



Consiglio
dell'Unione europea

Bruxelles, 16 luglio 2018
(OR. en)

11190/18
ADD 1

EF 200
ECOFIN 734
DELECT 113

NOTA DI TRASMISSIONE

Origine:	Jordi AYET PUIGARNAU, Direttore, per conto del Segretario Generale della Commissione europea
Data:	13 luglio 2018
Destinatario:	Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, Segretario Generale del Consiglio dell'Unione europea
n. doc. Comm.:	C(2018) 4426 final
Oggetto:	ALLEGATO del REGOLAMENTO DELEGATO (UE) .../.. DELLA COMMISSIONE che integra il regolamento (UE) 2016/1011 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione relative alla forma e al contenuto della domanda di riconoscimento presso l'autorità competente dello Stato membro di riferimento e della presentazione delle informazioni nella notifica all'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (ESMA)

Si trasmette in allegato, per le delegazioni, il documento C(2018) 4426 final.

All.: C(2018) 4426 final



COMMISSIONE
EUROPEA

Bruxelles, 13.7.2018
C(2018) 4426 final

ANNEX 1

ALLEGATO

del

REGOLAMENTO DELEGATO (UE) .../.. DELLA COMMISSIONE

che integra il regolamento (UE) 2016/1011 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione relative alla forma e al contenuto della domanda di riconoscimento presso l'autorità competente dello Stato membro di riferimento e della presentazione delle informazioni nella notifica all'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (ESMA)

ALLEGATO
Informazioni da fornire nella domanda di riconoscimento a norma dell'articolo 32 del regolamento (UE) 2016/1011

**SEZIONE A — INFORMAZIONI SUL FORNITORE E SUL SUO RAPPRESENTANTE
LEGALE NELL'UNIONE**

1. INFORMAZIONI GENERALI

- (a) Nome completo del richiedente e corrispondente identificativo della persona giuridica (LEI).
- (b) Indirizzo dell'ufficio nel paese in cui è ubicato.
- (c) Status giuridico.
- (d) Sito web, ove esistente.
- (e) Nel caso in cui il richiedente sia sottoposto a vigilanza nel paese terzo in cui è ubicato, informazioni circa l'attuale status dell'autorizzazione, comprese le attività per le quali è autorizzato, il nome e l'indirizzo dell'autorità competente del paese terzo e il link al registro di tale autorità competente, se disponibile; qualora vi siano più autorità competenti per la vigilanza, le informazioni sui rispettivi ambiti di competenza.
- (f) La descrizione delle operazioni del richiedente negli Stati membri e nei paesi terzi, siano esse soggette o no a regolamentazione finanziaria UE o extra-UE, che siano pertinenti per l'attività di fornitura di indici di riferimento, nonché l'indicazione di dove tali operazioni sono effettuate.
- (g) Nel caso in cui il richiedente faccia parte di un gruppo, la struttura del gruppo unitamente al prospetto della struttura societaria, che illustrino i collegamenti tra l'impresa madre e le filiazioni. Le imprese e le filiazioni indicate nel prospetto sono identificate con il nominativo completo, lo status giuridico e l'indirizzo della sede legale e dell'amministrazione centrale.
- (h) Un'autocertificazione sul possesso dei requisiti di onorabilità, se del caso comprensiva dei dettagli relativi a eventuali:
 - i) procedimenti disciplinari nei suoi confronti, passati e in corso (a meno che non siano stati respinti);
 - ii) autorizzazioni o registrazioni rifiutate da un'autorità finanziaria;
 - iii) autorizzazioni o registrazioni revocate da un'autorità finanziaria.

2. RAPPRESENTANTE LEGALE NELLO STATO MEMBRO DI RIFERIMENTO

- (a) Documentazione a sostegno della scelta dello Stato membro di riferimento, in applicazione dei criteri di cui all'articolo 32, paragrafo 4, del regolamento (UE) 2016/1011.
- (b) Per quanto riguarda il rappresentante legale stabilito nello Stato membro di riferimento come previsto all'articolo 32, paragrafo 3, del regolamento (UE) 2016/1011:
 - i) nome completo;
 - ii) titolo, per le persone fisiche, o status giuridico, per le persone giuridiche;

- iii) per le persone giuridiche, atto costitutivo, statuto o altro documento costitutivo e indicazione se sono o no sottoposte alla vigilanza di un'autorità di vigilanza;
- iv) indirizzo;
- v) indirizzo di posta elettronica;
- vi) numero di telefono;
- vii) conferma scritta dell'autorità del rappresentante legale ad agire per conto del richiedente conformemente all'articolo 32, paragrafo 3, del regolamento (UE) 2016/1011;
- viii) dettagli sull'esercizio della funzione di sorveglianza da parte del rappresentante legale in relazione alla fornitura di indici di riferimento che possono essere utilizzati nell'Unione;
- ix) nome e cognome, titolo, indirizzo, indirizzo di posta elettronica e numero di telefono del referente all'interno del rappresentante legale.

3. STRUTTURA ORGANIZZATIVA E GOVERNANCE

- (a) Struttura organizzativa interna del consiglio di amministrazione, dei comitati dell'alta dirigenza, della funzione di sorveglianza e di qualsiasi altro organo interno che eserciti funzioni di gestione rilevanti coinvolte nella fornitura dell'indice di riferimento, compresi:
 - i) il mandato o una sua sintesi; e
 - ii) il rispetto di codici di governance o di disposizioni simili.
- (b) Procedure atte a garantire che i dipendenti dell'amministratore e altre persone fisiche i cui servizi sono messi a sua disposizione o sotto il suo controllo e che sono direttamente coinvolte nella fornitura dell'indice di riferimento abbiano le competenze, le conoscenze e l'esperienza necessarie per i compiti loro assegnati e operino nel rispetto delle disposizioni di cui all'articolo 4, paragrafo 7, del regolamento (UE) 2016/1011.
- (c) Il numero di dipendenti (a tempo determinato e a tempo indeterminato) che partecipano alla fornitura dell'indice di riferimento.

4. CONFLITTI DI INTERESSE

- (a) Politiche e procedure che trattano:
 - i) il modo in cui i conflitti di interesse attuali e potenziali sono o saranno individuati, registrati, gestiti, attenuati, prevenuti o risolti;
 - ii) circostanze particolari che si applicano al richiedente o a un particolare indice di riferimento fornito dal richiedente, che può essere utilizzato nell'Unione e in relazione a cui è più probabile che insorgano conflitti di interesse, anche nei casi in cui: nel processo di determinazione dell'indice di riferimento sia esercitato il giudizio o la discrezionalità di un esperto, il richiedente appartenga allo stesso gruppo di un utente dell'indice di riferimento e il richiedente sia un partecipante del mercato o della realtà economica che l'indice di riferimento intende misurare.

- (b) Per l'indice di riferimento o per la famiglia di indici di riferimento, l'elenco degli eventuali conflitti di interessi rilevanti individuati, unitamente alle relative misure di attenuazione.
- (c) La struttura della politica di remunerazione, che specifichi i criteri utilizzati per determinare la remunerazione delle persone partecipanti, direttamente o indirettamente, all'attività di fornitura degli indici di riferimento.

5. **STRUTTURA DI CONTROLLO INTERNO, SORVEGLIANZA E QUADRO DI RESPONSABILITÀ**

- (a) Politiche e procedure per monitorare le attività di fornitura dell'indice di riferimento o della famiglia di indici di riferimento, comprese quelle riguardanti:
 - i) i sistemi informatici;
 - ii) la gestione dei rischi, unitamente alla mappatura dei rischi che possono insorgere e incidere sull'accuratezza, l'integrità e la rappresentatività degli indici di riferimento forniti o sulla continuità dell'attività di fornitura, comprese le rispettive misure di attenuazione;
 - iii) la costituzione, il ruolo e il funzionamento della funzione di sorveglianza, descritta all'articolo 5 del regolamento (UE) 2016/1011 e ulteriormente specificata nelle norme tecniche di regolamentazione adottate a norma dell'articolo 5, paragrafo 5, del regolamento (UE) 2016/1011¹, o i corrispondenti principi sugli indici di riferimento finanziari concordati dall'Organizzazione internazionale delle commissioni sui valori mobiliari (IOSCO) il 17 luglio 2013 (di seguito "principi IOSCO per gli indici di riferimento finanziari") o i principi per le agenzie di rilevazione dei prezzi petroliferi concordati dalla IOSCO il 5 ottobre 2012 (di seguito "principi IOSCO per le agenzie di rilevazione dei prezzi petroliferi"), a seconda dei casi, comprese le procedure per la nomina, la sostituzione o la destituzione delle persone nell'ambito della funzione di sorveglianza;
 - iv) l'istituzione, il ruolo e il funzionamento del sistema dei controlli di cui all'articolo 6 del regolamento (UE) 2016/1011, o i corrispondenti principi IOSCO per gli indici di riferimento finanziari o per le agenzie di rilevazione dei prezzi petroliferi, a seconda dei casi, comprese le procedure per la nomina, la sostituzione o la destituzione delle persone responsabili di tale sistema;
 - v) il quadro di responsabilità di cui all'articolo 7 del regolamento (UE) 2016/1011, o i corrispondenti principi IOSCO per gli indici di riferimento finanziari o per le agenzie di rilevazione dei prezzi petroliferi, a seconda dei casi, comprese le procedure per la nomina, la sostituzione o la destituzione delle persone responsabili di tale quadro.
- (b) I piani di emergenza per la determinazione e la pubblicazione dell'indice di riferimento su base temporanea.

¹ Regolamento delegato (UE) [Ufficio delle pubblicazioni: inserire il numero di riferimento del documento C (2018)...] della Commissione che integra il regolamento (UE) 2016/1011 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione per le procedure e le caratteristiche della funzione di sorveglianza.

- (c) Procedure per la segnalazione interna delle violazioni del regolamento (UE) 2016/1011 da parte di dirigenti, dipendenti e altre persone fisiche i cui servizi sono messi a disposizione del fornitore o sotto il suo controllo.

6. ESTERNALIZZAZIONE

Se una o più attività facenti parte del processo di fornitura dell'indice di riferimento o della famiglia di indici di riferimento è esternalizzata:

- (a) gli accordi di esternalizzazione, inclusi gli accordi sul livello dei servizi, che dimostrano la conformità all'articolo 10 del regolamento (UE) 2016/1011 o ai corrispondenti principi IOSCO per gli indici di riferimento finanziari o per le agenzie di rilevazione dei prezzi petroliferi, a seconda dei casi;
- (b) i dettagli relativi alle funzioni esternalizzate, a meno che tali informazioni non siano già incluse nei pertinenti contratti;
- (c) le politiche e le procedure relative alla sorveglianza delle attività esternalizzate, a meno che tali informazioni non siano già incluse nei pertinenti contratti.

7. CONFORMITÀ AI PRINCIPI IOSCO

- (a) Se disponibile, la valutazione da parte di un revisore esterno indipendente della conformità ai principi per gli indici di riferimento finanziari concordati dall'Organizzazione internazionale delle commissioni sui valori mobiliari (IOSCO) il 17 luglio 2013 o ai principi per le agenzie di rilevazione dei prezzi petroliferi concordati dalla IOSCO il 5 ottobre 2012, a seconda dei casi.
- (b) Se disponibile, nei casi in cui il richiedente è sottoposto a vigilanza, un certificato fornito dall'autorità competente del paese terzo in cui è ubicato il richiedente che ne attesti la conformità ai principi IOSCO di cui alla lettera a).

8. ALTRE INFORMAZIONI

- (a) Il richiedente può fornire tutte le informazioni supplementari pertinenti per la domanda che ritiene opportune.
- (b) Il richiedente presenta le informazioni nella forma e secondo le modalità stabilite dall'autorità competente.

SEZIONE B — INFORMAZIONI SUGLI INDICI DI RIFERIMENTO

9. DESCRIZIONE DEGLI INDICI DI RIFERIMENTO O DELLE FAMIGLIE DI INDICI DI RIFERIMENTO, REALI O POTENZIALI, CHE POSSONO ESSERE UTILIZZATI NELL'UNIONE

- (a) L'elenco comprendente tutti gli indici di riferimento forniti dal richiedente che sono già utilizzati nell'Unione e, ove disponibili, i relativi codici internazionali di identificazione dei titoli (ISIN).
- (b) La descrizione degli indici di riferimento o delle famiglie di indici di riferimento forniti e già utilizzati nell'Unione, compresa la descrizione del mercato o della realtà economica sottostante che gli indici di riferimento o le famiglie di indici di riferimento intendono misurare, unitamente all'indicazione

delle fonti utilizzate per le descrizioni, nonché la descrizione dei contributori, se del caso, a tali indici di riferimento o famiglie di indici di riferimento.

- (c) L'elenco comprensivo di tutti gli indici di riferimento che sono destinati a essere commercializzati per essere utilizzati nell'Unione e, se del caso, i loro codici ISIN.
- (d) La descrizione degli indici di riferimento o delle famiglie di indici di riferimento destinati a essere commercializzati per essere utilizzati nell'Unione, compresa la descrizione del mercato o della realtà economica sottostante che gli indici di riferimento o le famiglie di indici di riferimento intendono misurare, con l'indicazione delle fonti utilizzate per le descrizioni, nonché la descrizione dei contributori, se del caso, a tali indici di riferimento o famiglie di indici di riferimento.
- (e) Tutta la documentazione a dimostrazione che gli indici di riferimento o le famiglie di indici di riferimento di cui alle lettere b) e d) possono essere considerati indici di riferimento basati su dati regolamentati, ai sensi dell'articolo 3, paragrafo 1, punto 24, del regolamento (UE) 2016/1011, e possono quindi beneficiare delle esenzioni di cui all'articolo 17, paragrafo 1, dello stesso regolamento.
- (f) Tutta la documentazione a dimostrazione che gli indici di riferimento o le famiglie di indici di riferimento di cui alle lettere b) e d) possono essere considerati indici di riferimento per le merci, ai sensi dell'articolo 3, paragrafo 1, punto 23, del regolamento (UE) 2016/1011, e che non si basano su dati trasmessi da contributori che sono per la maggior parte entità sottoposte a vigilanza, nonché elementi a dimostrazione dell'attuazione delle disposizioni del regime speciale di cui all'articolo 19 e all'allegato II dello stesso regolamento o dei corrispondenti principi IOSCO per le agenzie di rilevazione dei prezzi petroliferi.
- (g) Tutta la documentazione a dimostrazione che gli indici di riferimento o le famiglie di indici di riferimento di cui alle lettere b) e d) possono essere considerati indici di riferimento per la determinazione dei tassi di interesse, ai sensi della definizione di cui all'articolo 3, paragrafo 1, punto 22, del regolamento (UE) 2016/1011, nonché elementi a dimostrazione dell'attuazione delle disposizioni del regime speciale di cui all'articolo 18 e all'allegato I dello stesso regolamento.
- (h) Tutta la documentazione a dimostrazione che gli indici di riferimento o le famiglie di indici di riferimento di cui alla lettera b) hanno un grado di utilizzo nel territorio dell'Unione che qualifica l'indice di riferimento o tutti gli indici di riferimento contenuti nella famiglia come indici di riferimento significativi, ai sensi dell'articolo 3, paragrafo 1, punto 26, del regolamento (UE) 2016/1011, o come indici di riferimento non significativi, ai sensi dell'articolo 3, paragrafo 1, punto 27, del regolamento (UE) 2016/1011. Le informazioni da fornire sono determinate, per quanto possibile, sulla base delle disposizioni del regolamento delegato (UE) 2018/66 della Commissione² per la valutazione

² Regolamento delegato (UE) 2018/66 della Commissione, del 29 settembre 2017, che integra il regolamento (UE) 2016/1011 del Parlamento europeo e del Consiglio specificando le modalità con cui devono essere valutati l'importo nominale degli strumenti finanziari diversi dai derivati, l'importo nozionale dei derivati e il valore patrimoniale netto dei fondi di investimento (GU L 12 del 17.1.2018, pag. 11).

dell'importo nominale degli strumenti finanziari diversi dai derivati, dell'importo nozionale dei derivati e del valore patrimoniale netto dei fondi di investimento che fanno riferimento agli indici di riferimento di paesi terzi, all'interno dell'Unione, anche nel caso di riferimento indiretto a tale indice all'interno di una combinazione di indici di riferimento.

- (i) Le ragioni alla base della decisione dell'amministratore di applicare in relazione all'indice di riferimento le esenzioni di cui all'articolo 25, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2016/1011 per gli indici di riferimento significativi e le esenzioni di cui all'articolo 26, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2016/1011, per gli indici di riferimento non significativi. Le informazioni sono presentate, per quanto possibile, sulla base del modello definito dalle norme tecniche di attuazione adottate ai sensi dell'articolo 25, paragrafo 8, e dell'articolo 26, paragrafo 5, del regolamento (UE) 2016/1011³.
- (j) Informazioni sulle misure per trattare le rettifiche della determinazione o della pubblicazione dell'indice di riferimento.
- (k) Informazioni sulla procedura che il fornitore è tenuto a seguire in caso di variazioni o cessazione dell'indice di riferimento, in conformità all'articolo 28, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2016/1011 o ai corrispondenti principi IOSCO per gli indici di riferimento finanziati o per le agenzie di rilevazione dei prezzi petroliferi, a seconda dei casi.

10. DATI E METODOLOGIA

- (a) Per ciascun indice di riferimento o famiglia di indici di riferimento, le politiche e le procedure in materia di dati, ivi comprese quelle riguardanti:
 - i) il tipo di dati usati, la loro priorità di utilizzo e ogni esercizio della discrezionalità o della valutazione di esperti;
 - ii) tutti i processi volti a garantire che i dati siano sufficienti, adeguati e verificabili;
 - iii) i criteri per determinare chi può contribuire dati all'amministratore e il processo di selezione dei contributori;
 - iv) la valutazione dei dati del contribuente e il processo di convalida dei dati.
- (b) Per ciascun indice di riferimento o famiglia di indici di riferimento, per quanto concerne la metodologia:
 - i) la descrizione della metodologia che ne metta in evidenza gli elementi chiave conformemente all'articolo 13 del regolamento (UE) 2016/1011, come ulteriormente specificato nelle norme tecniche di regolamentazione adottate a norma dell'articolo 13, paragrafo 3, del regolamento (UE) 2016/1011⁴;

³ Regolamento di esecuzione (UE) [Ufficio delle pubblicazioni: inserire il numero di riferimento del documento C (2018)...] della Commissione che stabilisce norme tecniche di attuazione per quanto riguarda i modelli per le dichiarazioni di conformità che gli amministratori di indici di riferimento significativi e non significativi sono tenuti a pubblicare e a mantenere aggiornati a norma del regolamento (UE) 2016/1011 del Parlamento europeo e del Consiglio.

⁴ Regolamento delegato (UE) [Ufficio delle pubblicazioni: inserire il numero di riferimento del documento C (2018) ...] della Commissione che integra il regolamento (UE) 2016/1011 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione che specificano

- ii) le politiche e le procedure, ivi comprese quelle riguardanti:
 - le misure adottate per convalidare o riesaminare la metodologia, incluse eventuali prove o test a posteriori effettuati;
 - il processo di consultazione su eventuali proposte di modifica rilevanti della metodologia.

ulteriormente le informazioni che gli amministratori di indici di riferimento critici o significativi sono tenuti a fornire in merito alla metodologia utilizzata per determinare gli indici di riferimento, il riesame interno e l'approvazione della metodologia e in merito alle procedure per introdurre modifiche rilevanti della metodologia.