalla controparte segnalante indicata nella tabella 1, campo 3, dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2019/363 della Commissione, sia debitamente autorizzata ad effettuare la segnalazione per conto della controparte segnalante, tranne nel caso di cui all'articolo 4, paragrafo 3, del regolamento (UE) 2015/2365;
  - d) che la stessa segnalazione di SFT non sia stata presentata in precedenza;
  - e) che la segnalazione di SFT con tipo di azione «Modifica» si riferisca a una segnalazione presentata in precedenza;
  - f) che la segnalazione di SFT con tipo di azione «Modifica» non si riferisca a un'SFT segnalata come annullata;
  - g) che la segnalazione di SFT non includa un tipo di azione «Nuova» con riferimento a un'SFT già segnalata;
  - h) che la segnalazione di SFT non includa un tipo di azione «Componente posizione» con riferimento a un'SFT già segnalata;

<sup>(2)</sup> 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 (GU L 201 del 27.7.2012, pag. 1).

<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).

<sup>(4)</sup> Regolamento di esecuzione (UE) 2019/363 della Commissione, del 13 dicembre 2018, che stabilisce norme tecniche di attuazione per quanto riguarda il formato e la frequenza delle segnalazioni delle informazioni sulle operazioni di finanziamento tramite titoli (SFT) ai repertori di dati sulle negoziazioni a norma del regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio e che modifica il regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012 della Commissione relativamente all'utilizzo di codici per la segnalazione dei contratti derivati (Cfr. pag. 85 della presente Gazzetta ufficiale).

- i) che la segnalazione di SFT non intenda modificare le informazioni dell'entità che trasmette la segnalazione, della controparte segnalante o dell'altra controparte in un'SFT segnalata in precedenza;
- j) che la segnalazione di SFT non intenda modificare una segnalazione esistente indicando una data di valuta successiva alla data di scadenza dell'SFT segnalata;
- k) la correttezza e la completezza della segnalazione di SFT.

2. Il repertorio di dati sulle negoziazioni verifica se le informazioni sulle garanzie reali sono state indicate nella tabella 2, campi da 73 a 96, dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2019/363 della Commissione in relazione alle SFT per cui il campo 72 «Contrassegno Prestito titoli non garantito» della medesima tabella è segnalato come «falso». Il repertorio notifica l'esito della verifica, in conformità all'articolo 3, all'entità che trasmette la segnalazione, alla controparte segnalante e, se del caso, all'entità responsabile della segnalazione.

3. Se la segnalazione di SFT non rispetta i requisiti di cui al paragrafo 1, il repertorio di dati sulle negoziazioni la rifiuta, assegnandola a una delle rispettive categorie di cui alla tabella 2 dell'allegato I.

4. Entro sessanta minuti dal ricevimento della segnalazione di SFT, il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce all'entità che trasmette la segnalazione, alla controparte segnalante, e, se del caso, all'entità responsabile della segnalazione informazioni dettagliate sui risultati della verifica dei dati di cui al paragrafo 1. Il repertorio trasmette tali risultati in formato XML utilizzando un modello elaborato secondo la metodologia ISO 20022. I risultati comprendono, ove necessario, i motivi specifici del rifiuto della segnalazione di SFT conformemente al paragrafo 3.

## Articolo 2

### Riconciliazione dei dati da parte dei repertori di dati sulle negoziazioni

1. Il repertorio di dati sulle negoziazioni si adopera a riconciliare l'SFT segnalata seguendo l'iter indicato al paragrafo 2, a condizione che siano soddisfatte tutte le seguenti condizioni:

- a) il repertorio ha completato le verifiche di cui all'articolo 1, paragrafi 1 e 2;
- b) entrambe le controparti dell'SFT segnalata hanno l'obbligo di segnalazione;
- c) il repertorio non ha ricevuto per l'SFT segnalata una segnalazione successiva con il tipo di azione «Errore».

2. Se tutte le condizioni di cui al paragrafo 1 sono soddisfatte, il repertorio di dati sulle negoziazioni segue il seguente iter utilizzando l'ultimo valore segnalato per ciascun campo della tabella 1 dell'allegato I:

- a) il repertorio che ha ricevuto la segnalazione di un'SFT verifica se ha ricevuto una segnalazione corrispondente da o per conto dell'altra controparte;
- b) se non ha ricevuto la segnalazione corrispondente di cui alla lettera a), il repertorio si adopera per identificare il repertorio che l'ha ricevuta comunicando a tutti i repertori registrati i valori dei seguenti campi dell'SFT segnalata: «Identificativo unico dell'operazione (UTI)», «Controparte segnalante», «Altra controparte» e «Tipo di accordo quadro»;
- c) il repertorio che accerta che un altro repertorio ha ricevuto la segnalazione corrispondente di cui alla lettera a) scambia con esso le informazioni dell'SFT segnalata in formato XML, utilizzando un modello elaborato secondo la metodologia ISO 20022;
- d) fatta salva la lettera e), il repertorio considera riconciliata l'SFT segnalata se le informazioni dell'SFT trovano riscontro in n quelle della segnalazione corrispondente di cui alla lettera a);
- e) il repertorio si adopera a combinare separatamente i campi con i dati sui prestiti e i campi con i dati sulle garanzie reali dell'SFT segnalata osservando i limiti di tolleranza e le rispettive date di applicazione di cui alla tabella 1 dell'allegato I;

- f) per ogni SFT segnalata il repertorio assegna quindi valori alle categorie di riconciliazione della tabella 3 dell'allegato I;
  - g) il repertorio conclude le fasi di cui alle lettere da a) a f) quanto prima e non le intraprende dopo le ore 18.00 del tempo universale coordinato (UCT) di un giorno lavorativo;
  - h) il repertorio che non riesce a riconciliare l'SFT segnalata si adopera a combinarne le informazioni il giorno lavorativo successivo. Il repertorio cessa di adoperarsi per riconciliare l'SFT segnalata trenta giorni di calendario dopo la relativa scadenza segnalata oppure quando ha ricevuto al riguardo una segnalazione con tipo di azione «Chiusura» o «Componente posizione».
3. Al termine di ogni giorno lavorativo il repertorio di dati sulle negoziazioni conferma il numero totale di SFT segnalate oggetto di riconciliazione con ciascun repertorio con cui ha riconciliato SFT segnalate.
4. Entro sessanta minuti dalla conclusione del processo di riconciliazione di cui al paragrafo 2, lettera g), il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce all'entità che trasmette la segnalazione, alla controparte segnalante e, se del caso, all'entità responsabile della segnalazione i risultati del processo di riconciliazione che ha eseguito sulle SFT segnalate. Il repertorio trasmette tali risultati in formato XML utilizzando un modello elaborato secondo la metodologia ISO 20022, in cui inserisce informazioni sui campi che non sono stati oggetto di riconciliazione.

### Articolo 3

#### **Meccanismi di risposta a fine giornata**

Entro la fine di ogni giornata lavorativa il repertorio di dati sulle negoziazioni mette a disposizione dell'entità che trasmette la segnalazione, della controparte segnalante, e, se del caso, dell'entità responsabile della segnalazione le seguenti informazioni sulle pertinenti SFT, in formato XML utilizzando un modello elaborato secondo la metodologia ISO 20022:

- a) le SFT segnalate nel corso della giornata;
- b) la situazione più recente delle SFT non giunte a scadenza o non segnalate con tipo di azione «Errore», «Chiusura» o «Componente posizione»;
- c) l'identificativo unico dell'operazione (UTI) delle SFT per cui il campo 72 della tabella 2 dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2019/363 della Commissione è segnalato come «falso» e per cui nei campi da 73 a 96 della stessa tabella non sono ancora state segnalate informazioni sulle garanzie reali;
- d) le SFT segnalate che sono state rifiutate nel corso della giornata;
- e) lo stato di riconciliazione di tutte le SFT segnalate, ad eccezione di quelle giunte a scadenza o per le quali oltre un mese prima del giorno lavorativo in questione erano pervenute segnalazioni con tipo di azione «Chiusura» o «Componente posizione».

### Articolo 4

#### **Accesso alle informazioni sulle SFT**

Il repertorio di dati sulle negoziazioni dà alle entità elencate all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365, anche in caso di delega a norma dell'articolo 28 del regolamento (UE) n. 1095/2010, accesso diretto e immediato alle informazioni sulle SFT in forma elettronica informaticamente leggibile conformemente al regolamento delegato (UE) 2019/357 della Commissione <sup>(3)</sup>.

Ai fini del primo comma, il repertorio di dati sulle negoziazioni utilizza il formato XML e un modello elaborato secondo la metodologia ISO 20022.

<sup>(3)</sup> Regolamento delegato (UE) 2019/357 della Commissione, del 13 dicembre 2018, che integra il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione sull'accesso alle informazioni sulle operazioni di finanziamento tramite titoli registrate nei repertori di dati sulle negoziazioni (Cfr. pag. 22 della presente Gazzetta ufficiale).

## Articolo 5

**Calcolo e accesso ai dati a livello di posizione**

1. Il repertorio di dati sulle negoziazioni calcola i dati a livello di posizione sulle esposizioni tra le controparti in termini di prestiti e garanzie reali. Il calcolo dei dati a livello di posizione si basa sui seguenti criteri:
  - a) i valori delle categorie di riconciliazione della tabella 3 dell'allegato I;
  - b) il tipo di SFT;
  - c) il settore delle controparti;
  - d) la situazione in termini di compensazione;
  - e) il fatto che l'SFT sia stata conclusa o meno in una sede di negoziazione;
  - f) il tipo di garanzia reale;
  - g) la valuta della componente contante;
  - h) lo scaglione di scadenza;
  - i) lo scaglione di scarto di garanzia;
  - j) i repertori ai quali l'altra controparte ha segnalato le informazioni sull'SFT.
2. Il repertorio di dati sulle negoziazioni assicura che le entità elencate all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365 abbiano accesso ai dati a livello di posizione conformemente alle modalità di accesso ai dati di cui al regolamento delegato (UE) 2019/357 della Commissione.
3. I dati a livello di posizione di cui al paragrafo 1 sono presentati in forma elettronica e leggibile a macchina, in formato XML utilizzando un modello elaborato secondo la metodologia ISO 20022.
4. L'accesso di cui al paragrafo 2 è dato il più presto possibile e comunque non oltre un giorno lavorativo successivo al ricevimento della segnalazione di SFT ai sensi dell'articolo 4, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2015/2365.
5. Il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce alle entità elencate all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365 l'accesso ai dati a livello aggregato conformemente alle modalità di accesso ai dati di cui al regolamento delegato (UE) 2019/357 della Commissione, calcolati in conformità alle norme e ai processi convenuti di comune accordo per la raccolta e l'aggregazione globale dei dati sulle SFT.

## Articolo 6

**Calcolo dei dati sulle posizioni aggregate da pubblicare**

1. Il repertorio di dati sulle negoziazioni aggrega i dati sulle posizioni secondo i criteri di cui ai paragrafi 2 e 3 per i seguenti valori:
  - a) l'importo del capitale dei contratti di vendita con patto di riacquisto, delle operazioni di *buy-sell back* o di *sell-buy back*, la quantità totale di titoli o merci concessi o assunti in prestito e l'importo dei prestiti su margine;
  - b) il numero dell'identificativo unico dell'operazione (UTI) delle SFT;
  - c) il valore di mercato della garanzia reale.
2. Il repertorio di dati sulle negoziazioni aggrega i dati sulle posizioni per tutte le SFT segnalate con tipo di azione «Nuova» tra il sabato alle ore 00.00.00 UTC e il venerdì alle ore 23.59.59 UTC sulla base dei seguenti criteri e dei rispettivi valori di cui alla tabella 1 dell'allegato II:
  - a) l'ubicazione della controparte segnalante o eventualmente della relativa succursale;
  - b) l'ubicazione dell'altra controparte o eventualmente della relativa succursale;
  - c) il tipo di SFT;
  - d) lo stato di riconciliazione dell'SFT di cui alla tabella 3 dell'allegato I;

- e) il tipo di sede in cui l'SFT è stata conclusa;
  - f) il fatto che l'SFT sia stata sottoposta o meno a compensazione;
  - g) il metodo di trasferimento della garanzia reale;
  - h) ciascun indice utilizzato come riferimento per un'SFT negoziata in una sede di esecuzione diversa da «XXXX», se l'importo nominale aggregato segnalato al repertorio nell'indice è superiore a 5 miliardi di EUR e se almeno sei diverse controparti hanno segnalato le SFT corrispondenti al repertorio.
3. Il repertorio di dati sulle negoziazioni aggrega i dati sulle posizioni per tutte le SFT non giunte a scadenza oppure non segnalate con tipo di azione «Errore», «Chiusura» o «Componente posizione», entro il venerdì alle ore 23.59.59 UTC sulla base dei seguenti criteri e dei rispettivi valori di cui alla tabella 1 dell'allegato II:
- a) l'ubicazione della controparte segnalante o eventualmente della relativa succursale;
  - b) l'ubicazione dell'altra controparte o eventualmente della relativa succursale;
  - c) il tipo di SFT;
  - d) lo stato di riconciliazione dell'SFT di cui alla tabella 3 dell'allegato I;
  - e) il tipo di sede in cui l'SFT è stata conclusa;
  - f) il fatto che l'SFT sia stata sottoposta o meno a compensazione;
  - g) il metodo di trasferimento della garanzia reale;
  - h) ciascun indice utilizzato come riferimento per un'SFT negoziata in una sede di esecuzione diversa da «XXXX», se l'importo nominale aggregato segnalato al repertorio nell'indice è superiore a 5 miliardi di EUR e se almeno sei diverse controparti hanno segnalato le SFT corrispondenti al repertorio.
4. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dispone di una procedura per individuare i valori straordinari nei dati sulle posizioni aggregate.
5. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dispone di una procedura per eseguire e notificare rettifiche dei dati sulle posizioni aggregate, compresi quelle derivanti dalle segnalazioni con tipo di azione «Errore», e per pubblicare le aggregazioni originarie e rettifiche.

#### Articolo 7

### **Pubblicazione dei dati sulle posizioni aggregate**

1. Il repertorio di dati sulle negoziazioni pubblica sul proprio sito Internet i dati sulle posizioni aggregate, calcolati conformemente all'articolo 6, su base settimanale e al più tardi il martedì a mezzogiorno per le SFT segnalate entro le ore 23.59.59 UTC del venerdì precedente.
2. Il repertorio di dati sulle negoziazioni pubblica tutti i dati sulle posizioni aggregate in euro utilizzando i tassi di cambio pubblicati sul sito Internet della BCE il venerdì precedente la pubblicazione di tali dati.
3. Il repertorio di dati sulle negoziazioni assicura che i dati sulle posizioni aggregate siano pubblicati in un formato tabellare di cui all'allegato II che consenta lo scaricamento dei dati.
4. I dati sulle posizioni aggregate pubblicate dal repertorio di dati sulle negoziazioni sul proprio sito Internet rimangono disponibili almeno 104 settimane.

#### Articolo 8

### **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 13 dicembre 2018

*Per la Commissione*

*Il presidente*

Jean-Claude JUNCKER

---

## ALLEGATO I

Tabella 1

**Campi riconciliazione, livelli di tolleranza e data di inizio della fase di conciliazione**

Tabella	Sezione	Campo	Tolleranza	Data di inizio specificata da:
Dati sulla controparte	NA	Controparte segnalante	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sulla controparte	NA	Lato della controparte	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sulla controparte	NA	Altra controparte	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Identificativo unico dell'operazione (UTI)	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Tipo di SFT	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Compensato	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Data e ora della compensazione	Un'ora	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Controparte centrale (CCP)	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Sede di negoziazione	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Tipo di accordo quadro	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Data e ora di esecuzione	Un'ora	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Data di valuta (data di inizio)	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Data di scadenza (data di fine)	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Data di chiusura	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Preavviso minimo	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Prima data di richiamo ( <i>call-back</i> )	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Indicatore delle garanzie generiche ( <i>general collateral</i> )	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi

Tabella	Sezione	Campo	Tolleranza	Data di inizio specificata da:
Dati sull'operazione	Prestito	Indicatore della consegna per valore ( <i>delivery by value, DBV</i> )	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Metodo utilizzato per fornire le garanzie reali	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Scadenza aperta	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Opzione di chiusura	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Tasso fisso	Fino alla terza cifra decimale	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Convenzione sul conteggio dei giorni	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Tasso variabile	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Periodo di riferimento del tasso variabile - periodo	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Periodo di riferimento del tasso variabile - moltiplicatore	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Frequenza di pagamento per il tasso variabile - periodo	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Frequenza di pagamento per il tasso variabile - moltiplicatore	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Frequenza di revisione del tasso variabile - periodo	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Frequenza di revisione del tasso variabile - moltiplicatore	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Differenziale	Fino alla terza cifra decimale	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Importo in valuta delle operazioni di marginazione	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Valuta delle operazioni di marginazione	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365

Tabella	Sezione	Campo	Tolleranza	Data di inizio specificata da:
Dati sull'operazione	Prestito	Tasso rettificato	Fino alla terza cifra decimale	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Data di applicazione del tasso	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Importo del capitale alla data di valuta	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Importo del capitale alla data di scadenza	0,0005 %	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Valuta dell'importo del capitale	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Tipo di attività	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Identificativo del titolo	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Classificazione del titolo	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Categoria di prodotti	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Sottocategoria di prodotti	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Ulteriore sottocategoria di prodotti	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Quantità o importo nominale	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Unità di misura	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Valuta dell'importo nominale	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Prezzo del titolo o della merce	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Valuta del prezzo	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Qualità del titolo	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Scadenza del titolo	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365

Tabella	Sezione	Campo	Tolleranza	Data di inizio specificata da:
Dati sull'operazione	Prestito	Giurisdizione dell'emittente	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	LEI dell'emittente	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Tipo di titolo	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Valore del prestito	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Valore di mercato	0,0005 %	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Tasso di rimborso fisso	Fino alla terza cifra decimale	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Tasso di rimborso variabile	Fino alla terza cifra decimale	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Periodo di riferimento del tasso di rimborso variabile - periodo	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Periodo di riferimento del tasso di rimborso variabile - moltiplicatore	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Frequenza di pagamento per il tasso di rimborso variabile - periodo	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Frequenza di pagamento per il tasso di rimborso variabile - moltiplicatore	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Frequenza di revisione del tasso di rimborso variabile - periodo	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Frequenza di revisione del tasso di rimborso variabile - moltiplicatore	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Differenziale del tasso di rimborso	Fino alla terza cifra decimale	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Commissione sul prestito	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365

Tabella	Sezione	Campo	Tolleranza	Data di inizio specificata da:
Dati sull'operazione	Prestito	Accordi di esclusiva	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Prestito	Prestito su margine in essere	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Valuta di base del prestito su margine in essere	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Valore di mercato dei prestiti a breve scadenza	0,0005 %	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Contrassegno Prestito titoli non garantito	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Copertura dell'esposizione netta	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Data di valuta della garanzia	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Tipo di componente della garanzia	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Importo delle garanzie in contante	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Valuta delle garanzie in contante	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Identificazione di un titolo utilizzato come garanzia	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Classificazione di un titolo utilizzato come garanzia reale	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Categoria di prodotti	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Sottocategoria di prodotti	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Ulteriore sottocategoria di prodotti	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto iv), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Quantità o importo nominale della garanzia	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Unità di misura della garanzia	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi

Tabella	Sezione	Campo	Tolleranza	Data di inizio specificata da:
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Valuta dell'importo nominale della garanzia	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Valuta del prezzo	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Prezzo unitario	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Valore di mercato della garanzia	0,0005 %	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365 + 24 mesi
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Scarto o margine	Fino alla terza cifra decimale	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Qualità della garanzia	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Data di scadenza della garanzia	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Giurisdizione dell'emittente	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	LEI dell'emittente	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Tipo di garanzia	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Possibilità di riutilizzare la garanzia reale	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Garanzia reale	Identificativo del paniere di garanzie reali	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365
Dati sull'operazione	Prestito	Livello	Nessuna	Articolo 33, paragrafo 2, lett. a), punto i), del regolamento (UE) 2015/2365

Tabella 2

**Motivi di rifiuto della segnalazione di SFT**

Categoria di rifiuto	Motivo
Schema	— la SFT è stata rifiutata perché non conforme allo schema
Autorizzazione	— la SFT è stata rifiutata perché l'entità che ha trasmesso la segnalazione non è autorizzata a trasmetterla a nome della controparte segnalante
Logica	— la SFT è stata rifiutata perché il tipo di azione non è a logica corretto
Conformità	— la SFT è stata rifiutata perché non è conforme a una o più norme di convalida

Tabella 3

**Risultati del processo di riconciliazione**

Categoria di riconciliazione	Valori
Tipo di segnalazione	Unilaterale/Bilaterale
Obbligo di segnalazione per entrambe le controparti	Sì/No
Stato di abbinamento	Abbinata/Non abbinata
Stato di riconciliazione del prestito	Riconciliato/Non riconciliato
Stato di riconciliazione della garanzia reale	Riconciliata/Non riconciliata
Ulteriori modifiche	Sì/No

Tabella 1

## Dati pubblici

Tabella A. Aggregazione

Data	Registro	Tipo di aggregazione	Tipo di sede	Ubicazione della controparte segnalante	Ubicazione dell'altra controparte	Riconciliazione	Tipo di SFT	Compensata	Metodo di trasferimento della garanzia	Indice di riferimento <sup>(1)</sup>	Importo aggregato concesso in prestito	Numero aggregato delle operazioni	Valore aggregato delle garanzie reali
20161007	Rep. UE	Segnalata	XXXX	SEE	SEE	Bilaterale, prestito riconciliato, garanzia non riconciliata	Pronti contro termine	Sì	TTCA		...		...
...	...	In essere	XOFF	Extra SEE	Extra SEE	Bilaterale, prestito riconciliato, garanzia riconciliata	BSB/SBB	No	SICA		...		...
...	...	...	SEE - MIC	...	...	Unilaterale SEE, prestito riconciliato, garanzia riconciliata	Concessione e assunzione in prestito di titoli o merci	...	SIUR		...		...
...	...	...	SEE - MIC	...	...	...	Operazione di marginazione	...			...		...
...	...	...	...	...	...	...	...	...	...		...		...

<sup>(1)</sup> Inserire gli indici pertinenti indicati nel campo 25 della tabella 2 «Dati sui prestiti e sulle garanzie» dell'allegato I del regolamento di esecuzione (UE) 2019/363

**REGOLAMENTO DELEGATO (UE) 2019/359 DELLA COMMISSIONE****del 13 dicembre 2018****che integra il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione che specificano i dettagli della domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni e della domanda di estensione della registrazione****(Testo rilevante ai fini del SEE)**

LA COMMISSIONE EUROPEA,

visto il trattato sul funzionamento dell'Unione europea,

visto il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 25 novembre 2015, sulla trasparenza delle operazioni di finanziamento tramite titoli e del riutilizzo e che modifica il regolamento (UE) n. 648/2012 <sup>(1)</sup>, in particolare l'articolo 5, paragrafo 7,

considerando quanto segue:

- (1) È opportuno fissare norme per specificare le informazioni che devono essere fornite all'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (ESMA) nella domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni o nella domanda di estensione della registrazione.
- (2) L'istituzione di un quadro solido e completo per la registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni e per l'estensione della registrazione è essenziale per conseguire gli obiettivi del regolamento (UE) 2015/2365 e per assicurare in modo efficace le funzioni del repertorio.
- (3) Le regole e le norme tecniche per la registrazione come repertori di dati sulle negoziazioni e per l'estensione della registrazione ai fini del regolamento (UE) 2015/2365 dovrebbero basarsi sulle infrastrutture, le procedure operative e i formati preesistenti che sono stati introdotti in ordine alla segnalazione dei contratti derivati ai repertori di dati sulle negoziazioni, al fine di ridurre al minimo i costi operativi aggiuntivi per i partecipanti al mercato.
- (4) L'esperienza nell'applicazione delle disposizioni del regolamento delegato (UE) n. 150/2013 della Commissione <sup>(2)</sup> ha dimostrato che le disposizioni per la registrazione come repertorio di dati sulla negoziazione a norma del regolamento (UE) n. 648/2012 rappresentano una base solida per la definizione di un quadro per la registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni nell'ambito del regolamento (UE) 2015/2365. Al fine di rafforzare ulteriormente tale quadro, il presente regolamento dovrebbe rispecchiare la natura evolutiva del settore.
- (5) È necessario che le domande di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contengano informazioni sulla struttura dei controlli interni e sull'indipendenza degli organi direttivi, per consentire all'ESMA di valutare se la struttura del governo societario garantisca l'indipendenza del repertorio di dati sulle negoziazioni e se la struttura e le relative linee di responsabilità siano sufficienti ad assicurare la conformità alle prescrizioni per i repertori di dati sulle negoziazioni di cui al regolamento (UE) 2015/2365. La domanda di registrazione dovrebbe contenere informazioni dettagliate sui meccanismi e sulle strutture di controllo interno pertinenti, sulla funzione di audit interno e sul piano di lavoro di audit al fine di consentire all'ESMA di valutare come tali fattori contribuiscano all'efficiente funzionamento del repertorio di dati sulle negoziazioni.
- (6) Sebbene i repertori di dati sulle negoziazioni che operano mediante succursali non siano considerati persone giuridiche distinte, è opportuno che siano fornite informazioni separate sulle succursali per consentire all'ESMA di identificare chiaramente la posizione delle succursali nella struttura organizzativa del repertorio di dati sulle negoziazioni, di valutare l'idoneità e l'adeguatezza dell'alta dirigenza della succursale e di verificare se i meccanismi di controllo, la funzione di controllo della conformità e le altre funzioni di cui il repertorio dispone siano sufficientemente solidi per individuare, valutare e gestire i rischi delle succursali in maniera efficace.

<sup>(1)</sup> GUL 337 del 23.12.2015, pag. 1.

<sup>(2)</sup> Regolamento delegato (UE) n. 150/2013, del 19 dicembre 2012, della Commissione 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 i dettagli della domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni (GUL 52 del 23.2.2013, pag. 25).

- (7) Per consentire all'ESMA di valutare l'onorabilità, l'esperienza e le competenze dei futuri membri del consiglio e dell'alta dirigenza del repertorio di dati sulle negoziazioni, il repertorio richiedente dovrebbe fornire le informazioni pertinenti su tali persone come curriculum vitae, informazioni relative a eventuali condanne penali, autodichiarazioni in merito all'onorabilità e dichiarazioni di potenziali conflitti di interessi.
- (8) Le domande di registrazione dovrebbero contenere informazioni che dimostrino che il richiedente dispone delle risorse finanziarie necessarie per l'esercizio delle sue funzioni come repertorio di dati sulle negoziazioni su base continuativa e di meccanismi efficaci per assicurare la continuità operativa.
- (9) L'articolo 5, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365 impone ai repertori di dati sulle negoziazioni di verificare la completezza e la correttezza delle informazioni segnalate a norma dell'articolo 4 dello stesso regolamento. Per essere registrati o perché sia concessa un'estensione della registrazione a norma del regolamento (UE) 2015/2365, i repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero dimostrare di aver istituito sistemi e procedure che garantiscono loro la capacità di verificare la completezza e la correttezza delle informazioni sulle operazioni di finanziamento tramite titoli (SFT).
- (10) L'utilizzo di risorse comuni all'interno di un repertorio di dati sulle negoziazioni tra servizi di segnalazione delle SFT, da un lato, e servizi accessori o servizi di segnalazione dei derivati, dall'altro, può dar luogo a un contagio dei rischi operativi fra i diversi servizi. Considerando che la convalida, la riconciliazione, il trattamento e la conservazione di dati possono richiedere un'effettiva separazione operativa per evitare tale contagio dei rischi, pratiche come un *front-end* comune dei sistemi, un punto di accesso comune ai dati per le autorità o l'utilizzo dello stesso personale per vendite, conformità o servizi di assistenza ai clienti potrebbero essere meno esposte al rischio di contagio e, di conseguenza, potrebbero non richiedere necessariamente una separazione operativa. I repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero pertanto stabilire un livello adeguato di separazione operativa tra le risorse, i sistemi e le procedure utilizzati in diverse linee di attività, anche quando queste comprendono la prestazione di servizi soggetti ad altra normativa dell'Unione o di paesi terzi, e dovrebbero garantire che nella domanda di registrazione o di estensione della registrazione siano fornite all'ESMA informazioni chiare e dettagliate sui servizi accessori o su altre linee di attività offerte dal repertorio di dati sulle negoziazioni al di fuori della sua attività principale di servizi di repertorio di cui al regolamento (UE) 2015/2365.
- (11) La solidità, la resilienza e la protezione dei sistemi informatici dei repertori di dati sulle negoziazioni sono essenziali per assicurare la conformità agli obiettivi del regolamento (UE) 2015/2365. Pertanto, i repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero fornire informazioni dettagliate e complete su tali sistemi così da permettere all'ESMA di valutare la solidità e la resilienza dei loro sistemi informatici. Se lo svolgimento delle funzioni di repertorio di dati sulle negoziazioni è esternalizzato a terzi, a livello del gruppo o al di fuori di esso, il repertorio dovrebbe fornire informazioni dettagliate sui pertinenti accordi di esternalizzazione al fine di consentire la valutazione della conformità alle condizioni di registrazione, ivi comprese informazioni su eventuali accordi sul livello dei servizi, sulle metriche e sulle modalità di controllo effettivo di tali metriche. Infine, i repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero fornire informazioni sui meccanismi e i controlli messi a punto per gestire efficacemente i potenziali rischi informatici e proteggere i dati che conservano da attacchi informatici.
- (12) Diversi tipi di utenti possono segnalare dati al repertorio, accedere ai dati che quest'ultimo conserva o modificarli. Le caratteristiche, nonché i diritti e le obbligazioni dei vari tipi di utenti dovrebbero essere chiaramente definiti dal repertorio di dati sulle negoziazioni e dovrebbero essere forniti a corredo della domanda di registrazione. Le informazioni fornite dai repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero identificare chiaramente le diverse categorie di accesso esistenti. Al fine di garantire la riservatezza dei dati, ma anche la loro disponibilità a terzi, i repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero fornire informazioni su come assicurano che soltanto i dati per i quali le controparti interessate abbiano fornito il proprio consenso esplicito, revocabile e discrezionale siano resi accessibili a terzi. Infine, nella domanda che presenta il repertorio di dati sulle negoziazioni dovrebbe fornire informazioni sui canali e i meccanismi utilizzati per rendere pubbliche le informazioni sulle regole di accesso al fine di permettere agli utenti dei suoi servizi di scegliere con cognizione di causa.
- (13) Le commissioni associate ai servizi prestati dai repertori di dati sulle negoziazioni costituiscono informazioni essenziali per permettere ai partecipanti al mercato di scegliere con cognizione di causa e dovrebbero pertanto essere inserite nella domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni.
- (14) Dato che i partecipanti al mercato e le autorità fanno affidamento sui dati conservati dai repertori di dati sulle negoziazioni, nella domanda di registrazione del repertorio dovrebbero essere chiaramente descritti meccanismi operativi e di conservazione dei dati rigorosi ed efficaci. Per dimostrare in che modo sia mantenuta la riservatezza e assicurata la protezione dei dati conservati dal repertorio di dati sulle negoziazioni nonché per consentirne la tracciabilità, nelle domande di registrazione deve essere inserito un riferimento specifico alla creazione di un log di segnalazione.

- (15) Per conseguire gli obiettivi del regolamento (UE) 2015/2365 per quanto riguarda la trasparenza delle SFT, i repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero dimostrare di applicare la procedura per i termini e le condizioni di accesso conformemente al regolamento delegato (UE) 2019/357 della Commissione <sup>(3)</sup>, di essere in grado di fornire l'accesso ai dati conformemente ai pertinenti obblighi di cui al Regolamento delegato (UE) 2019/358 della Commissione <sup>(4)</sup> e che l'integrità dei dati forniti alle autorità sia garantita.
- (16) L'effettivo pagamento delle commissioni di registrazione da parte dei repertori di dati sulle negoziazioni al momento della domanda è essenziale per coprire le spese necessarie dell'ESMA connesse alla registrazione o all'estensione della registrazione dei repertori di dati sulle negoziazioni.
- (17) Dovrebbe essere istituita una procedura di domanda semplificata di estensione della registrazione per permettere ai repertori di dati sulle negoziazioni già registrati ai sensi del regolamento (UE) n. 648/2012 di estendere la registrazione ai sensi del regolamento (UE) 2015/2365. Al fine di evitare una duplicazione degli obblighi, le informazioni che il repertorio di dati sulle negoziazioni è tenuto a fornire nell'estensione della registrazione dovrebbero includere informazioni dettagliate sugli adattamenti necessari per garantirne la conformità agli obblighi di cui al regolamento (UE) 2015/2365.
- (18) 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 a norma dell'articolo 10 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) <sup>(5)</sup>.
- (19) L'ESMA ha effettuato consultazioni pubbliche aperte sui 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 degli strumenti finanziari e dei mercati istituito dall'articolo 37 del regolamento (UE) n. 1095/2010,

HA ADOTTATO IL PRESENTE REGOLAMENTO:

#### Articolo 1

### **Identificazione, status giuridico e tipi di operazioni di finanziamento tramite titoli**

1. Ai fini dell'articolo 5, paragrafo 5, lettera a), del regolamento (UE) 2015/2365, la domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le seguenti informazioni:
- a) la denominazione sociale del richiedente e l'indirizzo della sede legale nell'Unione;
  - b) un estratto del registro delle imprese o del registro del tribunale, o qualsiasi altra prova certificata della sede di costituzione e dell'ambito di attività del richiedente, valido alla data di presentazione della domanda;
  - c) informazioni sui tipi di operazioni di finanziamento tramite titoli per i quali il richiedente presenta domanda di registrazione;
  - d) informazioni sull'esistenza di un'eventuale autorizzazione o registrazione del richiedente concessa dall'autorità competente nello Stato membro in cui è stabilito e, in tal caso, il nome dell'autorità competente e l'eventuale numero di riferimento relativo all'autorizzazione o alla registrazione;
  - e) gli atti costitutivi e, se del caso, ogni altra documentazione di legge attestante che il richiedente presterà servizi di repertorio di dati sulle negoziazioni;
  - f) i verbali della riunione in cui il consiglio del richiedente ha approvato la domanda;
  - g) il nominativo e i recapiti delle persone responsabili della conformità o di ogni altro membro del personale addetto alla valutazione della conformità per il richiedente;
  - h) il programma delle operazioni, comprendente l'indicazione dell'ubicazione delle principali attività;
  - i) l'identificazione di eventuali filiazioni e, se del caso, la struttura del gruppo;
  - j) i servizi diversi da quelli legati alla funzione di repertorio che il richiedente fornisce o intende fornire;

<sup>(3)</sup> Regolamento delegato (UE) 2019/357 della Commissione, del 13 dicembre 2018, che integra il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione sull'accesso alle informazioni sulle operazioni di finanziamento tramite titoli (SFT) registrate nei repertori di dati sulle negoziazioni (Cfr. pag. 22 della presente Gazzetta ufficiale).

<sup>(4)</sup> Regolamento delegato (UE) 2019/358 della Commissione, del 13 dicembre 2018, che integra il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione per la raccolta, verifica, aggregazione, comparazione e pubblicazione dei dati sulle operazioni di finanziamento tramite titoli (SFT) da parte dei repertori di dati sulle negoziazioni (Cfr. pag. 30 della presente Gazzetta ufficiale).

<sup>(5)</sup> GÜ L 331 del 15.12.2010, pag. 84.

- k) informazioni su procedure in corso giudiziarie, amministrative, di arbitrato o di contenzioso, indipendentemente dal tipo, riguardanti il richiedente, in particolare per quanto riguarda questioni di fiscalità e di insolvenza, suscettibili di comportare significativi costi finanziari e in termini di reputazione, o procedimenti conclusi, che potrebbero ancora avere ripercussioni significative sui costi del repertorio.
2. Su richiesta dell'ESMA, i richiedenti forniscono anche informazioni supplementari nel corso della procedura di esame della domanda di registrazione, quando dette informazioni siano necessarie per la valutazione della capacità del richiedente di rispettare i requisiti di cui al capo III del regolamento (UE) 2015/2365 e consentano all'ESMA di interpretare e analizzare debitamente la documentazione già presentata o da presentare.
3. Il richiedente che ritiene che un requisito del presente regolamento non si applichi nel suo caso indica chiaramente nella domanda di registrazione il requisito in oggetto e spiega perché non si applica.

#### Articolo 2

##### **Politiche e procedure**

Se nell'ambito di una domanda sono fornite informazioni concernenti le politiche e le procedure, il richiedente assicura che la domanda contenga i seguenti elementi:

- a) l'indicazione che il consiglio approva le politiche e che l'alta dirigenza approva le procedure ed è responsabile dell'attuazione e dell'aggiornamento delle politiche e delle procedure;
- b) la descrizione del modo in cui è organizzata la comunicazione delle politiche e delle procedure all'interno del richiedente e del modo in cui è assicurata e controllata giornalmente la conformità alle politiche e procedure e il soggetto o i soggetti responsabili della conformità a questo riguardo;
- c) i dati indicanti che i dipendenti e il personale dedicato sono a conoscenza delle politiche e delle procedure;
- d) la descrizione delle misure da adottare in caso di violazione delle politiche e delle procedure;
- e) l'indicazione della procedura per segnalare all'ESMA le violazioni rilevanti di politiche o procedure, tali da comportare una violazione delle condizioni previste per la registrazione iniziale.

#### Articolo 3

##### **Proprietà del repertorio di dati sulle negoziazioni**

1. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene:
  - a) l'elenco con i nomi delle persone o delle entità che, direttamente o indirettamente, detengono il 5 % o più del capitale o dei diritti di voto del richiedente o che grazie alla partecipazione detenuta possono esercitare un'influenza significativa sulla gestione del richiedente;
  - b) l'elenco di ogni impresa in cui le persone di cui alla lettera a) detengono il 5 % o più del capitale o dei diritti di voto o sulla cui gestione esse esercitano un'influenza significativa.
2. Se il richiedente ha un'impresa madre, esso deve:
  - a) indicare l'indirizzo della sede legale dell'impresa madre;
  - b) indicare se l'impresa madre è autorizzata o registrata e soggetta a vigilanza e, in caso affermativo, comunicare ogni numero di riferimento utile e la denominazione dell'autorità di vigilanza responsabile.

#### Articolo 4

##### **Prospetto della struttura societaria**

1. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene un prospetto indicante i legami proprietari tra l'impresa madre, le filiazioni e ogni altra entità collegata o succursale.
2. Le imprese indicate nel prospetto di cui al paragrafo 1 sono identificate con la denominazione completa, lo status giuridico e l'indirizzo della sede legale.

*Articolo 5***Organigramma**

1. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene l'organigramma del richiedente, compresi i servizi accessori.
2. L'organigramma indica i dati della persona responsabile di ogni funzione significativa, compresa l'alta dirigenza e le persone che dirigono le attività di ogni succursale.

*Articolo 6***Governo societario**

1. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le informazioni concernenti le politiche e le procedure interne di governo societario del richiedente, nonché il mandato dell'alta dirigenza, compreso il consiglio, i suoi membri non esecutivi e, se del caso, i comitati.
2. Dette informazioni includono una descrizione della procedura di selezione, di nomina, di valutazione delle prestazioni e di rimozione dell'alta dirigenza e dei membri del consiglio.
3. Se il richiedente aderisce ad un codice di condotta riconosciuto in materia di governo societario, esso indica il codice e fornisce una spiegazione per i casi in cui si discosta dal codice.

*Articolo 7***Controllo interno**

1. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene informazioni dettagliate relative al sistema di controllo interno del richiedente, comprese le informazioni sulla funzione di controllo della conformità, la valutazione del rischio, i meccanismi e i dispositivi di controllo interno e la funzione di audit interno.
2. Le informazioni dettagliate di cui al paragrafo 1 comprendono:
  - a) le politiche di controllo interno del richiedente e le relative procedure connesse alla loro applicazione coerente ed efficace;
  - b) le politiche, le procedure e i manuali relativi alla sorveglianza e alla valutazione dell'adeguatezza e dell'efficacia dei sistemi del richiedente;
  - c) le politiche, le procedure e i manuali relativi al controllo e alla protezione dei sistemi di trattamento delle informazioni del richiedente;
  - d) l'identità degli organi interni incaricati della valutazione dei risultati dei controlli interni pertinenti.
3. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le seguenti informazioni relative alle attività di audit interno del richiedente:
  - a) la composizione dell'eventuale comitato di audit interno, le sue competenze e responsabilità;
  - b) la carta, le metodologie, le norme e le procedure della funzione di audit interno;
  - c) la modalità di elaborazione e applicazione della carta, della metodologia e delle procedure di audit interno, tenuto conto della natura e della portata delle attività del richiedente, della loro complessità e dei relativi rischi;
  - d) il piano di lavoro per i tre anni successivi alla data della domanda per quanto riguarda la natura e la portata delle attività del richiedente, la loro complessità e i relativi rischi.

*Articolo 8***Conformità alla normativa**

La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le seguenti informazioni relative alle politiche e alle procedure del richiedente per assicurare la conformità al regolamento (UE) 2015/2365:

- a) la descrizione dei ruoli dei responsabili della conformità e di ogni altro membro del personale addetto alla valutazione della conformità, ivi comprese le modalità per assicurare l'indipendenza della funzione di controllo della conformità dal resto dell'impresa;

- b) le politiche e procedure interne miranti ad assicurare che il richiedente, ivi compresi i suoi dirigenti e dipendenti, rispetti tutte le disposizioni del regolamento (UE) 2015/2365, ivi compresa la descrizione del ruolo del consiglio e dell'alta dirigenza;
- c) se disponibile, la più recente relazione interna preparata dai responsabili della conformità o da qualsiasi altro membro del personale addetto alla valutazione della conformità all'interno del richiedente.

#### Articolo 9

##### **Alta dirigenza e membri del consiglio**

La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le seguenti informazioni per ogni alto dirigente e per ogni membro del consiglio:

- a) una copia del *curriculum vitae*;
- b) informazioni dettagliate sulle conoscenze e le esperienze nella gestione, nelle operazioni e nello sviluppo delle tecnologie informatiche;
- c) informazioni relative a eventuali condanne penali per atti connessi alla fornitura di servizi finanziari o di gestione dati o per frode o appropriazione indebita, in particolare mediante documenti ufficiali, se disponibili nello Stato membro;
- d) un'autodichiarazione in merito all'onorabilità in relazione alla prestazione di servizi finanziari o di gestione di dati, in cui ogni membro dell'alta dirigenza o del consiglio dichiara se:
  - i) è stato condannato per reati connessi alla prestazione di servizi finanziari o di gestione dati o per frode o appropriazione indebita;
  - ii) è stato condannato in procedimenti disciplinari avviati nei suoi confronti da autorità di regolamentazione o da organismi o agenzie pubblici o è oggetto di un tale procedimento non ancora concluso;
  - iii) è stato condannato in un procedimento civile dinanzi al giudice connesso alla prestazione di servizi finanziari o di gestione di dati, o per irregolarità o frode nella gestione di un'impresa;
  - iv) è stato membro del consiglio o alto dirigente di un'impresa la cui registrazione o autorizzazione è stata revocata da un organismo di regolamentazione;
  - v) gli è stato rifiutato il diritto di svolgere attività che richiedono la registrazione o l'autorizzazione da parte di un organismo di regolamentazione;
  - vi) ha fatto parte del consiglio o dell'alta dirigenza di un'impresa che sia divenuta insolvente o sia stata posta in liquidazione mentre la persona in questione aveva ancora legami con l'impresa, oppure entro un anno dalla cessazione dei legami della persona con l'impresa;
  - vii) è stato membro del consiglio o alto dirigente di un'impresa condannata o sanzionata da un organismo di regolamentazione;
  - viii) è stato altrimenti multato, sospeso, interdetto o soggetto ad altra sanzione per frode, appropriazione indebita o in connessione alla prestazione di servizi finanziari o di gestione di dati, da parte di un'amministrazione o di un organismo di regolamentazione o professionale;
  - ix) è stato interdetto dalla funzione di amministratore o dal ruolo di dirigente, licenziato o rimosso da qualsiasi altro incarico in un'impresa in seguito a condotta scorretta o irregolarità;
- e) una dichiarazione in merito a potenziali conflitti di interesse che l'alta dirigenza e i membri del consiglio possono avere nell'esercizio delle loro funzioni e le modalità di gestione di tali conflitti.

#### Articolo 10

##### **Politiche e procedure in materia di personale**

La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le seguenti informazioni:

- a) una copia della politica di remunerazione dell'alta dirigenza, dei membri del consiglio e del personale impiegato nelle funzioni di gestione del rischio e di controllo del richiedente;
- b) la descrizione delle misure messe in atto dal richiedente per ridurre il rischio di fare eccessivo affidamento su singoli dipendenti.

*Articolo 11***Idoneità e onorabilità**

La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le seguenti informazioni sul personale del richiedente:

- a) l'elenco generale del personale direttamente impiegato dal repertorio di dati sulle negoziazioni, comprensivo di funzioni e qualifiche;
- b) la descrizione specifica del personale informatico direttamente impiegato addetto alla prestazione dei servizi di repertorio di dati sulle negoziazioni, comprensiva delle funzioni e delle qualifiche di ogni dipendente;
- c) la descrizione delle funzioni e delle qualifiche di ogni persona responsabile dell'audit interno, dei controlli interni, del controllo della conformità e della valutazione del rischio;
- d) l'identità dei membri del personale dedicato e dei membri del personale che operano nel quadro di un accordo di esternalizzazione;
- e) informazioni riguardanti la formazione sulle politiche e le procedure del richiedente nonché sulle attività del repertorio di dati sulle negoziazioni, compresi eventuali esami o altro tipo di valutazione formale richiesti al personale per lo svolgimento delle attività di repertorio.

La descrizione di cui alla lettera b) include prove scritte del diploma accademico e dell'esperienza nell'ambito delle tecnologie dell'informazione di almeno un membro del personale di grado superiore competente in materia.

*Articolo 12***Documenti finanziari e piani aziendali**

1. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le seguenti informazioni finanziarie e aziendali sul richiedente:

- a) un bilancio di esercizio completo, redatto conformemente ai principi internazionali adottati ai sensi dell'articolo 3 del regolamento (CE) n. 1606/2002 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(6)</sup>;
- b) se il bilancio del richiedente è soggetto alla revisione legale dei conti ai sensi dell'articolo 2, punto 1, della direttiva 2006/43/CE del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(7)</sup>, i documenti finanziari comprendono la relazione di revisione dei bilanci di esercizio e dei bilanci consolidati;
- c) se il richiedente è sottoposto a revisione dei conti, il nome e il numero di registrazione nazionale del revisore esterno.

2. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene un piano finanziario aziendale che contempli scenari economici diversi per i servizi di repertorio di dati sulle negoziazioni per un periodo di riferimento minimo di tre anni e le seguenti informazioni supplementari:

- a) il livello previsto di attività di segnalazione espresso in numero di operazioni;
- b) i costi fissi e variabili pertinenti individuati in relazione alla prestazione di servizi di repertorio di dati sulle negoziazioni ai sensi del regolamento (UE) 2015/2365;
- c) le variazioni positive e negative pari almeno al 20 % rispetto allo scenario di attività di base identificato.

3. Se le informazioni finanziarie storiche di cui al paragrafo 1 non sono disponibili, la domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le seguenti informazioni sul richiedente:

- a) la dichiarazione pro forma attestante la disponibilità di risorse adeguate e la situazione attesa dell'impresa sei mesi dopo la concessione della registrazione;
- b) il bilancio intermedio, qualora il bilancio di esercizio non sia ancora disponibile per il periodo richiesto;
- c) il prospetto della situazione patrimoniale-finanziaria, quale lo stato patrimoniale, il conto economico, variazioni del patrimonio netto e dei flussi finanziari e le note comprensive di una sintesi delle politiche contabili e altre note esplicative.

<sup>(6)</sup> Regolamento (CE) n. 1606/2002 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 19 luglio 2002, relativo all'applicazione di principi contabili internazionali (GU L 243 dell'11.9.2002, pag. 1).

<sup>(7)</sup> Direttiva 2006/43/CE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 17 maggio 2006, relativa alle revisioni legali dei conti annuali e dei conti consolidati che modifica le direttive 78/660/CEE e 83/349/CEE del Consiglio e abroga la direttiva 84/253/CEE del Consiglio (GU L 157 del 9.6.2006, pag. 87).

4. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene il bilancio di esercizio sottoposto a revisione dell'impresa madre dei tre esercizi anteriori alla data di presentazione della domanda.
5. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene anche le seguenti informazioni finanziarie sul richiedente:
  - a) l'indicazione dei piani futuri per la costituzione di filiazioni e la loro ubicazione;
  - b) la descrizione dell'attività economica che il richiedente si propone di svolgere, specificando le attività delle filiazioni o delle succursali.

#### *Articolo 13*

### **Gestione dei conflitti di interessi**

La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le seguenti informazioni sulle politiche e sulle procedure di gestione dei conflitti di interesse messe in atto dal richiedente:

- a) politiche e procedure relative all'individuazione, la gestione e la comunicazione dei conflitti di interesse e la descrizione del processo utilizzato per garantire che le persone interessate siano a conoscenza di dette politiche e procedure;
- b) ogni altra misura e controllo messi in atto per assicurare il rispetto degli obblighi di cui alla lettera a) sulla gestione dei conflitti di interesse.

#### *Articolo 14*

### **Riservatezza**

1. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le politiche, le procedure e i meccanismi interni per prevenire ogni eventuale uso delle informazioni conservate dal futuro repertorio di dati sulle negoziazioni
  - a) per scopi illegittimi;
  - b) per divulgazione di informazioni riservate;
  - c) per scopi commerciali non ammessi.
2. Le politiche, le procedure e i meccanismi interni comprendono le procedure interne in materia di autorizzazione del personale all'uso di parole di accesso ai dati, specificando lo scopo, l'entità dei dati visualizzati e le restrizioni sull'uso dei dati, nonché informazioni dettagliate su eventuali meccanismi e controlli per gestire efficacemente i potenziali rischi informatici e proteggere i dati conservati dagli attacchi informatici.
3. I richiedenti forniscono all'ESMA informazioni sulle procedure di tenuta di un log che consenta di identificare ogni membro del personale che accede ai dati, il momento dell'accesso, la natura dei dati visualizzati e lo scopo.

#### *Articolo 15*

### **Inventario dei conflitti di interesse e loro attenuazione**

1. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene l'inventario aggiornato, al momento della presentazione della domanda, dei conflitti di interesse rilevanti in essere in relazione ai servizi accessori o ad altri servizi collegati forniti dal richiedente e la descrizione del modo in cui sono gestiti.
2. Se il richiedente fa parte di un gruppo, esso include nell'inventario i conflitti di interesse rilevanti derivanti da altre imprese appartenenti al gruppo e il modo in cui i conflitti sono gestiti.

#### *Articolo 16*

### **Risorse informatiche ed esternalizzazione**

La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le seguenti informazioni sulle risorse informatiche:

- a) la descrizione dettagliata del sistema informatico, compresi i pertinenti requisiti commerciali, delle specifiche funzionali e tecniche, dell'architettura e della progettazione tecnica del sistema, del modello e dei flussi di dati e delle operazioni, nonché le procedure amministrative e i manuali;
- b) i dispositivi d'utente messi a punto dal richiedente per fornire servizi agli utenti pertinenti, ivi compresa una copia di ogni manuale d'uso e delle procedure interne;

- c) le politiche seguite dal richiedente in materia di investimenti in risorse informatiche e nel loro rinnovo;
- d) gli accordi di esternalizzazione conclusi dal richiedente, ivi compresi:
  - i) la definizione dettagliata dei servizi da fornire, compresa la portata misurabile di tali servizi, la granularità delle attività, nonché le condizioni alle quali tali attività vengono prestate e il loro calendario;
  - ii) gli accordi sul livello dei servizi, con funzioni e responsabilità chiare, metriche e obiettivi per ogni requisito fondamentale esternalizzato del repertorio di dati sulle negoziazioni, i metodi utilizzati per monitorare il livello dei servizi delle funzioni esternalizzate, nonché le misure o le azioni da intraprendere qualora non sia raggiunto l'obiettivo in materia di livello dei servizi;
  - iii) una copia dei contratti che disciplinano tali accordi.

#### *Articolo 17*

##### **Servizi accessori**

Se un richiedente, un'impresa in seno al suo gruppo o un'impresa con cui il richiedente ha concluso un accordo relativo ai servizi di negoziazione o di post-negoziazione offre, o ha in progetto di offrire, servizi accessori, la domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le seguenti informazioni:

- a) la descrizione dei servizi ausiliari che il richiedente, o l'impresa in seno al suo gruppo, presta e la descrizione degli accordi che il repertorio di dati sulle negoziazioni ha con le imprese che offrono servizi di negoziazione, di post-negoziazione o altri servizi connessi, nonché una copia di tali accordi;
- b) le procedure e le politiche per garantire il livello necessario di separazione operativa in termini di risorse, sistemi e procedure tra i servizi di repertorio di dati sulle negoziazioni del richiedente nel quadro del regolamento (UE) 2015/2365 e altre linee di attività, anche nel caso di linee di attività che includono la prestazione di servizi nel quadro della normativa dell'Unione o di un paese terzo, indipendentemente dal fatto che tale linea di attività separata sia gestita dal repertorio di dati sulle negoziazioni, da un'impresa appartenente alla sua impresa madre o da qualsiasi altra impresa con cui ha concluso un accordo nel quadro della catena o della linea di attività relativa alla negoziazione o post-negoziazione.

#### *Articolo 18*

##### **Trasparenza delle regole di accesso**

1. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le seguenti informazioni:

- a) le politiche e le procedure in conformità alle quali i diversi tipi di utenti segnalano i dati al repertorio di dati sulle negoziazioni e vi accedono, compresi i processi necessari agli utenti per accedere alle informazioni conservate dai repertori di dati sulle negoziazioni, consultarle o modificarle;
- b) una copia dei termini e delle condizioni che determinano i diritti e le obbligazioni dei diversi tipi di utenti in relazione alle informazioni conservate dal repertorio di dati sulle negoziazioni;
- c) una descrizione delle diverse categorie di accesso a disposizione degli utenti;
- d) le politiche e le procedure in materia di accesso in conformità alle quali altri fornitori di servizi possono avere accesso non discriminatorio alle informazioni conservate dal repertorio di dati sulle negoziazioni, previo consenso scritto, volontario e revocabile delle controparti interessate;
- e) la descrizione dei canali e dei meccanismi usati dal repertorio di dati sulle negoziazioni per divulgare pubblicamente le informazioni sull'accesso.

2. Le informazioni di cui al paragrafo 1, lettere a), b) e c), sono specificate per i seguenti tipi di utenti:

- a) utenti interni;
- b) controparti segnalanti;
- c) entità segnalanti;
- d) entità responsabili della segnalazione;
- e) controparti non segnalanti;

- f) entità non segnalanti;
- g) entità di cui all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365;
- h) altri tipi di utenti, se del caso.

#### Articolo 19

### Verifica della completezza e della correttezza dei dati

La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le seguenti informazioni:

- a) le procedure di autenticazione dell'identità degli utenti che accedono al repertorio di dati sulle negoziazioni conformemente all'articolo 1 del Regolamento delegato (UE) 2019/358;
- b) le procedure per verificare l'uso di un modello XML conforme alla metodologia ISO 20022 conformemente all'articolo 1 del Regolamento delegato (UE) 2019/358;
- c) le procedure per verificare l'autorizzazione e il permesso IT dell'entità segnalante per conto della controparte segnalante conformemente all'articolo 1 del Regolamento delegato (UE) 2019/358;
- d) e procedure per verificare che sia mantenuta in ogni momento la sequenza logica delle informazioni sulle SFT segnalate conformemente all'articolo 1 del Regolamento delegato (UE) 2019/358;
- e) le procedure per verificare la completezza e la correttezza delle informazioni sulle SFT segnalate conformemente all'articolo 1 del Regolamento delegato (UE) 2019/358;
- f) le procedure per la riconciliazione dei dati tra i repertori di dati sulle negoziazioni quando le controparti trasmettono le informazioni a diversi repertori di dati sulle negoziazioni conformemente all'articolo 2 del Regolamento delegato (UE) 2019/358;
- g) le procedure per l'invio di un riscontro alle controparti delle SFT o a terzi che segnalano per loro conto sulle verifiche effettuate a norma delle lettere da a) a e), e i risultati del processo di riconciliazione di cui alla lettera f) conformemente all'articolo 3 del Regolamento delegato (UE) 2019/358.

#### Articolo 20

### Trasparenza sulle politiche tariffarie

La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene la descrizione:

- a) della politica tariffaria del richiedente, compresi eventuali sconti e riduzioni e le condizioni per beneficiarne;
- b) della struttura tariffaria del richiedente per la fornitura dei servizi di repertorio di dati sulle negoziazioni e dei servizi accessori, ivi compresi il costo stimato di tali servizi, e dei metodi utilizzati per contabilizzare separatamente i costi che il richiedente sostiene per la fornitura dei servizi di dati sulle negoziazioni e dei servizi accessori;
- c) dei metodi utilizzati per mettere le informazioni a disposizione di tutti i tipi di utenti, ivi compresa una copia della struttura tariffaria in cui i servizi di repertorio dei dati sulle negoziazioni e i servizi accessori sono separati.

#### Articolo 21

### Rischio operativo

1. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene:
  - a) la descrizione dettagliata delle risorse disponibili e delle procedure miranti a individuare e ridurre il rischio operativo e qualsiasi altro rischio rilevante cui il richiedente sia esposto, ivi compresa una copia di politiche, metodologie, procedure interne e manuali pertinenti;
  - b) la descrizione delle attività liquide nette finanziate da capitale proprio per la copertura di potenziali perdite economiche di natura generale al fine di continuare a fornire i servizi in condizioni normali e una valutazione dell'adeguatezza delle sue risorse finanziarie al fine di coprire i costi operativi di una liquidazione o riorganizzazione delle operazioni e dei servizi critici per un periodo di almeno sei mesi;

- c) il piano di continuità operativa del richiedente e la descrizione delle modalità per aggiornarlo, tra cui i seguenti elementi:
- i) tutti i processi aziendali, le risorse, le procedure di attivazione di livelli successivi di intervento e i relativi sistemi aventi importanza critica per garantire i servizi del repertorio di dati sulle negoziazioni richiedente, ivi compresi i pertinenti servizi esternalizzati e la strategia, la politica e gli obiettivi del repertorio per garantire la continuità dei processi;
  - ii) gli accordi in vigore con altri fornitori di infrastrutture del mercato finanziario, ivi compresi altri repertori di dati sulle negoziazioni;
  - iii) le modalità per garantire un livello minimo di servizio delle funzioni principali e la tempistica prevista per il pieno ripristino dei processi;
  - iv) il tempo di ripristino massimo accettabile dei processi e dei sistemi aziendali, tenendo conto dei termini per la segnalazione ai repertori di dati sulle negoziazioni di cui all'articolo 4 del regolamento (UE) 2015/2365 e del volume di dati che il repertorio di dati sulle negoziazioni deve trattare entro il periodo giornaliero;
  - v) le procedure di gestione del rilevamento e della registrazione degli incidenti e delle revisioni;
  - vi) il programma di prove e i relativi risultati;
  - vii) il numero di siti tecnici e operativi alternativi disponibili, la loro ubicazione, le risorse di cui dispongono rispetto al sito principale e le procedure di continuità operativa in vigore qualora si renda necessario l'uso dei siti alternativi;
  - viii) informazioni sull'accesso ad un sito di attività secondario per consentire al personale di garantire la continuità del servizio, qualora la sede principale non sia disponibile;
  - ix) i piani, le procedure e i dispositivi per gestire le situazioni di emergenza e garantire la sicurezza del personale;
  - x) i piani, le procedure e i dispositivi per gestire le crisi, incluso il coordinamento dell'azione complessiva di continuità operativa e la sua tempestiva ed efficace attivazione entro un tempo massimo di ripristino stabilito;
  - xi) i piani, le procedure e i dispositivi per ripristinare i componenti del sistema, dell'applicazione e dell'infrastruttura del richiedente entro il tempo massimo di ripristino previsto;
- d) la descrizione delle misure adottate per garantire le attività del repertorio di dati sulle negoziazioni richiedente in caso di perturbazioni e la partecipazione degli utenti del repertorio e dei terzi a tali misure.

2. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le procedure per assicurare la sostituzione regolare del repertorio di dati sulle negoziazioni originale se richiesto da una controparte segnalante o da un terzo che effettua la segnalazione per conto di una controparte non segnalante, o qualora tale sostituzione sia il risultato di una revoca della registrazione e comprende le procedure per il trasferimento dei dati e il reindirizzamento dei flussi di informazioni a un altro repertorio di dati sulle negoziazioni.

## Articolo 22

### Politica in materia di conservazione dei dati

1. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le informazioni sul ricevimento e la gestione dei dati, comprese le politiche e le procedure messe in atto dal richiedente per assicurare:
- a) la registrazione tempestiva e accurata delle informazioni trasmesse;
  - b) la conservazione in un log di segnalazione di tutte le informazioni segnalate riguardanti la conclusione, la modifica o la cessazione di SFT;
  - c) che i dati siano conservati sia online che offline;
  - d) che i dati siano adeguatamente copiati ai fini della continuità operativa.
2. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene informazioni sui sistemi, sulle politiche e sulle procedure di conservazione dei dati utilizzati per garantire che i dati segnalati siano modificati in modo adeguato e che le posizioni siano calcolate correttamente a norma delle pertinenti disposizioni legislative o regolamentari.

*Articolo 23***Meccanismi per assicurare la disponibilità dei dati**

La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene la descrizione delle risorse, dei metodi e dei canali che il richiedente utilizza per permettere l'accesso alle informazioni ai sensi dell'articolo 12, paragrafi 1, 2 e 3, del regolamento (UE) 2015/2365 e le seguenti informazioni:

- a) la procedura per calcolare le posizioni aggregate conformemente all'articolo 6 del Regolamento delegato (UE) 2019/358 e la descrizione delle risorse, dei metodi e dei canali che il repertorio di dati sulle negoziazioni intende utilizzare per facilitare l'accesso del pubblico ai dati ivi contenuti a norma dell'articolo 12, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2015/2365, e la descrizione della frequenza degli aggiornamenti, nonché una copia dei manuali e delle politiche interne specifici;
- b) la descrizione delle risorse, dei metodi e delle strutture che il repertorio di dati sulle negoziazioni utilizza per facilitare l'accesso delle autorità competenti alle proprie informazioni, ai sensi dell'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365, la frequenza degli aggiornamenti e i controlli e le verifiche che il repertorio di dati sulle negoziazioni può stabilire per il processo di filtraggio dell'accesso, nonché una copia dei manuali e delle procedure interne specifici;
- c) la procedura e la descrizione delle risorse, dei metodi e dei canali che il repertorio di dati sulle negoziazioni utilizza per facilitare una raccolta di dati tempestiva, strutturata ed esauriente da parte delle controparti, l'accesso delle controparti delle SFT alle informazioni, a norma dell'articolo 4, paragrafo 6, del regolamento (UE) 2015/2365 e dell'articolo 80, paragrafo 5, del regolamento (UE) n. 648/2012, nonché una copia dei manuali e delle politiche interne specifici.

*Articolo 24***Accesso diretto e immediato ai dati da parte delle autorità**

La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene informazioni sui seguenti elementi:

- a) i termini e le condizioni in base a cui alle autorità di cui all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365 è concesso accesso diretto e immediato alle informazioni sulle SFT conservate in tale repertorio di dati sulle negoziazioni conformemente al Regolamento delegato (UE) 2019/357;
- b) la procedura tramite cui alle autorità di cui alla lettera a) è dato accesso diretto e immediato alle informazioni sulle SFT conservate da repertorio di dati sulle negoziazioni conformemente agli articoli 4 e 5 del Regolamento delegato (UE) 2019/358;
- c) la procedura per garantire l'integrità dei dati a cui tali autorità accedono.

*Articolo 25***Pagamento delle commissioni**

La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene la prova del pagamento delle commissioni per la registrazione stabilito dal Regolamento delegato (UE) 2019/360 della Commissione <sup>(8)</sup>.

*Articolo 26***Informazioni da fornire in caso di estensione della registrazione**

Ai fini dell'articolo 5, paragrafo 5, lettera b), del regolamento (UE) 2015/2365, la domanda di estensione della registrazione esistente contiene le informazioni specificate:

- a) all'articolo 1, ad esclusione del paragrafo 1, lettera k);
- b) all'articolo 2;
- c) all'articolo 5;
- d) all'articolo 7, ad esclusione del paragrafo 2, lettera d);
- e) all'articolo 8, lettera b);

<sup>(8)</sup> Regolamento delegato (UE) 2019/360 della Commissione del 13 dicembre 2018 che integra il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le commissioni imposte ai repertori di dati sulle negoziazioni dall'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (Cfr. pag. 58 della presente Gazzetta ufficiale).

- f) all'articolo 9, paragrafo 1, lettere b) ed e);
- g) all'articolo 11;
- h) all'articolo 12, paragrafo 2;
- i) all'articolo 13;
- j) all'articolo 14, paragrafo 2;
- k) all'articolo 15;
- l) all'articolo 16, ad esclusione della lettera c);
- m) all'articolo 17;
- n) all'articolo 18;
- o) all'articolo 19;
- p) all'articolo 20;
- q) all'articolo 21;
- r) all'articolo 22;
- s) all'articolo 23;
- t) all'articolo 24;
- u) all'articolo 25;
- v) all'articolo 27.

#### *Articolo 27*

#### **Verifica dell'accuratezza e della completezza della domanda**

1. Tutte le informazioni fornite all'ESMA nel corso della procedura di registrazione sono accompagnate da una lettera firmata da un membro del consiglio e da un alto dirigente del repertorio di dati sulle negoziazioni, in cui questi attestino che, per quanto a loro conoscenza, alla data della presentazione le informazioni fornite sono corrette e complete.
2. Le informazioni sono anche accompagnate, se del caso, dalla pertinente documentazione societaria di legge che certifica l'accuratezza dei dati.

#### *Articolo 28*

#### **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 13 dicembre 2018

*Per la Commissione*  
*Il presidente*  
Jean-Claude JUNCKER

---

**REGOLAMENTO DELEGATO (UE) 2019/360 DELLA COMMISSIONE****del 13 dicembre 2018****che integra il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le commissioni imposte ai repertori di dati sulle negoziazioni dall'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati****(Testo rilevante ai fini del SEE)**

LA COMMISSIONE EUROPEA,

visto il trattato sul funzionamento dell'Unione europea,

visto il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 25 novembre 2015, sulla trasparenza delle operazioni di finanziamento tramite titoli e del riutilizzo e che modifica il regolamento (UE) n. 648/2012 <sup>(1)</sup>, in particolare l'articolo 11, paragrafo 2,

considerando quanto segue:

- (1) L'articolo 62 del regolamento (UE) n. 1095/2010 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(2)</sup> dispone che le entrate dell'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (ESMA) siano costituite, oltre che dai contributi delle autorità pubbliche nazionali e da una sovvenzione dell'Unione, dalle commissioni pagate all'ESMA nei casi previsti dalla normativa dell'Unione.
- (2) Ai repertori di dati sulle negoziazioni stabiliti nell'Unione è imposta una commissione di registrazione che copre i costi sostenuti dall'ESMA per il trattamento della domanda di registrazione.
- (3) I costi sostenuti dall'ESMA per il trattamento della domanda di registrazione saranno più elevati se il repertorio di dati sulle negoziazioni presta servizi accessori. La prestazione di tali servizi accessori è indice di un fatturato atteso alto e di maggiori costi associati alla valutazione della domanda di registrazione. Pertanto, ai fini dell'imposizione della commissione di registrazione i repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero essere classificati in due diverse categorie in funzione del fatturato totale atteso, alto o basso, a cui si applica una commissione di registrazione diversa nel caso in cui intendano prestare servizi accessori.
- (4) Qualora un repertorio di dati sulle negoziazioni già registrato a norma del regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(3)</sup> presenti domanda di estensione della registrazione, le spese necessarie per esaminare e valutare attentamente la domanda sarebbero inferiori rispetto a quelle di una nuova registrazione, poiché l'ESMA è già in possesso delle pertinenti informazioni riguardanti il repertorio di dati richiedente. Di conseguenza, il repertorio di dati richiedente dovrebbe pagare una commissione ridotta. Qualora un repertorio di dati sulle negoziazioni già registrato a norma del regolamento (UE) n. 648/2012 presenti contemporaneamente una domanda di registrazione a norma del regolamento (UE) n. 648/2012 e una domanda di registrazione a norma del regolamento (UE) 2015/2365, le spese necessarie per esaminare e valutare attentamente le domande sarebbero anche in questo caso inferiori, in virtù della sinergia di esaminare congiuntamente lo stesso tipo di documenti. In caso di domande simultanee, il repertorio di dati sulle negoziazioni dovrebbe pagare la commissione di registrazione dovuta a norma del regolamento (UE) n. 648/2012 per intero e la commissione per l'estensione della registrazione dovuta a norma del regolamento (UE) 2015/2365 in forma ridotta.
- (5) Se dopo la registrazione il repertorio di dati sulle negoziazioni inizia a prestare servizi accessori rientrando così nella categoria superiore in termini di fatturato totale atteso, il repertorio di dati sulle negoziazioni dovrebbe pagare la differenza tra la commissione di registrazione iniziale e la commissione di registrazione corrispondente alla categoria di fatturato superiore. Per contro, il repertorio di dati sulle negoziazioni non dovrebbe essere rimborsato dall'ESMA qualora smetta di prestare servizi accessori, poiché durante la registrazione sono state effettivamente sostenute spese necessarie a valutare la domanda di un repertorio di dati sulle negoziazioni con fatturato alto.
- (6) Al fine di scoraggiare domande infondate, la commissione di registrazione non dovrebbe essere rimborsata se il richiedente ritira la domanda nel corso della procedura di registrazione o in caso di rifiuto della registrazione.

<sup>(1)</sup> GUL 337 del 23.12.2015, pag. 1.

<sup>(2)</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).

<sup>(3)</sup> 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 (GU L 201 del 27.7.2012, pag. 1).

- (7) Per garantire l'uso efficiente del bilancio dell'ESMA e alleggerire allo stesso tempo l'onere finanziario a carico degli Stati membri e dell'Unione, è necessario assicurare che i repertori di dati sulle negoziazioni paghino almeno tutti i costi legati alla loro vigilanza. Le commissioni di vigilanza dovrebbero essere fissate ad un livello tale da evitare un accumulo significativo di disavanzi o di avanzi per le attività collegate ai repertori di dati sulle negoziazioni. Se si dovesse verificare un disavanzo, l'ESMA non dovrebbe recuperarne l'importo presso il repertorio di dati sulle negoziazioni. Se il disavanzo dovesse essere significativo, l'ESMA dovrebbe analizzarne le ragioni e modificare la previsione del costo della vigilanza per il successivo periodo di programmazione finanziaria. Per quanto riguarda gli avanzi, i repertori di dati sulle negoziazioni non dovrebbero recuperare gli avanzi delle commissioni.
- (8) Per assicurare una distribuzione equa e chiara delle commissioni, che rifletta allo stesso tempo l'effettivo carico amministrativo generato da ogni entità soggetta a vigilanza, la commissione di vigilanza dovrebbe essere calcolata in funzione del fatturato generato dalle attività di base del repertorio di dati sulle negoziazioni e dai suoi servizi accessori. Ai fini del calcolo del fatturato applicabile, è necessario operare una distinzione tra i servizi accessori direttamente connessi alla prestazione dei servizi di base di raccolta e conservazione in modo centralizzato delle registrazioni sulle operazioni di finanziamento tramite titoli (SFT) a norma del regolamento (UE) 2015/2365, come l'attività di agente mutuante (*agent lending*) e di gestione delle garanzie reali, e i servizi connessi alla raccolta e alla conservazione in modo centralizzato delle registrazioni sulle SFT e sui derivati, quali il riscontro (*matching*), la conferma/verifica delle negoziazioni, la valutazione delle garanzie reali e le segnalazioni da parte di terzi. Le commissioni di vigilanza a carico di un determinato repertorio di dati sulle negoziazioni dovrebbero essere proporzionate all'attività di quest'ultimo rispetto al totale delle attività di tutti i repertori di dati sulle negoziazioni registrati e sottoposti a vigilanza in un determinato anno. Tuttavia, tenuto conto delle spese amministrative fisse per la vigilanza dei repertori di dati sulle negoziazioni, è opportuno fissare una commissione minima di vigilanza annuale. Tale importo non è influenzato dal pagamento delle commissioni di vigilanza a norma del regolamento (UE) n. 648/2012.
- (9) È opportuno stabilire disposizioni in materia di commissioni a carico dei repertori di dati sulle negoziazioni di paesi terzi che presentano domanda di riconoscimento nell'Unione ai sensi del regolamento (UE) 2015/2365, al fine di coprire le spese di riconoscimento e le spese amministrative annuali di vigilanza. A tale riguardo, la commissione di riconoscimento dovrebbe comprendere due componenti: le spese necessarie relative al trattamento della domanda di riconoscimento da parte dell'ESMA di tali repertori di dati sulle negoziazioni di paesi terzi a norma dell'articolo 19, paragrafo 4, di detto regolamento, e le spese necessarie relative alla conclusione di accordi di cooperazione con le autorità competenti del paese terzo in cui il repertorio di dati richiedente è registrato ai sensi dell'articolo 20 del medesimo regolamento. I costi connessi alla conclusione di accordi di cooperazione dovrebbero essere ripartiti tra i repertori di dati sulle negoziazioni riconosciuti dello stesso paese terzo. Inoltre, i repertori di dati sulle negoziazioni di paesi terzi dovrebbero essere tenuti al pagamento di una commissione annuale di vigilanza.
- (10) Qualora un repertorio di dati sulle negoziazioni di un paese terzo già riconosciuto a norma del regolamento (UE) n. 648/2012 presenti una domanda di estensione della registrazione del riconoscimento, i costi relativi al trattamento della domanda dovrebbero essere inferiori rispetto ai costi del trattamento di una nuova domanda in virtù della sinergia tra i regimi di cui al regolamento (UE) n. 648/2012 e al regolamento (UE) 2015/2365. Pertanto, è opportuno ridurre la componente della commissione di riconoscimento relativa al trattamento della domanda. D'altro canto, i costi della conclusione di un accordo di cooperazione sono costi specifici connessi all'osservanza del regolamento (UE) 2015/2365, pertanto la componente della commissione di riconoscimento relativa agli accordi di cooperazione non dovrebbe dipendere dall'esistenza di accordi di cooperazione a norma del regolamento (UE) n. 648/2012.
- (11) Le funzioni di vigilanza esercitate dall'ESMA nei riguardi dei repertori di dati sulle negoziazioni riconosciuti di paesi terzi riguardano principalmente l'attuazione degli accordi di cooperazione, ivi compreso l'effettivo scambio di dati tra le autorità competenti. È opportuno che il costo dell'esercizio di tali funzioni sia coperto da commissioni annuali di vigilanza a carico dei repertori di dati sulle negoziazioni riconosciuti. Dato che tali costi saranno molto inferiori ai costi sostenuti dall'ESMA per l'esercizio della vigilanza diretta dei repertori di dati sulle negoziazioni registrati nell'Unione, è opportuno che la commissione di vigilanza a carico dei repertori di dati sulle negoziazioni riconosciuti sia notevolmente inferiore alla commissione minima di vigilanza a carico dei repertori di dati sulle negoziazioni registrati soggetti alla vigilanza diretta dell'ESMA.
- (12) Le autorità nazionali competenti sostengono costi per lo svolgimento di compiti a norma del regolamento (UE) 2015/2365 e a seguito di deleghe di compiti dell'ESMA alle autorità nazionali competenti a norma dell'articolo 74 del regolamento (UE) n. 648/2012 e conformemente all'articolo 9, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2015/2365. Occorre che le commissioni che l'ESMA impone ai repertori di dati sulle negoziazioni coprano anche questi costi. Per evitare che le autorità competenti subiscano perdite o realizzino profitti svolgendo compiti loro delegati o prestando assistenza all'ESMA, quest'ultima rimborsa all'autorità nazionale competente i costi effettivamente sostenuti.
- (13) Poiché nell'anno in cui viene effettuata la registrazione sono disponibili solo pochi dati sull'attività del repertorio di dati sulle negoziazioni, è opportuno calcolare una commissione provvisoria di vigilanza sulla base della stima delle spese necessarie per la vigilanza del repertorio di dati sulle negoziazioni in questione nel primo anno. Il calcolo esatto della commissione dovrebbe tener conto della data di registrazione del repertorio di dati sulle

negoziazioni e della data di decorrenza dell'obbligo di segnalazione di cui all'articolo 4, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2015/2365, in modo da rispecchiare con precisione il livello di vigilanza richiesto all'ESMA. Se le segnalazioni regolamentari di un repertorio di dati sulle negoziazioni iniziano soltanto nell'anno successivo alla sua registrazione, la commissione provvisoria di vigilanza per l'anno di registrazione dovrebbe essere basata sulla commissione di registrazione, in quanto le spese necessarie per la vigilanza di un repertorio di dati sulle negoziazioni che ancora non effettua segnalazioni sono comparabili alle spese necessarie per valutare la domanda di registrazione. In funzione del periodo di tempo che intercorre tra la registrazione e la fine dell'anno, l'importo è adeguato in proporzione, partendo dal presupposto che un processo di registrazione standard richiede 150 giorni lavorativi. Se le segnalazioni regolamentari di un repertorio di dati sulle negoziazioni iniziano nel primo semestre dell'anno di registrazione, la commissione provvisoria di vigilanza dovrebbe essere calcolata sulla base del fatturato applicabile che rispecchia i proventi del repertorio di dati sulle negoziazioni per il primo semestre. Se le segnalazioni regolamentari di un repertorio di dati sulle negoziazioni iniziano nel secondo semestre dell'anno di registrazione, la commissione provvisoria di vigilanza dovrebbe essere calcolata sulla base del livello della commissione di registrazione del repertorio di dati sulle negoziazioni, in quanto sono disponibili solo pochi dati per avvalersi del fatturato applicabile.

- (14) I repertori di dati sulle negoziazioni registrati nel 2019 non inizieranno a fornire i servizi di segnalazione prima della fine del 2019 e probabilmente il loro livello di attività nel 2019 sarà quasi inesistente. Pertanto, è opportuno calcolare la commissione annuale di vigilanza per il 2020 sulla base del loro fatturato applicabile nel primo semestre del 2020.
- (15) Il presente regolamento dovrebbe costituire la base su cui si fonda il diritto dell'ESMA di imporre commissioni ai repertori di dati sulle negoziazioni,

HA ADOTTATO IL PRESENTE REGOLAMENTO:

#### CAPO I

#### DISPOSIZIONI GENERALI

##### Articolo 1

#### **Recupero totale dei costi di vigilanza**

Le commissioni imposte ai repertori di dati sulle negoziazioni coprono:

- a) tutti i costi connessi alla registrazione dei repertori di dati sulle negoziazioni e alla vigilanza esercitata dall'ESMA su questi ultimi in conformità del regolamento (UE) 2015/2365, compresi i costi derivanti dal riconoscimento dei repertori di dati sulle negoziazioni, nonché i costi derivanti dall'estensione della registrazione o dall'estensione del riconoscimento per i repertori di dati sulle negoziazioni che sono già registrati o riconosciuti a norma del regolamento (UE) n. 648/2012;
- b) tutti i costi per il rimborso delle autorità competenti che abbiano svolto compiti ai sensi del regolamento (UE) 2015/2365 e a seguito di deleghe di compiti a norma dell'articolo 74 del regolamento (UE) n. 648/2012 e conformemente all'articolo 9 del regolamento (UE) 2015/2365.

##### Articolo 2

#### **Fatturato applicabile**

1. I repertori di dati sulle negoziazioni registrati a norma del regolamento (UE) 2015/2365 tengono soltanto conti sottoposti a revisione contabile ai fini del presente regolamento che operino una distinzione almeno tra i seguenti elementi:

- a) i proventi generati dalle funzioni di base di raccolta e conservazione in modo centralizzato delle registrazioni sulle operazioni di finanziamento tramite titoli (SFT) a norma del regolamento (UE) 2015/2365;
- b) i proventi generati dai servizi accessori che sono direttamente connessi alla raccolta e alla conservazione in modo centralizzato delle registrazioni sulle SFT a norma del regolamento (UE) 2015/2365.

I proventi applicabili dei servizi accessori del repertorio di dati sulle negoziazioni per un determinato anno (n) sono costituiti dai proventi dei servizi determinati ai sensi della lettera b).

2. I repertori di dati sulle negoziazioni registrati sia a norma del regolamento (UE) 2015/2365 che a norma del regolamento (UE) n. 648/2012 tengono conti sottoposti a revisione contabile ai fini del presente regolamento che operino una distinzione almeno tra i seguenti elementi:

- a) i proventi generati dalle funzioni di base di raccolta e conservazione in modo centralizzato delle registrazioni sulle SFT a norma del regolamento (UE) 2015/2365;
- b) i proventi generati dalle funzioni di base di raccolta e conservazione in modo centralizzato delle registrazioni sui derivati a norma del regolamento (UE) n. 648/2012;

- c) i proventi generati dai servizi accessori che sono direttamente connessi alla raccolta e alla conservazione in modo centralizzato delle registrazioni sulle SFT a norma del regolamento (UE) 2015/2365;
- d) i proventi generati dai servizi accessori che sono direttamente connessi sia alla raccolta e alla conservazione in modo centralizzato delle registrazioni sulle SFT a norma del regolamento (UE) 2015/2365 che alla raccolta e alla conservazione in modo centralizzato delle registrazioni sui derivati a norma del regolamento (UE) n. 648/2012.

I proventi applicabili dei servizi accessori del repertorio di dati sulle negoziazioni per un determinato anno (n) sono costituiti dalla somma dei seguenti elementi:

- i proventi di cui alla lettera c) e
- una quota dei proventi di cui alla lettera d).

La quota dei proventi di cui alla lettera d) è pari alle entrate di cui alla lettera a), divise per la somma dei seguenti elementi:

- i proventi di cui alla lettera a) e
- i proventi di cui alla lettera b).

3. Il fatturato applicabile del repertorio di dati sulle negoziazioni per un determinato anno (n) è costituito dalla somma dei seguenti elementi:

- i suoi proventi generati dalle funzioni di base di raccolta e conservazione in modo centralizzato delle registrazioni sulle SFT a norma del regolamento (UE) 2015/2365 sulla base dei conti sottoposti a revisione contabile dell'anno precedente (n – 1) e
- i proventi applicabili dei servizi accessori, determinati conformemente ai paragrafi 1 e 2, a seconda dei casi, sulla base dei conti sottoposti a revisione contabile dell'anno precedente (n – 1),

divisa per la somma dei seguenti elementi:

- i proventi totali di tutti i repertori di dati sulle negoziazioni registrati, generati dalle funzioni di base di raccolta e conservazione in modo centralizzato delle registrazioni sulle SFT a norma del regolamento (UE) 2015/2365 sulla base dei conti sottoposti a revisione contabile dell'anno precedente (n – 1) e
- i proventi applicabili totali dei servizi accessori di tutti i repertori di dati sulle negoziazioni registrati, determinati conformemente ai paragrafi 1 e 2, a seconda dei casi, sulla base dei conti sottoposti a revisione contabile dell'anno precedente (n – 1).

Il fatturato applicabile di un dato repertorio di dati sulle negoziazioni («TRI» nella formula che segue) è quindi calcolato come segue:

$$\frac{\text{proventi delle SFT del Tri}}{\sum \text{proventi delle SFT di tutti i TR}}$$

dove: proventi delle SFT = proventi dei servizi di base delle SFT + proventi applicabili dei servizi accessori.

4. Se il repertorio di dati sulle negoziazioni non ha svolto attività per l'intero anno precedente (n – 1), il suo fatturato applicabile è stimato secondo la formula di cui al paragrafo 3, estrapolando all'intero anno (n – 1) il valore per il repertorio di dati sulle negoziazioni calcolato per il numero di mesi nei quali il repertorio di dati sulle negoziazioni ha svolto attività nell'anno (n – 1).

### Articolo 3

#### Adeguamento delle commissioni

Le commissioni imposte per le attività dell'ESMA connesse ai repertori di dati sulle negoziazioni sono fissate a un livello tale da evitare un accumulo significativo di disavanzi o di avanzi.

In caso di disavanzi o avanzi significativi ricorrenti, la Commissione rivede il livello delle commissioni.

### CAPO II

#### COMMISSIONI

### Articolo 4

#### Tipo di commissioni

1. I repertori di dati sulle negoziazioni stabiliti nell'Unione che presentano domanda di registrazione ai sensi dell'articolo 5, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2015/2365 sono tenuti al pagamento dei seguenti tipi di commissioni:

- a) le commissioni per la registrazione e l'estensione della registrazione a norma dell'articolo 5;
- b) la commissione annuale di vigilanza ai sensi dell'articolo 6.

2. I repertori di dati sulle negoziazioni stabiliti in paesi terzi che chiedono il riconoscimento ai sensi dell'articolo 19, paragrafo 4, del regolamento (UE) 2015/2365 sono tenuti al pagamento dei seguenti tipi di commissioni:

- a) la commissione per il riconoscimento o per l'estensione della registrazione ai sensi dell'articolo 7, paragrafi 1 e 2;
- b) la commissione annuale di vigilanza a carico dei repertori di dati sulle negoziazioni riconosciuti ai sensi dell'articolo 7, paragrafo 3.

#### Articolo 5

##### **Commissione di registrazione e commissione per l'estensione della registrazione**

1. La commissione di registrazione a carico del singolo repertorio di dati sulle negoziazioni richiedente rispecchia le spese necessarie per esaminare e valutare attentamente la domanda di registrazione o di estensione della registrazione, tenendo conto dei servizi che il repertorio di dati sulle negoziazioni deve fornire, compresi eventuali servizi accessori.

2. Si ritiene che il repertorio di dati sulle negoziazioni offra servizi accessori in ciascuna delle seguenti situazioni:

- a) quando presta direttamente servizi accessori;
- b) quando un'entità appartenente allo stesso gruppo del repertorio di dati sulle negoziazioni presta servizi accessori;
- c) quando i servizi accessori sono forniti da un'entità con la quale il repertorio di dati sulle negoziazioni ha concluso un accordo nel quadro della catena o della linea di attività di negoziazione o di post-negoziazione per cooperare alla prestazione di servizi.

3. Il repertorio di dati sulle negoziazioni che non fornisce i servizi accessori secondo quanto stabilito al paragrafo 2, e che pertanto si ritiene abbia un fatturato totale atteso basso, è tenuto a pagare una commissione di registrazione di 65 000 EUR.

4. Il repertorio di dati sulle negoziazioni che fornisce i servizi accessori secondo quanto stabilito al paragrafo 2, e che pertanto si ritiene abbia un fatturato totale atteso alto, è tenuto a pagare una commissione di registrazione di 100 000 EUR.

5. Qualora il repertorio di dati sulle negoziazioni che presenta domanda di registrazione sia già stato registrato a norma del titolo VI, capo 1, del regolamento (UE) n. 648/2012, il repertorio di dati sulle negoziazioni è tenuto a pagare una commissione per l'estensione della registrazione pari a:

- a) 50 000 EUR per i repertori di dati sulle negoziazioni che forniscono servizi accessori secondo quanto stabilito al paragrafo 2;
- b) 32 500 EUR per i repertori di dati sulle negoziazioni con fatturato atteso basso che non forniscono servizi accessori secondo quanto stabilito al paragrafo 2.

6. Qualora un repertorio di dati sulle negoziazioni che non è già registrato a norma del regolamento (UE) n. 648/2012 presenti contemporaneamente una domanda di registrazione a norma del regolamento (UE) n. 648/2012 e una domanda di registrazione a norma del regolamento (UE) 2015/2365, il repertorio di dati sulle negoziazioni paga la commissione di registrazione dovuta a norma del regolamento (UE) n. 648/2012 per intero e la commissione per l'estensione della registrazione a norma del paragrafo 5.

7. In caso di cambiamento sostanziale delle condizioni per la registrazione di cui all'articolo 5, paragrafo 4, del regolamento (UE) 2015/2365, in conseguenza del quale il repertorio di dati sulle negoziazioni sia tenuto, ai sensi dei paragrafi 3, 4 e 5, al pagamento di una commissione di registrazione più elevata della commissione di registrazione pagata inizialmente, il repertorio di dati sulle negoziazioni è tenuto a pagare la differenza fra la commissione di registrazione pagata inizialmente e la commissione di registrazione più elevata applicabile a seguito del cambiamento sostanziale.

#### Articolo 6

##### **Commissioni annuali di vigilanza per i repertori di dati sulle negoziazioni registrati e i repertori di dati sulle negoziazioni che hanno esteso la registrazione**

1. Il repertorio di dati sulle negoziazioni registrato è tenuto al pagamento di una commissione annuale di vigilanza.

2. La commissione annuale di vigilanza totale e la commissione annuale di vigilanza a carico di un dato repertorio di dati sulle negoziazioni per un determinato anno (n) sono calcolate come segue:

- a) la commissione annuale di vigilanza totale per un determinato anno (n) è la stima delle spese relative alle attività di vigilanza dei repertori di dati sulle negoziazioni a norma del regolamento (UE) 2015/2365, inserita nel bilancio dell'ESMA per il medesimo anno;
- b) la commissione annuale di vigilanza a carico di un dato repertorio di dati sulle negoziazioni per un determinato anno (n) è la commissione annuale di vigilanza totale calcolata in applicazione della lettera a), ripartita tra tutti i repertori di dati sulle negoziazioni registrati nell'anno (n - 1), in proporzione al loro fatturato applicabile calcolato a norma dell'articolo 2, paragrafo 3.

3. In nessun caso il repertorio di dati sulle negoziazioni che presenta domanda di registrazione o di estensione della registrazione ai sensi dell'articolo 5, paragrafo 5, del regolamento (UE) 2015/2365 può pagare una commissione annuale di vigilanza inferiore a 30 000 EUR.

#### *Articolo 7*

### **Commissioni a carico dei repertori di dati sulle negoziazioni di paesi terzi**

1. Il repertorio di dati sulle negoziazioni che presenta domanda di riconoscimento a norma dell'articolo 19, paragrafo 4, lettera a), del regolamento (UE) 2015/2365 è tenuto al pagamento di una commissione di riconoscimento calcolata sommando i seguenti elementi:

- a) 20 000 EUR;
- b) l'importo derivante dalla divisione di 35 000 EUR per il numero totale dei repertori di dati sulle negoziazioni dello stesso paese terzo riconosciuti dall'ESMA o che hanno presentato domanda di riconoscimento ma non sono stati ancora riconosciuti.

2. Il repertorio di dati sulle negoziazioni che presenta domanda di estensione della registrazione a norma dell'articolo 19, paragrafo 4, lettera b), del regolamento (UE) 2015/2365 è tenuto al pagamento di una commissione di riconoscimento calcolata sommando 10 000 EUR e l'importo calcolato conformemente al paragrafo 1, lettera b).

3. Il repertorio di dati sulle negoziazioni riconosciuto ai sensi dell'articolo 19, paragrafo 3, del regolamento (UE) 2015/2365 è tenuto al pagamento di una commissione annuale di vigilanza di 5 000 EUR.

#### CAPO III

### **MODALITÀ DI PAGAMENTO E DI RIMBORSO**

#### *Articolo 8*

### **Modalità generali di pagamento**

1. Tutte le commissioni sono pagate in euro. Le modalità di pagamento sono specificate agli articoli 9, 10 e 11.
2. I ritardi di pagamento comportano una penalità giornaliera pari allo 0,1 % dell'importo dovuto.

#### *Articolo 9*

### **Pagamento della commissione di registrazione**

1. La commissione di registrazione di cui all'articolo 5 è pagata per intero all'atto della presentazione della domanda di registrazione da parte del repertorio di dati sulle negoziazioni a norma dell'articolo 5, paragrafo 5, del regolamento (UE) 2015/2365.

2. La commissione di registrazione non viene rimborsata se il repertorio di dati sulle negoziazioni ritira la domanda di registrazione prima che l'ESMA abbia adottato la decisione motivata di registrazione o di rifiuto della registrazione, o in caso di rifiuto della registrazione.

#### *Articolo 10*

### **Pagamento della commissione annuale di vigilanza**

1. La commissione annuale di vigilanza di cui all'articolo 6 per un determinato anno è pagata in due rate.

La prima rata scade il 28 febbraio dell'anno in questione ed è pari a cinque sestimi della commissione annuale di vigilanza stimata. Se il fatturato applicabile, calcolato conformemente all'articolo 2, non è ancora noto in quel momento, il calcolo si basa sull'ultimo fatturato applicabile ai sensi dell'articolo 2 disponibile.

La seconda rata scade il 31 ottobre. L'importo della seconda rata è pari all'importo della commissione annuale di vigilanza calcolato conformemente all'articolo 6 meno l'importo della prima rata.

2. L'ESMA invia ai repertori di dati sulle negoziazioni le fatture relative alle rate almeno 30 giorni prima delle rispettive date di pagamento.

*Articolo 11***Pagamento delle commissioni a carico dei repertori di dati sulle negoziazioni di paesi terzi**

1. La commissione di riconoscimento di cui all'articolo 7, paragrafi 1 e 2, è pagabile per intero all'atto della presentazione della domanda di riconoscimento da parte del repertorio di dati sulle negoziazioni a norma dell'articolo 19, paragrafo 4, del regolamento (UE) 2015/2365. Non è rimborsata.
2. Ogni volta che riceve una nuova domanda di riconoscimento di un repertorio di dati sulle negoziazioni di un paese terzo a norma dell'articolo 19, paragrafo 4, del regolamento (UE) 2015/2365, l'ESMA ricalcola l'importo di cui all'articolo 7, paragrafo 1, lettera b).  
Ai repertori di dati sulle negoziazioni dello stesso paese terzo già riconosciuti l'ESMA rimborsa in parti uguali la differenza tra l'importo imposto ai sensi dell'articolo 7, paragrafo 1, lettera b), e l'importo risultante dal nuovo calcolo. La differenza è rimborsata mediante pagamento diretto o tramite la riduzione delle commissioni da pagare nell'anno successivo.
3. I repertori di dati sulle negoziazioni riconosciuti sono tenuti al pagamento della commissione annuale di vigilanza entro la fine di febbraio. L'ESMA invia la fattura al repertorio di dati sulle negoziazioni riconosciuto almeno 30 giorni prima di tale data.

*Articolo 12***Rimborso alle autorità competenti**

1. Soltanto l'ESMA impone ai repertori di dati sulle negoziazioni commissioni di registrazione, estensione della registrazione, vigilanza e riconoscimento a norma del presente regolamento.
2. L'ESMA rimborsa alle autorità competenti i costi effettivamente sostenuti per lo svolgimento dei compiti ai sensi del regolamento (UE) 2015/2365 e a seguito di deleghe di compiti ai sensi dell'articolo 74 del regolamento (UE) n. 648/2012 e conformemente all'articolo 9, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2015/2365.

## CAPO IV

**DISPOSIZIONI TRANSITORIE E FINALI***Articolo 13***Calcolo delle commissioni provvisorie di vigilanza**

1. Se l'obbligo di segnalazione di cui all'articolo 4, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2015/2365, conformemente all'articolo 33, paragrafo 2, lettera a), di detto regolamento, ha inizio nell'anno che segue la registrazione del repertorio di dati sulle negoziazioni a norma dell'articolo 5, paragrafo 5, del regolamento (UE) 2015/2365, il repertorio di dati sulle negoziazioni è tenuto, nell'anno della sua registrazione, al pagamento di una commissione provvisoria di vigilanza calcolata conformemente alla parte 1 dell'allegato.
2. Se l'obbligo di segnalazione di cui all'articolo 4, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2015/2365, conformemente all'articolo 33, paragrafo 2, lettera a), di detto regolamento, ha inizio nel primo semestre dell'anno di registrazione del repertorio di dati sulle negoziazioni a norma dell'articolo 5, paragrafo 5, del regolamento (UE) 2015/2365, il repertorio di dati sulle negoziazioni è tenuto, nell'anno della sua registrazione, al pagamento di una commissione provvisoria di vigilanza calcolata conformemente alla parte 2 dell'allegato.
3. Se l'obbligo di segnalazione di cui all'articolo 4, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2015/2365, conformemente all'articolo 33, paragrafo 2, lettera a), di detto regolamento, ha inizio nel secondo semestre dell'anno di registrazione del repertorio di dati sulle negoziazioni a norma dell'articolo 5, paragrafo 5, del regolamento (UE) 2015/2365, il repertorio di dati sulle negoziazioni è tenuto, nell'anno della sua registrazione, al pagamento di una commissione provvisoria di vigilanza calcolata conformemente alla parte 3 dell'allegato.

*Articolo 14***Pagamento delle commissioni di registrazione e delle commissioni per i repertori di dati sulle negoziazioni di paesi terzi nel 2019**

1. I repertori di dati sulle negoziazioni che presentano domanda di registrazione a norma dell'articolo 5, paragrafo 5, del regolamento (UE) 2015/2365 nel 2019 sono tenuti al pagamento integrale della commissione di registrazione di cui all'articolo 6 entro 30 giorni dall'entrata in vigore del presente regolamento o alla data di presentazione della domanda di registrazione, se successiva.
2. I repertori di dati sulle negoziazioni di paesi terzi che presentano domanda di riconoscimento a norma dell'articolo 19, paragrafo 4, del regolamento (UE) 2015/2365 nel 2019 sono tenuti al pagamento integrale della commissione di riconoscimento di cui all'articolo 7, paragrafo 1, o all'articolo 7, paragrafo 2, a seconda dei casi, entro 30 giorni dall'entrata in vigore del presente regolamento o alla data di presentazione della domanda, se successiva.

3. I repertori di dati sulle negoziazioni di paesi terzi riconosciuti nel 2019 a norma dell'articolo 19, paragrafo 3, del regolamento (UE) 2015/2365 sono tenuti, per il 2019, al pagamento integrale di una commissione annuale di vigilanza calcolata conformemente all'articolo 7, paragrafo 3, entro 60 giorni dall'entrata in vigore del presente regolamento o entro 30 giorni dalla data in cui l'ESMA informa il repertorio di dati sulle negoziazioni della decisione sul riconoscimento di cui all'articolo 19, paragrafo 7, del regolamento (UE) 2015/2365, se la seconda data è successiva.

#### Articolo 15

### **Commissione annuale di vigilanza per il 2020 a carico dei repertori di dati sulle negoziazioni registrati, o che hanno ottenuto un'estensione della registrazione, nel 2019**

1. La commissione di vigilanza a carico dei repertori di dati sulle negoziazioni per il 2020 è la commissione annuale di vigilanza totale calcolata in applicazione dell'articolo 6, paragrafo 2, lettera a), ripartita tra tutti i repertori di dati sulle negoziazioni registrati nel 2019, in proporzione al fatturato applicabile calcolato a norma del paragrafo 2.

2. Ai fini del calcolo della commissione annuale di vigilanza per il 2020 conformemente all'articolo 6 per i repertori di dati sulle negoziazioni registrati nel 2019 a norma dell'articolo 5, paragrafo 5, del regolamento (UE) 2015/2365, il fatturato applicabile del repertorio di dati sulle negoziazioni è pari alla somma dei seguenti elementi:

- i proventi generati dalle funzioni di base di raccolta e conservazione in modo centralizzato delle registrazioni sulle SFT durante il periodo dal 1° gennaio 2020 al 30 giugno 2020 e
- i proventi applicabili dei servizi accessori del repertorio di dati sulle negoziazioni in conformità dell'articolo 2, paragrafi 1 e 2, durante il periodo dal 1° gennaio 2020 al 30 giugno 2020,

divisa per la somma dei seguenti elementi:

- i proventi totali generati dalle funzioni di base di raccolta e conservazione in modo centralizzato delle registrazioni sulle SFT durante il periodo dal 1° gennaio 2020 al 30 giugno 2020 di tutti i repertori di dati sulle negoziazioni registrati e
- i proventi applicabili dei servizi accessori in conformità dell'articolo 2, paragrafi 1 e 2, durante il periodo dal 1° gennaio 2020 al 30 giugno 2020, di tutti i repertori di dati sulle negoziazioni registrati.

3. La commissione annuale di vigilanza per il 2020 a carico dei repertori di dati sulle negoziazioni registrati nel 2019 è pagata in due rate.

La prima rata scade il 28 febbraio 2020 e corrisponde alla commissione di registrazione pagata dal repertorio di dati sulle negoziazioni nel 2019 ai sensi dell'articolo 5.

La seconda rata scade il 31 ottobre 2020. L'importo della seconda rata è pari all'importo della commissione annuale di vigilanza calcolato conformemente al paragrafo 1 meno l'importo della prima rata.

Nel caso in cui l'importo della prima rata pagata dal repertorio di dati sulle negoziazioni sia superiore all'importo della commissione annuale di vigilanza calcolata conformemente al paragrafo 1, l'ESMA rimborsa al repertorio di dati sulle negoziazioni la differenza tra l'importo della prima rata pagata e l'importo della commissione annuale di vigilanza calcolato conformemente al paragrafo 1.

4. L'ESMA invia le fatture relative alle rate della commissione annuale di vigilanza per il 2020 ai repertori di dati sulle negoziazioni registrati nel 2019 almeno 30 giorni prima della data del pagamento.

5. Quando sono disponibili i conti 2020 sottoposti a revisione contabile, i repertori di dati sulle negoziazioni registrati nel 2019 comunicano all'ESMA eventuali variazioni del fatturato applicabile calcolato in conformità del paragrafo 2, dovute alla differenza tra i dati definitivi per il periodo dal 1° gennaio 2020 al 30 giugno 2020 e i dati provvisori utilizzati per il calcolo a norma del paragrafo 2.

I repertori di dati sulle negoziazioni sono tenuti a pagare la differenza fra la commissione annuale di vigilanza per il 2020 effettivamente pagata a norma del paragrafo 1 e la commissione annuale di vigilanza per il 2020 da pagare a seguito della variazione del fatturato applicabile di cui al primo comma.

L'ESMA invia ai repertori di dati sulle negoziazioni la fattura relativa agli eventuali pagamenti supplementari di cui al comma precedente almeno 30 giorni prima della rispettiva data di pagamento.

#### Articolo 16

### **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 13 dicembre 2018

*Per la Commissione*

*Il presidente*

Jean-Claude JUNCKER

---

## ALLEGATO

## COMMISSIONI PROVVISORIE PER IL PRIMO ANNO

**Parte 1**

*Commissione provvisoria di vigilanza per l'anno di registrazione di un repertorio di dati sulle negoziazioni laddove l'obbligo di segnalazione entri in vigore nell'anno successivo*

1. La commissione provvisoria di vigilanza applicata al repertorio di dati sulle negoziazioni è l'importo inferiore tra i seguenti:
  - a) la commissione di registrazione a carico del repertorio di dati sulle negoziazioni a norma dell'articolo 5 del presente regolamento;
  - b) la commissione di registrazione a carico del repertorio di dati sulle negoziazioni a norma dell'articolo 5 del presente regolamento moltiplicata per il rapporto tra i giorni lavorativi compresi tra la data di registrazione e la fine dell'anno e 150 giorni lavorativi.

Questo calcolo è effettuato come segue:

*Commissione provvisoria di vigilanza del rep. dati = Min (commissione di registrazione, commissione di registrazione \* coefficiente)*

$$\text{Coefficiente} = \frac{\text{giorni lavorativi di vigilanza nell'anno 1}}{150}$$

2. La commissione provvisoria di vigilanza è corrisposta per intero entro 60 giorni dall'entrata in vigore del presente regolamento o entro 30 giorni dalla notifica di cui all'articolo 8, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2015/2365, se la seconda data è posteriore.

**Parte 2**

*Commissione provvisoria di vigilanza per l'anno di registrazione di un repertorio di dati sulle negoziazioni laddove l'obbligo di segnalazione entri in vigore nei primi sei mesi dello stesso anno*

1. La commissione provvisoria di vigilanza a carico del repertorio di dati sulle negoziazioni è la commissione annuale di vigilanza totale calcolata in applicazione dell'articolo 6, paragrafo 2, lettera a), del presente regolamento ripartita tra tutti i repertori di dati sulle negoziazioni registrati in tale anno, in proporzione al fatturato applicabile calcolato a norma del paragrafo 2.
2. Ai fini del calcolo della commissione provvisoria di vigilanza il fatturato applicabile di un repertorio di dati sulle negoziazioni è pari alla somma di:
  - i proventi generati dalle funzioni di base di raccolta e conservazione in modo centralizzato delle registrazioni delle SFT nel periodo compreso tra il 1° gennaio e il 30 giugno dell'anno in cui il repertorio di dati sulle negoziazioni è stato registrato e
  - i proventi applicabili dei servizi accessori del repertorio di dati sulle negoziazioni in conformità dell'articolo 2, paragrafi 1 e 2, del presente regolamento, a seconda dei casi, nel periodo compreso tra il 1° gennaio e il 30 giugno dell'anno in cui il repertorio di dati sulle negoziazioni è stato registrato

diviso per i proventi totali generati dalle funzioni di base di raccolta e conservazione in modo centralizzato delle registrazioni delle SFT e i proventi applicabili dei servizi accessori di tutti i repertori di dati sulle negoziazioni registrati, in conformità dell'articolo 2, paragrafi 1 e 2, del presente regolamento, a seconda dei casi, nel periodo dal 1° gennaio al 30 giugno di quell'anno.

3. La commissione provvisoria di vigilanza è pagata in due rate.

La prima rata è corrisposta entro 30 giorni dalla notifica di cui all'articolo 8, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2015/2365 ed è pari all'importo della commissione di registrazione del repertorio di dati sulle negoziazioni in conformità dell'articolo 5 del presente regolamento.

La seconda rata scade il 31 ottobre. L'importo della seconda rata è pari all'importo della commissione provvisoria di vigilanza calcolato conformemente al paragrafo 1 meno l'importo della prima rata.

Nel caso in cui l'importo della prima rata pagata dal repertorio di dati sulle negoziazioni sia superiore all'importo della commissione provvisoria di vigilanza calcolata conformemente al paragrafo 1, l'ESMA rimborsa al repertorio di dati sulle negoziazioni la differenza tra l'importo della prima rata pagata e l'importo della commissione provvisoria di vigilanza calcolato conformemente al paragrafo 1.

4. Quando sono disponibili i conti sottoposti a revisione contabile dell'anno di registrazione, i repertori di dati sulle negoziazioni comunicano all'ESMA eventuali variazioni del fatturato applicabile calcolato a norma del paragrafo 1, dovute alla differenza tra i dati definitivi per il periodo dal 1° gennaio al 30 giugno e i dati provvisori utilizzati per il calcolo a norma del paragrafo 1.

I repertori di dati sulle negoziazioni sono tenuti a pagare la differenza fra la commissione annuale di vigilanza per l'anno di registrazione effettivamente pagata a norma del paragrafo 3 e la commissione annuale di vigilanza per l'anno di registrazione da pagare a seguito della variazione del fatturato applicabile di cui al primo comma.

5. Fatti salvi i paragrafi 1 e 4, la commissione provvisoria di vigilanza non è inferiore a 15 000 EUR.

### **Parte 3**

*Commissione provvisoria di vigilanza per l'anno di registrazione di un repertorio di dati sulle negoziazioni laddove l'obbligo di segnalazione entri in vigore negli ultimi sei mesi dello stesso anno*

1. La commissione provvisoria di vigilanza a carico del repertorio di dati sulle negoziazioni è la commissione di vigilanza totale calcolata in applicazione dell'articolo 6, paragrafo 2, lettera a), del presente regolamento, ripartita tra tutti i repertori di dati sulle negoziazioni in proporzione al rapporto tra la commissione di registrazione corrisposta all'ESMA dal repertorio di dati sulle negoziazioni e il totale di tutte le commissioni di registrazione corrisposte all'ESMA dai repertori di dati sulle negoziazioni nell'anno in questione.
  2. La commissione calcolata in applicazione del paragrafo 1 è corrisposta entro 30 giorni dalla notifica di cui all'articolo 8, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2015/2365.
-

**REGOLAMENTO DELEGATO (UE) 2019/361 DELLA COMMISSIONE****del 13 dicembre 2018****che modifica il regolamento delegato (UE) n. 151/2013 per quanto riguarda l'accesso ai dati in possesso dei repertori di dati sulle negoziazioni****(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'articolo 32, punto 3), del regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(2)</sup>, ha modificato l'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012 aggiungendo un certo numero di soggetti all'elenco dei soggetti ai quali i repertori di dati sulle negoziazioni devono fornire informazioni sui derivati per consentire loro di assolvere le responsabilità e i mandati rispettivi. Detti soggetti dovrebbero pertanto essere inclusi anche nel regolamento delegato (UE) n. 151/2013 della Commissione <sup>(3)</sup> specificando le informazioni e il livello di accesso ai dati sui derivati da fornire. È pertanto essenziale che i repertori di dati sulle negoziazioni siano in grado di individuare con precisione le controparti e le operazioni in questione. L'accesso fornito dai repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbe comprendere l'accesso ai dati sulle operazioni in derivati concluse da una controparte, a prescindere dal fatto che la controparte sia l'impresa madre o una filiazione di un'altra impresa, a condizione che l'accesso richiesto riguardi informazioni necessarie al soggetto interessato per assolvere le proprie responsabilità e i propri mandati.
- (2) Molti dei soggetti di cui all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012 hanno responsabilità e mandati numerosi e diversi. Al fine di evitare che i repertori di dati sulle negoziazioni debbano costantemente verificare sulla base di quale mandato e per quale specifica necessità un soggetto richiede l'accesso, e quindi evitare loro oneri amministrativi inutili, è opportuno consentire ai repertori di dati sulle negoziazioni di fornire a ciascun soggetto un accesso unico, che dovrebbe coprire le responsabilità e i mandati di ciascun soggetto.
- (3) L'accesso da parte dei soggetti di cui all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012 a tutti i dati sui derivati, compresi i dati sui derivati che non sono stati accettati dal repertorio di dati sulle negoziazioni e i dati a seguito dell'esecuzione del processo di riconciliazione dei derivati di cui all'articolo 19 del regolamento delegato (UE) n. 150/2013 della Commissione <sup>(4)</sup>, è della massima importanza per assicurare che detti soggetti siano in grado di assolvere le responsabilità e i mandati rispettivi.
- (4) Alcuni dei soggetti di cui all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012 sono responsabili della sorveglianza dei rischi sistemici per la stabilità finanziaria. Il corretto assolvimento dei loro compiti richiede che tali soggetti abbiano accesso alla più ampia gamma di partecipanti al mercato e di sedi di negoziazione e a dati sui derivati quanto più possibile completi e granulari disponibili per i rispettivi ambiti di responsabilità, che possono essere, a seconda del soggetto in questione, uno Stato membro, la zona euro o l'Unione.

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

<sup>(2)</sup> Regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 25 novembre 2015, sulla trasparenza delle operazioni di finanziamento tramite titoli e del riutilizzo e che modifica il regolamento (UE) n. 648/2012 (GUL 337 del 23.12.2015, pag. 1).

<sup>(3)</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>(4)</sup> Regolamento delegato (UE) n. 150/2013 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 i dettagli della domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni (GUL 52 del 23.2.2013, pag. 25).

- (5) In ragione dei legami tra derivati e politica monetaria, i membri del Sistema europeo di banche centrali (SEBC), di cui all'articolo 81, paragrafo 3, lettera g), del regolamento (UE) n. 648/2012, dovrebbero avere accesso ai dati sulle posizioni in derivati espressi nella valuta da essi emessa. I dati sulle posizioni dovrebbero includere dati sui derivati aggregati per criteri, tra cui il sottostante, il prodotto e la scadenza per singole controparti.
- (6) L'Autorità bancaria europea (ABE), l'Autorità europea delle assicurazioni e delle pensioni aziendali e professionali (EIOPA) e il Comitato europeo per il rischio sistemico (CERS) fanno parte del Sistema europeo di vigilanza finanziaria e hanno, in materia di stabilità finanziaria e rischio sistemico, mandati e responsabilità molto simili a quelli dell'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (ESMA). È pertanto importante che queste autorità abbiano, al pari dell'ESMA, accesso a tutti i dati sulle operazioni in derivati.
- (7) Il regolamento (UE) n. 1024/2013 del Consiglio <sup>(5)</sup> ha istituito il meccanismo di vigilanza unico. I repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero pertanto assicurare che la Banca centrale europea (BCE) abbia accesso a tutti i dati sulle operazioni in derivati concluse da controparti soggette, nell'ambito del meccanismo di vigilanza unico, alla vigilanza della BCE a norma del regolamento (UE) n. 1024/2013.
- (8) A norma della direttiva 2014/59/UE del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(6)</sup>, le autorità di risoluzione devono disporre di mezzi di intervento efficaci nei confronti delle entità di cui all'articolo 1, paragrafo 1, della stessa direttiva al fine di evitare il contagio. Ciascuna autorità di risoluzione dovrebbe pertanto avere accesso ai dati sulle operazioni in derivati comunicati dalle predette entità.
- (9) A norma del regolamento (UE) n. 806/2014 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(7)</sup>, il Comitato di risoluzione unico è responsabile del funzionamento efficace e coerente del meccanismo di risoluzione unico, tra l'altro mediante l'elaborazione di piani di risoluzione per le entità di cui all'articolo 2 del medesimo regolamento. Per consentire al Comitato di risoluzione unico di elaborare i piani di risoluzione, i repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero dare al Comitato l'accesso ai dati sulle operazioni in derivati concluse dalle controparti rientranti nell'ambito di applicazione del regolamento (UE) n. 806/2014.
- (10) Per consentire alle autorità di cui all'articolo 81, paragrafo 3, lettere o) e p), del regolamento (UE) n. 648/2012 di assolvere le responsabilità e i mandati rispettivi, esse dovrebbero avere accesso ai dati segnalati dalle controparti soggette alle loro responsabilità e ai loro mandati.
- (11) Il presente regolamento si basa sul progetto di norme tecniche di regolamentazione che l'ESMA ha presentato alla Commissione europea.
- (12) L'ESMA ha consultato le autorità competenti e i membri del SEBC, prima di presentare il progetto di norme tecniche di regolamentazione su cui si basa il presente regolamento. L'ESMA ha anche condotto consultazioni pubbliche aperte, 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 del regolamento (UE) n. 1095/2010 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(8)</sup>.
- (13) È pertanto opportuno modificare di conseguenza il regolamento delegato (UE) n. 151/2013 della Commissione,

<sup>(5)</sup> Regolamento (UE) n. 1024/2013 del Consiglio, del 15 ottobre 2013, che attribuisce alla Banca centrale europea compiti specifici in merito alle politiche in materia di vigilanza prudenziale degli enti creditizi (GU L 287 del 29.10.2013, pag. 63).

<sup>(6)</sup> Direttiva 2014/59/UE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 15 maggio 2014, che istituisce un quadro di risanamento e risoluzione degli enti creditizi e delle imprese di investimento e che modifica la direttiva 82/891/CEE del Consiglio, e le direttive 2001/24/CE, 2002/47/CE, 2004/25/CE, 2005/56/CE, 2007/36/CE, 2011/35/UE, 2012/30/UE e 2013/36/UE e i regolamenti (UE) n. 1093/2010 e (UE) n. 648/2012, del Parlamento europeo e del Consiglio (GU L 173 del 12.6.2014, pag. 190).

<sup>(7)</sup> Regolamento (UE) n. 806/2014 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 15 luglio 2014, che fissa norme e una procedura uniformi per la risoluzione degli enti creditizi e di talune imprese di investimento nel quadro del meccanismo di risoluzione unico e del Fondo di risoluzione unico e che modifica il regolamento (UE) n. 1093/2010 (GU L 225 del 30.7.2014, pag. 1).

<sup>(8)</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).

HA ADOTTATO IL PRESENTE REGOLAMENTO:

### Articolo 1

L'articolo 2 del regolamento delegato (UE) n. 151/2013 della Commissione è sostituito dal seguente:

#### «Articolo 2

#### **Accesso ai dati sui derivati conformemente alle responsabilità e al mandato di ciascuna autorità interessata**

1. Il repertorio di dati sulle negoziazioni provvede affinché i dati sulle operazioni in derivati messi a disposizione dei soggetti di cui all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012 a norma dei paragrafi da 3 a 17 del presente articolo comprendano i dati seguenti:

- a) le segnalazioni relative ai derivati segnalati in conformità delle tabelle 1 e 2 dell'allegato del regolamento delegato (UE) n. 148/2013 della Commissione (\*), compresi i dati più recenti sulle operazioni in derivati non ancora scaduti o che non sono stati oggetto di segnalazioni con tipo di azione «errore», «cessazione anticipata», «compressione» e «componente di posizione», di cui al campo 93 della tabella 2 dell'allegato dello stesso regolamento delegato;
- b) i dati pertinenti relativi alle segnalazioni di derivati respinte dal repertorio di dati sulle negoziazioni, comprese le segnalazioni sui derivati respinte durante il precedente giorno lavorativo e i motivi del rigetto;
- c) lo stato di riconciliazione di tutti i derivati segnalati per i quali il repertorio di dati sulle negoziazioni ha effettuato il processo di riconciliazione a norma dell'articolo 19 del regolamento delegato (UE) n. 150/2013 della Commissione.

2. Il repertorio di dati sulle negoziazioni mette a disposizione dei soggetti di cui all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012 che hanno diverse responsabilità o diversi mandati un punto di accesso unico ai derivati che ricadono nell'ambito delle loro responsabilità e mandati.

3. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dà all'Aesfem l'accesso a tutti i dati sulle operazioni in derivati per permetterle di esercitare le sue competenze conformemente alle sue responsabilità e ai suoi mandati.

4. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dà all'Autorità bancaria europea (ABE), all'Autorità europea delle assicurazioni e delle pensioni aziendali e professionali (EIOPA) e al Comitato europeo per il rischio sistemico (CERS) l'accesso a tutti i dati sulle operazioni in derivati.

5. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dà all'Agenzia per la cooperazione fra i regolatori nazionali dell'energia (ACER) l'accesso a tutti i dati sulle operazioni in derivati il cui sottostante è l'energia.

6. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dà alle autorità che esercitano la vigilanza sulle sedi di negoziazione l'accesso a tutti i dati sulle operazioni in derivati eseguite in tali sedi.

7. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dà all'autorità di vigilanza designata a norma dell'articolo 4 della direttiva 2004/25/CE l'accesso a tutti i dati sulle operazioni in derivati il cui sottostante è un titolo emesso da una società che soddisfa una o più delle seguenti condizioni:

- a) la società è ammessa alla negoziazione in un mercato regolamentato stabilito nello Stato membro dell'autorità e le offerte pubbliche di acquisto dei titoli della società rientrano nell'ambito delle responsabilità e dei mandati di vigilanza dell'autorità;
- b) la società ha la sede legale o la sede principale nello Stato membro dell'autorità e le offerte pubbliche di acquisto dei titoli della società ricadono nell'ambito delle responsabilità e dei mandati di vigilanza dell'autorità;
- c) la società è un offerente, ai sensi dell'articolo 2, paragrafo 1, lettera c), della direttiva 2004/25/CE, per le società di cui alle lettere a) e b), e il corrispettivo da essa offerto include titoli.

8. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dà alle autorità di cui all'articolo 81, paragrafo 3, lettera j), del regolamento (UE) n. 648/2012 l'accesso a tutti i dati sulle operazioni in derivati riguardanti mercati, contratti, sottostante, parametri di riferimento e controparti che ricadono nell'ambito delle responsabilità e dei mandati di vigilanza di tali autorità.

9. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dà ai membri del SEBC il cui Stato membro abbia come valuta l'euro l'accesso:

a) a tutti i dati sulle operazioni in derivati in cui il soggetto di riferimento del derivato è stabilito nello Stato membro del membro del SEBC o in uno Stato membro la cui moneta è l'euro e rientra nell'ambito di competenza del membro conformemente alle sue responsabilità e ai suoi mandati di vigilanza, o in cui l'obbligazione di riferimento è un titolo di debito sovrano dello Stato membro del membro del SEBC o di uno Stato membro la cui moneta è l'euro;

b) ai dati sulle posizioni per i contratti derivati in euro.

10. Il repertorio di dati sulle negoziazioni fornisce alle autorità, di cui all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012, incaricate della sorveglianza dei rischi sistemici per la stabilità finanziaria e il cui Stato membro ha come valuta l'euro l'accesso a tutti i dati su operazioni in derivati concluse in sedi di negoziazione o da controparti centrali e controparti che rientrano nell'ambito delle responsabilità e dei mandati di tale autorità ai fini della sorveglianza dei rischi sistemici per la stabilità finanziaria della zona euro.

11. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dà ai membri del SEBC il cui Stato membro non abbia come valuta l'euro l'accesso:

a) a tutti i dati sulle operazioni in derivati in cui il soggetto di riferimento del derivato è stabilito nello Stato membro del membro del SEBC e rientra nell'ambito di competenza di detto membro conformemente alle sue responsabilità e ai suoi mandati di vigilanza, o in cui l'obbligazione di riferimento è un titolo di debito sovrano dello Stato membro del membro del SEBC;

b) ai dati sulle posizioni in derivati nella valuta emessa dal membro del SEBC.

12. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dà alle autorità, di cui all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012, incaricate della sorveglianza dei rischi sistemici per la stabilità finanziaria e il cui Stato membro non ha come valuta l'euro l'accesso a tutti i dati sulle operazioni in derivati concluse in sedi di negoziazione o da controparti centrali e controparti che rientrano nell'ambito delle responsabilità e dei mandati di tali autorità ai fini della sorveglianza dei rischi sistemici per la stabilità finanziaria in uno Stato membro la cui valuta non è l'euro.

13. Il repertorio di dati dà alla BCE, per lo svolgimento dei compiti che le sono assegnati nell'ambito del meccanismo di vigilanza unico ai sensi del regolamento (UE) n. 1024/2013 del Consiglio, l'accesso a tutti i dati sulle operazioni in derivati concluse dalle controparti che, nell'ambito del meccanismo di vigilanza unico, sono soggette alla vigilanza della BCE a norma del regolamento (UE) n. 1024/2013 del Consiglio (\*\*).

14. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dà alle autorità competenti di cui all'articolo 81, paragrafo 3, lettere o) e p), del regolamento (UE) n. 648/2012 l'accesso a tutti i dati sulle operazioni in derivati concluse da tutte le controparti che rientrano nell'ambito delle responsabilità e dei mandati di tali autorità.

15. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dà alle autorità di risoluzione di cui all'articolo 81, paragrafo 3, lettera m), del regolamento (UE) n. 648/2012 l'accesso a tutti i dati sulle operazioni in derivati concluse da controparti che rientrano nell'ambito delle responsabilità e dei mandati di tali autorità.

16. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dà al Comitato di risoluzione unico l'accesso a tutti i dati sulle operazioni in derivati concluse da controparti che rientrano nell'ambito di applicazione del regolamento (UE) n. 806/2014.

17. Il repertorio di dati sulle negoziazioni dà all'autorità di vigilanza di una controparte centrale (CCP) e, ove applicabile, al pertinente membro del Sistema europeo di banche centrali (SEBC) che esercita la vigilanza sulla CCP, l'accesso a tutti i dati sulle operazioni in derivati compensate dalla CCP.

(\*) Regolamento delegato (UE) n. 148/2013 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 per precisare le informazioni minime da segnalare al repertorio di dati sulle negoziazioni (GU L 52 del 23.2.2013, pag. 1).

(\*\*) Regolamento (UE) n. 1024/2013 del Consiglio, del 15 ottobre 2013, che attribuisce alla Banca centrale europea compiti specifici in merito alle politiche in materia di vigilanza prudenziale degli enti creditizi (GU L 287 del 29.10.2013, pag. 63).»

## Articolo 2

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 13 dicembre 2018

*Per la Commissione*

*Il presidente*

Jean-Claude JUNCKER

---

**REGOLAMENTO DELEGATO (UE) 2019/362 DELLA COMMISSIONE****del 13 dicembre 2018****che modifica il regolamento delegato (UE) n. 150/2013 della Commissione per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione che specificano i dettagli della domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni****(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 56, paragrafo 3,

considerando quanto segue:

- (1) L'esperienza acquisita nell'applicazione del regolamento delegato (UE) n. 150/2013 della Commissione <sup>(2)</sup> ha dimostrato che le disposizioni del regolamento (UE) n. 648/2012 relative alla registrazione dei repertori di dati sulle negoziazioni costituiscono una base solida per la creazione di un quadro per la registrazione dei repertori di dati sulle negoziazioni. Al fine di rafforzare ulteriormente tale quadro, il regolamento (UE) n. 150/2013 dovrebbe riepescchiare la natura evolutiva del settore.
- (2) La creazione di un quadro coerente per la registrazione e l'estensione della registrazione dei repertori di dati sulle negoziazioni ai sensi sia del regolamento (UE) n. 648/2012 che del regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(3)</sup> è essenziale per garantire condizioni di parità tra repertori di dati sulle negoziazioni e l'efficiente svolgimento delle funzioni di repertorio.
- (3) La funzione di verifica dei repertori di dati sulle negoziazioni è di primaria importanza per la trasparenza dei mercati dei derivati e per garantire la qualità dei dati. I repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero pertanto dimostrare di aver predisposto sistemi e procedure appropriati per verificare la completezza e la correttezza dei dati sui contratti derivati. Tali sistemi e procedure dovrebbero pertanto essere ulteriormente precisati al fine di rafforzare il quadro in materia di registrazione. Dovrebbero stabilire in che modo i repertori di dati devono autenticare gli utenti, convalidare lo schema dei dati, autorizzare la registrazione dei dati, convalidare la logica e il contenuto dei dati, riconciliare i dati sui derivati e inviare un riscontro ai loro utenti.
- (4) Le domande di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni dovrebbero includere informazioni più dettagliate sui pertinenti meccanismi e strutture di controllo interno, sulla funzione di audit interno e sul piano di lavoro di audit, per consentire all'ESMA di valutare in che modo tali fattori contribuiscono all'efficiente funzionamento del repertorio di dati sulle negoziazioni.
- (5) Per consentire all'ESMA di valutare meglio l'onorabilità, l'esperienza e le competenze dei membri del consiglio di amministrazione, dell'alta dirigenza e del pertinente personale di grado superiore del repertorio di dati richiedente, quest'ultimo dovrebbe fornire informazioni supplementari su tali persone, comprese informazioni in merito alle loro conoscenze ed esperienze nella gestione, nelle operazioni e nello sviluppo delle tecnologie informatiche.
- (6) L'utilizzo di risorse comuni all'interno del repertorio di dati sulle negoziazioni per i servizi di segnalazione dei derivati, da un lato, e per i servizi accessori o per i servizi di segnalazione delle operazioni di finanziamento tramite titoli, dall'altro, può dar luogo a un contagio dei rischi operativi tra tali servizi. La convalida, la riconciliazione, il trattamento e la conservazione dei dati possono necessitare di un'effettiva separazione operativa per evitare tale contagio dei rischi. Tuttavia, talune pratiche, come un *front-end* comune dei sistemi, un punto di

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

<sup>(2)</sup> Regolamento delegato (UE) n. 150/2013 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 i dettagli della domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni (GUL 52 del 23.2.2013, pag. 25).

<sup>(3)</sup> Regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 25 novembre 2015, sulla trasparenza delle operazioni di finanziamento tramite titoli e del riutilizzo e che modifica il regolamento (UE) n. 648/2012 (GUL 337 del 23.12.2015, pag. 1).

accesso comune ai dati per le autorità o l'utilizzo dello stesso personale per vendite, conformità o servizi di assistenza ai clienti, potrebbero essere meno esposte al rischio di contagio e, di conseguenza, potrebbero non richiedere necessariamente una separazione operativa. I repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero pertanto stabilire un livello adeguato di separazione operativa tra le risorse, i sistemi e le procedure utilizzati nelle diverse linee di attività. Tale separazione dovrebbe contemplare linee di attività che prestano servizi soggetti ad altra normativa dell'Unione o di paesi terzi. Dovrebbe inoltre garantire che la domanda di registrazione contenga informazioni chiare e dettagliate sui servizi accessori o su altre linee di attività offerte dal repertorio di dati sulle negoziazioni al di fuori della sua attività principale di servizi di repertorio a norma del regolamento (UE) n. 648/2012.

- (7) La solidità, la resilienza e la protezione dei sistemi informatici dei repertori di dati sulle negoziazioni sono essenziali per assicurare la conformità agli obiettivi del regolamento (UE) n. 648/2012. Pertanto, i repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero fornire informazioni complete e più dettagliate su tali sistemi così da permettere all'ESMA di valutare la solidità e la resilienza dei loro sistemi informatici. Se lo svolgimento delle funzioni di repertorio di dati sulle negoziazioni è esternalizzato a terzi, a livello del gruppo o al di fuori di esso, il repertorio dovrebbe fornire informazioni dettagliate sui pertinenti accordi di esternalizzazione per consentire all'ESMA di valutarne la conformità alle condizioni di registrazione, ivi comprese informazioni su eventuali accordi sul livello dei servizi, sulle metriche e sulle modalità di controllo effettivo di tali metriche. Infine, i repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero fornire informazioni sui meccanismi e i controlli messi a punto per gestire efficacemente i potenziali rischi informatici e proteggere i dati da attacchi informatici.
- (8) Per conseguire meglio gli obiettivi del regolamento (UE) n. 648/2012 per quanto riguarda la trasparenza del mercato dei derivati, i repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero dimostrare di applicare i termini e le condizioni di accesso ai dati contenuti nei repertori di dati sulle negoziazioni ai sensi del regolamento delegato (UE) n. 151/2013 della Commissione (\*). Tali termini e condizioni dovrebbero garantire l'integrità dei dati forniti alle autorità e che i repertori di dati sulle negoziazioni siano in grado di fornire l'accesso ai dati in conformità del regolamento delegato (UE) n. 151/2013. La domanda di registrazione dovrebbe pertanto precisare le politiche e le procedure in conformità delle quali i diversi tipi di utenti segnalano i dati al repertorio di dati sulle negoziazioni e vi accedono. Per lo stesso motivo, la domanda di registrazione dovrebbe contenere una descrizione dei canali e dei meccanismi usati per divulgare pubblicamente le informazioni sulle norme di accesso ai dati contenuti nel repertorio di dati sulle negoziazioni. I repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero inoltre fornire informazioni più dettagliate sulle loro procedure per verificare la completezza e la correttezza dei dati.
- (9) Le commissioni associate ai servizi prestati dai repertori di dati sulle negoziazioni costituiscono informazioni essenziali per permettere ai partecipanti al mercato di scegliere con cognizione di causa. Dovrebbero pertanto essere inserite nella domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni.
- (10) Per consentire all'ESMA di stabilire la base di riferimento per la pianificazione della capacità e delle prestazioni dei repertori di dati sulle negoziazioni, le domande di registrazione dovrebbero contenere informazioni che dimostrino che il repertorio richiedente dispone delle risorse finanziarie necessarie per l'esercizio delle sue funzioni come repertorio di dati sulle negoziazioni su base continuativa. Per lo stesso motivo, la domanda di registrazione dovrebbe contenere meccanismi efficaci per assicurare la continuità operativa. In particolare, i repertori di dati sulle negoziazioni dovrebbero fornire informazioni in merito ai piani, alle procedure e ai dispositivi per la gestione delle situazioni di emergenza e delle crisi, comprese le procedure per assicurare la sostituzione regolare del repertorio di dati sulle negoziazioni originale qualora la registrazione sia revocata o una controparte segnalante decida di segnalare a un altro repertorio di dati sulle negoziazioni.
- (11) Poiché i partecipanti al mercato e le autorità fanno affidamento sui dati conservati dai repertori di dati sulle negoziazioni, è opportuno che la domanda di registrazione del repertorio di dati sulle negoziazioni descriva chiaramente meccanismi operativi e di conservazione dei dati che dovrebbero essere rigorosi ed efficaci. Per dimostrare in che modo sia mantenuta la riservatezza e assicurata la protezione dei dati conservati dal repertorio di dati sulle negoziazioni e per consentirne la tracciabilità, nella domanda di registrazione dovrebbe essere inserito un riferimento specifico alla creazione di un log di segnalazione.
- (12) Il presente regolamento si basa sui progetti di norme tecniche di regolamentazione che l'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (ESMA) ha presentato alla Commissione europea conformemente alla procedura di cui all'articolo 10 del regolamento (UE) n. 1095/2010 del Parlamento europeo e del Consiglio (†).

(\*) 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).

(†) 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 (GUL 331 del 15.12.2010, pag. 84).

- (13) L'ESMA ha effettuato consultazioni pubbliche aperte sui 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 degli strumenti finanziari e dei mercati istituito dall'articolo 37 del regolamento (UE) n. 1095/2010.
- (14) È pertanto opportuno modificare di conseguenza il regolamento delegato (UE) n. 150/2013,

HA ADOTTATO IL PRESENTE REGOLAMENTO:

#### Articolo 1

### Modifiche del regolamento delegato (UE) n. 150/2013

(1) All'articolo 1, il paragrafo 2 è sostituito dal seguente:

«2. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene in particolare le seguenti informazioni:

- a) la denominazione sociale del richiedente e l'indirizzo della sede legale nell'Unione;
- b) un estratto del registro delle imprese o del registro del tribunale, o qualsiasi altra prova certificata della sede di costituzione e dell'ambito di attività del richiedente, valido alla data in cui è stata presentata la domanda;
- c) informazioni sulle categorie di derivati per le quali il richiedente presenta domanda di registrazione;
- d) informazioni sull'esistenza di un'eventuale autorizzazione o registrazione del richiedente concessa dall'autorità competente nello Stato membro in cui è stabilito e, in tal caso, il nome dell'autorità competente e l'eventuale numero di riferimento relativo all'autorizzazione o alla registrazione;
- e) gli atti costitutivi del richiedente e, se del caso, ogni altra documentazione di legge attestante che il richiedente presterà servizi di repertorio di dati sulle negoziazioni;
- f) i verbali della riunione in cui il consiglio del richiedente ha approvato la domanda;
- g) il nominativo e i recapiti delle persone responsabili della conformità o di ogni altro membro del personale addetto alla valutazione della conformità per il richiedente;
- h) il programma delle operazioni, comprendente l'indicazione dell'ubicazione delle principali attività;
- i) l'identificazione di eventuali filiazioni e, se del caso, la struttura del gruppo;
- j) i servizi diversi da quelli legati alla funzione di repertorio che il richiedente fornisce o intende fornire;
- k) informazioni su procedure in corso giudiziarie, amministrative, di arbitrato o di contenzioso, indipendentemente dal tipo, riguardanti il richiedente, in particolare per quanto riguarda questioni di fiscalità e di insolvenza, suscettibili di comportare significativi costi finanziari e in termini di reputazione, o procedimenti conclusi, che potrebbero ancora avere ripercussioni significative sui costi del repertorio.»;

(2) l'articolo 2 è sostituito dal seguente:

«Articolo 2

#### Politiche e procedure

Se nell'ambito di una domanda sono fornite informazioni concernenti le politiche e le procedure, il richiedente assicura che la domanda contenga i seguenti elementi:

- a) l'indicazione che il consiglio approva le politiche e che l'alta dirigenza approva le procedure ed è responsabile dell'attuazione e dell'aggiornamento delle politiche e delle procedure;
- b) la descrizione del modo in cui è organizzata la comunicazione delle politiche e delle procedure all'interno del richiedente e del modo in cui sarà assicurata e controllata giornalmente la conformità alle politiche e procedure e la persona o le persone responsabili della conformità a questo riguardo;
- c) i dati indicanti che i dipendenti e il personale dedicato sono a conoscenza delle politiche e delle procedure;

- d) la descrizione delle misure da adottare in caso di violazione delle politiche e delle procedure;
- e) l'indicazione della procedura per segnalare all'Aesfem le violazioni rilevanti di politiche o procedure, tali da comportare una violazione delle condizioni previste per la registrazione iniziale.»;
- (3) all'articolo 3, il paragrafo 2 è sostituito dal seguente:
- «2. Se il richiedente ha un'impresa madre, esso deve:
- a) indicare l'indirizzo della sede legale dell'impresa madre;
- b) indicare se l'impresa madre è autorizzata o registrata e soggetta a vigilanza e, in caso affermativo, comunicare ogni numero di riferimento utile e la denominazione dell'autorità di vigilanza responsabile.»;
- (4) l'articolo 7 è sostituito dal seguente:

«Articolo 7

### **Controllo interno**

1. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene informazioni dettagliate relative al sistema di controllo interno del richiedente, comprese le informazioni sulla funzione di controllo della conformità, la valutazione del rischio, i meccanismi e i dispositivi di controllo interno e la funzione di audit interno.
2. Le informazioni dettagliate di cui al paragrafo 1 comprendono:
- a) le politiche di controllo interno del richiedente e le relative procedure connesse alla loro applicazione coerente ed efficace;
- b) le politiche, le procedure e i manuali relativi alla sorveglianza e alla valutazione dell'adeguatezza e dell'efficacia dei sistemi del richiedente;
- c) le politiche, le procedure e i manuali relativi al controllo e alla protezione dei sistemi di trattamento delle informazioni del richiedente;
- d) l'identità degli organi interni incaricati della valutazione dei risultati dei controlli interni pertinenti.
3. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le seguenti informazioni relative alle attività di audit interno del richiedente:
- a) la composizione dell'eventuale comitato di audit interno, le sue competenze e responsabilità;
- b) la carta, le metodologie, le norme e le procedure della funzione di audit interno;
- c) la modalità di elaborazione e applicazione della carta, della metodologia e delle procedure di audit interno, tenuto conto della natura e della portata delle attività del richiedente, della loro complessità e dei relativi rischi;
- d) il piano di lavoro per i tre anni successivi alla data della domanda per quanto riguarda la natura e la portata delle attività del richiedente, la loro complessità e i relativi rischi.»;
- (5) l'articolo 9 è sostituito dal seguente:

«Articolo 9

### **Alta dirigenza e membri del consiglio**

1. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le seguenti informazioni per ogni alto dirigente e per ogni membro del consiglio:
- a) una copia del curriculum vitae;
- b) informazioni dettagliate sulle conoscenze e le esperienze nella gestione, nelle operazioni e nello sviluppo delle tecnologie informatiche;
- c) informazioni relative a eventuali condanne penali per atti connessi alla fornitura di servizi finanziari o di gestione dati o per frode o appropriazione indebita, in particolare mediante documenti ufficiali, se disponibili nello Stato membro;

- d) un'autodichiarazione in merito all'onorabilità in relazione alla prestazione di servizi finanziari o di gestione di dati, in cui ogni membro dell'alta dirigenza o del consiglio dichiara se:
- i) è stato condannato per reati connessi alla prestazione di servizi finanziari o di gestione dati o per frode o appropriazione indebita;
  - ii) è stato condannato in procedimenti disciplinari avviati nei suoi confronti da autorità di regolamentazione o da organismi o agenzie pubblici o è oggetto di un tale procedimento non ancora concluso;
  - iii) è stato condannato in un procedimento civile dinanzi al giudice connesso alla prestazione di servizi finanziari o di gestione di dati, o per irregolarità o frode nella gestione di un'impresa;
  - iv) è Stato membro del consiglio o alto dirigente di un'impresa la cui registrazione o autorizzazione è stata revocata da un organismo di regolamentazione;
  - v) gli è stato rifiutato il diritto di svolgere attività che richiedono la registrazione o l'autorizzazione da parte di un organismo di regolamentazione;
  - vi) ha fatto parte del consiglio o dell'alta dirigenza di un'impresa che sia divenuta insolvente o sia stata posta in liquidazione mentre la persona in questione aveva ancora legami con l'impresa, oppure entro un anno dalla cessazione dei legami della persona con l'impresa;
  - vii) è Stato membro del consiglio o alto dirigente di un'impresa condannata o sanzionata da un organismo di regolamentazione;
  - viii) è stato altrimenti multato, sospeso, interdetto o soggetto ad altra sanzione per frode, appropriazione indebita o in connessione alla prestazione di servizi finanziari o di gestione di dati, da parte di un'amministrazione o di un organismo di regolamentazione o professionale;
  - ix) è stato interdetto dalla funzione di amministratore o dal ruolo di dirigente, licenziato o rimosso da qualsiasi altro incarico in un'impresa in seguito a condotta scorretta o irregolarità;
- e) una dichiarazione in merito a potenziali conflitti di interesse che l'alta dirigenza e i membri del consiglio possono avere nell'esercizio delle loro funzioni e le modalità di gestione di tali conflitti.;

(6) l'articolo 11 è sostituito dal seguente:

«*Articolo 11*

### **Idoneità e onorabilità**

La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le seguenti informazioni sul personale del richiedente:

- a) l'elenco generale del personale direttamente impiegato dal repertorio di dati sulle negoziazioni, comprensivo di funzioni e qualifiche;
- b) la descrizione specifica del personale informatico direttamente impiegato addetto alla prestazione dei servizi di repertorio di dati sulle negoziazioni, comprensiva delle funzioni e delle qualifiche di ogni dipendente;
- c) la descrizione delle funzioni e delle qualifiche di ogni persona responsabile dell'audit interno, dei controlli interni, del controllo della conformità e della valutazione del rischio;
- d) l'identità dei membri del personale dedicato e dei membri del personale che operano nel quadro di un accordo di esternalizzazione;
- e) informazioni riguardanti la formazione sulle politiche e le procedure del richiedente nonché sulle attività del repertorio di dati sulle negoziazioni, compresi eventuali esami o altro tipo di valutazione formale richiesti al personale per lo svolgimento delle attività di repertorio.

La descrizione di cui alla lettera b) include prove scritte del diploma accademico e dell'esperienza nell'ambito delle tecnologie informatiche di almeno un membro del personale di grado superiore competente in materia.»;

(7) l'articolo 12 è sostituito dal seguente:

«*Articolo 12*

### **Documenti finanziari e piani aziendali**

1. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le seguenti informazioni finanziarie e aziendali sul richiedente:

- a) un bilancio di esercizio completo, redatto conformemente ai principi internazionali adottati ai sensi dell'articolo 3 del regolamento (CE) n. 1606/2002 del Parlamento europeo e del Consiglio (\*);
- b) se il bilancio del richiedente è soggetto alla revisione legale dei conti ai sensi dell'articolo 2, punto 1, della direttiva 2006/43/CE del Parlamento europeo e del Consiglio (\*\*), i documenti finanziari comprendono la relazione di revisione del bilancio di esercizio e del bilancio consolidato;
- c) se il richiedente è sottoposto a revisione dei conti, il nome e il numero di registrazione nazionale del revisore esterno.

2. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene un piano finanziario aziendale che contenga scenari economici diversi per i servizi di repertorio di dati sulle negoziazioni per un periodo di riferimento minimo di tre anni e le seguenti informazioni supplementari:

- a) il livello previsto di attività di segnalazione espresso in numero di operazioni;
- b) i costi fissi e variabili pertinenti individuati in relazione alla prestazione di servizi di repertorio di dati sulle negoziazioni ai sensi del regolamento (UE) n. 648/2012;
- c) le variazioni positive e negative pari almeno al 20 % rispetto allo scenario di attività di base identificato.

3. Se le informazioni finanziarie storiche di cui al paragrafo 1 non sono disponibili, la domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le seguenti informazioni sul richiedente:

- a) la dichiarazione pro forma attestante la disponibilità di risorse adeguate e la situazione attesa dell'impresa sei mesi dopo la concessione della registrazione;
- b) il bilancio intermedio, qualora il bilancio di esercizio non sia ancora disponibile per il periodo richiesto;
- c) il prospetto della situazione patrimoniale-finanziaria, quale lo stato patrimoniale, il conto economico, variazioni del patrimonio netto e dei flussi finanziari e le note comprensive di una sintesi delle politiche contabili e altre note esplicative.

4. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene il bilancio di esercizio sottoposto a revisione dell'impresa madre dei tre esercizi anteriori alla data di presentazione della domanda.

5. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene anche le seguenti informazioni finanziarie sul richiedente:

- a) l'indicazione dei piani futuri per la costituzione di filiazioni e la loro ubicazione;
- b) la descrizione dell'attività economica che il richiedente si propone di svolgere, specificando le attività delle filiazioni o delle succursali.

(\*) Regolamento (CE) n. 1606/2002 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 19 luglio 2002, relativo all'applicazione di principi contabili internazionali (GU L 243 dell'11.9.2002, pag. 1).

(\*\*) Direttiva 2006/43/CE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 17 maggio 2006, relativa alle revisioni legali dei conti annuali e dei conti consolidati (GU L 157 del 9.6.2006, pag. 87).»;

(8) l'articolo 14 è sostituito dal seguente:

«*Articolo 14*

### **Riservatezza**

1. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le politiche, le procedure e i meccanismi interni per prevenire ogni eventuale uso delle informazioni conservate dal repertorio di dati sulle negoziazioni richiedente:

- a) per scopi illegittimi;
- b) per divulgazione di informazioni riservate;
- c) per scopi commerciali non ammessi.

2. Le politiche, le procedure e i meccanismi interni comprendono le procedure interne in materia di autorizzazione del personale all'uso di parole di accesso ai dati, specificando lo scopo, l'entità dei dati visualizzati e le restrizioni sull'uso dei dati, nonché informazioni dettagliate su eventuali meccanismi e controlli per gestire efficacemente i potenziali rischi informatici e proteggere i dati conservati dagli attacchi informatici.

3. I richiedenti forniscono all'Aesfem informazioni sulle procedure di tenuta di un *log* che consenta di identificare ogni membro del personale che accede ai dati, il momento dell'accesso, la natura dei dati visualizzati e lo scopo.»;

(9) l'articolo 16 è sostituito dal seguente:

«Articolo 16

#### **Risorse informatiche ed esternalizzazione**

La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le seguenti informazioni sulle risorse informatiche:

- a) la descrizione dettagliata del sistema informatico, compresi i pertinenti requisiti commerciali, delle specifiche funzionali e tecniche, dell'architettura e della progettazione tecnica del sistema, del modello e dei flussi di dati e delle operazioni, nonché le procedure amministrative e i manuali;
- b) i dispositivi d'utente messi a punto dal richiedente per fornire servizi agli utenti pertinenti, ivi compresa una copia di ogni manuale d'uso e delle procedure interne;
- c) le politiche seguite dal richiedente in materia di investimenti in risorse informatiche e nel loro rinnovo;
- d) gli accordi di esternalizzazione conclusi dal richiedente, ivi compresi:
  - i) la definizione dettagliata dei servizi da fornire, compresa la portata misurabile di tali servizi, la granularità delle attività, nonché le condizioni alle quali tali attività vengono prestate e il loro calendario;
  - ii) gli accordi sul livello dei servizi, con funzioni e responsabilità chiare, metriche e obiettivi per ogni requisito fondamentale esternalizzato del repertorio di dati sulle negoziazioni, i metodi utilizzati per monitorare il livello dei servizi delle funzioni esternalizzate, nonché le misure o le azioni da intraprendere qualora non sia raggiunto l'obiettivo in materia di livello dei servizi;
  - iii) una copia dei contratti che disciplinano tali accordi.»;

(10) l'articolo 17 è sostituito dal seguente:

«Articolo 17

#### **Servizi accessori**

Se un richiedente, un'impresa in seno al suo gruppo o un'impresa con cui il richiedente ha concluso un accordo relativo ai servizi di negoziazione o di post-negoziazione offre, o ha in progetto di offrire, servizi accessori, la domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le seguenti informazioni:

- a) la descrizione dei servizi ausiliari che il richiedente, o l'impresa in seno al suo gruppo, presta e la descrizione degli accordi che il repertorio di dati sulle negoziazioni ha con le imprese che offrono servizi di negoziazione, di post-negoziazione o altri servizi connessi, nonché una copia di tali accordi;
- b) le procedure e le politiche per garantire il livello necessario di separazione operativa in termini di risorse, sistemi e procedure tra i servizi di repertorio di dati sulle negoziazioni del richiedente nel quadro del regolamento (UE) n. 648/2012 e altre linee di attività, anche nel caso di linee di attività che includono la prestazione di servizi nel quadro della normativa dell'Unione o di un paese terzo, indipendentemente dal fatto che tale linea di attività separata sia gestita dal repertorio di dati sulle negoziazioni, da un'impresa appartenente alla sua impresa madre o da qualsiasi altra impresa con cui ha concluso un accordo nel quadro della catena o della linea di attività relativa alla negoziazione o post-negoziazione.»;

(11) gli articoli 18, 19 e 20 sono sostituiti dai seguenti:

«Articolo 18

#### **Trasparenza delle regole di accesso**

1. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le seguenti informazioni:

- a) le politiche e le procedure in conformità delle quali i diversi tipi di utenti segnalano i dati al repertorio di dati sulle negoziazioni e vi accedono, compresi i processi necessari agli utenti per accedere alle informazioni conservate dai repertori di dati sulle negoziazioni, consultarle o modificarle;

- b) una copia dei termini e delle condizioni che determinano i diritti e le obbligazioni dei diversi tipi di utenti in relazione alle informazioni conservate dal repertorio di dati sulle negoziazioni;
  - c) una descrizione delle diverse categorie di accesso a disposizione degli utenti;
  - d) le politiche e le procedure in materia di accesso in conformità delle quali altri fornitori di servizi possono avere accesso non discriminatorio alle informazioni conservate dal repertorio di dati sulle negoziazioni, previo consenso scritto, volontario e revocabile delle controparti interessate;
  - e) la descrizione dei canali e dei meccanismi usati dal repertorio di dati sulle negoziazioni per divulgare pubblicamente le informazioni sull'accesso.
2. Le informazioni di cui al paragrafo 1, lettere a), b) e c), sono specificate per i seguenti tipi di utenti:
- a) utenti interni;
  - b) controparti segnalanti;
  - c) soggetti incaricati della segnalazione;
  - d) soggetti responsabili della segnalazione;
  - e) controparti non segnalanti;
  - f) terzi non segnalanti;
  - g) soggetti di cui all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012;
  - h) altri tipi di utenti, se del caso.

#### Articolo 19

##### **Verifica della completezza e della correttezza dei dati**

La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le seguenti informazioni:

- a) le procedure di autenticazione dell'identità degli utenti che accedono al repertorio di dati sulle negoziazioni;
- b) le procedure per verificare la completezza e la correttezza dei dati sui derivati segnalati al repertorio di dati sulle negoziazioni;
- c) le procedure per verificare l'autorizzazione e il permesso IT del soggetto che effettua la segnalazione per conto della controparte segnalante;
- d) le procedure per verificare che sia mantenuta in ogni momento la sequenza logica dei dati sui derivati segnalati;
- e) le procedure per verificare la completezza e la correttezza dei dati sui derivati segnalati;
- f) le procedure per la riconciliazione dei dati tra repertori di dati sulle negoziazioni quando le controparti segnalano le informazioni a repertori di dati sulle negoziazioni diversi;
- g) le procedure per l'invio di un riscontro alle controparti dei derivati o a terzi che segnalano per loro conto sulle verifiche effettuate a norma delle lettere da a) a e) e sui risultati del processo di riconciliazione di cui alla lettera f).

#### Articolo 20

##### **Trasparenza sulle politiche tariffarie**

La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene la descrizione:

- a) della politica tariffaria del richiedente, compresi eventuali sconti e riduzioni e le condizioni per beneficiarne;
- b) della struttura tariffaria del richiedente per la fornitura dei servizi di repertorio di dati sulle negoziazioni e dei servizi accessori, ivi compresi il costo stimato di tali servizi, e dei metodi utilizzati per contabilizzare separatamente i costi che il richiedente sostiene per la fornitura dei servizi di dati sulle negoziazioni e dei servizi accessori;
- c) dei metodi utilizzati per mettere le informazioni a disposizione di tutti i tipi di utenti, ivi compresa una copia della struttura tariffaria in cui i servizi di repertorio dei dati sulle negoziazioni e i servizi accessori sono separati.»;

(12) l'articolo 21 è sostituito dal seguente:

«*Articolo 21*

### **Rischio operativo**

1. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene:
  - a) la descrizione dettagliata delle risorse disponibili e delle procedure miranti a individuare e ridurre il rischio operativo e qualsiasi altro rischio rilevante cui il richiedente sia esposto, ivi compresa una copia di politiche, metodologie, procedure interne e manuali pertinenti;
  - b) la descrizione delle attività liquide nette finanziate da capitale proprio per la copertura di potenziali perdite economiche di natura generale al fine di continuare a fornire i servizi in condizioni normali e una valutazione dell'adeguatezza delle sue risorse finanziarie, al fine di coprire i costi operativi di una liquidazione o riorganizzazione delle operazioni e dei servizi critici per un periodo di almeno sei mesi;
  - c) il piano di continuità operativa del richiedente e la descrizione delle modalità per aggiornarlo, tra cui i seguenti elementi:
    - i) tutti i processi aziendali, le risorse, le procedure di attivazione di livelli successivi di intervento e i relativi sistemi aventi importanza critica per garantire i servizi del repertorio di dati sulle negoziazioni richiedente, ivi compresi i pertinenti servizi esternalizzati e la strategia, la politica e gli obiettivi del repertorio per garantire la continuità dei processi;
    - ii) gli accordi in vigore con altri fornitori di infrastrutture del mercato finanziario, ivi compresi altri repertori di dati sulle negoziazioni;
    - iii) le modalità per garantire un livello minimo di servizio delle funzioni principali e la tempistica prevista per il pieno ripristino dei processi;
    - iv) il tempo di ripristino massimo accettabile dei processi e dei sistemi aziendali, tenendo conto dei termini per la segnalazione ai repertori di dati sulle negoziazioni di cui all'articolo 9, paragrafo 1, del regolamento (UE) n. 648/2012 e del volume di dati che il repertorio di dati sulle negoziazioni deve trattare entro il periodo giornaliero;
    - v) le procedure di gestione del rilevamento e della registrazione degli incidenti e delle revisioni;
    - vi) il programma di prove e i relativi risultati;
    - vii) il numero di siti tecnici e operativi alternativi disponibili, la loro ubicazione, le risorse di cui dispongono rispetto al sito principale e le procedure di continuità operativa in vigore qualora si renda necessario l'uso dei siti alternativi;
    - viii) informazioni sull'accesso a un sito di attività secondario per consentire al personale di garantire la continuità del servizio, qualora la sede principale non sia disponibile;
    - ix) i piani, le procedure e i dispositivi per gestire le situazioni di emergenza e garantire la sicurezza del personale;
    - x) i piani, le procedure e i dispositivi per gestire le crisi, incluso il coordinamento dell'azione complessiva di continuità operativa e la sua tempestiva ed efficace attivazione entro un tempo massimo di ripristino stabilito;
    - xi) i piani, le procedure e i dispositivi per ripristinare i componenti del sistema, dell'applicazione e dell'infrastruttura del richiedente entro il tempo massimo di ripristino previsto;
  - d) la descrizione delle misure adottate per garantire le attività del repertorio di dati sulle negoziazioni richiedente in caso di perturbazioni e la partecipazione degli utenti del repertorio e dei terzi a tali misure.
2. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le procedure per assicurare la sostituzione regolare del repertorio di dati sulle negoziazioni originale se richiesto da una controparte segnalante o da un terzo che effettua la segnalazione per conto di una controparte non segnalante, o qualora tale sostituzione sia il risultato di una revoca della registrazione, e comprende le procedure per il trasferimento dei dati e il reindirizzamento dei flussi di informazioni a un altro repertorio di dati sulle negoziazioni.»;

(13) l'articolo 22 è sostituito dal seguente:

«*Articolo 22*

### **Politica in materia di conservazione dei dati**

1. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene le informazioni sul ricevimento e la gestione dei dati, comprese le politiche e le procedure messe in atto dal richiedente per assicurare:
  - a) la registrazione tempestiva e accurata delle informazioni segnalate;

- b) la conservazione in un *log* di segnalazione di tutte le informazioni segnalate riguardanti la conclusione, la modifica o la cessazione del contratto derivato;
- c) che i dati siano conservati sia *online* che *offline*;
- d) che i dati siano adeguatamente copiati ai fini della continuità operativa.

2. La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene informazioni sui sistemi, sulle politiche e sulle procedure di conservazione dei dati utilizzati per garantire che i dati segnalati siano modificati in modo adeguato e che le posizioni siano calcolate correttamente a norma delle pertinenti disposizioni legislative o regolamentari.»

(14) l'articolo 23 è sostituito dal seguente:

«*Articolo 23*

#### **Meccanismi per assicurare la disponibilità dei dati**

La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene la descrizione delle risorse, dei metodi e dei canali che il richiedente utilizza per permettere l'accesso alle informazioni ai sensi dell'articolo 81, paragrafi 1, 3 e 5, del regolamento (UE) n. 648/2012 e le seguenti informazioni:

- a) la procedura per calcolare le posizioni aggregate conformemente al regolamento delegato (UE) n. 151/2013 della Commissione (\*) e la descrizione delle risorse, dei metodi e dei canali che il repertorio di dati sulle negoziazioni intende utilizzare per facilitare l'accesso del pubblico ai dati ivi contenuti a norma dell'articolo 81, paragrafo 1, del regolamento (UE) n. 648/2012, e la descrizione della frequenza degli aggiornamenti, nonché una copia dei manuali e delle politiche interne specifici;
- b) la descrizione delle risorse, dei metodi e delle strutture che il repertorio di dati sulle negoziazioni utilizza per facilitare l'accesso delle autorità competenti alle proprie informazioni, ai sensi dell'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012, la frequenza degli aggiornamenti e i controlli e le verifiche che il repertorio di dati sulle negoziazioni può stabilire per il processo di filtraggio dell'accesso, nonché una copia di eventuali manuali e procedure interne specifici;
- c) la procedura e la descrizione delle risorse, dei metodi e dei canali che il repertorio di dati sulle negoziazioni utilizza per facilitare una raccolta di dati tempestiva, strutturata ed esauriente da parte delle controparti, l'accesso delle controparti dei derivati alle informazioni, a norma dell'articolo 80, paragrafo 5, del regolamento (UE) n. 648/2012, nonché una copia dei manuali e delle politiche interne specifici.

(\*) 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 (GU L 52 del 23.2.2013, pag. 33).»

(15) è inserito il seguente articolo 23 bis:

«*Articolo 23 bis*

#### **Accesso diretto e immediato ai dati da parte delle autorità**

La domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni contiene informazioni sui seguenti elementi:

- a) i termini e le condizioni in base a cui alle autorità di cui all'articolo 81, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012 è concesso accesso diretto e immediato ai dati sui derivati conservati nel repertorio di dati sulle negoziazioni conformemente al regolamento delegato (UE) n. 151/2013;
- b) la procedura tramite la quale alle autorità di cui alla lettera a) è concesso accesso diretto e immediato ai dati sui contratti derivati conservati nel repertorio di dati sulle negoziazioni conformemente al regolamento delegato (UE) n. 151/2013;
- c) la procedura per garantire l'integrità dei dati a cui tali autorità accedono.»

*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*.

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

Fatto a Bruxelles, il 13 dicembre 2018

*Per la Commissione*

*Il presidente*

Jean-Claude JUNCKER

---

**REGOLAMENTO DI ESECUZIONE (UE) 2019/363 DELLA COMMISSIONE****del 13 dicembre 2018**

**che stabilisce norme tecniche di attuazione per quanto riguarda il formato e la frequenza delle segnalazioni delle informazioni sulle operazioni di finanziamento tramite titoli (SFT) ai repertori di dati sulle negoziazioni a norma del regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio e che modifica il regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012 della Commissione relativamente all'utilizzo di codici per la segnalazione dei contratti derivati**

(Testo rilevante ai fini del SEE)

LA COMMISSIONE EUROPEA,

visto il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 25 novembre 2015, sulla trasparenza delle operazioni di finanziamento tramite titoli e del riutilizzo e che modifica il regolamento (UE) n. 648/2012 <sup>(1)</sup>, in particolare l'articolo 4, paragrafo 10,

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>(2)</sup>, in particolare l'articolo 9, paragrafo 6,

considerando quanto segue:

- (1) Le informazioni che le controparti delle operazioni di finanziamento tramite titoli (SFT) segnalano ai repertori di dati sulle negoziazioni o all'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (ESMA) dovrebbero essere presentate in un formato armonizzato per agevolare la raccolta, l'aggregazione e la comparazione dei dati detenuti dai diversi repertori di dati sulle negoziazioni. Per ridurre al minimo i costi per le controparti segnalanti, il formato di segnalazione delle SFT dovrebbe essere per quanto possibile coerente con quello previsto per la segnalazione dei contratti derivati ai sensi dell'articolo 9 del regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio. Pertanto, il presente regolamento stabilisce il formato per ciascuno dei campi oggetto di segnalazione e definisce una segnalazione standard con riferimento a una norma ISO che trova ampio impiego nel settore finanziario.
- (2) Il sistema globale di identificazione delle entità giuridiche (codice LEI) è ormai integralmente attuato e ogni controparte di una SFT dovrebbe quindi utilizzare esclusivamente tale sistema per identificare un'entità giuridica in una segnalazione. Affinché l'utilizzo del sistema LEI a opera della controparte sia efficace, la controparte in questione dovrebbe garantire che i dati di riferimento inerenti al suo LEI vengano rinnovati conformemente alle condizioni di un emittente LEI accreditato (unità operativa locale). L'estensione del sistema LEI globale per identificare le succursali delle entità giuridiche è attualmente in fase di definizione. Fino al momento in cui tale estensione sarà stata finalizzata e considerata idonea ai fini della segnalazione delle SFT e il presente regolamento sarà stato modificato di conseguenza, per identificare la succursale nella quale una SFT è conclusa tramite una succursale di una controparte dovrebbe essere utilizzato il codice ISO del paese nel quale è ubicata la succursale.
- (3) È in fase di definizione anche un sistema globale di identificazione unica dell'operatore (UTI) per identificare le SFT. Fino al momento in cui il sistema globale UTI sarà stato finalizzato e considerato idoneo ai fini della segnalazione delle SFT e il presente regolamento sarà stato modificato di conseguenza, per identificare una SFT dovrebbe essere utilizzato un UTI concordato dalle controparti.
- (4) L'articolo 4 bis del regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012 della Commissione <sup>(3)</sup> definisce una procedura per determinare il soggetto responsabile della generazione dell'UTI in relazione alla segnalazione dei contratti derivati nelle situazioni in cui le controparti non giungono a un accordo sul soggetto responsabile della generazione dell'UTI. Per garantire la coerenza tra le segnalazioni relative ai contratti derivati e quelle relative alle SFT, dovrebbe essere istituita una procedura analoga per le controparti che segnalano le SFT.

<sup>(1)</sup> GUL 337 del 23.12.2015, pag. 1.

<sup>(2)</sup> GUL 201 del 27.7.2012, pag. 1.

<sup>(3)</sup> 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 (GUL 352 del 21.12.2012, pag. 20).

- (5) Attualmente non esiste una comune prassi di mercato per determinare il lato della controparte in una SFT. Dovrebbero perciò essere stabilite norme specifiche per assicurare che il datore e il beneficiario della garanzia reale in una SFT vengano individuati in modo preciso e coerente.
- (6) Per una singola SFT è possibile che venga presentata una serie di segnalazioni, ad esempio se a tale SFT vengono apportate modifiche successive. Per assicurare la corretta comprensione di ciascuna segnalazione relativa a una SFT e di ciascuna SFT nel suo complesso, le segnalazioni dovrebbero essere presentate nell'ordine cronologico degli eventi segnalati.
- (7) Per rendere meno gravosa la segnalazione della modifica di determinati valori, e in particolare dei dati concernenti il valore della garanzia, il margine fornito o ricevuto e il riutilizzo della garanzia, tali dati dovrebbero essere segnalati secondo la situazione a fine giornata soltanto se variano rispetto ai dati segnalati in precedenza.
- (8) I dati concernenti un prestito su margine in essere dovrebbero essere segnalati secondo la situazione a fine giornata, laddove esista un addebito di cassa netto nella valuta di base o laddove il valore di mercato della posizione corta di una controparte sia positivo.
- (9) Il valore di mercato dei titoli concessi o assunti in prestito dovrebbe essere segnalato secondo la situazione a fine giornata. Analogamente, quando le controparti segnalano il valore di mercato della garanzia, dovrebbero farlo secondo la situazione a fine giornata.
- (10) Il presente regolamento si basa sui progetti di norme tecniche di attuazione che l'ESMA ha presentato alla Commissione conformemente alla procedura di cui all'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) (\*).
- (11) L'ESMA ha effettuato consultazioni pubbliche aperte sui progetti di norme tecniche di attuazione, ne ha analizzato i potenziali costi e benefici e 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.
- (12) Come per la segnalazione delle SFT, taluni identificativi e codici da utilizzare per la segnalazione dei contratti derivati sono ancora in fase di definizione. Fino al momento in cui tali identificativi e codici saranno disponibili e saranno considerati idonei ai fini della segnalazione e il regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012 sarà stato modificato di conseguenza, tale regolamento prevede che per classificare i derivati per i quali non è disponibile né codice ISIN secondo ISO 6166 né codice AII venga utilizzato un codice CFI secondo ISO 10692, e che per identificare la segnalazione di un derivato venga utilizzato un identificativo unico dell'operazione concordato dalle controparti. Per garantire la certezza del diritto riguardo alla procedura appropriata per modificare i requisiti applicabili alla segnalazione dei contratti derivati, nonché il necessario livello di coerenza fra la segnalazione dei derivati e la segnalazione delle SFT, il regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012 dovrebbe rinviare unicamente ai requisiti attualmente applicabili a tale segnalazione.
- (13) È opportuno pertanto modificare di conseguenza il regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012,

HA ADOTTATO IL PRESENTE REGOLAMENTO:

#### *Articolo 1*

### **Standard e formati dei dati relativi alle segnalazioni delle SFT**

Le informazioni relative a una SFT oggetto di segnalazione ai sensi dell'articolo 4, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2015/2365 sono fornite secondo gli standard e i formati specificati nelle tabelle da 1 a 5 dell'allegato I. Tale segnalazione è trasmessa in forma elettronica uniforme e leggibile da dispositivo elettronico e in un modello XML uniforme secondo la metodologia ISO 20022.

(\*) GUL 331 del 15.12.2010, pag. 84.

*Articolo 2***Identificazione delle controparti e di altri soggetti**

1. Nella segnalazione di cui all'articolo 1 è utilizzato come identificativo della persona giuridica (LEI) il codice ISO 17442 per identificare:
  - a) il beneficiario, se persona giuridica;
  - b) l'intermediario;
  - c) la controparte centrale (CCP) autorizzata ai sensi del regolamento (UE) n. 648/2012;
  - d) il partecipante diretto;
  - e) l'agente mutuante;
  - f) il partecipante del depositario centrale di titoli (CSD);
  - g) la controparte, se persona giuridica;
  - h) l'agente *triparty*;
  - i) il soggetto che trasmette la segnalazione;
  - j) l'emittente di un titolo che è stato concesso o assunto in prestito o fornito come garanzia in una SFT.
2. La controparte di una SFT provvede a rinnovare i dati di riferimento inerenti al suo codice LEI secondo ISO 17442 conformemente alle condizioni di qualsivoglia unità operativa locale accreditata del sistema LEI globale.
3. Laddove la SFT è conclusa tramite una succursale di una controparte, per identificare tale succursale nella segnalazione di cui all'articolo 1 è utilizzato il codice specificato nel campo 7 e nel campo 8 della tabella 1 dell'allegato I.

*Articolo 3***Identificativo unico dell'operazione**

1. La segnalazione è identificata mediante un identificativo unico dell'operazione (UTI) concordato dalle controparti nel formato specificato nel campo 1 della tabella 2 dell'allegato I.
2. In caso di mancato accordo sul soggetto responsabile della generazione dell'UTI da assegnare alla segnalazione, le controparti determinano il soggetto responsabile della generazione dell'UTI come segue:
  - a) per le SFT eseguite e compensate a livello centrale, l'UTI è generato nel punto di compensazione dalla CCP per il partecipante diretto. Un altro UTI è generato dal partecipante diretto per la sua controparte;
  - b) per le SFT eseguite a livello centrale ma non compensate a livello centrale, l'UTI è generato dalla sede di esecuzione per il suo partecipante;
  - c) per le SFT confermate e compensate a livello centrale, l'UTI è generato dalla CCP per il partecipante diretto nel punto di compensazione. Un altro UTI è generato dal partecipante diretto per la sua controparte;
  - d) per le SFT confermate a livello centrale mediante mezzi elettronici ma non compensate a livello centrale, l'UTI è generato dalla piattaforma di conferma dell'operazione nel punto di conferma;
  - e) per tutte le SFT diverse da quelle di cui alle lettere da a) a d) si applica quanto segue:
    - i) per le SFT concluse tra controparti finanziarie e controparti non finanziarie, l'UTI è generato dalle controparti finanziarie;
    - ii) per tutte le operazioni di concessione o assunzione di titoli in prestito diverse da quelle di cui al punto i), l'UTI è generato dal datore della garanzia di cui all'articolo 4;

- iii) per tutte le SFT diverse da quelle di cui ai punti i) e ii), l'UTI è generato dal beneficiario della garanzia di cui all'articolo 4.
3. La controparte che genera l'UTI lo comunica all'altra controparte in tempo utile affinché quest'ultima possa adempiere agli obblighi di segnalazione.

#### Articolo 4

##### Lato della controparte

1. Il lato della controparte della SFT di cui al campo 9 della tabella 1 dell'allegato I è identificato conformemente ai paragrafi da 2 a 4.
2. Per le operazioni di vendita con patto di riacquisto e le operazioni di *buy-sell back* e di *sell-buy back*, la controparte che acquista titoli, merci o diritti garantiti riguardanti la proprietà di titoli o merci nell'*opening leg (spot leg)* dell'operazione e si impegna a venderli a un determinato prezzo a una data futura nella *closing leg (forward leg)* dell'operazione è identificata come beneficiario della garanzia nel campo 9 della tabella 1 dell'allegato I. La controparte che vende tali titoli, merci o diritti garantiti è identificata come datore della garanzia nel campo 9 della tabella 1 dell'allegato I.
3. Per le operazioni di assunzione di titoli o merci in prestito e le operazioni di concessione di titoli o merci in prestito, la controparte che concede i titoli o le merci in prestito a condizione che il prestatore restituisca titoli o merci equivalenti a una data futura o su richiesta del cedente è identificata come beneficiario della garanzia nel campo 9 della tabella 1 dell'allegato I. La controparte che assume tali titoli o merci in prestito è identificata come datore della garanzia nel campo 9 della tabella 1 dell'allegato I.
4. Per le operazioni di finanziamento con margini, il prestatore, ossia la controparte alla quale è concesso un credito in cambio di una garanzia, è identificato come datore della garanzia nel campo 9 della tabella 1 dell'allegato I. Il prestatore, ossia la controparte che concede il credito in cambio di una garanzia, è identificato come beneficiario della garanzia nel campo 9 della tabella 1 dell'allegato I.

#### Articolo 5

##### Frequenza delle segnalazioni relative alle SFT

1. Tutte le segnalazioni delle informazioni relative a una SFT di cui all'articolo 1, paragrafo 2, del regolamento delegato (UE) 2019/356 <sup>(5)</sup> sono presentate nell'ordine cronologico degli eventi segnalati.
2. La controparte di un'operazione di finanziamento con margini segnala le informazioni sul prestito su margine in essere secondo la situazione a fine giornata, laddove esiste un addebito di cassa netto nella valuta di base o laddove il valore di mercato della posizione corta di una controparte è positivo.
3. La controparte di una SFT in essere segnala ogni modifica dei dati relativi alla garanzia nei campi da 75 a 94 della tabella 2 dell'allegato I con l'azione «*Collateral update*» (Aggiornamento della garanzia reale). La controparte segnala tali dati modificati secondo la situazione a fine giornata fino a quando segnala la cessazione della SFT, oppure segnala la SFT con l'azione «*Error*» (Errore), oppure fino a quando la SFT raggiunge la sua data di scadenza, se questa data è anteriore.
4. La controparte di una SFT in essere segnala ogni modifica del valore di mercato a fine giornata dei titoli concessi o assunti in prestito nel campo 57 della tabella 2 dell'allegato I con l'azione «*Valuation update*» (Aggiornamento della valutazione). La controparte segnala il valore di mercato modificato secondo la situazione a fine giornata fino a quando segnala la cessazione della SFT, oppure segnala la SFT con l'azione «*Error*» (Errore), oppure fino a quando la SFT raggiunge la sua data di scadenza.

<sup>(5)</sup> Regolamento delegato (UE) 2019/356 della Commissione, del 13 dicembre 2018, che integra il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione che precisano le informazioni sulle operazioni di finanziamento tramite titoli da segnalare ai repertori di dati sulle negoziazioni (cfr. pag. 1 della presente Gazzetta ufficiale).

5. La controparte segnala ogni modifica dell'importo totale del margine fornito o ricevuto per tutte le SFT compensate secondo la situazione a fine giornata nei campi da 8 a 19 della tabella 3 dell'allegato I con l'azione «*Margin update*» (Aggiornamento del margine) dopo aver prima segnalato l'importo totale del margine fornito o ricevuto con l'azione «*New*» (Nuova).

6. La controparte segnala ogni modifica del valore della garanzia riutilizzata, del contante reinvestito e delle fonti di finanziamento con l'azione «*Reuse update*» (Aggiornamento del riutilizzo) secondo la situazione a fine giornata nei campi da 8 a 14 della tabella 4 dell'allegato I, dopo aver segnalato i pertinenti valori con l'azione «*New*» (Nuova).

#### Articolo 6

### Modifiche del regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012

Il regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012 è così modificato:

1) l'articolo 4 è così modificato:

a) il paragrafo 7 è sostituito dal seguente:

«Il derivato è classificato nel campo 4 della tabella 2 dell'allegato con il codice CFI (*Classification of Financial Instrument* — classificazione degli strumenti finanziari) secondo la norma ISO 10692.»;

b) i paragrafi 8 e 9 sono soppressi;

2) all'articolo 4 bis, il paragrafo 1 è sostituito dal seguente:

«1. La segnalazione è identificata mediante un identificativo unico dell'operazione concordato dalle controparti.»;

3) l'allegato è sostituito dal testo che figura nell'allegato II del presente regolamento.

#### Articolo 7

### 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 13 dicembre 2018

Per la Commissione  
Il presidente  
Jean-Claude JUNCKER

## ALLEGATO I

**Formati da utilizzare per segnalare le informazioni relative alle operazioni di finanziamento  
tramite titoli, di cui all'articolo 4, paragrafi 1 e 5, del regolamento (UE) 2015/2365**

Tabella 1

**Dati sulla controparte**

N.	Campo	Formato
1	Data e ora della segnalazione	Formato della data secondo ISO 8601 e formato dell'ora secondo il Tempo Universale Coordinato (UTC), ossia AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ
2	Soggetto che trasmette la segnalazione	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
3	Controparte segnalante	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
4	Natura della controparte segnalante	«F» — controparte finanziaria «N» — controparte non finanziaria
5	Settore della controparte segnalante	Tassonomia delle controparti finanziarie: «CDTI» — ente creditizio autorizzato ai sensi della direttiva 2013/36/UE del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(1)</sup> o del regolamento (UE) n. 1024/2013 del Consiglio <sup>(2)</sup> oppure entità di un paese terzo che richiederebbe l'autorizzazione o la registrazione ai sensi di tale atto legislativo «INVF» — impresa di investimento autorizzata ai sensi della direttiva 2014/65/UE del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(3)</sup> oppure entità di un paese terzo che richiederebbe l'autorizzazione o la registrazione ai sensi di tale atto legislativo «INUN» — impresa di assicurazione autorizzata ai sensi della direttiva 2009/138/CE del Parlamento europeo e del Consiglio (solvibilità II) <sup>(4)</sup> oppure entità di un paese terzo che richiederebbe l'autorizzazione o la registrazione ai sensi di tale atto legislativo «AIFD» — fondo di investimento alternativo gestito da GEFIA autorizzati o registrati ai sensi della direttiva 2011/61/UE del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(5)</sup> oppure entità di un paese terzo che richiederebbe l'autorizzazione o la registrazione ai sensi di tale atto legislativo «ORPI» — ente pensionistico aziendale o professionale autorizzato o registrato ai sensi della direttiva 2003/41/CE del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(6)</sup> oppure entità di un paese terzo che richiederebbe l'autorizzazione o la registrazione ai sensi di tale atto legislativo «CCPS» — controparte centrale autorizzata ai sensi del regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(7)</sup> oppure entità di un paese terzo che richiederebbe l'autorizzazione o la registrazione ai sensi di tale atto legislativo «REIN» — impresa di riassicurazione autorizzata ai sensi della direttiva Solvibilità II oppure entità di un paese terzo che richiederebbe l'autorizzazione o la registrazione ai sensi di tale atto legislativo «CSDS» — depositario centrale di titoli autorizzato ai sensi del regolamento (UE) n. 909/2014 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(8)</sup> oppure entità di un paese terzo che richiederebbe l'autorizzazione o la registrazione ai sensi di tale atto legislativo «UCIT» — OICVM e relativa società di gestione, autorizzati ai sensi della direttiva 2009/65/CE del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(9)</sup> oppure entità di un paese terzo che richiederebbe l'autorizzazione o la registrazione ai sensi di tale atto legislativo

N.	Campo	Formato
		<p>Tassonomia delle controparti non finanziarie. Le categorie seguenti corrispondono alle principali sezioni della classificazione NACE, quale definita dal regolamento (CE) n. 1893/2006 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(10)</sup></p> <p>«A» — agricoltura, silvicoltura e pesca</p> <p>«B» — attività estrattiva</p> <p>«C» — attività manifatturiere</p> <p>«D» — fornitura di energia elettrica, gas, vapore e aria condizionata</p> <p>«E» — fornitura di acqua; reti fognarie, attività di trattamento dei rifiuti e risanamento</p> <p>«F» — costruzioni</p> <p>«G» — commercio all'ingrosso e al dettaglio; riparazione di autoveicoli e motocicli</p> <p>«H» — trasporto e magazzinaggio</p> <p>«I» — servizi di alloggio e di ristorazione</p> <p>«J» — servizi di informazione e comunicazione</p> <p>«K» — attività finanziarie e assicurative</p> <p>«L» — attività immobiliari</p> <p>«M» — attività professionali, scientifiche e tecniche</p> <p>«N» — attività amministrative e di servizi di supporto</p> <p>«O» — amministrazione pubblica e difesa; assicurazione sociale obbligatoria</p> <p>«P» — istruzione</p> <p>«Q» — sanità e assistenza sociale</p> <p>«R» — attività artistiche, di intrattenimento e divertimento</p> <p>«S» — altre attività di servizi</p> <p>«T» — attività di famiglie e convivenze come datori di lavoro per personale domestico; produzione di beni e servizi indifferenziati per uso proprio da parte di famiglie e convivenze</p> <p>«U» — attività di organizzazioni e organismi extraterritoriali</p>
6	Classificazione settoriale supplementare	<p>«ETFT» — ETF (fondo indicizzato quotato)</p> <p>«MMFT» — MMF (fondo del mercato monetario)</p> <p>«REIT» — fondo comune di investimento immobiliare</p> <p>«OTHR» — <i>Other</i> (altro)</p>
7	Succursale della controparte segnalante	Codice paese alpha—2 secondo ISO 3166-1 di 2 caratteri alfabetici
8	Succursale dell'altra controparte	Codice paese alpha-2 secondo ISO 3166-1 di 2 caratteri alfabetici
9	Lato della controparte	<p>«TAKE» — <i>Collateral taker</i> (beneficiario della garanzia)</p> <p>«GIVE» — <i>Collateral provider</i> (datore della garanzia)</p>
10	Soggetto responsabile della segnalazione	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
11	Altra controparte	<p>Codice LEI (<i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici.</p> <p>Codice cliente (massimo 50 caratteri alfanumerici).</p>
12	Paese dell'altra controparte	Codice paese alpha-2 secondo ISO 3166-1 di 2 caratteri alfabetici

N.	Campo	Formato
13	Beneficiario	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici. Codice cliente (massimo 50 caratteri alfanumerici).
14	Agente triparty	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
15	Intermediario	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
16	Partecipante diretto	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
17	Partecipante o partecipante indiretto di depositari centrali di titoli («CSD»)	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
18	Agente mutuante	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici

- (<sup>1</sup>) Direttiva 2013/36/UE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 26 giugno 2013, sull'accesso all'attività degli enti creditizi e sulla vigilanza prudenziale sugli enti creditizi e sulle imprese di investimento (GU L 176 del 27.6.2013, pag. 338).
- (<sup>2</sup>) Regolamento (UE) n. 1024/2013 del Consiglio, del 15 ottobre 2013, che attribuisce alla Banca centrale europea compiti specifici in merito alle politiche in materia di vigilanza prudenziale degli enti creditizi (GU L 287 del 29.10.2013, pag. 63).
- (<sup>3</sup>) Direttiva 2014/65/UE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 15 maggio 2014, relativa ai mercati degli strumenti finanziari (GU L 173 del 12.6.2014, pag. 349).
- (<sup>4</sup>) Direttiva 2009/138/CE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 25 novembre 2009, in materia di accesso ed esercizio delle attività di assicurazione e di riassicurazione (solvibilità II) (GU L 335 del 17.12.2009, pag. 1).
- (<sup>5</sup>) Direttiva 2011/61/UE del Parlamento europeo e del Consiglio, dell'8 giugno 2011, sui gestori di fondi di investimento alternativi (GU L 174 dell'1.7.2011, pag. 1).
- (<sup>6</sup>) Direttiva 2003/41/CE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 3 giugno 2003, relativa alle attività e alla supervisione degli enti pensionistici aziendali o professionali (GU L 235 del 23.9.2003, pag. 10).
- (<sup>7</sup>) 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 (GU L 201 del 27.7.2012, pag. 1).
- (<sup>8</sup>) Regolamento (UE) n. 909/2014 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 23 luglio 2014, relativo al miglioramento del regolamento titoli nell'Unione europea e ai depositari centrali di titoli (GU L 257 del 28.8.2014, pag. 1).
- (<sup>9</sup>) Direttiva 2009/65/CE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 13 luglio 2009, concernente il coordinamento delle disposizioni legislative, regolamentari e amministrative in materia di taluni organismi d'investimento collettivo in valori mobiliari (OICVM) (GU L 302 del 17.11.2009, pag. 32).
- (<sup>10</sup>) Regolamento (CE) n. 1893/2006 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 20 dicembre 2006, che definisce la classificazione statistica delle attività economiche NACE Revisione 2 (GU L 393 del 30.12.2006, pag. 1).

Tabella 2

### Dati sul prestito e sulla garanzia reale

N.	Campo	Formato
1	Identificativo unico dell'operazione (UTI)	Codice di massimo 52 caratteri alfanumerici, tra cui quattro caratteri speciali: Sono ammessi soltanto i caratteri alfabetici maiuscoli da A a Z (comprese queste due lettere) e le cifre da 0 a 9 (comprese queste due cifre).
2	Numero di tracciamento della segnalazione	Codice di massimo 52 caratteri alfanumerici, tra cui quattro caratteri speciali: Sono ammessi soltanto i caratteri alfabetici maiuscoli da A a Z (comprese queste due lettere) e le cifre da 0 a 9 (comprese queste due cifre).
3	Data dell'evento	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
4	Tipo di SFT	«SLEB» — <i>securities or commodities lending or securities or commodities borrowing</i> (concessione o assunzione di titoli o merci in prestito) «SBSC» — <i>buy-sell back transaction or sell-buy back transaction</i> (operazione di buy-sell back o di sell-buy back) «REPO» — <i>repurchase transaction</i> (operazione di vendita con patto di riacquisto) «MGLD» — <i>margin lending transaction</i> (finanziamento con margini)

N.	Campo	Formato
5	Compensata	«vero» «falso»
6	Data e ora della compensazione	Formato della data secondo ISO 8601 e formato dell'ora secondo il Tempo Universale Coordinato (UTC), ossia AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ
7	Controparte centrale (CCP)	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
8	Sede di negoziazione	Codice identificativo del mercato ( <i>Market Identifier Code</i> — MIC) secondo ISO 10383 di 4 caratteri alfanumerici. Laddove per una sede di negoziazione esistono MIC per segmenti, è utilizzato il MIC per segmento.
9	Tipo di accordo quadro	«MRAA» — MRA «GMRA» — GMRA «MSLA» — MSLA «GMSL» — GMSLA «ISDA» — ISDA «DERP» — <i>Deutscher Rahmenvertrag für Wertpapierpensionsgeschäfte</i> «CNBR» — <i>China Bond Repurchase Master Agreement</i> «KRRR» — <i>Korea Financial Investment Association (KOFIA) Standard Repurchase Agreement</i> «CARA» — <i>Investment Industry Regulatory Organization of Canada (IIROC) Repurchase/Reverse Repurchase Transaction Agreement</i> «FRFB» — <i>Convention-Cadre Relative aux Operations de Pensions Livrees</i> «CHRA» — <i>Swiss Master Repurchase Agreement</i> «DEMA» — <i>German Master Agreement</i> «JPBR» — <i>Japanese Master Agreement on the Transaction with Repurchase Agreement of the Bonds</i> «ESRA» — <i>Contrato Marco de compraventa y Reporto de valores</i> «OSLA» — <i>Overseas Securities Lending Agreement (OSLA)</i> «MEFI» — <i>Master Equity and Fixed Interest Stock Lending Agreement (MEFISLA)</i> «GESL» — <i>Gilt Edged Stock Lending Agreement (GESLA)</i> «KRSL» — <i>Korean Securities Lending Agreement (KOSLA)</i> «DERD» — <i>Deutscher Rahmenvertrag für Wertpapierdarlehen</i> «AUSL» — <i>Australian Masters Securities Lending Agreement (AMSLA)</i> «JPBL» — <i>Japanese Master Agreement on Lending Transaction of Bonds</i> «JPSL» — <i>Japanese Master Agreement on the Borrowing and Lending Transactions of Share Certificates</i> «BIAG» — <i>bilateral agreement</i> (accordo bilaterale) «CSDA» — <i>CSD bilateral agreement</i> (accordo bilaterale CSD) Oppure «OTHR» (altro) se il tipo di accordo quadro non figura nel precedente elenco
10	Altro tipo di accordo quadro	Massimo 50 caratteri alfanumerici
11	Versione dell'accordo quadro	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA)
12	Data e ora di esecuzione	Formato della data secondo ISO 8601 e formato dell'ora secondo il Tempo Universale Coordinato (UTC), ossia AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ
13	Data di valuta (data di inizio)	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)

N.	Campo	Formato
14	Data di scadenza (data di fine)	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
15	Data di cessazione	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
16	Preavviso minimo	Campo con numero intero di massimo 3 cifre
17	Prima data di richiamo (call-back)	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
18	Indicatore delle garanzie generiche (general collateral)	«SPEC» — <i>specific collateral</i> (garanzia specifica) «GENE» — <i>general collateral</i> (garanzia generica)
19	Indicatore della consegna per valore (delivery by value, DBV)	«vero» «falso»
20	Metodo utilizzato per fornire le garanzie reali	«TTCA» — <i>title transfer collateral arrangement</i> (contratto di garanzia con trasferimento del titolo di proprietà) «SICA» — <i>securities financial collateral arrangement</i> (contratto di garanzia finanziaria con costituzione di garanzia reale) «SIUR» — <i>securities financial collateral arrangement with the right of use</i> (contratto di garanzia finanziaria con costituzione di garanzia reale con diritto di uso)
21	Scadenza aperta	«vero» «falso»
22	Opzione di chiusura	«EGRN» — <i>evergreen</i> «ETSB» — <i>extendable</i> (prorogabile) «NOAP» — <i>non applicable</i> (non pertinente)

Nel caso di finanziamenti con margini, i dati dei campi da 23 a 34 devono essere ripetuti e compilati per ciascuna valuta utilizzata nel prestito su margine.

23	Tasso fisso	Massimo 11 caratteri numerici compresi massimo 10 decimali espressi in percentuale, dove il 100 % è rappresentato da «100». Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
24	Convenzione sul conteggio dei giorni	Codice della convenzione sul conteggio dei giorni: «A001» — IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule «A002» — IC30365 «A003» — IC30Actual «A004» — Actual360 «A005» — Actual365Fixed «A006» — ActualActualICMA «A007» — IC30E360orEuroBondBasismodel1 «A008» — ActualActualISDA «A009» — Actual365LorActuActubasisRule «A010» — ActualActualAFB «A011» — IC30360ICMAor30360basicrule «A012» — IC30E2360orEurobondbasismodel2 «A013» — IC30E3360orEurobondbasismodel3 «A014» — Actual365NL O massimo 35 caratteri alfanumerici se la convenzione sul conteggio dei giorni non figura nel precedente elenco

N.	Campo	Formato
25	Tasso variabile	Codice dell'indice a tasso variabile «EONA» — EONIA «EONS» — EONIA SWAP ( <i>swap</i> sull'EONIA) «EURI» — EURIBOR «EUUS» — EURODOLLAR «EUCH» — EuroSwiss «GCFR» — GCF REPO «ISDA» — ISDAFIX «LIBI» — LIBID «LIBO» — LIBOR «MAAA» — Muni AAA «PFAN» — Pfandbriefe «TIBO» — TIBOR «STBO» — STIBOR «BBSW» — BBSW «JIBA» — JIBAR «BUBO» — BUBOR «CDOR» — CDOR «CIBO» — CIBOR «MOSP» — MOSPRIM «NIBO» — NIBOR «PRBO» — PRIBOR «TLBO» — TELBOR «WIBO» — WIBOR «TREA» — <i>Treasury</i> (Tesoro) «SWAP» — <i>swap</i> «FUSW» — <i>Future SWAP</i> ( <i>swap</i> su <i>future</i> ) O massimo 25 caratteri alfanumerici se il tasso di riferimento non figura nel precedente elenco
26	Periodo di riferimento del tasso variabile — periodo	Periodo di tempo che descrive il periodo di riferimento. Si applicano le seguenti abbreviazioni: «YEAR» — anno «MNTH» — <i>month</i> (mese) «WEEK» — settimana «DAYS» — giorno
27	Periodo di riferimento del tasso variabile — moltiplicatore	Un intero multiplo del periodo di tempo che descrive il periodo di riferimento del tasso variabile Massimo 3 caratteri numerici
28	Frequenza di pagamento per il tasso variabile — periodo	Periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti si scambiano i pagamenti. Si applicano le seguenti abbreviazioni: «YEAR» — anno «MNTH» — <i>month</i> (mese) «WEEK» — settimana «DAYS» — giorno
29	Frequenza di pagamento per il tasso variabile — moltiplicatore	Un intero multiplo del periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti si scambiano i pagamenti Massimo 3 caratteri numerici

N.	Campo	Formato
30	Frequenza di revisione del tasso variabile — periodo	Periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti rivedono il tasso variabile dei repo. Si applicano le seguenti abbreviazioni: «YEAR» — anno «MNTH» — <i>month</i> (mese) «WEEK» — settimana «DAYS» — giorno
31	Frequenza di revisione del tasso variabile — moltiplicatore	Un intero multiplo del periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti rivedono il tasso variabile dei repo Massimo 3 caratteri numerici
32	Differenziale	Massimo 5 caratteri numerici
33	Importo in valuta dei finanziamenti con margini	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
34	Valuta dei finanziamenti con margini	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici

I campi 35-36 devono essere ripetuti e compilati per ciascuna rettifica del tasso d'interesse variabile.

35	Tasso rettificato	Massimo 11 caratteri numerici compresi massimo 10 decimali espressi in percentuale, dove il 100 % è rappresentato da «100». Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
36	Data di applicazione del tasso	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
37	Importo del capitale alla data di valuta	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
38	Importo del capitale alla data di scadenza	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
39	Valuta dell'importo del capitale	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
40	Tipo di attività	«SECU» — <i>Securities</i> (titoli) «COMM» — <i>Commodities</i> (merci)
41	Identificativo del titolo	ISIN secondo ISO 6166, codice di 12 caratteri alfanumerici
42	Classificazione del titolo	CFI secondo ISO 10692, codice di 6 caratteri alfabetici

Se una merce è stata concessa o assunta in prestito, la classificazione di tale merce è specificata nei campi 43, 44 e 45.

43	Categoria di prodotti	Sono ammessi solo i valori della colonna «Categoria di prodotti» secondo la tabella della classificazione dei derivati su merci.
----	-----------------------	--

N.	Campo	Formato
44	Sottocategoria di prodotti	Sono ammessi solo i valori della colonna «Sottocategoria di prodotti» secondo la tabella della classificazione dei derivati su merci.
45	Ulteriore sottocategoria di prodotti	Sono ammessi solo i valori della colonna «Ulteriore sottocategoria di prodotti» secondo la tabella della classificazione dei derivati su merci.
46	Quantità o importo nominale	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
47	Unità di misura	«KILO» — Kilogram (chilogrammo), «PIEC» — Piece (pezzo), «TONS» — Ton (tonnellata), «METR» — Metre (metro), «INCH» — Inch (pollice), «YARD» — Yard (iarda), «GBGA» — GBGallon (gallone GB), «GRAM» — Gram (grammo), «CMET» — Centimetre (centimetro), «SMET» — SquareMetre (metro quadrato), «FOOT» — Foot (piede), «MILE» — Mile (miglio), «SQIN» — SquareInch (pollice quadrato), «SQFO» — SquareFoot (piede quadrato), «SQMI» — SquareMile (miglio quadrato), «GBOU» — GBounce (oncia GB), «USOU» — USOunce (oncia USA), «GBPI» — GBPint (pinta GB), «USPI» — USPint (pinta USA), «GBQA» — GBQuart (quarto GB), «USQA» — USQuart (quarto USA), «USGA» — USGallon (gallone USA), «MMET» — Millimetre (millimetro), «KMET» — Kilometre (chilometro), «SQYA» — SquareYard (iarda quadrata) «ACRE» — Acre (acro), «ARES» — Are (ara), «SMIL» — SquareMillimetre (millimetro quadrato), «SCMT» — SquareCentimetre (centimetro quadrato), «HECT» — Hectare (ettaro), «SQKI» — SquareKilometre (chilometro quadrato), «MILI» — MilliLitre (millilitro), «CELL» — Centilitre (centilitro), «LITR» — Litre (litro), «PUND» — Pound (libbra), «ALOW» — Allowances (quote), «ACCY» — AmountOfCurrency (importo in valuta), «BARL» — Barrels (barili), «BCUF» — BillionCubicFeet (miliardi di piedi cubi), «BDFT» — BoardFeet (piedi tavolari), «BUSL» — Bushels (stai), «CEER» — CertifiedEmissionsReduction (riduzione certificata delle emissioni), «CLRT» — ClimateReserveTonnes (tonnellate di riserva per il clima), «CBME» — CubicMeters (metri cubi), «DAYS» — Days (giorni), «DMET» — DryMetricTons (tonnellate metriche secche), «ENVC» — EnvironmentalCredit (credito ambientale), «ENVO» — EnvironmentalOffset (compensazione ambientale) «HUWG» — Hundredweight (cental), «KWDC» — KilowattDayCapacity (capacità in kilowatt-giorno), «KWHO» — KilowattHours (kilowattora), «KWHC» — KilowattHoursCapacity (capacità in kilowattora), «KMOC» — KilowattMinuteCapacity (capacità in kilowatt-minuto), «KWMC» — KilowattMonthCapacity (capacità in kilowatt-mese), «KWYC» — KilowattYearCapacity (capacità in kilowatt-anno), «MWDC» — MegawattDayCapacity (capacità in megawatt-giorno), «MWHO» — MegawattHours (megawattora), «MWHC» — MegawattHoursCapacity (capacità in megawattora), «MWMC» — MegawattMinuteCapacity (capacità in megawatt-minuto), «MMOC» — MegawattMonthCapacity (capacità in megawatt-mese), «MWYC» — MegawattYearCapacity (capacità in megawatt-anno), «TONE» — MetricTons (tonnellate metriche), «MIBA» — MillionBarrels (milioni di barili), «MBTU» — OneMillionBTU (un milione di BTU), «OZTR» — TroyOunces (once troy), «UCWT» — USHundredweight (cental USA), «IPNT» — IndexPoint (punto indice), «PWRD» — PrincipalWithRelationToDebtInstrument (capitale relativo allo strumento di debito), «DGEU» — DieselGallonEquivalent (gallone diesel equivalente), «GGEU» — GasolineGallonEquivalent (gallone benzina equivalente), «TOCD» — TonsOfCarbonDioxide (tonnellate di anidride carbonica).
48	Valuta dell'importo nominale	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
49	Prezzo del titolo o della merce	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali se il prezzo è espresso in unità. Massimo 11 caratteri numerici compresi massimo 10 decimali se il prezzo è espresso in percentuale o rendimento. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
50	Valuta del prezzo	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici

N.	Campo	Formato
51	Qualità del titolo	«INVG» — <i>Investment grade</i> «NIVG» — <i>Non-investment grade</i> «NOTR» — <i>Non-rated</i> (privo di rating) «NOAP» — <i>Not applicable</i> (non pertinente)
52	Scadenza del titolo	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
53	Giurisdizione dell'emittente	Codice paese alpha-2 secondo ISO 3166-1 di 2 caratteri alfabetici
54	LEI dell'emittente	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
55	Tipo di titolo	«GOVS» — <i>Government securities</i> (titoli di Stato) «SUNS» — <i>Supra-nationals and agencies securities</i> (titoli sovranazionali e di agenzie) «FIDE» — <i>Debt securities (including covered bonds) issued by banks and other financial institutions</i> (titoli di debito, comprese le obbligazioni garantite, emessi da banche e altri enti finanziari) «NFID» — <i>Corporate debt securities (including covered bonds) issued by non-financial institutions</i> (titoli di debito societario, comprese le obbligazioni garantite, emessi da enti non finanziari) «SEPR» — <i>Securitized products (including CDO, CMBS, ABCP)</i> (prodotti cartolarizzati, compresi CDO, CMBS, ABCP) «MEQU» — <i>Main index equities (including convertible bonds)</i> (strumenti di capitale inclusi in un listino principale, comprese le obbligazioni convertibili) «OEQU» — <i>Other equities (including convertible bonds)</i> (altri strumenti di capitale, comprese le obbligazioni convertibili) «OTHR» — <i>Other assets (including shares in mutual funds)</i> (altre attività, comprese le quote di fondi comuni di investimento)
56	Valore del prestito	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
57	Valore di mercato	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
58	Tasso di rimborso fisso	Massimo 11 caratteri numerici compresi massimo 10 decimali espressi in percentuale, dove il 100 % è rappresentato da «100». Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.
59	Tasso di rimborso variabile	Codice dell'indice a tasso variabile «EONA» — EONIA «EONS» — EONIA SWAP ( <i>swap</i> sull'EONIA) «EURI» — EURIBOR «EUUS» — EURODOLLAR «EUCH» — EuroSwiss «GCFR» — GCF REPO «ISDA» — ISDAFIX «LIBI» — LIBID «LIBO» — LIBOR «MAAA» — Muni AAA «PFAN» — Pfandbriefe «TIBO» — TIBOR «STBO» — STIBOR «BBSW» — BBSW

N.	Campo	Formato
		«JIBA» — JIBAR «BUBO» — BUBOR «CDOR» — CDOR «CIBO» — CIBOR «MOSP» — MOSPRIM «NIBO» — NIBOR «PRBO» — PRIBOR «TLBO» — TELBOR «WIBO» — WIBOR «TREA» — <i>Treasury</i> (Tesoro) «SWAP» — <i>swap</i> «FUSW» — <i>Future SWAP (swap su future)</i> O massimo 25 caratteri alfanumerici se il tasso di riferimento non figura nel precedente elenco
60	Periodo di riferimento del tasso di rimborso variabile — periodo	Periodo di tempo che descrive il periodo di riferimento. Si applicano le seguenti abbreviazioni: «YEAR» — anno «MNTH» — <i>month</i> (mese) «WEEK» — settimana «DAYS» — giorno
61	Periodo di riferimento del tasso di rimborso variabile — moltiplicatore	Un intero multiplo del periodo di tempo che descrive il periodo di riferimento del tasso di rimborso variabile Massimo 3 caratteri numerici
62	Frequenza di pagamento per il tasso di rimborso variabile — periodo	Periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti si scambiano i pagamenti. Si applicano le seguenti abbreviazioni: «YEAR» — anno «MNTH» — <i>month</i> (mese) «WEEK» — settimana «DAYS» — giorno
63	Frequenza di pagamento per il tasso di rimborso variabile — moltiplicatore	Un intero multiplo del periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti si scambiano i pagamenti Massimo 3 caratteri numerici
64	Frequenza di revisione del tasso di rimborso variabile — periodo	Periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti rivedono il tasso di rimborso variabile. Si applicano le seguenti abbreviazioni: «YEAR» — anno «MNTH» — <i>month</i> (mese) «WEEK» — settimana «DAYS» — giorno
65	Frequenza di revisione del tasso di rimborso variabile — moltiplicatore	Un intero multiplo del periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti rivedono il tasso di rimborso variabile Massimo 3 caratteri numerici
66	Differenziale del tasso di rimborso	Massimo 5 caratteri numerici
67	Commissione sul prestito	Massimo 11 caratteri numerici compresi massimo 10 decimali espressi in percentuale, dove il 100 % è rappresentato da «100».

N.	Campo	Formato
68	Accordi di esclusiva	«vero» «falso»
69	Prestito su margine in essere	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
70	Valuta di base del prestito su margine in essere	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
71	Valore di mercato della posizione corta	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.

## Dati sulla garanzia reale

72	Contrassegno Prestito titoli «Securities Lending» — «SL») non garantito	«vero» «falso»
73	Copertura dell'esposizione netta	«vero» «falso»
74	Data di valuta della garanzia	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)

Se è stata utilizzata una garanzia reale specifica, i campi da 75 a 94 devono essere ripetuti e compilati per ogni componente della garanzia, se del caso.

75	Tipo di componente della garanzia reale	«SECU» — <i>Securities</i> (titoli) «COMM» — <i>Commodities</i> (merci) (soltanto per operazioni di vendita con patto di riacquisto, concessione o assunzione di titoli o merci in prestito e buy-sell back) «CASH» — contante
----	---	--

Se è stato utilizzato il contante come garanzia, ciò viene specificato nei campi 76 e 77.

76	Importo delle garanzie in contante	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
77	Valuta della garanzia in contante	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
78	Identificazione del titolo utilizzato come garanzia	ISIN secondo ISO 6166, codice di 12 caratteri alfanumerici
79	Classificazione del titolo utilizzato come garanzia	CFI secondo ISO 10692, codice di 6 caratteri alfabetici

N.	Campo	Formato
Se una merce è stata usata come garanzia, la classificazione di tale merce è specificata nei campi 80, 81 e 82.		
80	Categoria di prodotti	Sono ammessi solo i valori della colonna «Categoria di prodotti» secondo la tabella della classificazione dei derivati su merci.
81	Sottocategoria di prodotti	Sono ammessi solo i valori della colonna «Sottocategoria di prodotti» secondo la tabella della classificazione dei derivati su merci.
82	Ulteriore sottocategoria di prodotti	Sono ammessi solo i valori della colonna «Ulteriore sottocategoria di prodotti» secondo la tabella della classificazione dei derivati su merci.
83	Quantità o importo nominale della garanzia	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
84	Unità di misura della garanzia reale	«KILO» — Kilogram (chilogrammo), «PIEC» — Piece (pezzo), «TONS» — Ton (tonnellata), «METR» — Metre (metro), «INCH» — Inch (pollice), «YARD» — Yard (iarda), «GBGA» — GBGallon (gallone GB), «GRAM» — Gram (grammo), «CMET» — Centimetre (centimetro), «SMET» — SquareMetre (metro quadrato), «FOOT» — Foot (piede), «MILE» — Mile (miglio), «SQIN» — SquareInch (pollice quadrato), «SQFO» — SquareFoot (piede quadrato), «SQMI» — SquareMile (miglio quadrato), «GBOU» — GBounce (oncia GB), «USOU» — USOunce (oncia USA), «GBPI» — GBPint (pinta GB), «USPI» — USPint (pinta USA), «GBQA» — GBQuart (quarto GB), «USQA» — USQuart (quarto USA), «USGA» — USGallon (gallone USA), «MMET» — Millimetre (millimetro), «KMET» — Kilometre (chilometro), «SQYA» — SquareYard (iarda quadrata), «ACRE» — Acre (acro), «ARES» — Are (ara), «SMIL» — SquareMillimetre (millimetro quadrato), «SCMT» — SquareCentimetre (centimetro quadrato), «HECT» — Hectare (ettaro), «SQKI» — SquareKilometre (chilometro quadrato), «MILL» — MilliLitre (millilitro), «CELL» — Centilitre (centilitro), «LITR» — Litre (litro), «PUND» — Pound (libbra), «ALOW» — Allowances (quote), «ACCY» — AmountOfCurrency (importo in valuta), «BARL» — Barrels (barili), «BCUF» — BillionCubicFeet (miliardi di piedi cubi), «BDFT» — BoardFeet (piedi tavolari), «BUSL» — Bushels (stai), «CEER» — CertifiedEmissionsReduction (riduzione certificata delle emissioni), «CLRT» — ClimateReserveTonnes (tonnellate di riserva per il clima), «CBME» — CubicMeters (metri cubi), «DAYS» — Days (giorni), «DMET» — DryMetricTons (tonnellate metriche secche), «ENVC» — EnvironmentalCredit (credito ambientale), «ENVO» — EnvironmentalOffset (compensazione ambientale) «HUWG» — Hundredweight (cental), «KWDC» — KilowattDayCapacity (capacità in kilowatt-giorno), «KWHO» — KilowattHours (kilowattora), «KWHC» — KilowattHoursCapacity (capacità in kilowattora), «KMOC» — KilowattMinuteCapacity (capacità in kilowatt-minuto), «KWMC» — KilowattMonthCapacity (capacità in kilowatt-mese), «KWYC» — KilowattYearCapacity (capacità in kilowatt-anno), «MWDC» — MegawattDayCapacity (capacità in megawatt-giorno), «MWHO» — MegawattHours (megawattora), «MWHC» — MegawattHoursCapacity (capacità in megawattora), «MWMC» — MegawattMinuteCapacity (capacità in megawatt-minuto), «MMOC» — MegawattMonthCapacity (capacità in megawatt-mese), «MWYC» — MegawattYearCapacity (capacità in megawatt-anno), «TONE» — MetricTons (tonnellate metriche), «MIBA» — MillionBarrels (milioni di barili), «MBTU» — OneMillionBTU (un milione di BTU), «OZTR» — TroyOunces (once troy), «UCWT» — USHundredweight (cental USA), «IPNT» — IndexPoint (punto indice), «PWRD» — PrincipalWithRelationToDebtInstrument (capitale relativo allo strumento di debito), «DGEU» — DieselGallonEquivalent (gallone diesel equivalente), «GGEU» — GasolineGallonEquivalent (gallone benzina equivalente), «TOCD» — TonsOfCarbonDioxide (tonnellate di anidride carbonica).
85	Valuta dell'importo nominale della garanzia reale	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
86	Valuta del prezzo	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
87	Prezzo unitario	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali se il prezzo è espresso in unità. Massimo 11 caratteri numerici compresi massimo 10 decimali se il prezzo è espresso in percentuale o rendimento. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.

N.	Campo	Formato
88	Valore di mercato della garanzia reale	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
89	Scarto o margine	Massimo 11 caratteri numerici compresi massimo 10 decimali espressi in percentuale, dove il 100 % è rappresentato da «100». Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
90	Qualità della garanzia reale	«INVG» — <i>Investment grade</i> «NIVG» — <i>Non-investment grade</i> «NOTR» — <i>Non-rated</i> (privo di rating) «NOAP» — <i>Not applicable</i> (non pertinente)
91	Data di scadenza del titolo	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
92	Giurisdizione dell'emittente	Codice paese alpha-2 secondo ISO 3166-1 di 2 caratteri alfabetici
93	LEI dell'emittente	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
94	Tipo di garanzia reale	«GOVS» — <i>Government securities</i> (titoli di Stato) «SUNS» — <i>Supra-nationals and agencies securities</i> (titoli sovranazionali e di agenzie) «FIDE» — <i>Debt securities (including covered bonds) issued by banks and other financial institutions</i> (titoli di debito, comprese le obbligazioni garantite, emessi da banche e altri enti finanziari) «NFID» — <i>Corporate debt securities (including covered bonds) issued by non-financial institutions</i> (titoli di debito societario, comprese le obbligazioni garantite, emessi da enti non finanziari) «SEPR» — <i>Securitized products (including CDO, CMBS, ABCP)</i> (prodotti cartolarizzati, compresi CDO, CMBS, ABCP) «MEQU» — <i>Main index equities (including convertible bonds)</i> (strumenti di capitale inclusi in un listino principale, comprese le obbligazioni convertibili) «OEQU» — <i>Other equities (including convertible bonds)</i> (altri strumenti di capitale, comprese le obbligazioni convertibili) «OTHR» — <i>Other assets (including shares in mutual funds)</i> (altre attività, comprese le quote di fondi comuni di investimento)
95	Possibilità di riutilizzare la garanzia reale	«vero» «falso»
<p>Compilare il campo 96 in caso di utilizzo di un paniere di garanzie. Nei campi da 75 a 94 va specificata l'allocazione dettagliata delle garanzie reali per le SFT concluse a fronte di un aggregato di garanzie, se disponibile.</p>		
96	Identificativo del paniere di garanzie reali	ISIN secondo ISO 6166, codice di 12 caratteri alfanumerici, oppure «NTAV»
97	Codice del portafoglio	Codice di 52 caratteri alfanumerici, tra cui quattro caratteri speciali: - - - I caratteri speciali non sono autorizzati all'inizio e alla fine del codice. Non sono autorizzati gli spazi.
98	Tipo di azione	«NEWT» — <i>New</i> (nuova) «MODI» — <i>Modification</i> (modifica) «VALU» — <i>Valuation</i> (valutazione) «COLU» — <i>Collateral update</i> (aggiornamento della garanzia) «EROR» — <i>Error</i> (errore) «CORR» — <i>Correction</i> (correzione)

N.	Campo	Formato
		«ETRM» — <i>Termination/Early Termination</i> (cessazione/cessazione anticipata) «POSC» — <i>Position component</i> (componente della posizione)
99	Livello	«TCTN» — <i>Transaction</i> (operazione) «PSTN» — <i>Position</i> (posizione)

Tabella 3

**Dati sui margini**

N.	Campo	Formato
1	Data e ora della segnalazione	Formato della data secondo ISO 8601 e formato dell'ora secondo il Tempo Universale Coordinato (UTC), ossia AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ
2	Data dell'evento	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
3	Soggetto che trasmette la segnalazione	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
4	Controparte segnalante	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
5	Soggetto responsabile della segnalazione	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
6	Altra controparte	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
7	Codice del portafoglio	Codice di 52 caratteri alfanumerici, tra cui quattro caratteri speciali: - - - I caratteri speciali non sono autorizzati all'inizio e alla fine del codice. Non sono autorizzati gli spazi.
8	Margine iniziale costituito	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
9	Valuta del margine iniziale costituito	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
10	Margine di variazione costituito	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
11	Valuta del margine di variazione costituito	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
12	Margine iniziale ricevuto	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
13	Valuta del margine iniziale ricevuto	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
14	Margine di variazione ricevuto	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.

N.	Campo	Formato
15	Valuta del margine di variazione ricevuto	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
16	Garanzia costituita in eccesso	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
17	Valuta della garanzia costituita in eccesso	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
18	Garanzia ricevuta in eccesso	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
19	Valuta della garanzia ricevuta in eccesso	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
20	Tipo di azione	«NEWT» — <i>New</i> (nuova) «MARU» — <i>Margin update</i> (aggiornamento del margine) «EROR» — <i>Error</i> (errore) «CORR» — <i>Correction</i> (correzione)

Tabella 4

**Dati sul riutilizzo, sul reinvestimento del contante e sulle fonti di finanziamento**

N.	Campo	Formato
1	Data e ora della segnalazione	Formato della data secondo ISO 8601 e formato dell'ora secondo UTC, ossia AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ
2	Data dell'evento	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)
3	Soggetto che trasmette la segnalazione	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
4	Controparte segnalante	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
5	Soggetto responsabile della segnalazione	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo dell'entità giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici

Il campo 6 deve essere ripetuto e compilato per ciascuna componente della garanzia.

6	Tipo di componente della garanzia reale	«SECU» — <i>Securities</i> (titoli) «CASH» — contante
---	---	--

I campi 7, 8, 9 e 10 devono essere ripetuti e compilati per ciascun titolo.

7	Componente della garanzia reale	ISIN secondo ISO 6166, codice di 12 caratteri alfanumerici
8	Valore della garanzia riutilizzata	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
9	Riutilizzo stimato della garanzia reale	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.

N.	Campo	Formato
10	Valuta della garanzia riutilizzata	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
11	Tasso di reinvestimento	Massimo 11 caratteri numerici compresi massimo 10 decimali espressi in percentuale, dove il 100 % è rappresentato da «100».

I campi 12, 13 e 14 devono essere ripetuti e compilati per ogni investimento se la garanzia in contante è stata reinvestita e per ciascuna valuta.

12	Tipo di reinvestimento del contante	«MMFT» — <i>registered money market fund</i> (fondo del mercato monetario registrato) «OCMP» — <i>any other commingled pool</i> (ogni altro aggregato combinato) «REPM» — <i>the repo market</i> (il mercato delle operazioni di vendita con patto di riacquisto) «SDPU» — <i>direct purchase of securities</i> (acquisto diretto di titoli) «OTHR» — <i>other</i> (altro)
13	Importo del contante reinvestito	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
14	Valuta del contante reinvestito	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici

Nel caso di finanziamenti con margini, la controparte ripete e compila i campi 15, 16 e 17 per ciascuna fonte di finanziamento e fornisce le informazioni in questi campi a livello di soggetto.

15	Fonti di finanziamento	«REPO» — <i>repos or BSB</i> (operazioni di vendita con patto di riacquisto o BSB) «SECL» — <i>cash collateral from securities lending</i> (garanzia in contante proveniente da operazioni di prestito titoli) «FREE» — <i>free credits</i> (crediti gratuiti) «CSHS» — <i>proceeds from customer short sales</i> (proventi delle vendite allo scoperto del cliente) «BSHS» — <i>proceeds from broker short sales</i> (proventi delle vendite allo scoperto dell'intermediario) «UBOR» — <i>unsecured borrowing</i> (assunzione di prestiti non garantiti) «OTHR» — <i>other</i> (altro)
16	Valore di mercato delle fonti di finanziamento	Massimo 18 caratteri numerici compresi massimo 5 decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se non è possibile, importo proporzionale.
17	Valuta delle fonti di finanziamento	Codice valuta secondo ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
18	Tipo di azione	«NEWT» — <i>New</i> (nuova) «REUU» — <i>Reuse update</i> (aggiornamento del riutilizzo) «EROR» — <i>Error</i> (errore) «CORR» — <i>Correction</i> (correzione)

Tabella 5

### Classificazione delle merci

Categoria di prodotti	Sottocategoria di prodotti	Ulteriore sottocategoria di prodotti
«AGRI» — <i>Agricultural</i> (agricoli)	«GROS» — <i>Grains Oil Seeds</i> (cereali e semi oleosi)	«FWHT» — <i>Feed Wheat</i> (frumento da foraggio) «SOYB» — <i>Soybeans</i> (soia) «CORN» — <i>Granturco</i> «RPSD» — <i>Rapeseed</i> (colza) «RICE» — Riso «OTHR» — <i>Other</i> (altro)

Categoria di prodotti	Sottocategoria di prodotti	Ulteriore sottocategoria di prodotti
	«SOFT» — <i>Softs</i>	«CCOA» — <i>Cocoa</i> (cacao) «ROBU» — Caffè Robusta «WHSG» — <i>White Sugar</i> (zucchero bianco) «BRWN» — <i>Raw Sugar</i> (zucchero grezzo) «OTHR» — <i>Other</i> (altro)
	«POTA» — <i>Potato</i> (patate)	
	«OOLI» — Olio di oliva	«LAMP» — «Lampante» «OTHR» — <i>Other</i> (altro)
	«DIRY» — <i>Dairy</i> (prodotti lattiero-caseari)	
	«FRST» — <i>Forestry</i> (silvicoltura)	
	«SEAF» — <i>Seafood</i> (prodotti ittici)	
	«LSTK» — <i>Livestock</i> (bestiame)	
	«GRIN» — <i>Grain</i> (cereali)	«MWHT» — <i>Milling Wheat</i> (frumento da panificazione) «OTHR» — <i>Other</i> (altro)
	«OTHR» — <i>Other</i> (altro)	
«NRGY» — Energy (energia)	«ELEC» — <i>Electricity</i> (energia elettrica)	«BSLD» — <i>Base load</i> (carico di base) «FITR» — <i>Financial Transmission Rights</i> (diritti di trasmissione finanziari) «PKLD» — <i>Peak load</i> (carico di punta) «OFFP» — <i>Off-peak</i> (orario normale) «OTHR» — <i>Other</i> (altro)
	«NGAS» — <i>Natural Gas</i> (gas naturale)	«GASP» — GASPOOL «LNGG» — LNG «NBPG» — NBP «NCGG» — NCG «TTFG» — TTF «OTHR» — <i>Other</i> (altro)
	«OILP» — <i>Oil</i> (petrolio)	«BAKK» — Bakken «BDSL» — Biodiesel «BRNT» — Brent «BRNX» — Brent NX «CNDA» — <i>Canadian</i> (canadese) «COND» — Condensato «DSEL» — Diesel «DUBA» — Dubai «ESPO» — ESPO «ETHA» — <i>Ethanol</i> (etanolo) «FUEL» — Combustibile «FOIL» — <i>Fuel Oil</i> (olio combustibile) «GOIL» — <i>Gasoil</i> (gasolio)

Categoria di prodotti	Sottocategoria di prodotti	Ulteriore sottocategoria di prodotti
		«GSLN» — <i>Gasoline</i> (benzina) «HEAT» — <i>Heating Oil</i> (gasolio da riscaldamento) «JTFL» — JET Fuel «KERO» — Kerosene «LLSO» — <i>Light Louisiana Sweet</i> (LLS) «MARS» — Mars «NAPH» — Nafta «NGLO» — NGL «TAPI» — Tapis «URAL» — Urali «WTIO» — WTI «OTHR» — <i>Other</i> (altro)
	«COAL» — Carbone «INRG» — Inter Energy «RNNG» — <i>Renewable energy</i> (energie rinnovabili) «LGHT» — <i>Light ends</i> (benzina leggera di prima distillazione) «DIST» — Distillati «OTHR» — <i>Other</i> (altro)	
«ENVR» — <i>Environmental</i> (ambientali)	«EMIS» — Emissioni	«CERE» — CER «ERUE» — ERU «EUAЕ» — EUA «EUAA» — EUAA «OTHR» — <i>Other</i> (altro)
	«WTHR» — <i>Weather</i> (meteo) «CRBR» — <i>Carbon related</i> (associati al carbonio) «OTHR» — <i>Other</i> (altro)	
«FRGT» — <i>Freight</i> (carico)	«WETF» — Wet	«TNKR» — <i>Tankers</i> (navi cisterna) «OTHR» — <i>Other</i> (altro)
	«DRYF» — Dry	«DBCR» — <i>Dry bulk carriers</i> (portarinfuse) «OTHR» — <i>Other</i> (altro)
	«CSHP» — <i>Containerships</i> (portacontainer)	
	«OTHR» — <i>Other</i> (altro)	
«FRTL» — <i>Fertilizer</i> (concimi)	«AMMO» — Ammoniaca «DAPH» — DAP ( <i>Diammonium Phosphate</i> ) (fosfato di diammonio, DAP) «PTSH» — <i>Potash</i> (potassa) «SLPH» — <i>Sulphur</i> (zolfo) «UREA» — Urea «UAAN» — UAN ( <i>urea and ammonium nitrate</i> ) (nitrato di ammonio e urea, UAN) «OTHR» — <i>Other</i> (altro)	

Categoria di prodotti	Sottocategoria di prodotti	Ulteriore sottocategoria di prodotti
«INDP» — <i>Industrial products</i> (prodotti industriali)	«CSTR» — <i>Construction</i> (costruzioni) «MFTG» — <i>Manufacturing</i> (manifatturieri)	
«METL» — <i>Metals</i> (metalli)	«NPRM» — <i>Non Precious</i> (non preziosi)	«ALUM» — <i>Aluminium</i> (alluminio) «ALUA» — <i>Aluminium Alloy</i> (lega di alluminio) «CBLT» — Cobalto «COPR» — <i>Copper</i> (rame) «IRON» — <i>Iron ore</i> (minerale di ferro) «LEAD» — Piombo «MOLY» — <i>Molybdenum</i> (molibdeno) «NASC» — NASAAC «NICK» — <i>Nickel</i> (nicel) «STEL» — <i>Steel</i> (acciaio) «TINN» — <i>Tin</i> (stagno) «ZINC» — Zinco «OTHR» — <i>Other</i> (altro)
	«PRME» — <i>Precious</i> (preziosi)	«GOLD» — Oro «SLVR» — <i>Silver</i> (argento) «PTNM» — <i>Platinum</i> (platino) «PLDM» — <i>Palladium</i> (palladio) «OTHR» — <i>Other</i> (altro)
«MCEX» — <i>Multi Commodity Exotic</i> (esotici multimerchi)		
«PAPR» — <i>Paper</i> (carta)	«CBRD» — <i>Containerboard</i> (cartone grezzo ondulato) «NSPT» — <i>Newsprint</i> (carta da giornale) «PULP» — <i>Pulp</i> (polpa) «RCVP» — <i>Recovered paper</i> (carta di recupero) «OTHR» — <i>Other</i> (altro)	
«POLY» — <i>Polypropylene</i> (polipropilene)	«PLST» — <i>Plastica</i> «OTHR» — <i>Other</i> (altro)	
«INFL» — <i>Inflazione</i>		
«OEST» — <i>Official economic statistics</i> (statistiche economiche ufficiali)		
«OTHC» — Altri C10 secondo la definizione della tabella 10.1 dell'allegato III, sezione 10, del regolamento delegato (UE) 2017/583 della Commissione <sup>(1)</sup>		
«OTHR» — <i>Other</i> (altro)		

<sup>(1)</sup> Regolamento delegato (UE) 2017/583 della Commissione, del 14 luglio 2016, che integra il regolamento (UE) n. 600/2014 del Parlamento europeo e del Consiglio sui mercati degli strumenti finanziari per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione sugli obblighi di trasparenza a carico delle sedi di negoziazione e delle imprese di investimento in relazione a obbligazioni, strumenti finanziari strutturati, quote di emissione e derivati (GU L 87 del 31.3.2017, pag. 229).

## ALLEGATO II

L'allegato del regolamento di esecuzione (UE) n. 1247/2012 è sostituito dal testo seguente.

«ALLEGATO

Tabella 1

**Dati sulla controparte**

	Campo	Formato
	Parti del contratto	
1	Data e ora della segnalazione	Formato della data secondo ISO 8601 e formato dell'ora secondo il Tempo Universale Coordinato (UTC) AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ
2	Identificativo della controparte segnalante	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
3	Tipo di identificativo dell'altra controparte	“LEI” per codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 “CLC” per codice cliente
4	Identificativo dell'altra controparte	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici Codice cliente (massimo 50 caratteri alfanumerici)
5	Paese dell'altra controparte	Codice paese secondo ISO 3166 di 2 caratteri
6	Settore di attività della controparte segnalante	Tassonomia delle controparti finanziarie: A = impresa di assicurazione autorizzata ai sensi della direttiva 2009/138/CE del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(1)</sup> C = ente creditizio autorizzato ai sensi della direttiva 2013/36/UE del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(2)</sup> F = impresa di investimento autorizzata ai sensi della direttiva 2004/39/CE del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(3)</sup> I = impresa di assicurazione autorizzata ai sensi della direttiva 2009/138/CE L = fondo di investimento alternativo gestito da un gestore di fondi di investimento alternativi (GEFIA) autorizzato o registrato ai sensi della direttiva 2011/61/UE del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(4)</sup> O = ente pensionistico aziendale o professionale ai sensi dell'articolo 6, lettera a), della direttiva 2003/41/CE del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(5)</sup> R = impresa di riassicurazione autorizzata ai sensi della direttiva 2009/138/CE U = organismo di investimento collettivo in valori mobiliari (OICVM) e relativa società di gestione, autorizzati ai sensi della direttiva 2009/65/CE del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(6)</sup>  Tassonomia delle controparti non finanziarie. Le seguenti categorie corrispondono alle principali sezioni della classificazione statistica delle attività economiche nella Comunità europea (NACE), quale definita dal regolamento (CE) n. 1893/2006 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(7)</sup> : 1 = agricoltura, silvicoltura e pesca 2 = attività estrattiva 3 = attività manifatturiere 4 = fornitura di energia elettrica, gas, vapore e aria condizionata

	Campo	Formato
		<p>5 = fornitura di acqua; reti fognarie, attività di trattamento dei rifiuti e risanamento</p> <p>6 = costruzioni</p> <p>7 = commercio all'ingrosso e al dettaglio; riparazione di autoveicoli e motocicli</p> <p>8 = trasporto e magazzinaggio</p> <p>9 = servizi di alloggio e di ristorazione</p> <p>10 = servizi di informazione e comunicazione</p> <p>11 = attività finanziarie e assicurative</p> <p>12 = attività immobiliari</p> <p>13 = attività professionali, scientifiche e tecniche</p> <p>14 = attività amministrative e di servizi di supporto</p> <p>15 = amministrazione pubblica e difesa; assicurazione sociale obbligatoria</p> <p>16 = istruzione</p> <p>17 = sanità e assistenza sociale</p> <p>18 = attività artistiche, di intrattenimento e divertimento</p> <p>19 = altre attività di servizi</p> <p>20 = attività di famiglie e convivenze come datori di lavoro per personale domestico; produzione di beni e di servizi indifferenziati per uso proprio da parte di famiglie e convivenze</p> <p>21 = attività di organizzazioni ed organismi extraterritoriali</p> <p>Se viene indicata più di un'attività, elencare i codici nell'ordine di importanza relativa delle attività corrispondenti, separati da "-".</p> <p>Lasciare in bianco in caso di controparti centrali (CCP) e altri tipi di controparti di cui all'articolo 1, paragrafo 5, del regolamento (UE) n. 648/2012.</p>
7	Natura della controparte segnalante	<p>F = controparte finanziaria</p> <p>N = controparte non finanziaria</p> <p>C = controparte centrale</p> <p>O = altro</p>
8	Identificativo dell'intermediario	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
9	Identificativo del soggetto segnalante	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
10	Identificativo del partecipante diretto	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici
11	Tipo di identificativo del beneficiario	<p>"LEI" per codice LEI (<i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442</p> <p>"CLC" per codice cliente</p>
12	Identificativo del beneficiario	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici o codice cliente di massimo 50 caratteri alfanumerici, nel caso in cui il cliente non possa ricevere il codice LEI
13	Capacità negoziale	<p>P = principale</p> <p>A = agente</p>
14	Lato della controparte	<p>B = acquirente</p> <p>S = venditore</p> <p>Compilato conformemente all'articolo 3 bis</p>

	Campo	Formato
15	Direttamente collegato ad attività commerciali o di finanziamento di tesoreria	Y = Sì N = No
16	Soglia di compensazione	Y = al di sopra della soglia N = al di sotto della soglia
17	Valore del contratto	Massimo 20 caratteri numerici inclusi i decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.
18	Valuta del valore	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
19	Data e ora della valutazione	Data nel formato secondo ISO 8601 e ora nel formato UTC AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ
20	Tipo di valutazione	M = ai prezzi correnti di mercato O = in base ad un modello C = valutazione della CCP
21	Costituzione di garanzia	U = senza garanzia PC = con garanzia parziale OC = con garanzia unilaterale FC = pienamente garantito Compilato conformemente all'articolo 3 <i>ter</i>
22	Garanzia per portafoglio	Y = Sì N = No
23	Codice della garanzia per portafoglio	Massimo 52 caratteri alfanumerici, di cui quattro caratteri speciali: ". - _." I caratteri speciali non sono autorizzati all'inizio e alla fine del codice. Non sono autorizzati gli spazi.
24	Margine iniziale costituito	Massimo 20 caratteri numerici inclusi i decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
25	Valuta del margine iniziale costituito	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
26	Margine di variazione costituito	Massimo 20 caratteri numerici inclusi i decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
27	Valuta dei margini di variazione costituiti	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
28	Margine iniziale ricevuto	Massimo 20 caratteri numerici inclusi i decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
29	Valuta del margine iniziale ricevuto	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici

	Campo	Formato
30	Margine di variazione ricevuto	Massimo 20 caratteri numerici inclusi i decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
31	Valuta dei margini di variazione ricevuti	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
32	Garanzia costituita in eccesso	Massimo 20 caratteri numerici inclusi i decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
33	Valuta della garanzia costituita in eccesso	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici
34	Garanzia ricevuta in eccesso	Massimo 20 caratteri numerici inclusi i decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.
35	Valuta della garanzia ricevuta in eccesso	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici

- (1) Direttiva 2009/138/CE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 25 novembre 2009, in materia di accesso ed esercizio delle attività di assicurazione e di riassicurazione (solvibilità II) (GU L 335 del 17.12.2009, pag. 1).
- (2) Direttiva 2013/36/UE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 26 giugno 2013, sull'accesso all'attività degli enti creditizi e sulla vigilanza prudenziale sugli enti creditizi e sulle imprese di investimento, che modifica la direttiva 2002/87/CE e abroga le direttive 2006/48/CE e 2006/49/CE (GU L 176 del 27.6.2013, pag. 338).
- (3) Direttiva 2004/39/CE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 21 aprile 2004, relativa ai mercati degli strumenti finanziari, che modifica le direttive 85/611/CEE e 93/6/CEE del Consiglio e la direttiva 2000/12/CE del Parlamento europeo e del Consiglio e che abroga la direttiva 93/22/CEE del Consiglio (GU L 145 del 30.4.2004, pag. 1).
- (4) Direttiva 2011/61/UE del Parlamento europeo e del Consiglio, dell'8 giugno 2011, sui gestori di fondi di investimento alternativi, che modifica le direttive 2003/41/CE e 2009/65/CE e i regolamenti (CE) n. 1060/2009 e (UE) n. 1095/2010 (GU L 174 dell'1.7.2011, pag. 1).
- (5) Direttiva 2003/41/CE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 3 giugno 2003, relativa alle attività e alla supervisione degli enti pensionistici aziendali o professionali (GU L 235 del 23.9.2003, pag. 10).
- (6) Direttiva 2009/65/CE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 13 luglio 2009, concernente il coordinamento delle disposizioni legislative, regolamentari e amministrative in materia di taluni organismi d'investimento collettivo in valori mobiliari (OICVM) (GU L 302 del 17.11.2009, pag. 32).
- (7) Regolamento (CE) n. 1893/2006 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 20 dicembre 2006, che definisce la classificazione statistica delle attività economiche NACE Revisione 2 e modifica il regolamento (CEE) n. 3037/90 del Consiglio nonché alcuni regolamenti (CE) relativi a settori statistici specifici (GU L 393 del 30.12.2006, pag. 1).

Tabella 2

## Dati comuni

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
	Sezione 2a — tipo di contratto		Tutti i contratti
1	Tipo di contratto	CD = contratti finanziari differenziali FR = contratti sui tassi a termine del tipo <i>forward rate agreement</i> FU = <i>future</i> FW = <i>forward</i> OP = opzione SB = scommesse su differenziale SW = <i>swap</i> ST = <i>swaption</i> OT = altro	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
2	Classe di attività	CO = materie prime e quote di emissione CR = crediti CU = valute EQ = azioni IR = tassi di interesse	
	Sezione 2b — informazioni sul contratto		Tutti i contratti
3	Tipo di classificazione del prodotto	C = CFI	
4	Classificazione del prodotto	CFI secondo ISO 10692, codice di 6 caratteri alfabetici	
5	Tipo di identificazione del prodotto	Precisare l'identificazione applicabile: I = ISIN A = AII	
6	Identificazione del prodotto	Per l'identificativo del prodotto di tipo I: ISIN secondo ISO 6166, codice di 12 caratteri alfanumerici Per l'identificativo del prodotto di tipo A: codice AII completo	
7	Tipo di identificazione del sottostante	I = ISIN A = AII B = paniere X = indice	
8	Identificazione del sottostante	Per il tipo I di identificazione del sottostante: ISIN secondo ISO 6166, codice di 12 caratteri alfanumerici Per il tipo A di identificazione del sottostante: codice AII completo Per il tipo B di identificazione del sottostante: identificazione di tutti i singoli componenti mediante ISIN secondo ISO 6166 o il codice AII completo. Gli identificativi dei singoli componenti sono separati da un trattino “-”. Per il tipo X di identificazione del sottostante: ISIN secondo ISO 6166, se disponibile, altrimenti nome completo dell'indice attribuito dal fornitore dell'indice	
9	Valuta nozionale 1	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici	
10	Valuta nozionale 2	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici	
11	Valuta di consegna	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici	
	Sezione 2c — Dati sull'operazione		Tutti i contratti
12	Identificativo dell'operazione	Codice di massimo 52 caratteri alfanumerici, tra cui quattro caratteri speciali: “. - _.” I caratteri speciali non sono autorizzati all'inizio e alla fine del codice. Non sono autorizzati gli spazi.	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
13	Numero di tracciamento della segnalazione	Campo alfanumerico di massimo 52 caratteri	
14	Identificativo della componente di negoziazione complessa	Campo alfanumerico di massimo 35 caratteri	
15	Sede di esecuzione	Codice identificativo del mercato ( <i>Market Identifier Code</i> — MIC) secondo ISO 10383 di 4 caratteri alfanumerici, conformemente all'articolo 4, lettera b)	
16	Compressione	Y = il contratto deriva da compressione N = il contratto non deriva da compressione	
17	Prezzo/tasso	Massimo 20 caratteri numerici inclusi i decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico. Se indicato in valore percentuale, il prezzo dovrebbe essere espresso in percentuale, dove il 100 % è rappresentato da "100"	
18	Notazione del prezzo	U = unità P = percentuale Y = rendimento	
19	Valuta del prezzo	Codice valuta ISO 4217 di 3 caratteri alfabetici	
20	Importo nozionale	Massimo 20 caratteri numerici inclusi i decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.	
21	Moltiplicatore del prezzo	Massimo 20 caratteri numerici inclusi i decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.	
22	Quantità	Massimo 20 caratteri numerici inclusi i decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.	
23	Pagamento anticipato	Massimo 20 caratteri numerici inclusi i decimali. Il simbolo negativo deve essere utilizzato per indicare che il pagamento è stato effettuato, e non ricevuto. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
24	Tipo di consegna	C = in contante P = fisica O = facoltativo per la controparte o quando stabilito da terzi	
25	Data e ora di esecuzione	Data nel formato secondo ISO 8601 e ora nel formato UTC AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ	
26	Data di entrata in vigore	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)	
27	Data di scadenza	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)	
28	Data di cessazione	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)	
29	Data di regolamento	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)	
30	Tipo di accordo quadro	Campo di testo libero, massimo 50 caratteri; indicare il nome dell'eventuale accordo quadro utilizzato.	
31	Versione dell'accordo quadro	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA)	
	Sezione 2d — attenuazione dei rischi/segnalazione		Tutti i contratti
32	Data e ora della conferma	Data nel formato secondo ISO 8601 e ora nel formato UTC AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ	
33	Mezzi di conferma	Y = confermato con mezzo non elettronico N = non confermato E = confermato con mezzo elettronico	
	Sezione 2e — compensazione		Tutti i contratti
34	Obbligo di compensazione	Y = Sì N = No	
35	Compensato	Y = Sì N = No	
36	Data e ora della compensazione	Data nel formato secondo ISO 8601 e ora nel formato UTC AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ	
37	Controparte centrale (CCP)	Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici	
38	Infragruppo	Y = Sì N = No	
	Sezione 2f — tassi di interesse		Derivati su tassi di interesse
39	Tasso fisso della gamba 1	Massimo 10 caratteri numerici compresi i decimali espressi in percentuale, dove il 100 % è rappresentato da "100"	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
		Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.	
40	Tasso fisso della gamba 2	Massimo 10 caratteri numerici compresi i decimali espressi in percentuale, dove il 100 % è rappresentato da "100" Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.	
41	Conteggio dei giorni del tasso fisso della gamba 1	Numeratore/denominatore, dove sia il numeratore che il denominatore sono caratteri numerici o l'espressione alfabetica "Actual", ad esempio 30/360 o Actual/365	
42	Conteggio dei giorni del tasso fisso della gamba 2	Numeratore/denominatore, dove sia il numeratore che il denominatore sono caratteri numerici o l'espressione alfabetica "Actual", ad esempio 30/360 o Actual/365	
43	Frequenza di pagamento per il tasso fisso della gamba 1 — Periodo	Periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti si scambiano i pagamenti. Si applicano le seguenti abbreviazioni: Y = anno M = mese W = settimana D = giorno	
44	Frequenza di pagamento per il tasso fisso della gamba 1 — Moltiplicatore	Un intero multiplo del periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti si scambiano i pagamenti. Massimo 3 caratteri numerici.	
45	Frequenza di pagamento per il tasso fisso della gamba 2 — Periodo	Periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti si scambiano i pagamenti. Si applicano le seguenti abbreviazioni: Y = anno M = mese W = settimana D = giorno	
46	Frequenza di pagamento per il tasso fisso della gamba 2 — Moltiplicatore	Un intero multiplo del periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti si scambiano i pagamenti. Massimo 3 caratteri numerici.	
47	Frequenza di pagamento per il tasso variabile della gamba 1 — Periodo	Periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti si scambiano i pagamenti. Si applicano le seguenti abbreviazioni: Y = anno M = mese W = settimana D = giorno	
48	Frequenza di pagamento per il tasso variabile della gamba 1 — Moltiplicatore	Un intero multiplo del periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti si scambiano i pagamenti. Massimo 3 caratteri numerici.	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
49	Frequenza di pagamento per il tasso variabile della gamba 2 — Periodo	Periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti si scambiano i pagamenti. Si applicano le seguenti abbreviazioni: Y = anno M = mese W = settimana D = giorno	
50	Frequenza di pagamento per il tasso variabile della gamba 2 — Moltiplicatore	Un intero multiplo del periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti si scambiano i pagamenti. Massimo 3 caratteri numerici.	
51	Frequenza di revisione per il tasso variabile della gamba 1 — Periodo	Periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti rivedono il tasso variabile. Si applicano le seguenti abbreviazioni: Y = anno M = mese W = settimana D = giorno	
52	Frequenza di revisione per il tasso variabile della gamba 1 — Moltiplicatore	Un intero multiplo del periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti rivedono il tasso variabile. Massimo 3 caratteri numerici.	
53	Frequenza di revisione del tasso variabile della gamba 2 — Periodo	Periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti rivedono il tasso variabile. Si applicano le seguenti abbreviazioni: Y = anno M = mese W = settimana D = giorno	
54	Frequenza di revisione per il tasso variabile della gamba 2 — Moltiplicatore	Un intero multiplo del periodo di tempo che descrive il numero di volte che le controparti rivedono il tasso variabile. Massimo 3 caratteri numerici.	
55	Tasso variabile della gamba 1	Nome dell'indice a tasso variabile "EONA" — EONIA "EONS" — EONIA SWAP ( <i>swap</i> sull'EONIA) "EURI" — EURIBOR "EUUS" — EURODOLLAR "EUCH" — EuroSwiss "GCFR" — GCF REPO "ISDA" — ISDAFIX "LIBI" — LIBID "LIBO" — LIBOR "MAAA" — Muni AAA "PFAN" — Pfandbriefe "TIBO" — TIBOR "STBO" — STIBOR "BBSW" — BBSW	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
		"JIBA" — JIBAR "BUBO" — BUBOR "CDOR" — CDOR "CIBO" — CIBOR "MOSP" — MOSPRIM "NIBO" — NIBOR "PRBO" — PRIBOR "TLBO" — TELBOR "WIBO" — WIBOR "TREA" — <i>Treasury</i> (Tesoro) "SWAP" — <i>swap</i> "FUSW" — <i>swap su future</i> O massimo 25 caratteri alfanumerici se il tasso di riferimento non figura nel precedente elenco	
56	Periodo di riferimento del tasso variabile della gamba 1 — Periodo	Periodo di tempo che descrive il periodo di riferimento. Si applicano le seguenti abbreviazioni: Y = anno M = mese W = settimana D = giorno	
57	Periodo di riferimento del tasso variabile della gamba 1 — Moltiplicatore	Un intero multiplo del periodo di tempo che descrive il periodo di riferimento. Massimo 3 caratteri numerici.	
58	Tasso variabile della gamba 2	Nome dell'indice a tasso variabile "EONA" — EONIA "EONS" — EONIA SWAP ( <i>swap sull'EONIA</i> ) "EURI" — EURIBOR "EUUS" — EURODOLLAR "EUCH" — EuroSwiss "GCFR" — GCF REPO "ISDA" — ISDAFIX "LIBI" — LIBID "LIBO" — LIBOR "MAAA" — Muni AAA "PFAN" — Pfandbriefe "TIBO" — TIBOR "STBO" — STIBOR "BBSW" — BBSW "JIBA" — JIBAR "BUBO" — BUBOR "CDOR" — CDOR "CIBO" — CIBOR "MOSP" — MOSPRIM "NIBO" — NIBOR "PRBO" — PRIBOR	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
		"TLBO" — TELBOR "WIBO" — WIBOR "TREA" — <i>Treasury</i> (Tesoro) "SWAP" — <i>swap</i> "FUSW" — <i>swap su future</i> O massimo 25 caratteri alfanumerici se il tasso di riferimento non figura nel precedente elenco	
59	Periodo di riferimento del tasso variabile della gamba 2 — Periodo	Periodo di tempo che descrive il periodo di riferimento. Si applicano le seguenti abbreviazioni: Y = anno M = mese W = settimana D = giorno	
60	Periodo di riferimento del tasso variabile della gamba 2 — Moltiplicatore	Un intero multiplo del periodo di tempo che descrive il periodo di riferimento. Massimo 3 caratteri numerici.	
	Sezione 2 g — tassi di cambio		Derivati su valute
61	Valuta di consegna 2	Codice valuta ISO 4217 a 3 caratteri alfabetici	
62	Tasso di cambio 1	Massimo 10 caratteri numerici inclusi i decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.	
63	Tasso di cambio a termine	Massimo 10 caratteri numerici inclusi i decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.	
64	Base del tasso di cambio	Due codici valuta ISO 4217 separati da "/". Il primo codice valuta indica la valuta di base e il secondo codice valuta indica la valuta della quotazione.	
	Sezione 2 h — materie prime e quote di emissione		Derivati su materie prime e quote di emissione
	Osservazioni generali		
65	Materie prime sottostanti	AG = agricole EN = energia	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
		FR = trasporto merci ME = metalli IN = indice EV = ambientali EX = esotiche OT = altro	
66	Informazioni specifiche sulle materie prime	<p><i>Agricole</i></p> GO = cereali e semi oleosi DA = prodotti lattiero-caseari LI = animali FO = prodotti forestali SO = softs SF = prodotti ittici OT = altro	
		<p><i>Energia</i></p> OI = petrolio NG = gas naturale CO = carbone EL = energia elettrica IE = interenergia OT = altro	
		<p><i>Trasporto merci</i></p> DR = secco WT = umido OT = altro	
		<p><i>Metalli</i></p> PR = preziosi NP = non preziosi	
		<p><i>Ambiente</i></p> WE = clima EM = emissioni OT = altro	
	Energia		
67	Punto o zona di consegna	Codice EIC alfanumerico di 16 caratteri Campo ripetibile	
68	Punto di interconnessione	Codice EIC alfanumerico di 16 caratteri	
69	Tipo di carico	BL = carico di base PL = carico di picco OP = carico normale BH = ora/blocco orario SH = profilato GD = giorno gas OT = altro	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
	Sezione ripetibile dei campi da 70 a 77		
70	Intervalli di consegna del carico	hh:mmZ	
71	Data e ora di inizio della consegna	Data nel formato secondo ISO 8601 e ora nel formato UTC AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ	
72	Data e ora di fine della consegna	Data nel formato secondo ISO 8601 e ora nel formato UTC AAAA-MM-GGThh:mm:ssZ	
73	Durata	N = minuti H = ora D = giorno W = settimana M = mese Q = trimestre S = stagione Y = annuale O = altro	
74	Giorni della settimana	WD = giorni feriali WN = fine settimana MO = lunedì TU = martedì WE = mercoledì TH = giovedì FR = venerdì SA = sabato SU = domenica Sono consentiti valori multipli separati da "/"	
75	Capacità di consegna	Massimo 20 caratteri numerici inclusi i decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.	
76	Unità di quantità	KW KWh/h KWh/d MW MWh/h MWh/d GW GWh/h GWh/d	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
		Therm/d KTherm/d MTherm/d cm/d mcm/d	
77	Prezzo per quantità per intervallo di tempo	Massimo 20 caratteri numerici inclusi i decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico.	
	Sezione 2i — opzioni		Contratti contenenti un'opzione
78	Tipo di opzione	P = <i>put</i> C = <i>call</i> O = se non è possibile stabilire se si tratta di <i>call</i> o di <i>put</i>	
79	Stile di esercizio dell'opzione	A = americano B = bermudiano E = europeo S = asiatico È consentito più di un valore	
80	Prezzo <i>strike</i> (tasso <i>cap/floor</i> )	Massimo 20 caratteri numerici inclusi i decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto. Il simbolo negativo, se inserito, non è contato come carattere numerico. Se indicato in valore percentuale, il prezzo <i>strike</i> dovrebbe essere espresso in percentuale, dove il 100 % è rappresentato da "100"	
81	Notazione del prezzo <i>strike</i>	U = unità P = percentuale Y = rendimento	
82	Data di scadenza del sottostante	Formato della data secondo ISO 8601 (AAAA-MM-GG)	
	Sezione 2 j — derivati su crediti		
83	Rango	SNDB = senior, ad esempio debito <i>senior</i> non garantito (societario/finanziario), debito sovrano in valuta estera (governo)	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
		SBOD = subordinato, ad esempio debito subordinato o debito di classe 2 inferiore ( <i>lower tier 2</i> ) (banche), debito subordinato <i>junior</i> o debito di classe 2 superiore ( <i>upper tier 2</i> ) (banche) OTHR = altro, ad esempio azioni privilegiate o capitale di classe 1 (banche) o altri derivati su crediti	
84	Entità di riferimento	Codice paese secondo ISO 3166 di 2 caratteri o Codice paese secondo ISO 3166-2 di 2 caratteri seguito da trattino "-" e da massimo 3 caratteri alfanumerici per il codice di suddivisione del paese o Codice LEI ( <i>Legal Entity Identifier</i> — identificativo della persona giuridica) secondo ISO 17442 di 20 caratteri alfanumerici	
85	Frequenza pagamenti	MNTH = mensile QURT = trimestrale MIAN = semestrale YEAR = annuale	
86	La base di calcolo	Numeratore/denominatore, dove sia il numeratore che il denominatore sono caratteri numerici o l'espressione alfabetica "Actual", ad esempio 30/360 o Actual/365	
87	Serie	Campo con numero intero di massimo 5 cifre	
88	Version (versione)	Campo con numero intero di massimo 5 cifre	
89	Fattore dell'indice	Massimo 10 caratteri numerici inclusi i decimali. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.	
90	Segmento	T = segmentato U = non segmentato	
91	Punto di attacco ( <i>attachment point</i> )	Massimo 10 caratteri numerici, compresi i decimali espressi come frazione decimale tra 0 e 1. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.	
92	Punto di distacco ( <i>detachment point</i> )	Massimo 10 caratteri numerici, compresi i decimali espressi come frazione decimale tra 0 e 1. Il segno del decimale non è contato come carattere numerico. Se inserito, è rappresentato da un punto.	
	Sezione 2k — modifiche del contratto		
93	Tipo di azione	N = nuova M = modifica	

	Campo	Formato	Tipi di contratti derivati interessati
		E = errore C = cessazione anticipata R = correzione Z = compressione V = aggiornamento della valutazione P = componente della posizione	
94	Livello	T = operazione P = posizione»	

**REGOLAMENTO DI ESECUZIONE (UE) 2019/364 DELLA COMMISSIONE****del 13 dicembre 2018****che stabilisce norme tecniche di attuazione per quanto riguarda il formato della domanda di registrazione e della domanda di estensione della registrazione dei repertori di dati sulle negoziazioni a norma del regolamento (UE) 2015/2365 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) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 25 novembre 2015, sulla trasparenza delle operazioni di finanziamento tramite titoli e del riutilizzo e che modifica il regolamento (UE) n. 648/2012 <sup>(1)</sup>, in particolare l'articolo 5, paragrafo 8,

considerando quanto segue:

- (1) Un formato uniforme per le domande di registrazione e di estensione della registrazione dei repertori di dati sulle negoziazioni presentate all'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (ESMA) dovrebbe garantire che tutte le informazioni richieste ai sensi del regolamento delegato (UE) 2019/359 della Commissione <sup>(2)</sup>, siano trasmesse all'ESMA e siano da questa facilmente identificate.
- (2) Per favorire l'identificazione delle informazioni fornite dal repertorio di dati sulle negoziazioni, ogni documento incluso nella domanda dovrebbe essere contraddistinto da un numero di riferimento unico.
- (3) A norma dell'articolo 1, paragrafo 3, del regolamento delegato (UE) 2019/359, se ritiene che un requisito del regolamento delegato (UE) 2019/359 non si applichi nel suo caso, il repertorio di dati sulle negoziazioni deve indicare chiaramente nella domanda il requisito in questione e spiegare perché non si applica. I requisiti e le spiegazioni in questione dovrebbero essere chiaramente indicati nella domanda di registrazione o nella domanda di estensione della registrazione.
- (4) Le informazioni trasmesse all'ESMA nella domanda di registrazione o nella domanda di estensione della registrazione di un repertorio di dati sulle negoziazioni dovrebbero essere fornite su un supporto durevole quale definito nella direttiva 2009/65/CE del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(3)</sup>, al fine di consentirne la conservazione per gli usi futuri e per la riproduzione.
- (5) Il presente regolamento si basa sui progetti di norme tecniche di attuazione che l'ESMA ha presentato alla Commissione a norma della procedura di cui all'articolo 15 del regolamento (UE) n. 1095/2010 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(4)</sup>.
- (6) L'ESMA ha effettuato consultazioni pubbliche aperte sui progetti di norme tecniche di attuazione, ne ha analizzato i potenziali costi e benefici e 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***Formato della domanda di registrazione e della domanda di estensione della registrazione**

1. La domanda di registrazione o la domanda di estensione della registrazione è presentata nel formato di cui all'allegato.
2. Il repertorio di dati sulle negoziazioni attribuisce un numero di riferimento unico a ogni documento presentato e indica chiaramente a quale obbligo specifico di cui al regolamento delegato (UE) 2019/359 si riferisce il documento.

<sup>(1)</sup> GUL 337 del 23.12.2015, pag. 1.<sup>(2)</sup> Regolamento delegato (UE) 2019/359 della Commissione, del 13 dicembre 2018, che integra il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione che specificano i dettagli della domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni e della domanda di estensione della registrazione (cfr. pag. 45 della presente Gazzetta ufficiale).<sup>(3)</sup> Direttiva 2009/65/CE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 13 luglio 2009, concernente il coordinamento delle disposizioni legislative, regolamentari e amministrative in materia di taluni organismi d'investimento collettivo in valori mobiliari (OICVM) (GUL 302 del 17.11.2009, pag. 32).<sup>(4)</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) (GUL 331 del 15.12.2010, pag. 84).

3. La domanda di registrazione o la domanda di estensione della registrazione indica chiaramente i motivi per cui non sono presentate le informazioni facenti riferimento a un determinato requisito.
4. La domanda di registrazione o la domanda di estensione della registrazione è presentata su un supporto durevole quale definito all'articolo 2, paragrafo 1, lettera m), della direttiva 2009/65/CE.

*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 13 dicembre 2018

*Per la Commissione*  
*Il presidente*  
Jean-Claude JUNCKER

---

## ALLEGATO

---

 FORMATO DELLA DOMANDA DI REGISTRAZIONE O DELLA DOMANDA DI ESTENSIONE DELLA REGISTRAZIONE COME  
 REPERTORIO DI DATI SULLE NEGOZIAZIONI
 

---

## INFORMAZIONI GENERALI

Data di presentazione della domanda	
Denominazione sociale del repertorio di dati sulle negoziazioni	
Indirizzo della sede legale del repertorio di dati sulle negoziazioni	
Categorie di operazioni di finanziamento tramite titoli per le quali il repertorio di dati sulle negoziazioni chiede la registrazione	
Nome della persona responsabile della domanda	
Recapiti della persona responsabile della domanda	
Nome della persona/delle persone responsabili della conformità del repertorio di dati sulle negoziazioni o che partecipano alle valutazioni della conformità del repertorio di dati sulle negoziazioni	
Recapiti della persona/delle persone responsabili della conformità del repertorio di dati sulle negoziazioni o che partecipano alle valutazioni della conformità del repertorio di dati sulle negoziazioni	
Identificazione di un'eventuale impresa madre o di eventuali filiazioni	

---

 RIFERIMENTI DEI DOCUMENTI <sup>(1)</sup>


---

Articolo regolamento delegato (UE) 2019/359 della Commissione	Numero di riferimento unico del documento	Titolo del documento	Capitolo, sezione o pagina del documento in cui l'informazione è riportata o motivo della mancata trasmissione dell'informazione

(1) Per tutte le informazioni previste da regolamento delegato (UE) 2019/359 della Commissione, fatta eccezione per l'articolo 1 lettere a), c) e g), dello stesso.

---

**REGOLAMENTO DI ESECUZIONE (UE) 2019/365 DELLA COMMISSIONE****del 13 dicembre 2018****che stabilisce norme tecniche di attuazione per quanto riguarda le procedure e i formulari per lo scambio di informazioni sulle sanzioni, sulle misure e sulle indagini ai sensi del regolamento (UE) 2015/2365 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) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 25 novembre 2015, sulla trasparenza delle operazioni di finanziamento tramite titoli e del riutilizzo e che modifica il regolamento (UE) n. 648/2012 <sup>(1)</sup>, in particolare l'articolo 25, paragrafo 4,

considerando quanto segue:

- (1) Per assicurare che l'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (ESMA) riceva informazioni complete e precise sulle misure amministrative e penali imposte e sulle indagini penali avviate in relazione alle violazioni del regolamento (UE) 2015/2365, dovrebbero essere definiti formulari e procedure comuni per la trasmissione delle informazioni.
- (2) Per evitare duplicazioni e conflitti di competenza tra diverse autorità segnalanti di uno stesso Stato membro, ciascuno Stato membro dovrebbe designare un punto di contatto unico per lo scambio di informazioni con l'ESMA.
- (3) Affinché la relazione annuale sulle sanzioni, sulle misure e sulle indagini che l'ESMA è tenuta a pubblicare contenga informazioni significative, l'autorità competente dovrebbe indicare chiaramente, in appositi formulari, le disposizioni del regolamento (UE) 2015/2365 che sono state violate.
- (4) L'autorità competente dovrebbe trasmettere all'ESMA copia della decisione che impone la sanzione o misura amministrativa assieme ad una sintesi chiara degli elementi essenziali della decisione. Tuttavia, al fine di ridurre l'onere di segnalazione, se una data sanzione o misura amministrativa è già stata notificata all'ESMA a norma dell'articolo 25, paragrafo 3, del regolamento (UE) 2015/2365, l'autorità competente dovrebbe essere tenuta a inserire unicamente un chiaro riferimento alla sanzione o misura.
- (5) Il presente regolamento si basa sui progetti di norme tecniche di attuazione che l'ESMA ha presentato alla Commissione 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) <sup>(2)</sup>.
- (6) Conformemente all'articolo 15 del regolamento (UE) n. 1095/2010, l'ESMA non ha condotto consultazioni pubbliche aperte sui progetti di norme tecniche di attuazione sui quali è basato il presente regolamento, né ha analizzato i potenziali costi e benefici collegati all'introduzione di procedure e formulari comuni per le autorità competenti interessate, in quanto ciò sarebbe stato sproporzionato rispetto all'ambito di applicazione e all'impatto delle norme tecniche di attuazione, tenuto conto che i destinatari sono soltanto le autorità competenti nazionali degli Stati membri e non i partecipanti al mercato.
- (7) 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***Punti di contatto**

1. L'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (ESMA) designa un punto di contatto unico per il ricevimento delle informazioni di cui all'articolo 25, paragrafi 1 e 2, del regolamento (UE) 2015/2365 e per tutte le comunicazioni sulle questioni relative al ricevimento di dette informazioni. I recapiti del punto di contatto sono pubblicati sul sito web dell'ESMA.

<sup>(1)</sup> GUL 337 del 23.12.2015, pag. 1.

<sup>(2)</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).

2. Le autorità competenti di ogni Stato membro designano un punto di contatto unico per il proprio Stato membro per tutte le comunicazioni relative alla trasmissione delle informazioni di cui all'articolo 25, paragrafi 1 e 2, del regolamento (UE) 2015/2365. Le autorità competenti notificano il punto di contatto all'ESMA.

#### *Articolo 2*

### **Comunicazione annuale delle informazioni aggregate**

1. I punti di contatto designati dalle autorità competenti di ciascuno Stato membro ai sensi dell'articolo 1, paragrafo 2, trasmettono all'ESMA le informazioni di cui all'articolo 25, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2015/2365 utilizzando il formulario di cui all'allegato I del presente regolamento. Essi forniscono anche copia delle decisioni di imposizione delle sanzioni amministrative e delle altre misure amministrative e una sintesi delle decisioni, a meno che la sanzione o misura sia già stata segnalata all'ESMA ai sensi dell'articolo 25, paragrafo 3, del regolamento (UE) 2015/2365. La copia delle decisioni è allegata al messaggio di posta elettronica di trasmissione del formulario.

2. I punti di contatto designati dalle autorità competenti di ciascuno Stato membro ai sensi dell'articolo 1, paragrafo 2, trasmettono all'ESMA le informazioni di cui all'articolo 25, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365 utilizzando il formulario di cui all'allegato II del presente regolamento.

3. I formulari di cui ai paragrafi 1 e 2 coprono un periodo di riferimento di un anno civile e, assieme agli eventuali allegati, sono completati per via elettronica e trasmessi per posta elettronica al punto di contatto dell'ESMA entro il 31 marzo dell'anno successivo.

La prima trasmissione dei formulari di cui ai paragrafi 1 e 2 è effettuata nel 2018, per gli anni civili 2016 e 2017.

#### *Articolo 3*

### **Entrata in vigore e applicazione**

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 13 dicembre 2018

*Per la Commissione*

*Il presidente*

Jean-Claude JUNCKER

---

## ALLEGATO I

**Formulario per la trasmissione di informazioni aggregate e granulari relative a tutte le sanzioni amministrative e alle altre misure amministrative imposte**

Informazioni aggregate e granulari relative a tutte le sanzioni amministrative e alle altre misure amministrative imposte da *[nome dell'autorità competente]* nel *[anno]* ai sensi dell'articolo ... del ...

MITTENTE:

Stato membro:

Autorità competente:

Indirizzo:

(Dati della persona di contatto designata)

Nome e cognome:

Telefono:

E-mail:

DESTINATARIO:

ESMA

(Dati della persona di contatto designata)

Nome e cognome:

Telefono:

E-mail:

Periodo di riferimento:

Gentile signor/signora *[inserire il nome]*,

ai sensi dell'articolo 25, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2015/2365, trasmettiamo all'ESMA informazioni aggregate e granulari relative a tutte le sanzioni amministrative e alle altre misure amministrative imposte da *[nome dell'autorità competente]* nel *[anno]*.

---

Le informazioni aggregate sono riportate nella seguente tabella:

Disposizioni del regolamento (UE) 2015/2365 in relazione alle quali sono state imposte sanzioni/altre misure amministrative	Numero di sanzioni/misure imposte nel periodo di riferimento	Importo delle sanzioni finanziarie imposte nel periodo di riferimento
[numero dell'articolo, paragrafo, comma]	[numero delle sanzioni/misure]	[importo delle sanzioni finanziarie <sup>(1)</sup> ]
<b>Totale sanzioni/misure <sup>(2)</sup></b>	<b>[numero totale di sanzioni/misure]</b>	<b>[importo totale delle sanzioni finanziarie]</b>

Le informazioni granulari relative a ognuna delle misure e delle sanzioni riportate nella precedente tabella sono fornite come indicato di seguito.

**In primo luogo**, le seguenti misure e sanzioni imposte nel [anno] sono già state segnalate all'ESMA ai sensi dell'articolo 25, paragrafo 3, del regolamento (UE) 2015/2365:

[Elenco di tutte le misure e sanzioni segnalate nel periodo di riferimento]

**In secondo luogo**, le copie della/e decisione/i relativa/e alle seguenti misure e sanzioni imposte nel [INSERIRE L'ANNO] sono allegate al messaggio di posta elettronica di trasmissione del presente formulario:

[Elenco di tutte le misure e sanzioni per le quali viene trasmessa copia della relativa decisione]

**In terzo luogo**, si fornisce di seguito la sintesi delle seguenti misure e sanzioni:

[Elenco in ordine numerico (1., 2., 3., e segg.) di tutte le misure e sanzioni di cui di seguito viene fornita la sintesi]

1. [Riferimento alla prima misura/sanzione elencata sopra]

[Sintesi della misura/sanzione]

2. [Riferimento alla seconda misura/sanzione elencata sopra]

[Sintesi della misura/sanzione]

[Per la terza sintesi fornita e per quelle successive, continuare in ordine numerico utilizzando il formato di cui sopra.]

Cordiali saluti.

[firma]

\_\_\_\_\_

(1) Inserire il valore in euro o in valuta nazionale. Se la sanzione si riferisce non soltanto a violazioni del pertinente articolo del regolamento (UE) 2015/2365 ma anche a violazioni di altre disposizioni, affiancare al valore la dicitura «IMPORTO AGGREGATO».

(2) Poiché le sanzioni/misure imposte possono riferirsi a più di una disposizione legislativa, la somma delle diverse righe (numero di sanzioni o misure/importo delle sanzioni finanziarie) può non corrispondere al numero totale di sanzioni/misure e/o all'importo totale delle sanzioni finanziarie imposte.

## ALLEGATO II

**Formulario per l'invio di dati anonimi e aggregati relativi a tutte le indagini penali avviate e alle sanzioni penali imposte**

Dati anonimi e aggregati relativi a tutte le indagini penali avviate e alle sanzioni penali imposte nel [anno] ai sensi dell'articolo ... del ...

MITTENTE:

Stato membro:

Autorità competente:

Indirizzo:

(Dati della persona di contatto designata)

Nome e cognome:

Telefono:

E-mail:

DESTINATARIO:

ESMA

(Dati della persona di contatto designata)

Nome e cognome:

Telefono:

E-mail:

Periodo di riferimento:

Gentile signor/signora [*inserire il nome*],

ai sensi dell'articolo 25, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2015/2365, trasmettiamo all'ESMA dati anonimi e aggregati relativi a tutte le indagini penali avviate e alle sanzioni penali imposte in [Stato membro] nel [anno].

---

I dati aggregati sono riportati nelle tabelle che seguono.

**Indagini penali avviate:**

Disposizioni del regolamento (UE) 2015/2365 in base alle quali sono state avviate indagini penali	Numero di indagini penali nel periodo di riferimento
[numero dell'articolo, paragrafo, comma]	[numero di indagini penali]
<b>Totale indagini penali</b>	<b>[numero totale di indagini penali <sup>(1)</sup>]</b>

**Sanzioni penali imposte:**

Disposizioni del regolamento (UE) 2015/2365 in relazione alle quali sono state imposte sanzioni penali.	Numero di sanzioni penali imposte nel periodo di riferimento	Valore delle sanzioni pecuniarie imposte nel periodo di riferimento
[numero dell'articolo, paragrafo, comma]	[numero delle sanzioni penali]	[valore delle sanzioni pecuniarie <sup>(2)</sup> ]
<b>Totale sanzioni penali <sup>(3)</sup></b>	<b>[numero totale di sanzioni penali]</b>	<b>[valore totale delle sanzioni pecuniarie]</b>

Cordiali saluti.

[firma]

<sup>(1)</sup> Poiché le indagini penali possono basarsi su più di una disposizione legislativa, la somma delle diverse righe può non corrispondere al numero totale delle indagini penali.

<sup>(2)</sup> Inserire il valore in euro o in valuta nazionale. Se la sanzione pecuniaria si riferisce non soltanto alla violazione del pertinente articolo del regolamento (UE) 2015/2365 ma anche alla violazione di altre disposizioni, affiancare al valore la dicitura «IMPORTO AGGREGATO».

<sup>(3)</sup> Poiché le sanzioni penali imposte possono basarsi su più di una disposizione legislativa, la somma delle diverse righe (numero di sanzioni penali/valore) può non corrispondere al numero totale di sanzioni penali/valore totale delle sanzioni pecuniarie imposte.









ISSN 1977-0707 (edizione elettronica)  
ISSN 1725-258X (edizione cartacea)



**Ufficio delle pubblicazioni dell'Unione europea**  
2985 Lussemburgo  
LUSSEMBURGO

**IT**