

**REGOLAMENTO DELEGATO (UE) 2020/1229 DELLA COMMISSIONE**  
**del 29 novembre 2019**

**che integra il regolamento (UE) 2017/2402 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione sugli standard operativi dei repertori di dati sulle cartolarizzazioni per la raccolta, l'aggregazione, la comparazione, la verifica della completezza e della coerenza dei dati e l'accesso ad essi**

(Testo rilevante ai fini del SEE)

LA COMMISSIONE EUROPEA,

visto il trattato sul funzionamento dell'Unione europea,

visto il regolamento (UE) 2017/2402 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 12 dicembre 2017, che stabilisce un quadro generale per la cartolarizzazione, instaura un quadro specifico per cartolarizzazioni semplici, trasparenti e standardizzate e modifica le direttive 2009/65/CE, 2009/138/CE e 2011/61/UE e i regolamenti (CE) n. 1060/2009 e (UE) n. 648/2012 <sup>(1)</sup>, in particolare l'articolo 10, paragrafo 7, lettera a), e l'articolo 17, paragrafo 2, lettere b), c) e d),

considerando quanto segue:

- (1) I soggetti di cui all'articolo 17, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2017/2402 dovrebbero essere in condizione di assolvere alle loro responsabilità, ai loro mandati e obblighi rispettivi. Le informazioni che i repertori di dati sulle cartolarizzazioni forniscono a tali soggetti dovrebbero pertanto essere di qualità elevata e prestarsi all'aggregazione e comparazione tempestiva, strutturata ed esauriente tra i diversi repertori di dati sulle cartolarizzazioni. I repertori di dati sulle cartolarizzazioni dovrebbero perciò valutare se dette informazioni sono complete e coerenti prima di metterle a disposizione di tali soggetti e dovrebbero fornire loro un rapporto di fine giornata e un punteggio globale di completezza dei dati.
- (2) Le procedure per la verifica della completezza e coerenza delle informazioni che i cedenti, i promotori o le SSPE segnalano ai repertori di dati sulle cartolarizzazioni dovrebbero tenere conto della varietà di tipi, caratteristiche e pratiche di cartolarizzazione. È quindi opportuno stabilire procedure di verifica che prevedano la comparazione delle informazioni segnalate per cartolarizzazioni tra loro simili, quali le cartolarizzazioni con cedente, tipo di esposizione sottostante, caratteristica strutturale o geografica identici o collegati.
- (3) Per garantire la qualità delle informazioni segnalate, le procedure di verifica dovrebbero altresì applicarsi alla completezza e coerenza della documentazione che le corrobora. Data tuttavia la difficoltà relativa della verifica della completezza e coerenza di tale documentazione, i repertori di dati sulle cartolarizzazioni dovrebbero richiedere ai soggetti segnalanti di confermare per iscritto che la documentazione riguardante le cartolarizzazioni che essi mettono a disposizione è completa e coerente. Gli aggiornamenti rilevanti della documentazione già trasmessa dovrebbero essere considerati un nuovo documento sulla cartolarizzazione che impone una richiesta di conferma scritta.
- (4) Per mettere i soggetti di cui all'articolo 17, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2017/2402 in condizione di assolvere alle loro responsabilità, ai loro mandati e obblighi rispettivi, le informazioni relative alle cartolarizzazioni a cui tali soggetti devono avere accesso diretto e immediato dovrebbero essere comparabili tra i diversi repertori di dati sulle cartolarizzazioni secondo modalità armonizzate e coerenti. Tali informazioni dovrebbero pertanto essere trasmesse nel formato XML (Extensible Markup Language), che è ampiamente utilizzato nel settore finanziario.
- (5) Dovrebbe essere garantita la riservatezza di ogni tipo di dati scambiati tra i repertori di dati sulle cartolarizzazioni e i soggetti di cui all'articolo 17, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2017/2402. Tali scambi dovrebbero quindi essere effettuati tramite una connessione tra macchine (machine-to-machine) sicura e utilizzando protocolli di cifratura dei dati. Al fine di garantire standard minimi comuni dovrebbe essere utilizzato un protocollo di trasferimento dei file SSH.

<sup>(1)</sup> GU L 347 del 28.12.2017, pag. 35.

- (6) I dati relativi alle ultime esposizioni sottostanti la cartolarizzazione, alle comunicazioni agli investitori, alle informazioni privilegiate e a quelle sugli eventi significativi, nonché gli indicatori della qualità e della tempestività di tali dati sono essenziali ai fini del controllo continuativo delle posizioni di investimento verso la cartolarizzazione e dei potenziali investimenti, nonché della stabilità finanziaria e del rischio sistemico. I soggetti di cui all'articolo 17, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2017/2402 dovrebbero quindi avere accesso a tali dati su base periodica predefinita o ad hoc in funzione della loro necessità di acquisire tali dati.
- (7) Le cartolarizzazioni sono complesse ed eterogenee e gli utenti che accedono alle informazioni dei repertori di dati sulle cartolarizzazioni sono diversificati. È quindi essenziale agevolare l'accesso diretto e immediato a serie di dati e informazioni specifiche. Tale accesso dovrebbe comprendere l'accesso in un formato leggibile da dispositivo automatico ai dati e a tutte le informazioni attuali e storiche concernenti una cartolarizzazione registrati in un repertorio. A tal fine, dovrebbero essere disciplinate le richieste ad hoc volte a ottenere informazioni specifiche. I termini entro i quali i repertori di dati sulle cartolarizzazioni dovrebbero fornire i dati ai soggetti di cui all'articolo 17, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2017/2402 dovrebbero essere armonizzati per facilitare il trattamento efficiente dei dati da parte di tali soggetti e repertori di dati sulle cartolarizzazioni. Allo stesso tempo, è opportuno garantire che i dati vengano acquisiti entro termini che consentono l'efficace adempimento delle responsabilità dei soggetti richiedenti.
- (8) I soggetti di cui all'articolo 17, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2017/2402 fanno affidamento sui dati conservati dai repertori di dati sulle cartolarizzazioni, anche per raffrontare le cartolarizzazioni attuali con quelle precedenti. Pertanto è opportuno specificare che i repertori debbano conservare i dati relativi a una cartolarizzazione per 10 anni a decorrere dalla cessazione della cartolarizzazione, a norma dell'articolo 10, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2017/2402 e dell'articolo 80, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio <sup>(2)</sup>.
- (9) Le disposizioni del presente regolamento sono strettamente interconnesse in quanto riguardano standard e procedure inerenti alla raccolta e al trattamento delle informazioni detenute dai repertori di dati sulle cartolarizzazioni e all'accesso a dette informazioni. È pertanto opportuno riunire tali disposizioni in un unico regolamento.
- (10) Il presente regolamento si basa sul progetto di norme tecniche di regolamentazione che l'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (ESMA) ha presentato alla Commissione.
- (11) L'ESMA ha condotto una consultazione pubblica sul progetto di norme tecniche di regolamentazione sul quale è basato il presente regolamento, 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>(3)</sup>,

HA ADOTTATO IL PRESENTE REGOLAMENTO:

#### Articolo 1

#### Definizioni

Ai fini del presente regolamento si applicano le seguenti definizioni:

- a) «soggetto segnalante»: il soggetto designato a norma dell'articolo 7, paragrafo 2, del regolamento (UE) 2017/2402;
- b) «data limite dei dati»: la data di riferimento delle informazioni segnalate conformemente al regolamento delegato (UE) 2020/1224 della Commissione <sup>(4)</sup>.

<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) 2020/1224 della Commissione, del 16 ottobre 2019, che integra il regolamento (UE) 2017/2402 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione che specificano le informazioni e i dati sulle cartolarizzazioni che devono essere messi a disposizione dal cedente, dal promotore e dalla SSPE (cfr. pagina 1 della presente Gazzetta ufficiale).

## Articolo 2

**Rapporto di fine giornata**

1. I repertori di dati sulle cartolarizzazioni generano giornalmente un rapporto unico aggregato di fine giornata relativo a tutte le cartolarizzazioni loro segnalate, escluse quelle che sono state rigettate a norma dell'articolo 4, paragrafo 6. Tale rapporto è basato sulle informazioni segnalate più recenti, esclude ogni cartolarizzazione segnalata che sia stata rigettata a norma dell'articolo 4, paragrafo 6, e comprende almeno le seguenti informazioni:

- a) l'identificativo unico assegnato a norma dell'articolo XI del regolamento delegato (UE) 2020/1224;
- b) i codici ISIN dei segmenti, delle obbligazioni o dei prestiti subordinati della cartolarizzazione, laddove disponibili;
- c) la somma dei saldi correnti del capitale di tutti i segmenti, obbligazioni o prestiti subordinati della cartolarizzazione, espressi in EUR utilizzando i tassi di cambio pubblicati sul sito web della Banca centrale europea il giorno lavorativo precedente;
- d) il nome della cartolarizzazione;
- e) se si tratta di una cartolarizzazione ABCP o di una cartolarizzazione non ABCP;
- f) se la struttura della cartolarizzazione è del tipo «M» (master trust) come indicato nel campo SESS9 dell'allegato XIV del regolamento delegato (UE) 2020/1224 oppure del tipo «S» (tutte le altre cartolarizzazioni);
- g) se il metodo di trasferimento del rischio della cartolarizzazione è «T» (vendita effettiva) come indicato nel campo IVSS11 dell'allegato XII del regolamento delegato (UE) 2020/1224 oppure «S» (cartolarizzazione sintetica) come riportato nel campo SESV11 dell'allegato XIV del medesimo regolamento, oppure «ABCP» (cartolarizzazioni ABCP);
- h) il nome e l'identificativo del soggetto giuridico (LEI) del cedente, del promotore e della SSPE;
- i) la data più recente di pagamento degli interessi, nel formato ISO 8601 della data;
- j) la marcatura temporale, nel formato ISO 8601 della data e ora (UTC), approssimata al secondo, dell'ultima comunicazione di dati pervenuta al repertorio di dati sulle cartolarizzazioni ovvero, in caso di molteplici comunicazioni in riferimento alla stessa data limite dei dati, le marcature temporali, nel formato ISO 8601 della data e ora (UTC), della prima e dell'ultima comunicazione avente la stessa data limite dei dati;
- k) la data limite dei dati, nel formato ISO 8601 della data, dell'ultima comunicazione di dati pervenuta al repertorio di dati sulle cartolarizzazioni;
- l) il numero delle comunicazioni di dati pervenute al repertorio di dati sulle cartolarizzazioni che fanno riferimento alla stessa data limite dei dati di cui alla lettera k);
- m) il punteggio di completezza dei dati di cui all'articolo 3 dell'ultima comunicazione di dati pervenuta al repertorio di dati sulle cartolarizzazioni;
- n) per le cartolarizzazioni non ABCP, il paese di stabilimento del cedente o del prestatore originario;
- o) per le cartolarizzazioni ABCP, il paese di stabilimento del promotore;
- p) il paese in cui è localizzata la maggioranza delle esposizioni sottostanti, in termini di saldo corrente del capitale dell'esposizione sottostante;
- q) il tipo prevalente di esposizioni sottostanti la cartolarizzazione, in termini di saldo corrente del capitale;
- r) ai fini della lettera n), laddove le esposizioni sottostanti la cartolarizzazione sono una combinazione di esposizioni provenienti da molteplici cedenti o prestatori originari, il paese di stabilimento del cedente o del prestatore originario è il paese del cedente o prestatore originario che detiene il massimo importo di esposizioni in termini di saldo corrente del capitale nella cartolarizzazione.

2. I repertori di dati sulle cartolarizzazioni mettono a disposizione il rapporto di fine giornata nel formato XML.

3. Le marcature temporali di cui al presente articolo non si discostano di più di un secondo dall'UTC emanato e mantenuto da uno dei centri di metrologia del tempo elencati nell'ultima relazione di attività sul tempo del Bureau international des poids et mesures (BIPM).

### Articolo 3

#### Punteggio di completezza dei dati

4. I repertori di dati sulle cartolarizzazioni calcolano un punteggio di completezza dei dati per ciascuna comunicazione di dati utilizzando la matrice di calcolo di cui alla tabella 1 dell'allegato e i seguenti valori (input):

$$\text{Input 1} = \frac{\sum_i^N \text{ND1}}{N}$$

$$\text{Input 2} = \frac{\sum_i^N \text{ND2} + \sum_i^N \text{ND3} + \sum_i^N \text{ND4}}{N}$$

dove:

$\sum_i^N \text{ND}x$  rappresenta il numero totale di campi di una comunicazione di dati che contengono i rispettivi valori «Opzione No Data (nessun dato)» indicati a norma dell'articolo 9, paragrafo 3, del regolamento delegato (UE) 2020/1224;

$N$  rappresenta il numero totale di campi di una comunicazione di dati dove è consentito indicare qualsivoglia valore «Opzione No Data (nessun dato)» (da ND1 a ND4) a norma dell'articolo 9, paragrafo 3, del regolamento delegato (UE) 2020/1224.

Ai fini del calcolo del punteggio di completezza dei dati, i campi compilati utilizzando il formato «ND4-AAAA-MM-GG» si intendono come «ND4».

### Articolo 4

#### Verifica della completezza e della coerenza delle informazioni

1. I repertori di dati sulle cartolarizzazioni verificano la completezza e la coerenza delle informazioni loro segnalate verificando:

- a) il nome del soggetto segnalante, come indicato nel campo IVSS4 dell'allegato XII o nel campo IVAS3 dell'allegato XIII del regolamento delegato (UE) 2020/1224;
- b) se il codice dell'elemento della comunicazione di cui all'allegato I, tabella 3, del regolamento delegato (UE) 2020/1224 è corretto.

2. In riferimento alle informazioni di cui all'articolo 7, paragrafo 1, lettere a), e), f) e g), del regolamento (UE) 2017/2402, i repertori di dati sulle cartolarizzazioni verificano altresì la completezza e la coerenza delle informazioni nel modo seguente:

- a) verificando se le informazioni sono state segnalate rispettando la struttura e il formato dei modelli di cui agli allegati da II a XV del regolamento di esecuzione (UE) 2020/1225 <sup>(9)</sup> della Commissione;
- b) comparando le informazioni segnalate:
  - i) in campi diversi per la stessa data limite dei dati e lo stesso elemento di informazione relativo a un'esposizione sottostante, una comunicazione agli investitori, un'informazione privilegiata o un evento significativo;
  - ii) per elementi di informazione diversi relativi a un'esposizione sottostante, una comunicazione agli investitori, un'informazione privilegiata o un evento significativo per lo stesso campo e la stessa data limite dei dati;
  - iii) per lo stesso elemento di informazione relativo a un'esposizione sottostante, una comunicazione agli investitori, un'informazione privilegiata o un evento significativo per lo stesso campo e date limite dei dati diverse;
  - iv) per cartolarizzazioni analoghe;

<sup>(9)</sup> Regolamento di esecuzione (UE) 2020/1225 della Commissione, del 29 ottobre 2019, che stabilisce le norme tecniche di attuazione per quanto riguarda il formato e i moduli standardizzati per la messa a disposizione delle informazioni e dei dati sulle cartolarizzazioni da parte del cedente, del promotore e della SSPE (cfr. pag. 217 della presente Gazzetta ufficiale).

- c) verificando se la data limite dei dati segnalati e la marcatura temporale della comunicazione rispettano l'articolo 10 del regolamento delegato (UE) 2020/1224;
- d) verificando se le opzioni «No Data (nessun dato)» di cui all'articolo 9, paragrafo 3, del regolamento delegato (UE) 2020/1224; sono utilizzate solo laddove permesso e non impediscono alla comunicazione di dati di essere sufficientemente rappresentativa delle esposizioni sottostanti la cartolarizzazione.

Per le cartolarizzazioni ABCP i riferimenti del presente paragrafo alle esposizioni sottostanti si intendono fatti ai tipi di esposizioni sottostanti.

3. I repertori di dati sulle cartolarizzazioni verificano la completezza e la coerenza della documentazione messa a loro disposizione ai sensi dell'articolo 7, paragrafo 1, lettera b), del regolamento (UE) 2017/2402 richiedendo ai soggetti segnalanti una conferma scritta di quanto segue:

- a) che al repertorio di dati sulle cartolarizzazioni sono stati trasmessi tutti gli elementi di cui all'allegato I, tabella 3, del regolamento delegato (UE) 2020/1224; oggetto di richiesta di messa a disposizione ai sensi dell'articolo 7, paragrafo 1, lettera b), del regolamento (UE) 2017/2402;
- b) che la documentazione è coerente con la struttura e le caratteristiche effettive della cartolarizzazione.

4. La conferma scritta di cui al paragrafo 3 è richiesta entro i seguenti termini:

- a) entro cinque giorni lavorativi dalla prima emissione di titoli nell'ambito della cartolarizzazione o, per le cartolarizzazioni ABCP, entro cinque giorni lavorativi dalla prima emissione di titoli nell'ambito del programma ABCP;
- b) ogni dodici mesi a decorrere dalla data delle richieste di cui alla lettera a);
- c) entro cinque giorni lavorativi dalla messa a disposizione di un nuovo documento ai sensi dell'articolo 7, paragrafo 1, lettera b), del regolamento (UE) 2017/2402.

Il repertorio di dati sulle cartolarizzazioni che non abbia ricevuto conferma scritta entro 14 giorni dalla data di una richiesta ai sensi del primo comma chiede al soggetto segnalante di trasmettergli la conferma scritta entro 14 giorni.

5. Il repertorio di dati sulle cartolarizzazioni verifica se la notifica STS di cui all'articolo 7, paragrafo 1, lettera d), del regolamento (UE) 2017/2402 che gli è stata messa a disposizione rispetta la struttura e il formato dei modelli di cui agli allegati del regolamento di esecuzione (UE) 2020/1227 della Commissione <sup>(6)</sup>.

6. Il repertorio di dati sulle cartolarizzazioni rigetta una comunicazione di informazioni che sia incompleta o incoerente a norma dei paragrafi 1, 2 e 5, tranne che per gli aspetti di cui al paragrafo 2, lettera b), punti iii) e iv). Il repertorio di dati sulle cartolarizzazioni assegna le comunicazioni rigettate ai sensi del presente paragrafo a una delle categorie di motivazione del rigetto di cui alla tabella 2 dell'allegato.

7. Il repertorio di dati sulle cartolarizzazioni notifica senza indebito ritardo ai soggetti di cui all'articolo 17, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2017/2402 quanto segue:

- a) che le informazioni comunicate sono incomplete o incoerenti ai sensi del paragrafo 2, lettera b), punti iii) e iv);
- b) che il repertorio di dati sulle cartolarizzazioni non ha ricevuto la conferma scritta di cui al paragrafo 3.

8. Entro un'ora dal ricevimento delle informazioni di cui all'articolo 7 del regolamento (UE) 2017/2402 i repertori di dati sulle cartolarizzazioni trasmettono ai soggetti segnalanti un riscontro dettagliato sui risultati delle verifiche eseguite a norma dei paragrafi 1, 2, 3 e 5, anche per quanto riguarda le eventuali assegnazioni alle categorie di motivazione del rigetto ai sensi del paragrafo 6. Tale riscontro comprende almeno gli elementi seguenti:

- a) l'identificativo unico assegnato alla cartolarizzazione a norma dell'articolo 11 del regolamento delegato (UE) 2020/1224;

---

<sup>(6)</sup> Regolamento di esecuzione (UE) 2020/1227, del 12 novembre 2019, che stabilisce norme tecniche di attuazione per quanto riguarda i moduli per fornire le informazioni conformemente ai requisiti di notifica (cfr. pagina 315 della presente Gazzetta ufficiale).

- b) il codice dell'elemento o degli elementi di cui all'allegato I, tabella 3, del regolamento delegato (UE) 2020/1224;
  - c) la marcatura temporale, nel formato ISO 8601 della data e ora (UTC), approssimata al secondo, delle informazioni segnalate.
9. Ogni lunedì entro le ore 19.00.00 UTC i repertori di dati sulle cartolarizzazioni generano un rapporto di tutte le informazioni che hanno rigettato dal lunedì precedente alle ore 19.00.00 UTC. Tale rapporto comprende almeno gli elementi seguenti:
- a) l'identificativo unico assegnato alla cartolarizzazione a norma dell'articolo 11 del regolamento delegato (UE) 2020/1224;
  - b) il nome della cartolarizzazione;
  - c) i codici ISIN dei segmenti o delle obbligazioni o dei prestiti subordinati della cartolarizzazione, laddove disponibili;
  - d) il nome e l'identificativo LEI del cedente, del promotore e della SSPE;
  - e) la marcatura temporale, nel formato ISO 8601 della data e ora (UTC), approssimata al secondo, delle informazioni comunicate;
  - f) il codice dell'elemento della comunicazione di cui all'allegato I, tabella 3, del regolamento delegato (UE) 2020/1224;
  - g) la categoria di motivazione del rigetto di cui alla tabella 2 dell'allegato del presente regolamento e le circostanze specifiche che hanno determinato l'assegnazione a tale categoria;
  - h) ogni spiegazione fornita dal soggetto segnalante prima delle ore 17.00.00 UTC del lunedì di pubblicazione del rapporto in merito al perché le informazioni segnalate fossero incomplete o incoerenti, o al perché non fosse stata trasmessa la conferma scritta di cui al paragrafo 3.

#### Articolo 5

##### **Dettagli delle informazioni a cui deve essere dato accesso**

I dettagli delle informazioni di cui all'articolo 17, paragrafo 2, lettera c), del regolamento (UE) 2017/2402 sono i seguenti:

- a) tutte le informazioni pervenute al repertorio di dati sulle cartolarizzazioni dai soggetti segnalanti conformemente al regolamento (UE) 2017/2402;
- b) il rapporto di fine giornata di cui all'articolo 2, il punteggio di completezza dei dati di cui all'articolo 3 e ogni informazione risultante dalle verifiche svolte a norma dell'articolo 4 del presente regolamento;
- c) tutte le formule e i metodi di calcolo e di aggregazione utilizzati per generare le informazioni di cui alle lettere a) e b).

#### Articolo 6

##### **Termini e condizioni per l'accesso ai dettagli delle informazioni**

1. L'accesso alle informazioni di cui all'articolo 5 è dato su richiesta. La richiesta di accesso contiene le informazioni seguenti:

- a) il nome del soggetto richiedente;
- b) la persona di contatto presso il soggetto richiedente;
- c) il tipo di soggetto richiedente, di cui all'articolo 17, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2017/2402, che chiede l'accesso;
- d) i nominativi delle persone presso il soggetto richiedente che avranno accesso alle informazioni richieste;
- e) le credenziali per il collegamento sicuro tramite il protocollo di trasferimento dei file SSH, come richiesto dall'articolo 7, paragrafo 2;
- f) se si tratta di una richiesta ad hoc o di una richiesta periodica predefinita;

- g) l'identificazione delle informazioni richieste in base a una qualsivoglia combinazione dei criteri di cui al paragrafo 4;
  - h) ogni altra informazione tecnica pertinente all'accesso del soggetto richiedente.
2. Ai fini del paragrafo 1, i repertori di dati sulle cartolarizzazioni:
- a) designano una persona o le persone responsabili per i contatti con i soggetti di cui all'articolo 17, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2017/2402;
  - b) pubblicano sul proprio sito web i termini e le condizioni per accedere alle informazioni e le istruzioni per la presentazione di una richiesta di accesso a tali informazioni;
  - c) danno l'accesso soltanto alle informazioni specificate nella richiesta di accesso;
  - d) non appena possibile e comunque non oltre i 30 giorni successivi alla richiesta di predisporre l'accesso a tali informazioni, stabiliscono le modalità tecniche necessarie per mettere i soggetti di cui all'articolo 17, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2017/2402 in condizione di presentare richieste di accesso a tali informazioni.
3. L'accesso alle informazioni di cui all'articolo 5 è dato entro i seguenti termini:
- a) non oltre le ore 19.00.00 UTC del giorno cui si riferisce il rapporto per una richiesta ad hoc o una richiesta periodica predefinita di rapporto di fine giornata di cui all'articolo 2;
  - b) non oltre le ore 19.00.00 UTC del primo giorno successivo alla data di ricevimento della richiesta di accesso laddove l'informazione riguarda una cartolarizzazione di cui non è ancora stato fissato il prezzo oppure che non è ancora scaduta o è scaduta meno di un anno prima della data di presentazione della richiesta;
  - c) non oltre i tre giorni lavorativi successivi alla data di ricevimento della richiesta di accesso laddove l'informazione riguarda una cartolarizzazione scaduta più di un anno prima della data di presentazione della richiesta;
  - d) non oltre i tre giorni lavorativi successivi alla data di ricevimento della richiesta di accesso laddove l'informazione riguarda diverse cartolarizzazioni che rientrano nelle lettere b) e c).
4. I repertori di dati sulle cartolarizzazioni danno alle entità di cui all'articolo 17, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2017/2402 l'accesso alle informazioni di cui all'articolo 5 in base a una qualsivoglia combinazione dei seguenti criteri:
- a) tipo di cartolarizzazione: non ABCP o ABCP;
  - b) tipo di struttura della cartolarizzazione: o «M» (master trust) come indicato nel campo SESS9 dell'allegato XIV del regolamento delegato (UE) 2020/1224 o «S» (tutte le altre cartolarizzazioni);
  - c) metodo di trasferimento del rischio della cartolarizzazione: o «Y» (vendita effettiva) come indicato nel campo IVSS11 dell'allegato XII del regolamento delegato (UE) 2020/1224 o «Y» (cartolarizzazione sintetica) come indicato nel campo SESV11 dell'allegato XIV del medesimo regolamento, oppure «ABCP» (cartolarizzazioni ABCP);
  - d) codice dell'elemento della cartolarizzazione;
  - e) tipo di esposizione sottostante la cartolarizzazione;
  - f) sezione relativa all'esposizione sottostante la cartolarizzazione;
  - g) sezione relativa al modello di comunicazione agli investitori di una cartolarizzazione;
  - h) sezione relativa al modello per le informazioni privilegiate o per le informazioni sugli eventi significativi;
  - i) identificativo:
    - i) identificativo unico;
    - ii) identificativo dell'operazione;
    - iii) numero internazionale di identificazione dei titoli (ISIN);

- iv) identificativo nuovo od originario del segmento/dell'obbligazione;
  - v) identificativo nuovo od originario dell'esposizione sottostante;
  - vi) identificativo nuovo od originario del debitore;
  - vii) identificativo del soggetto giuridico del cedente;
  - viii) identificativo del soggetto giuridico del promotore;
  - ix) identificativo del soggetto giuridico della SSPE;
  - x) identificativo del soggetto giuridico del prestatore originario;
  - xi) identificativo del soggetto giuridico del gestore di CLO;
- j) criterio geografico:
- i) regione geografica;
  - ii) legge applicabile;
- k) data e ora:
- i) marcatura temporale della comunicazione;
  - ii) data limite dei dati;
  - iii) data di emissione del segmento/dell'obbligazione;
  - iv) scadenza legale del segmento/dell'obbligazione;
  - v) data di creazione dell'esposizione sottostante;
  - vi) data di scadenza dell'esposizione sottostante;
- l) valuta:
- i) valuta del segmento/dell'obbligazione;
  - ii) valuta di denominazione dell'esposizione sottostante.
5. I repertori di dati sulle cartolarizzazioni mettono a disposizione le seguenti informazioni utilizzando il formato XML:
- a) le informazioni di cui all'articolo 7, paragrafo 1, lettera a) e lettere da d) a g), del regolamento (UE) 2017/2402;
  - b) le informazioni generate dai repertori di dati sulle cartolarizzazioni conformemente agli articoli 2 e 4 del presente regolamento, fatta eccezione per le conferme scritte ricevute ai sensi dell'articolo 4, paragrafo 3.

#### Articolo 7

##### **Standard per la raccolta dei dati e l'accesso a essi**

1. Per ricevere dati dai soggetti segnalanti o da altri repertori di dati sulle cartolarizzazioni e per trasferire dati ai soggetti di cui all'articolo 17, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2017/2402, i repertori di dati sulle cartolarizzazioni utilizzano protocolli di firma elettronica e di cifratura dei dati.
2. Ai fini del paragrafo 1, i repertori di dati sulle cartolarizzazioni istituiscono e mantengono un'interfaccia tra macchine (machine-to-machine) sicura e la mettono a disposizione dei soggetti segnalanti e dei soggetti di cui all'articolo 17, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2017/2402. Tale interfaccia si avvale del protocollo di trasferimento dei file SSH.
3. I repertori di dati sulle cartolarizzazioni utilizzano messaggi XML standardizzati per comunicare tramite l'interfaccia di cui al paragrafo 2 e mettono le informazioni di cui all'articolo 6, paragrafo 5, del presente regolamento a disposizione dei soggetti di cui all'articolo 17, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2017/2402.



*Articolo 8***Conservazione delle informazioni**

1. I repertori di dati sulle cartolarizzazioni conservano le seguenti informazioni:
  - a) le verifiche ai sensi del presente regolamento e qualsiasi altra convalida effettuata dal repertorio di dati sulle cartolarizzazioni;
  - b) le conferme scritte pervenute al repertorio di dati sulle cartolarizzazioni, di cui all'articolo 4, paragrafo 3;
  - c) i risultati che il repertorio di dati sulle cartolarizzazioni comunica al soggetto segnalante a norma dell'articolo 4, paragrafo 6;
  - d) ogni spiegazione fornita dal soggetto segnalante sul perché le informazioni presentate sono incomplete o incoerenti o sul perché manca la conferma scritta di cui all'articolo 4, paragrafo 7;
  - e) in un log di segnalazione, i particolari delle eventuali rettifiche o cancellazioni presentate dal soggetto segnalante;
  - f) ogni altra informazione generata o presentata ai sensi del presente regolamento.
2. Ogni informazione è conservata per 10 anni a decorrere dalla cessazione della cartolarizzazione cui si riferisce.
3. Il log di segnalazione di cui al paragrafo 1, lettera d), riporta l'identificativo unico della cartolarizzazione, il codice dell'elemento, la marcatura temporale della comunicazione interessata, la marcatura temporale delle variazioni e una descrizione chiara delle modifiche apportate alle informazioni presentate, riguardante anche il contenuto nuovo e il contenuto precedente di tali informazioni.

*Articolo 9***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 29 novembre 2019

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

## ALLEGATO

**Matrice del punteggio di completezza dei dati e categorie di motivazione del rigetto**

Tabella 1

**Matrice del punteggio di completezza dei dati**

		Input 1: percentuale dei campi inseriti come «ND1»			
		Input 1 = 0 %	0 % < Input 1 ≤ 10 %	10% < Input 1 ≤ 30 %	Input 1 > 30 %
Input 2: percentuale dei campi inseriti come «ND2», «ND3» o «ND4-AAAA-MM-GG»	Input 2 = 0 %	A1	B1	C1	D1
	0 % < Input 2 ≤ 20 %	A2	B2	C2	D2
	20 % < Input 2 ≤ 40 %	A3	B3	C3	D3
	Input 2 > 40 %	A4	B4	C4	D4

Tabella 2

**Categorie di motivazione del rigetto**

<b>Categoria</b>	<b>Motivo</b>
Schema	La comunicazione di informazioni è stata rigettata per non conformità dello schema.
Autorizzazione	La comunicazione di informazioni è stata rigettata perché il soggetto segnalante non ha ricevuto l'autorizzazione a effettuare la segnalazione per conto del cedente, del promotore o della SSPE.
Logica	La comunicazione di informazioni è stata rigettata perché il codice dell'elemento non corrisponde ai valori a disposizione nell'allegato 1, tabella 3, del regolamento delegato (UE) 2020/1224.
Attività	La comunicazione di informazioni è stata rigettata perché la comunicazione di dati non è conforme a una o più norme di convalida.
Rappresentatività	La comunicazione di informazioni è stata rigettata ai sensi dell'articolo 4, paragrafo 6.