

Bruxelles, 20 dicembre 2018
(OR. en)

15820/18

EF 351
ECOFIN 1246
DELECT 190

NOTA DI TRASMISSIONE

Origine:	Jordi AYET PUIGARNAU, Direttore, per conto del Segretario Generale della Commissione europea
Data:	13 dicembre 2018
Destinatario:	Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, Segretario Generale del Consiglio dell'Unione europea

n. doc. Comm.:	C(2018) 8332 final
----------------	--------------------

Oggetto:	REGOLAMENTO DELEGATO (UE) .../... DELLA COMMISSIONE del 13.12.2018 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
----------	---

Si trasmette in allegato, per le delegazioni, il documento C(2018) 8332 final.

All.: C(2018) 8332 final

Bruxelles, 13.12.2018
C(2018) 8332 final

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

del 13.12.2018

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)

RELAZIONE

1. CONTESTO DELL'ATTO DELEGATO

Ai sensi del regolamento (UE) 2015/2365 (in appresso "il regolamento")¹, i repertori di dati sulle negoziazioni devono raccogliere e conservare le informazioni sulle operazioni di finanziamento tramite titoli (SFT) loro segnalate, dare alle autorità competenti accesso alle informazioni raccolte e pubblicare periodicamente posizioni aggregate per tipologia di SFT. In questo contesto, l'articolo 12, paragrafo 3, e l'articolo 5, paragrafo 7, lettera a), del regolamento conferiscono alla Commissione il potere di adottare, previa presentazione dei progetti di norme tecniche di regolamentazione da parte dell'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (ESMA) e in conformità agli articoli da 10 a 14 del regolamento (UE) n. 1095/2010² che istituisce l'ESMA, un regolamento delegato che specifichi gli standard operativi per la raccolta, l'aggregazione e la comparazione dei dati da parte dei repertori di dati sulle negoziazioni e la frequenza e i dettagli delle posizioni aggregate che i repertori devono pubblicare, nonché le procedure che i repertori devono applicare per verificare la completezza e la correttezza delle informazioni sulle SFT loro segnalate.

A norma dell'articolo 10, paragrafo 1, del regolamento (UE) n. 1095/2010, la Commissione decide entro tre mesi dal loro ricevimento se approvare i progetti di norme presentati. La Commissione può approvarli anche solo in parte o con modifiche, se necessario per tutelare gli interessi dell'Unione, secondo la procedura specifica di cui al suddetto articolo.

2. CONSULTAZIONI PRECEDENTI L'ADOZIONE DELL'ATTO

Ai sensi dell'articolo 10, paragrafo 1, terzo comma, del regolamento (UE) n. 1095/2010, l'ESMA ha effettuato due consultazioni pubbliche. Una prima consultazione è stata condotta sulla base di un documento di discussione iniziale (marzo-aprile 2016), mentre la seconda ha riguardato un documento di consultazione con i progetti di norme tecniche di regolamentazione di cui all'articolo 12, paragrafo 3, del regolamento. Il documento di consultazione è stato pubblicato il 30 settembre 2016 e la consultazione si è conclusa il 30 novembre 2016.

Inoltre, per i progetti di norme tecniche è stato consultato il gruppo delle parti interessate nel settore degli strumenti finanziari e dei mercati dell'ESMA, istituito ai sensi dell'articolo 37 del regolamento (UE) n. 1095/2010.

L'ESMA ha altresì coinvolto i membri del Sistema europeo di banche centrali (SEBC) nella messa a punto dei progetti di norme tecniche di regolamentazione, come previsto dall'articolo 12, paragrafo 3, del regolamento.

I progetti di norme tecniche di regolamentazione presentati dall'ESMA alla Commissione sono corredati di una relazione sul modo in cui l'esito delle consultazioni è stato recepito nell'elaborazione della loro versione finale.

¹ 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).

² 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).

Unitamente ai progetti di norme tecniche di regolamentazione, in conformità all'articolo 10, paragrafo 1, terzo comma, del regolamento (UE) n. 1095/2010, l'ESMA ha inoltre commissionato un'analisi esterna dei costi e dei benefici connessi ai progetti di norme tecniche di regolamentazione presentati alla Commissione a norma dell'articolo 12, paragrafo 3, del regolamento. L'analisi è riportata nell'allegato XII della relazione finale sui progetti di norme tecniche previsti dal regolamento e può essere consultata al seguente indirizzo:

https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/esma70-708036281-82_2017_sfr_final_report_and_cba.pdf.

3. ELEMENTI GIURIDICI DELL'ATTO DELEGATO

Ai sensi dell'articolo 12, paragrafo 3, del regolamento, l'ESMA elabora progetti di norme tecniche di regolamentazione per specificare ulteriormente gli standard operativi per la raccolta, l'aggregazione e la comparazione di dati da parte dei repertori di dati sulle negoziazioni e la frequenza e i dettagli delle posizioni aggregate da pubblicare in tali repertori. Inoltre, ai sensi dell'articolo 5, paragrafo 7, lettera a), del regolamento, l'ESMA elabora progetti di norme tecniche di regolamentazione per specificare le procedure che i repertori di dati sulle negoziazioni devono applicare per verificare completezza e correttezza delle informazioni sulle SFT loro segnalate. Il potere di adottare regolamenti delegati a tale riguardo è conferito dall'articolo 5, paragrafo 7, e dall'articolo 12, paragrafo 3, del regolamento. Per garantire la coerenza tra le disposizioni di cui sopra 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.

3.1. Articolo 1

Il regolamento delegato specifica in dettaglio le fasi di verifica necessarie per la convalida dei dati raccolti dal repertorio di dati sulle negoziazioni, ivi comprese le verifiche delle informazioni segnalate in merito alle garanzie reali. Il regolamento delegato prevede inoltre che le segnalazioni delle SFT non conformi alla procedura di verifica vengano rifiutate e che alla controparte e alle entità segnalanti siano fornite informazioni dettagliate sui risultati delle convalide dei dati effettuate, in formato XML ed entro sessanta minuti dal ricevimento della segnalazione dell'SFT.

3.2. Articolo 2

Il regolamento delegato stabilisce la procedura dettagliata che un repertorio di dati sulle negoziazioni deve seguire per riconciliare i dati sull'SFT segnalati da una delle controparti dell'SFT con i dati ricevuti dall'altra controparte, anche nel caso in cui la controparte abbia segnalato i dati a un altro repertorio. Inoltre, i repertori di dati sulle negoziazioni sono tenuti a confermare al termine di ogni giornata lavorativa, per ciascun repertorio con cui hanno dovuto riconciliare le SFT segnalate, il numero totale delle SFT segnalate oggetto di riconciliazione. Infine, i repertori di dati sulle negoziazioni devono fornire alla controparte e alle entità segnalanti i risultati della procedura di riconciliazione, in formato XML ed entro sessanta minuti dalla conclusione di tale procedura.

3.3. Articolo 3

Il regolamento delegato precisa le informazioni che i repertori di dati sulle negoziazioni devono trasmettere alla controparte e alle entità segnalanti al termine di ogni giornata lavorativa sulle SFT rilevanti per la controparte.

3.4. Articolo 4

Il regolamento delegato impone ai repertori di dati sulle negoziazioni di garantire che le autorità di cui all'articolo 12, paragrafo 2, del regolamento abbiano accesso alle informazioni sulle SFT e specifica il formato in cui tale accesso deve essere fornito.

3.5. Articolo 5

Il regolamento delegato specifica i dati a livello di posizione sulle esposizioni tra controparti segnalanti cui le autorità competenti hanno accesso e il formato in cui tale accesso deve essere fornito. Stabilisce che le autorità hanno accesso a tali dati il più presto possibile e comunque non oltre un giorno lavorativo dopo il ricevimento della segnalazione della relativa SFT. I repertori di dati sulle negoziazioni devono inoltre garantire che le autorità abbiano accesso ai dati a livello aggregato, calcolati in conformità alle norme e ai processi convenuti di comune accordo per la raccolta e l'aggregazione globale dei dati sulle SFT.

3.6. Articolo 6

Il regolamento delegato definisce i vari criteri di aggregazione in base ai quali calcolare i) l'importo del capitale delle SFT, ii) il numero di operazioni e iii) il valore di mercato delle garanzie reali.

3.7. Articolo 7

Il regolamento delegato stabilisce che i repertori di dati sulle negoziazioni pubblichino i dati sulle posizioni aggregate su base settimanale, al più tardi il martedì a mezzogiorno per le SFT segnalate entro il venerdì precedente. Il regolamento delegato dispone che le posizioni aggregate vanno pubblicate in euro e nel formato tabellare definito nell'allegato dello stesso regolamento. I dati sulle posizioni aggregate vanno conservati sul sito web dei repertori di dati sulle negoziazioni per almeno 104 settimane.

3.8. Articolo 8

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

3.9. Allegato I

Nel primo allegato il regolamento delegato specifica in tre tabelle: i) i campi dati da riconciliare per le SFT, compresi eventualmente i livelli di tolleranza; ii) le diverse categorie per spiegare i motivi per cui un'SFT sia stata rifiutata e iii) le diverse categorie di riconciliazione, inclusi i valori ammissibili.

3.10. Allegato II

Nel secondo allegato il regolamento delegato precisa il formato tabellare in cui i repertori sulle negoziazioni sono tenuti a pubblicare i dati sulle posizioni aggregate.

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

del 13.12.2018

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. 648/2012¹, 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

¹ GU L 337 del 23.12.2015, pag. 1.

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 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 Consiglio² 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 Consiglio³.
- (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,

² 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).

³ 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

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 [OP: inserire il riferimento del C(2018)7658];
 - (b) che il modello XML utilizzato per segnalare l'SFT sia conforme alla metodologia ISO 20022, in linea con il [OP: inserire il riferimento del C(2018)7658];
 - (c) che l'entità che trasmette la segnalazione, se diversa dalla controparte segnalante indicata nella tabella 1, campo 3, dell'allegato I del [OP: inserire il riferimento del C(2018)7658], 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;
 - (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 [OP: inserire il riferimento del C(2018)7658] 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 [OP: inserire il riferimento del C(2018)7658] 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 [OP: inserire il riferimento del C(2018)8330].

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

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 [OP: inserire il riferimento del C(2018)8330].
 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 [OP: inserire il riferimento del C(2018)8330], 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 rettificate.

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 13.12.2018

Per la Commissione
Il presidente
Jean-Claude JUNCKER