

MODALITA' OPERATIVE

PER LA PARTECIPAZIONE ALLA TERZA SERIE DELLE OPERAZIONI MIRATE DI RIFINANZIAMENTO A PIU' LUNGO TERMINE (TLTRO-III)

Il 7 marzo 2019 il Consiglio direttivo della BCE ha annunciato una terza serie di operazioni mirate di rifinanziamento a più lungo termine (TLTRO-III) volte a preservare condizioni favorevoli del credito bancario e a sostenere l'orientamento accomodante della politica monetaria¹. Per la disciplina relativa a tali operazioni si rimanda alla “Decisione della Banca Centrale Europea del 22 luglio 2019 su una terza serie di operazioni mirate di rifinanziamento a più lungo termine” (BCE/2019/21, di seguito “Decisione TLTRO-III”).

Nel presente documento si forniscono le modalità operative per la partecipazione alle operazioni TLTRO-III e gli adempimenti tecnici e amministrativi cui dovranno attenersi le istituzioni creditizie abilitate alle operazioni di mercato aperto dell'Eurosistema (di seguito “controparti”) che intendono partecipare alle TLTRO-III.

Si fa inoltre presente che il Consiglio direttivo della BCE con la Decisione BCE/2019/22 ha modificato la Decisione BCE/2016/10 anticipando il termine ultimo per l'inoltro delle richieste di rimborso anticipato delle operazioni TLTRO II al fine di consentirne l'inclusione nella determinazione dei limiti di partecipazione alle TLTRO-III.

1. ACCESSO ALLE OPERAZIONI

Le controparti abilitate alle operazioni di mercato aperto possono partecipare alle TLTRO-III previo invio, nei tempi e nei modi previsti dall'Eurosistema, delle informazioni quantitative richieste.

È consentito altresì l'accesso alle operazioni TLTRO-III a livello di gruppo per il tramite di una controparte (di seguito capofila) abilitata alle operazioni di mercato aperto, qualora sussistano i requisiti stabiliti dalla Decisione TLTRO-III.

2. ITER OPERATIVO PER LA PARTECIPAZIONE INDIVIDUALE

Gli enti creditizi interessati a partecipare a livello individuale dovranno rendere una dichiarazione di conoscenza e accettazione delle condizioni applicate alle operazioni TLTRO-III.

¹ <https://www.ecb.europa.eu/press/pr/date/2019/html/ecb.mp190307~7d8a9d2665.en.html>.

La dichiarazione, redatta secondo lo Schema A, dovrà essere inviata alla Filiale competente². L'invio della dichiarazione andrà effettuato via PEC entro e non oltre la data indicata per l'inoltro della prima segnalazione, nel calendario delle TLTRO-III disponibile in Appendice I, con riferimento a ciascuna operazione.

3. ITER OPERATIVO PER IL RICONOSCIMENTO DEI GRUPPI

Gli enti creditizi interessati a partecipare come membri di un gruppo dovranno esplicitamente richiedere, per mezzo della banca capofila, il riconoscimento del gruppo TLTRO-III alla Banca d'Italia secondo i tempi e le modalità esposte di seguito. I gruppi già riconosciuti per la partecipazione alle operazioni TLTRO-II (ai sensi della Decisione BCE/2016/10) che intendano partecipare anche alle operazioni TLTRO-III dovranno invece inviare, per mezzo della capofila, un'apposita notifica.

L'istanza o la notifica di riconoscimento del gruppo dovrà essere inviata dalla capofila alla Filiale competente della Banca d'Italia e contestualmente al Servizio Operazioni sui mercati (OPM). L'invio della domanda dovrà essere effettuato via PEC entro e non oltre la data indicata nel calendario delle TLTRO-III riportato in Appendice 1, con riferimento a ciascuna operazione.

Nel caso di un nuovo gruppo, all'istanza della capofila - redatta in conformità allo Schema B e firmata dal legale rappresentante - dovrà essere acclusa, sia in formato "pdf" sia in formato "xls", la lista dei membri del gruppo compilata secondo lo schema riportato nell'allegato A.

Inoltre, laddove l'adesione di un membro a un gruppo TLTRO III avvenga in virtù di "stretti legami" con altri componenti dello stesso gruppo³ o laddove ricorrano le condizioni di cui all'ultimo capoverso dell'art. 3.3 della Decisione TLTRO-III (vigilanza consolidata), la capofila dovrà allegare all'istanza la dichiarazione di adesione firmata dal legale rappresentante di ciascun membro (redatta secondo lo Schema B.1), corredata da una copia della decisione pertinente adottata dai competenti organi.

Nel caso di gruppi già riconosciuti per la partecipazione alle operazioni TLTRO-II, la banca capofila invierà una notifica, redatta in conformità allo Schema C e firmata dal legale rappresentante, cui dovrà essere acclusa, sia in formato "pdf" sia in formato "xls", la lista dei membri che hanno formalmente deciso di essere parte del gruppo ai fini della partecipazione alla TLTRO-III, compilata secondo lo schema riportato all'allegato A.

² Per **Filiale competente** si intende la Filiale presso la quale la controparte ha sottoscritto i contratti o che gestisce il rapporto contrattuale.

³ Per la definizione di "stretti legami" (Close links) si rinvia all'articolo 138 dell'Indirizzo della Banca centrale europea BCE/2014/60 ("General documentation").

I moduli per la presentazione dell'istanza, oltre che allegati al presente documento, sono disponibili in formato "doc" e "xls" all'indirizzo web:

<https://www.bancaditalia.it/compiti/polmon-garanzie/tltro/index.html>.

La Banca d'Italia può rifiutare anche parzialmente l'istanza qualora i requisiti previsti dall'Eurosistema per l'appartenenza al gruppo non siano soddisfatti da uno o più membri. In tal caso il gruppo opererà in forma ridotta, salvo che la richiesta di riconoscimento non venga esplicitamente ritirata. La decisione del ritiro dovrà essere comunicata dalla capofila alla Banca d'Italia - Servizio OPM, via PEC.

La Banca d'Italia - Servizio OPM comunicherà alla banca capofila una formale accettazione del gruppo entro le date indicate nel calendario delle TLTRO-III.

Tutte le comunicazioni della Banca d'Italia inerenti al riconoscimento del gruppo saranno effettuate utilizzando l'indirizzo PEC fornito dalla controparte all'atto della richiesta.

Si precisa infine che gli enti creditizi che sono membri di un gruppo TLTRO-III non potranno contemporaneamente partecipare al programma a livello individuale né essere membri di un altro gruppo TLTRO-III.

4. SVOLGIMENTO DELLE OPERAZIONI

Le operazioni TLTRO-III saranno operazioni temporanee di immissione di liquidità, eseguite:

- in forma decentralizzata dalle Banche centrali nazionali;
- mediante procedure di asta "standard";
- nella forma di asta a tasso fisso.

Per quanto non specificato dalla Decisione TLTRO-III, alle operazioni sarà applicata la disciplina prevista per le operazioni di finanziamento dell'Eurosistema.

5. CALCOLO DEI LIMITI DI FINANZIAMENTO E DI OFFERTA

Il limite di finanziamento di ciascun partecipante sarà pari al 30% dell'ammontare di riferimento delle consistenze in essere alla data del 28 febbraio 2019, al netto dell'importo preso a prestito da ciascuna controparte nelle operazioni TLTRO-II e ancora in essere alle date di regolamento delle operazioni TLTRO-III.

Il limite di offerta di ciascun partecipante ad ogni singola operazione TLTRO-III sarà invece pari al minore tra:

- a) il limite di finanziamento diminuito dell'ammontare eventualmente preso già a prestito in precedenti operazioni TLTRO-III;

b) un decimo dell'ammontare di riferimento delle consistenze in essere al 28 febbraio 2019.

Nel caso di partecipazione in forma di gruppo, i limiti di finanziamento e di offerta applicati alla capofila di un gruppo TLTRO-III saranno calcolati sulla base dei dati aggregati di tutti i membri del gruppo.

Si precisa infine che i partecipanti che intendano includere i prestiti auto-cartolarizzati nel calcolo del proprio limite di finanziamento dovranno esercitare la relativa opzione, fornendo i dati integrativi relativi a tali prestiti congiuntamente alla certificazione degli stessi fornita da un revisore esterno in conformità alle disposizioni di cui agli articoli 6.3 e 6.6 della Decisione TLTRO-III.

6. INVIO DEI LIMITI DI FINANZIAMENTO E DI OFFERTA

Le controparti in regola con le segnalazioni riceveranno una informativa ad hoc concernente i propri limiti di finanziamento e di offerta. Le modalità di comunicazione di tale informativa saranno specificate in un prossimo aggiornamento delle presenti istruzioni.

7. PUNTI DI CONTATTO IN BANCA D'ITALIA

Per informazioni riguardanti gli elementi generali delle operazioni o per richieste di partecipazione in forma di gruppo TLTRO-III:

Servizio Operazioni sui mercati (OPM)

Divisione Operazioni di politica monetaria e in cambi

Tel. 06 4792 2525

Indirizzo e-mail: BI.FRONT_OFFICE@bancaditalia.it

Indirizzo PEC : opm@pec.bancaditalia.it

Per informazioni riguardati gli obblighi segnaletici propedeutici alla partecipazione:

Servizio Rilevazioni ed elaborazioni statistiche (RST)

Divisione Segnalazioni creditizie e finanziarie

Tel. 06 4792 8431 – 7781 – 6364 – 8530 – 8650 – 8978

Indirizzo e-mail: segnalazioni_TLTRO@bancaditalia.it

Appendice I

Calendario delle TLTRO-III

Avvenimento / Orario	TLTRO-III.1	TLTRO-III.2	TLTRO-III.3	TLTRO-III.4	TLTRO-III.5	TLTRO-III.6	TLTRO-III.7
La capofila presenta la domanda per riconoscimento del gruppo TLTRO-III o per le variazioni nella composizione dei gruppi TLTRO-III (ore 18:00)	14 agosto 2019 Domanda basata sui dati aggiornati dei close link e della riserva indiretta al 31 luglio 2019	04 novembre 2019 Domanda basata sui dati aggiornati dei close link e della riserva indiretta al 31 ottobre 2019	10 febbraio 2020 Domanda basata sui dati aggiornati dei close link e della riserva indiretta al 31 gennaio 2020	11 maggio 2020 Domanda basata sui dati aggiornati dei close link e della riserva indiretta al 30 aprile 2020	17 agosto 2020 Domanda basata sui dati aggiornati dei close link e della riserva indiretta al 31 luglio 2020	02 novembre 2020 Domanda basata sui dati aggiornati dei close link e della riserva indiretta al 31 ottobre 2020	08 febbraio 2021 Domanda basata sui dati aggiornati dei close link e della riserva indiretta al 31 gennaio 2021
Banca d'Italia conferma alla capofila la composizione/variazione del gruppo TLTRO-III (ore 15:30)	23 agosto 2019	14 novembre 2019	20 febbraio 2020	21 maggio 2020	27 agosto 2020	12 novembre 2020	18 febbraio 2021
Termine ultimo per l'invio della prima segnalazione per controparti/gruppi partecipanti alle TLTRO-III per la prima volta o per l'invio delle revisioni della prima segnalazione a seguito di: - revisioni dei dati; - riorganizzazioni aziendali; - modifiche nei gruppi TLTRO-III (ore 18:00)	27 agosto 2019	18 novembre 2019	24 febbraio 2020	25 maggio 2020	31 agosto 2020	16 novembre 2020	22 febbraio 2021

Avvenimento / Orario	TLTRO-III.1	TLTRO-III.2	TLTRO-III.3	TLTRO-III.4	TLTRO-III.5	TLTRO-III.6	TLTRO-III.7
Termine ultimo per la segnalazione dei prestiti auto-cartolarizzati e della relativa certificazione del revisore (ore 18:00)	24 febbraio 2020			25 maggio 2020	31 agosto 2020	16 novembre 2020	22 febbraio 2021
Banca d'Italia informa le controparti sui limiti di offerta e di finanziamento (entro le ore 15:30)	16 settembre 2019	09 dicembre 2019	16 marzo 2020	15 giugno 2020	21 settembre 2020	07 dicembre 2020	15 marzo 2021
Annuncio (inizio raccolta partecipazioni) (ore 15:40)	17 settembre 2019	10 dicembre 2019	17 marzo 2020	16 giugno 2020	22 settembre 2020	08 dicembre 2020	16 marzo 2021
Termine ultimo per l'invio delle partecipazioni (ore 9:30)	18 settembre 2019	11 dicembre 2019	18 marzo 2020	17 giugno 2020	23 settembre 2020	09 dicembre 2020	17 marzo 2021
Aggiudicazione (ore 11:30)	19 settembre 2019	12 dicembre 2019	19 marzo 2020	18 giugno 2020	24 settembre 2020	10 dicembre 2020	18 marzo 2021
Regolamento a pronti	25 settembre 2019	18 dicembre 2019	25 marzo 2020	24 giugno 2020	30 settembre 2020	16 dicembre 2020	24 marzo 2021
Termine ultimo per l'invio della certificazione del revisore per la prima segnalazione (ore 18:00)	07 gennaio 2021			30 luglio 2021			

Avvenimento / Orario	TLTRO-III.1	TLTRO-III.2	TLTRO-III.3	TLTRO-III.4	TLTRO-III.5	TLTRO-III.6	TLTRO-III.7
Termine ultimo per l'invio della seconda segnalazione e della relativa certificazione del revisore (ore 18:00)	31 agosto 2021						
Banca d'Italia informa le controparti della deviazione dal rispettivo livello di riferimento e dell'aggiustamento relativo all'incentivo di tasso. (ore 15:30 – le modalità di invio saranno pubblicate in seguito)	24 settembre 2021						
Banca d'Italia informa le controparti sui tassi di interesse finali (ore 15:30 – le modalità di invio saranno pubblicate in seguito)	24 settembre 2021	17 dicembre 2021	25 marzo 2022	24 giugno 2022	23 settembre 2022	16 dicembre 2022	24 marzo 2023
Scadenza dell'operazione	29 settembre 2021	22 dicembre 2021	30 marzo 2022	29 giugno 2022	28 settembre 2022	21 dicembre 2022	29 marzo 2023

Schema A – Dichiarazione controparte individuale

Oggetto: Partecipazione alla “*Terza serie di operazioni mirate di rifinanziamento a più lungo termine (TLTRO-III)*” come controparte individuale.

La banca (denominazione)

codice ABI - codice MFI,

con sede legale in:

(stato)

(città).....

(indirizzo)

Legalmente rappresentata da

.....

D I C H I A R A

a) di essere a conoscenza e di accettare che alla “*Terza serie di operazioni mirate di rifinanziamento a più lungo termine (TLTRO-III)*” si applicano le condizioni specificate nella Decisione BCE/2019/21 del 22 luglio 2019 (‘Decisione TLTRO-III’) riguardante le misure relative alle TLTRO-III, con particolare riguardo a:

1. limite di finanziamento, limite di offerta e livelli di riferimento: articolo 4 della Decisione TLTRO-III;
2. tasso di interesse: articolo 5 della Decisione TLTRO-III;
3. obblighi di segnalazione: articolo 6 della Decisione TLTRO-III;
4. inosservanza degli obblighi di segnalazione: articolo 7 della Decisione TLTRO-III;

- b) di essere a conoscenza e di accettare che qualora intenda includere i prestiti auto-cartolarizzati nel calcolo del limite di finanziamento, dovrà fornire i dati integrativi relativi a tali prestiti congiuntamente alla certificazione degli stessi fornita da un revisore esterno, conformemente alle disposizioni di cui agli articoli 6.3 e 6.6 della Decisione TLTRO-III;
- c) di essere a conoscenza e di accettare che la “*Terza serie di operazioni mirate di rifinanziamento a più lungo termine* (TLTRO-III)” è disciplinata:
1. dalle previsioni contenute nel presente documento;
 2. dalle previsioni contenute nell’annuncio d’asta relativo alla specifica operazione;
 3. per quanto non diversamente disciplinato dal presente documento e nell’annuncio d’asta relativo alla specifica operazione, dalle previsioni di cui agli allegati del documento “*Strumenti di politica monetaria dell’Eurosistema - Guida per gli operatori*” (disponibile sul sito internet della Banca d'Italia) che di seguito si riportano:
 - i. Condizioni generali di contratto per le operazioni di politica monetaria (allegato 1);
 - ii. Contratto quadro per le operazioni di mercato aperto (allegato 2);
 - iii. Operazioni di mercato aperto dell’Eurosistema - Specifiche per gli operatori (allegato 3);
 - iv. Contratto quadro sulle garanzie per operazioni di finanziamento (allegato 6).

.....

.....

(firma del legale rappresentante)

Ai sensi e per gli effetti di cui agli artt. 1341 e 1342 del codice civile la controparte dichiara di aver preso conoscenza e di approvare specificamente le norme e le condizioni di cui al paragrafo a), numeri 1 e 4 del presente documento.

.....

.....

(firma del legale rappresentante)

Di seguito si comunica/no:

il/i referente/i da contattare per eventuali chiarimenti relativi alla presente richiesta

.....
(nome) *(cognome)*

.....
(telefono) *(e-mail)*

.....
(nome) *(cognome)*

.....
(telefono) *(e-mail)*

l'indirizzo di posta elettronica certificata della banca richiedente

.....

Schema B – Istanza capofila

Oggetto: Partecipazione in forma di gruppo alla “*Terza serie di operazioni mirate di rifinanziamento a più lungo termine (TLTRO-III)*” - Istanza di riconoscimento del gruppo da parte della capofila.

La banca (denominazione)

codice ABI - codice MFI,

di seguito indicata come ‘intermediario capofila’ o ‘capofila’,

con sede legale in:

(stato)

(città)

(indirizzo)

Legalmente rappresentata da

.....

ai sensi della Decisione BCE/2019/21 del 22 luglio 2019 (‘Decisione TLTRO-III’) riguardante misure relative alle TLTRO-III,

C H I E D E

il riconoscimento dello status di “gruppo TLTRO-III” (‘gruppo’) formato dall’intermediario medesimo, nel ruolo di capofila, e dagli enti creditizi indicati nell’allegato A.

Al riguardo, in qualità di capofila, l’intermediario istante dichiara e conferma:

- a) di essere un ente creditizio con sede legale nell’area dell’euro idoneo alla partecipazione alle operazioni di politica monetaria, ai sensi dell’articolo 55, punti (a), (b) e (c) dell’Indirizzo n. 2014/60 della BCE sull’attuazione del quadro di riferimento della politica monetaria dell’Eurosistema e di essere controparte abilitata alle operazioni di mercato aperto;

- b) che il gruppo è formato dagli enti creditizi indicati nell'allegato A;
- c) che per ciascuno dei componenti del gruppo che intrattiene un rapporto di riserva obbligatoria indiretta con altro componente, sussiste l'una o l'altra delle seguenti condizioni: (i) il componente ha formalmente deciso di aderire al gruppo e di rinunciare a partecipare alle TLTRO-III in qualità di singola controparte o come componente di altro gruppo TLTRO-III; oppure (ii) l'accordo previsto dall'art. 10.2 del Regolamento BCE 2003/9, stipulato tra il componente del gruppo e la capofila, specifica che il componente ha accesso alle operazioni di mercato aperto dell'Eurosistema soltanto per il tramite della capofila;
- d) di essere a conoscenza degli obblighi derivanti dall'assunzione del ruolo di capofila così come definiti e/o richiamati dalla Decisione TLTRO-III, che si impegna a rispettare, e in particolare di essere consapevole che:
 - 1. permanendo la sua appartenenza al gruppo, non può prendere parte alle TLTRO-III come singola controparte, né può far parte di altro gruppo costituito per la partecipazione alle TLTRO-III;
 - 2. la sua qualità di capofila e la composizione del gruppo devono rimanere invariate per tutte le TLTRO-III, salvo quanto disposto agli articoli 3.5, 3.6 e 3.7 della Decisione TLTRO-III;
 - 3. in caso di variazione nella composizione del gruppo accettata ai sensi dell'art. 3.5 della Decisione TLTRO-III o approvata ai sensi dell'art. 3.6 della Decisione TLTRO-III, con riferimento a variazioni per le quali siano applicati gli articoli 3.5 o 3.6, lettere b e c, la partecipazione sulla base della nuova composizione potrà avvenire solo dopo aver ricevuto conferma da parte della Banca d'Italia che la nuova composizione del gruppo è stata riconosciuta, ai sensi dell'art. 3.7(a) della Decisione TLTRO-III;
 - 4. in caso di uscita dal gruppo, ai sensi dell'art. 3.7(b) della Decisione TLTRO-III, non potrà prendere parte alle successive TLTRO-III, né come singola controparte né come componente di altro gruppo, salvo che presenti nuova istanza;
 - 5. in caso di perdita dello status di controparte abilitata alle operazioni di mercato aperto, il gruppo TLTRO-III di cui è capofila perderà il riconoscimento di gruppo abilitato a partecipare alle TLTRO-III e la capofila sarà tenuta a rimborsare la totalità dei prestiti ottenuti tramite le TLTRO-III;

6. la Banca d'Italia può anche parzialmente rifiutare la richiesta di riconoscimento del gruppo qualora i prescritti requisiti non risultino soddisfatti per taluno dei suoi componenti;
 7. in caso di parziale rifiuto della composizione del gruppo ai sensi del punto 6, la capofila potrà comunicare l'eventuale decisione di ritiro della presente istanza alla Banca d'Italia. In assenza di tale comunicazione il gruppo verrà riconosciuto in forma ridotta;
- e) di essere a conoscenza e di accettare che, in qualità di capofila del gruppo, assume il ruolo di controparte della Banca d'Italia nella *“Terza serie di operazioni mirate di rifinanziamento a più lungo termine (TLTRO-III)”*;
- f) di essere a conoscenza e di accettare che alla *“Terza serie di operazioni mirate di rifinanziamento a più lungo termine (TLTRO-III)”* si applicano le condizioni specificate nella Decisione TLTRO-III, con particolare riguardo a:
1. limite di finanziamento, limite di offerta e livelli di riferimento: articolo 4 della Decisione TLTRO-III;
 2. tasso di interesse: articolo 5 della Decisione TLTRO-III;
 3. obblighi di segnalazione: articolo 6 della Decisione TLTRO-III;
 4. inosservanza degli obblighi di segnalazione: articolo 7 della Decisione TLTRO-III;
- g) di essere a conoscenza e di accettare che qualora intenda includere i prestiti autocartolarizzati nel calcolo del limite di finanziamento, dovrà fornire i dati integrativi relativi a tali prestiti congiuntamente alla certificazione degli stessi fornita da un revisore esterno, conformemente alle disposizioni di cui agli articoli 6.3 e 6.6 della Decisione TLTRO-III;
- h) di essere a conoscenza e di accettare che la *“Terza serie di operazioni mirate di rifinanziamento a più lungo termine (TLTRO-III)”* è disciplinata:
1. dalle previsioni contenute nel presente documento;
 2. dalle previsioni contenute nell'annuncio d'asta relativo alla specifica operazione;
 3. per quanto non diversamente disciplinato dal presente documento e nell'annuncio d'asta relativo alla specifica operazione, dalle previsioni di cui agli allegati del documento *“Strumenti di Politica monetaria dell'Eurosistema - Guida per gli operatori”* (disponibile sul sito internet della Banca d'Italia) che di seguito si riportano:

- i. Condizioni generali di contratto per le operazioni di politica monetaria (allegato 1);
 - ii. Contratto quadro per le operazioni di mercato aperto (allegato 2);
 - iii. Operazioni di mercato aperto dell'Eurosistema - Specifiche per gli operatori (allegato 3);
 - iv. Contratto quadro sulle garanzie per operazioni di finanziamento (allegato 6);
- i) che la documentazione allegata è completa e veritiera nei contenuti.

Allega, ai sensi dell'art. 3.3, lettera d(v), e dell'art. 3.3, ultimo capoverso, le dichiarazioni rilasciate dai componenti del gruppo, firmate dai rispettivi legali rappresentanti.

.....,

.....
(firma del legale rappresentante)

Ai sensi e per gli effetti di cui agli artt. 1341 e 1342 del codice civile la controparte dichiara di aver preso conoscenza e di approvare specificamente le norme e le condizioni di cui al paragrafo f), numeri 1 e 4 del presente documento.

.....,

.....
(firma del legale rappresentante)

Di seguito si comunica/no:

il/i referente/i da contattare per eventuali chiarimenti relativi alla presente richiesta

.....
(nome) (cognome)

.....
(telefono) (e-mail)

.....
(nome) (cognome)

.....
(telefono) (e-mail)

l'indirizzo di posta elettronica certificata della banca richiedente

.....

Schema B.1 – Dichiarazione di adesione di componente del gruppo

Oggetto: Partecipazione in forma di gruppo alla “*Terza serie di operazioni mirate di rifinanziamento a più lungo termine (TLTRO-III)*” - Dichiarazione di adesione a un gruppo da parte di un intermediario componente (ex art. 3.3, lettera d(v), e 3.3, ultimo capoverso, della Decisione TLTRO-III).

La banca (denominazione)

codice ABI - codice MFI,

di seguito indicata come intermediario, con sede legale in:

(stato)

(città)

(indirizzo)

Legalmente rappresentata da:

.....

ai sensi della Decisione BCE/2019/21 del 22 luglio 2019 (‘Decisione TLTRO-III’) riguardante le misure relative alle TLTRO-III,

DICHIARA

di voler aderire, in qualità di componente, al gruppo TLTRO-III facente capo alla seguente capofila:

(denominazione)

codice ABI - codice MFI

Al riguardo, l'intermediario dichiara e conferma:

a) di essere un ente creditizio con sede legale nell'area dell'euro idoneo alla partecipazione alle operazioni di politica monetaria ai sensi dell'articolo 55, punti (a), (b) e (c) dell'Indirizzo n. 2014/60 della BCE sull'attuazione del quadro di riferimento della politica monetaria dell'Eurosistema;

b) che:

- alla data del.....⁴, ha in essere uno "stretto legame", in accordo con la relativa definizione contenuta nell'Indirizzo n. 2014/60 della BCE", con l'ente creditizio:

(denominazione).....

codice ABI

codice MFI

che è componente/ capofila del gruppo TLTRO-III;

ovvero:

- alla data del.....⁵ è soggetto a vigilanza consolidata con l'ente creditizio:

(denominazione).....

codice ABI

codice MFI

che è componente/ capofila del gruppo TLTRO-III;

c) di rinunciare a partecipare alle TLTRO-III in qualità di singola controparte o come componente di altro gruppo TLTRO-III;

d) di essere a conoscenza degli obblighi derivanti dall'adesione al gruppo così come definiti e/o richiamati dalla Decisione TLTRO-III, che si impegna a rispettare, e in particolare di essere consapevole che:

1. in caso di uscita dal gruppo non potrà prendere parte alle future TLTRO-III di cui alla Decisione TLTRO-III, né in qualità di singola controparte né come componente di altro gruppo TLTRO-III, salvo che presenti nuova istanza ai sensi dell'art. 3.7(b) della Decisione TLTRO-III;

⁴ Lo "stretto legame" deve sussistere almeno dall'ultimo giorno del mese che precede la data di presentazione dell'istanza.

⁵ La condizione deve sussistere almeno dall'ultimo giorno del mese che precede la data di presentazione dell'istanza.

2. la composizione del gruppo deve rimanere invariata per tutte le TLTRO-III, salvo quanto disposto agli artt. 3.5, 3.6 e 3.7 della Decisione TLTRO-III;
3. la capofila è l'unico componente del gruppo che può partecipare alle procedure d'asta per le TLTRO-III;
4. qualora la capofila perda lo status di controparte abilitata alle operazioni di mercato aperto, il gruppo TLTRO-III a lei facente capo perderà il riconoscimento di gruppo abilitato a partecipare alle TLTRO-III e tale capofila sarà tenuta a rimborsare la totalità dei prestiti ottenuti tramite le operazioni TLTRO-III.

Ai sensi dell'art. 3.3(d)(v) e dell'ultimo capoverso dell'art. 3.3 della Decisione TLTRO-III, allega copia dell'atto adottato dai propri competenti organi decisionali avente ad oggetto la partecipazione al gruppo TLTRO-III in questione ai sensi e per gli effetti della Decisione TLTRO-III.

.....

.....
(firma del legale rappresentante)

Oggetto: comunicazione dell'intermediario capofila sulla composizione del gruppo ai fini della “Terza serie di operazioni mirate di rifinanziamento a più lungo termine (TLTRO-III)”.

DENOMINAZIONE BANCA MEMBRO	CODICE MFI *	CODICE ABI	RELAZIONE “STRETTI LEGAMI” ⁵			RELAZIONE DI RISERVA OBBLIGATORIA INDIRETTA			VIGILANZA CONSOLIDATA (si/no) ⁶
			DENOMINA ZIONE ⁷	CODICE MFI *	CODICE ABI	DENOMINA ZIONE ⁸	CODICE MFI *	CODICE ABI	
<banca capofila>									
<banca 2>									
<banca 3>									
...									
<banca x>									

⁵ Ai fini della redazione del presente allegato, la definizione di “stretto legame” è contenuta all’articolo 138 dell’Indirizzo della BCE/2014/60.

⁶ Indicare, nel caso in cui il gruppo sia sottoposto a vigilanza consolidata, se la componente ne fa parte o meno.

⁷ Indicare l’intermediario capofila, o l’intermediario membro, con cui sussiste la relazione di “stretto legame” ovvero di riserva obbligatoria indiretta.

⁸ Idem.

* Il codice MFI (Monetary and Financial Institutions) è visualizzabile sul sito della BCE consultando il link
https://www.ecb.europa.eu/stats/financial_corporations/list_of_financial_institutions/html/elegass.en.html

Schema C – Notifica capofila

Oggetto: Partecipazione in forma di gruppo alla “*Terza serie di operazioni mirate di rifinanziamento a più lungo termine (TLTRO-III)*” – Notifica del gruppo da parte della capofila.

La banca (denominazione)

codice ABI - codice MFI,

in qualità di ‘intermediario capofila’ o ‘capofila’ del “gruppo TLTRO-II” (‘gruppo’) composto dagli enti creditizi di cui al allegato A), che corrisponde a quello riconosciuto con nota della Banca d’Italia [xxxxxxx/aaaa] del [gg/mm/aaaa] [ad eccezione dei seguenti enti:],

con sede legale in:

(stato)

(città)

(indirizzo)

Legalmente rappresentata da

.....

C H I E D E

di partecipare alla “Terza serie di operazioni mirate di rifinanziamento a più lungo termine (TLTRO-III)” ai sensi della Decisione della BCE/2019/21 del 22 luglio 2019 (‘Decisione TLTRO-III’) riguardante misure relative alle TLTRO-III.

Al riguardo, in qualità di capofila, l'intermediario istante dichiara e conferma:

- a) che per ciascuno dei componenti del gruppo sussiste l'una o l'altra delle seguenti condizioni: (i) il componente ha formalmente deciso di aderire al gruppo e di rinunciare a partecipare alle TLTRO-III in qualità di singola controparte o come componente di altro gruppo TLTRO-III; oppure (ii) l'accordo previsto dall'art. 10.2 del Regolamento BCE 2003/9, stipulato tra il componente del gruppo e la capofila, specifica che il componente ha accesso alle operazioni di mercato aperto dell'Eurosistema soltanto per il tramite della capofila;
- b) di essere a conoscenza e di accettare che, in qualità di capofila del gruppo, assume il ruolo di controparte della Banca d'Italia nella *“terza serie di operazioni mirate di rifinanziamento a più lungo termine (TLTRO-III)”*;
- c) di essere a conoscenza e di accettare che alla *“terza serie di operazioni mirate di rifinanziamento a più lungo termine (TLTRO-III)”* si applicano le condizioni specificate nella Decisione TLTRO-III, con particolare riguardo a:
 - 1. limite di finanziamento, limite di offerta e livelli di riferimento: articolo 4 della Decisione TLTRO-III;
 - 2. tasso di interesse: articolo 5 della Decisione TLTRO-III;
 - 3. obblighi di segnalazione: articolo 6 della Decisione TLTRO-III;
 - 4. inosservanza degli obblighi di segnalazione: articolo 7 della Decisione TLTRO-III;
- d) di essere a conoscenza e di accettare che qualora intenda includere i prestiti autocartolarizzati nel calcolo del limite di finanziamento, dovrà fornire i dati integrativi relativi a tali prestiti congiuntamente alla certificazione degli stessi fornita da un revisore esterno, conformemente alle disposizioni di cui agli articoli 6.3 e 6.6 della Decisione TLTRO-III;
- e) di essere a conoscenza e di accettare che la *“terza serie di operazioni mirate di rifinanziamento a più lungo termine (TLTRO-III)”* è disciplinata:
 - 1. dalle previsioni contenute nel presente documento;
 - 2. dalle previsioni contenute nell'annuncio d'asta relativo alla specifica operazione;
 - 3. per quanto non diversamente disciplinato dal presente documento e nell'annuncio d'asta relativo alla specifica operazione, dalle previsioni di cui agli allegati del documento *“Strumenti di Politica monetaria dell'Eurosistema - Guida per gli operatori”* (disponibile sul sito internet della Banca d'Italia) che di seguito si riportano:



- i. Condizioni generali di contratto per le operazioni di politica monetaria (allegato 1);
 - ii. Contratto quadro per le operazioni di mercato aperto (allegato 2);
 - iii. Operazioni di mercato aperto dell'Eurosistema - Specifiche per gli operatori (allegato 3);
 - iv. Contratto quadro sulle garanzie per operazioni di finanziamento (allegato 6);
- e) che la documentazione allegata è completa e veritiera nei contenuti.

.....,

.....
(firma del legale rappresentante)

Ai sensi e per gli effetti di cui agli artt. 1341 e 1342 del codice civile la controparte dichiara di aver preso conoscenza e di approvare specificamente le norme e le condizioni di cui al paragrafo c), numeri 1 e 4 del presente documento.

.....,

.....
(firma del legale rappresentante)

Oggetto: comunicazione dell'intermediario capofila sulla composizione del gruppo ai fini della “Terza serie di operazioni mirate di rifinanziamento a più lungo termine (TLTRO-III)”.

DENOMINAZIONE BANCA MEMBRO	CODICE MFI *	CODICE ABI	RELAZIONE “STRETTI LEGAMI” ⁹			RELAZIONE DI RISERVA OBBLIGATORIA INDIRETTA			VIGILANZA CONSOLIDATA (si/no) ¹⁰
			DENOMINA ZIONE ¹¹	CODICE MFI *	CODICE ABI	DENOMINA ZIONE ¹²	CODICE MFI *	CODICE ABI	
<banca capofila>									
<banca 2>									
<banca 3>									
...									
<banca x>									

⁹ Ai fini della redazione del presente allegato, la definizione di “stretto legame” è contenuta all’articolo 138 dell’Indirizzo della Banca Centrale Europea BCE/2014/60.

¹⁰ Indicare, nel caso in cui il gruppo sia sottoposto a vigilanza consolidata, se la componente ne fa parte o meno.

¹¹ Indicare l’intermediario capofila, o l’intermediario membro, con cui sussiste la relazione di “stretto legame” ovvero di riserva obbligatoria indiretta.

¹² Idem.

* Il codice MFI (Monetary and Financial Institutions) è visualizzabile sul sito della BCE consultando il link
https://www.ecb.europa.eu/stats/financial_corporations/list_of_financial_institutions/html/elegass.en.htm

