

II

(Atti non legislativi)

REGOLAMENTI

REGOLAMENTO DI ESECUZIONE (UE) 2016/378 DELLA COMMISSIONE

dell'11 marzo 2016

che stabilisce norme tecniche di attuazione per quanto riguarda i tempi, il formato e il modello delle notifiche trasmesse alle autorità competenti a norma del regolamento (UE) n. 596/2014 del Parlamento europeo e del Consiglio

(Testo rilevante ai fini del SEE)

LA COMMISSIONE EUROPEA,

visto il trattato sul funzionamento dell'Unione europea,

visto il regolamento (UE) n. 596/2014 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 16 aprile 2014, relativo agli abusi di mercato (regolamento sugli abusi di mercato) e che abroga la direttiva 2003/6/CE del Parlamento europeo e del Consiglio e le direttive 2003/124/CE, 2003/125/CE e 2004/72/CE della Commissione ⁽¹⁾, in particolare l'articolo 4, paragrafo 5, terzo comma,

considerando quanto segue:

- (1) Per assicurare la coerenza degli obblighi di segnalazione alleviando l'onere amministrativo a carico dei soggetti tenuti a rispettarli è necessario allineare gli obblighi di segnalazione previsti dal presente regolamento e dal regolamento delegato che la Commissione deve adottare a norma dell'articolo 27, paragrafo 3, terzo comma, del regolamento (UE) n. 600/2014 del Parlamento europeo e del Consiglio ⁽²⁾.
- (2) Per poter garantire la qualità dei dati e l'effettivo monitoraggio del mercato nell'interesse della sua integrità, le autorità competenti e l'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (ESMA) dovrebbero poter ricevere prontamente notifiche complete per ciascun giorno di negoziazione.
- (3) Ai fini di un uso efficace ed efficiente dei dati da parte delle autorità competenti, è opportuno assicurare la coerenza dei modelli e dei formati usati per notificare gli strumenti finanziari. Le finalità ricercate risultano favorite dalla conformità alle norme internazionali relative alle informazioni da inserire nelle notifiche.
- (4) Il presente regolamento si basa sui progetti di norme tecniche di attuazione che l'ESMA ha presentato alla Commissione.
- (5) L'ESMA ha condotto una consultazione pubblica aperta sui progetti di norme tecniche di attuazione sui quali 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 ⁽³⁾.
- (6) Ai fini del corretto funzionamento dei mercati finanziari è necessario che il presente regolamento entri in vigore con urgenza e che le sue disposizioni si applichino a partire dalla stessa data di quelle del regolamento (UE) n. 596/2014,

⁽¹⁾ GUL 173 del 12.6.2014, pag. 1.

⁽²⁾ Regolamento (UE) n. 600/2014 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 15 maggio 2014, sui mercati degli strumenti finanziari e che modifica il regolamento (UE) n. 648/2012 (GUL 173 del 12.6.2014, pag. 84).

⁽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

1. Entro le ore 21.00 CET di ogni giorno in cui le negoziazioni sono aperte, la sede di negoziazione notifica con procedura automatizzata all'autorità competente, a norma dell'articolo 4, paragrafo 1, del regolamento (UE) n. 596/2014, ogni strumento finanziario che, entro le ore 18.00 CET del medesimo giorno, vi è stato per la prima volta oggetto di richiesta di ammissione alla negoziazione o ammesso alla negoziazione o negoziato, anche tramite inoltro di ordini o quotazioni nel sistema della sede di negoziazione, oppure che ha cessato di esservi negoziato o ammesso alla negoziazione.
2. Lo strumento finanziario che, dopo le ore 18.00 CET, è stato per la prima volta oggetto di richiesta di ammissione alla negoziazione o ammesso alla negoziazione o negoziato nella sede di negoziazione, anche tramite inoltro di ordini o quotazioni nel suo sistema, oppure che ha cessato di esservi negoziato o ammesso alla negoziazione è notificato con procedura automatizzata all'autorità competente dalla sede di negoziazione entro le ore 21.00 CET del giorno successivo in cui le negoziazioni sono aperte.
3. A norma dell'articolo 4, paragrafo 2, del regolamento (UE) n. 596/2014, l'autorità competente trasmette con procedura automatizzata all'ESMA le notifiche previste ai paragrafi 1 e 2 ogni giorno entro le ore 23.59 CET usando canali di comunicazione elettronica protetti.

Articolo 2

Tutti i dati da includere nelle notifiche a norma dell'articolo 4, paragrafi 1 e 2, del regolamento (UE) n. 596/2014 sono presentati secondo i criteri e i formati indicati nell'allegato del presente regolamento, in forma elettronica e in formato leggibile informaticamente e in un modello XML uniforme secondo la metodologia ISO 20022.

Articolo 3

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

Esso si applica a decorrere dal 3 luglio 2016.

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

Fatto a Bruxelles, l'11 marzo 2016

Per la Commissione
Il presidente
Jean-Claude JUNCKER

ALLEGATO

Criteria e formati per la trasmissione delle notifiche alle autorità competenti a norma del regolamento (UE) n. 596/2014

Tabella 1

Legenda della tabella 3

SIMBOLO	TIPO DI DATI	DEFINIZIONE
{ALPHANUM-n}	Fino a n caratteri alfanumerici	Testo libero.
{CFI_CODE}	6 caratteri	Codice CFI di ISO 10962.
{COUNTRYCODE_2}	2 caratteri alfanumerici	Codice del paese a 2 lettere secondo i codici paese alpha-2 di ISO 3166-1.
{CURRENCYCODE_3}	3 caratteri alfanumerici	Codice della valuta a 3 lettere secondo i codici valuta di ISO 4217.
{DATE_TIME_FORMAT}	Formato della data e dell'ora secondo ISO 8601	<ul style="list-style-type: none"> — Data e ora nel formato seguente: — AAAA-MM-GGThh:mm:ss. ddddddZ. — «AAAA» indica l'anno; — «MM» indica il mese; — «GG» indica il giorno; — «T» indica che va inserita la lettera «T»; — «hh» indica l'ora — «mm» indica il minuto; — «ss.ddd» indica il secondo e la relativa frazione; — «Z» indica l'ora UTC. <p>Le date e ore sono indicate al tempo universale coordinato (UTC).</p>
{DATEFORMAT}	Formato della data secondo ISO 8601	<p>Le date sono indicate con il formato seguente:</p> <p>AAAA-MM-GG.</p>
{DECIMAL-n/m}	Numero decimale fino a n cifre in totale, di cui fino a m possono essere decimali	<p>Campo numerico per valori sia positivi sia negativi.</p> <ul style="list-style-type: none"> — il simbolo del decimale è «.» (punto); — i numeri negativi sono preceduti dal segno «-» (meno); <p>i valori sono arrotondati e non troncati.</p>

SIMBOLO	TIPO DI DATI	DEFINIZIONE
{INDEX}	4 caratteri alfabetici	<p>«EONA» — EONIA</p> <p>«EONS» — <i>swap</i> sull'EONIA</p> <p>«EURI» — EURIBOR</p> <p>«EUUS» — EURODOLLAR</p> <p>«EUCH» — EuroSwiss</p> <p>«GCFR» — GCF REPO</p> <p>«ISDA» — ISDAFIX</p> <p>«LIBI» — LIBID</p> <p>«LIBO» — LIBOR</p> <p>«MAAA» — Muni AAA</p> <p>«PFAN» — Pfandbriefe</p> <p>«TIBO» — TIBOR</p> <p>«STBO» — STIBOR</p> <p>«BBSW» — BBSW</p> <p>«JIBA» — JIBAR</p> <p>«BUBO» — BUBOR</p> <p>«CDOR» — CDOR</p> <p>«CIBO» — CIBOR</p> <p>«MOSP» — MOSPRIM</p> <p>«NIBO» — NIBOR</p> <p>«PRBO» — PRIBOR</p> <p>«TLBO» — TELBOR</p> <p>«WIBO» — WIBOR</p> <p>«TREA» — Tesoro</p> <p>«SWAP» — <i>swap</i></p> <p>«FUSW» — <i>swap</i> su future</p>
{INTEGER-n}	Numero intero fino a n cifre in totale	Campo numerico per valori interi sia positivi sia negativi.
{ISIN}	12 caratteri alfanumerici	Codice ISIN secondo ISO 6166.
{LEI}	20 caratteri alfanumerici	Identificativo della persona giuridica secondo ISO 17442.
{MIC}	4 caratteri alfanumerici	Identificativo del mercato secondo ISO 10383.
{FISN}	35 caratteri alfanumerici	Codice FISN secondo ISO 18774.

Tabella 2

Classificazioni dei derivati su merci e su quote di emissione ai fini della tabella 3 (campi 35-37)

Categoria di prodotti	Sottocategoria di prodotti	Ulteriore sottocategoria di prodotti
«AGRI» — Agricoli	«GROS» — Cereali e semi oleosi	«FWHT» — Frumento da foraggio «SOYB» — Soia «CORN» — Granturco «RPSD» — Colza «RICE» — Riso «OTHR» — Altro
	«SOFT» — <i>Softs</i>	«CCOA» — Cacao «ROBU» — Caffè Robusta «WHSG» — Zucchero bianco «BRWN» — Zucchero grezzo «OTHR» — Altro
	«POTA» — Patate	
	«OOLI» — Olio d'oliva	«LAMP» — Lampante
	«DIRY» — Prodotti lattiero-caseari	
	«FRST» — Silvicultura	
	«SEAF» — Prodotti ittici	
	«LSTK» — Bestiame	
«NRGY» — Energia	«GRIN» — Cereali	«MWHT» — Frumento da panificazione
	«ELEC» — Energia elettrica	«BSLD» — Carico di base «FITR» — Diritti di trasmissione finanziari «PKLD» — Carico di punta «OFFP» — Orario normale «OTHR» — Altro
	«NGAS» — Gas naturale	«GASP» — GASPOOL «LNGG» — LNG «NBPG» — NBP «NCGG» — NCG «TTFG» — TTF

Categoria di prodotti	Sottocategoria di prodotti	Ulteriore sottocategoria di prodotti
	«OILP» — Petrolio	«BAKK» — Bakken «BDSL» — Biodiesel «BRNT» — Brent «BRNX» — Brent NX «CND» — Canadese «COND» — Condensato «DSEL» — Diesel «DUBA» — Dubai «ESPO» — ESPO «ETHA» — Etanolo «FUEL» — Combustibile «FOIL» — Olio combustibile «GOIL» — Gasolio «GSLN» — Benzina «HEAT» — Gasolio da riscaldamento «JTFL» — JET Fuel «KERO» — Kerosene «LLSO» — Light Louisiana Sweet (LLS) «MARS» — Mars «NAPH» — Nafta «NGLO» — NGL «TAPI» — Tapis «URAL» — Urali «WTIO» — WTI
	«COAL» — Carbone «INRG» — Inter Energy «RNG» — Energie rinnovabili «LGHT» — Benzina leggera di prima distillazione «DIST» — Distillati	
«ENVR» — Ambientali	«EMIS» — Emissioni	«CERE» — CER «ERUE» — ERU «EUA» — EUA «EUAA» — EUAA «OTHR» — Altro
	«WTHR» — Meteo «CRBR» — Associati al carbonio	

Categoria di prodotti	Sottocategoria di prodotti	Ulteriore sottocategoria di prodotti
«FRGT» — Carico	«WETF» — <i>Wet</i>	«TNKR» — Petroliere
	«DRYF» — <i>Dry</i>	«DBCR» — Portarinfuse
	«CSHP» — Portacontainer	
«FRTL» — Concimi	«AMMO» — Ammoniaca «DAPH» — Fosfato di diammonio (DAP) «PTSH» — Potassa «SLPH» — Zolfo «UREA» — Urea «UAAN» — Nitrato di ammonio e urea (UAN)	
«INDP» — Prodotti industriali	«CSTR» — Edilizia «MFTG» — Manifatturieri	
«METL» — Metalli	«NPRM» — Non preziosi	«ALUM» — Alluminio «ALUA» — Leghe di alluminio «CBLT» — Cobalto «COPR» — Rame «IRON» — Minerale di ferro «LEAD» — Piombo «MOLY» — Molibdeno «NASC» — NASAAC «NICK» — Nichel «STEL» — Acciaio «TINN» — Stagno «ZINC» — Zinco «OTHR» — Altro
	«PRME» — Preziosi	«GOLD» — Oro «SLVR» — Argento «PTNM» — Platino «PLDM» — Palladio «OTHR» — Altro
«MCEX» — Esotici multimerchi		
«PAPR» — Carta	«CBRD» — Cartone ondulato grezzo «NSPT» — Carta da giornale «PULP» — Polpa «RCVP» — Carta di recupero	

Categoria di prodotti	Sottocategoria di prodotti	Ulteriore sottocategoria di prodotti
«POLY» — Polipropilene	«PLST» — Plastica	
«INFL» — Inflazione		
«OEST» — Statistiche economiche ufficiali		
«OTHC» — Altri C10 secondo la definizione dell'allegato III, tabella 10.1, sezione 10, del regolamento delegato della Commissione che integra il regolamento (UE) n. 600/2014 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione sugli obblighi di trasparenza per le sedi di negoziazione e le imprese di investimento relativamente a obbligazioni, strumenti finanziari strutturati, quote di emissione e derivati	«DLVR» — Con obbligo di consegna «NDLV» — Senza obbligo di consegna	
«OTHR» — Altro		

Tabella 3

Criteria e formati per le notifiche da trasmettere a norma dell'articolo 4, paragrafi 1 e 2, del regolamento (UE) n. 596/2014

N.	CAMPO	CRITERI E FORMATI PER LE SEGNALAZIONI
Campi generali		
1	Codice identificativo dello strumento	{ISIN}
2	Nome completo dello strumento	{ALPHANUM-350}
3	Classificazione dello strumento	{CFI_CODE}
4	Indicatore di derivato su merci	«true» — sì «false» — no
Campi relativi all'emittente		
5	Identificativo dell'emittente o del gestore della sede di negoziazione	{LEI}
Campi relativi alla sede		
6	Sede di negoziazione	{MIC}
7	Nome breve dello strumento finanziario	{FISN}
8	Richiesta dell'emittente di ammissione alla negoziazione	«true» — sì «false» — no

N.	CAMPO	CRITERI E FORMATI PER LE SEGNALAZIONI
9	Data di approvazione dell'ammissione alla negoziazione	{DATE_TIME_FORMAT}
10	Data della richiesta di ammissione alla negoziazione	{DATE_TIME_FORMAT}
11	Data di ammissione alla negoziazione o data di prima negoziazione	{DATE_TIME_FORMAT}
12	Data di cessazione	{DATE_TIME_FORMAT}

Campi relativi al nozionale

13	Valuta nozionale 1	{CURRENCYCODE_3}
----	--------------------	------------------

Campi relativi a obbligazioni o altre forme di titoli di debito

14	Importo nominale totale emesso	{DECIMAL-18/5}
15	Data di scadenza	{DATEFORMAT}
16	Valuta del valore nominale	{CURRENCYCODE_3}
17	Valore nominale per unità/valore minimo di negoziazione	{DECIMAL-18/5}
18	Tasso fisso	{DECIMAL-11/10} espresso in percentuale (ad esempio, 7.0 indica 7 % e 0.3 indica 0,3 %)
19	Identificativo dell'indice/parametro dell'obbligazione a tasso variabile	{ISIN}
20	Nome dell'indice/parametro dell'obbligazione a tasso variabile	{INDEX} oppure {ALPHANUM-25} — se il nome dell'indice non è compreso nell'elenco {INDEX}
21	Termine dell'indice/parametro dell'obbligazione a tasso variabile	{INTEGER-3}+«DAYS» — giorni {INTEGER-3}+«WEEK» — settimane {INTEGER-3}+«MNTH» — mesi {INTEGER-3}+«YEAR» — anni
22	Differenziale in punti base dell'indice/parametro dell'obbligazione a tasso variabile	{INTEGER-5}
23	Rango (<i>seniority</i>) dell'obbligazione	«SNDB» — debito senior «MZZD» — mezzanino «SBOD» — debito subordinato «JUND» — debito junior

N.	CAMPO	CRITERI E FORMATI PER LE SEGNALAZIONI
Campi relativi a derivati e derivati cartolarizzati		
24	Data di scadenza	{DATEFORMAT}
25	Moltiplicatore del prezzo	{DECIMAL-18/17}
26	Codice dello strumento sottostante	{ISIN}
27	Emittente sottostante	{LEI}
28	Nome dell'indice sottostante	{INDEX} oppure {ALPHANUM-25} — se il nome dell'indice non è compreso nell'elenco {INDEX}
29	Termine dell'indice sottostante	{INTEGER-3}+«DAYS» — giorni {INTEGER-3}+«WEEK» — settimane {INTEGER-3}+«MNTH» — mesi {INTEGER-3}+«YEAR» — anni
30	Tipo di opzione	«PUTO» — <i>put</i> «CALL» — <i>call</i> «OTHR» — se non è possibile stabilire se si tratta di <i>call</i> o di <i>put</i>
31	Prezzo di esercizio	{DECIMAL-18/13} se il prezzo è espresso in valore monetario {DECIMAL-11/10} se il prezzo è espresso in percentuale o rendimento {DECIMAL-18/17} se il prezzo è espresso in punti base «PNDG» se il prezzo non è disponibile
32	Valuta del prezzo di esercizio	{CURRENCYCODE_3}
33	Stile di esercizio dell'opzione	«EURO» — europeo «AMER» — americano «ASIA» — asiatico «BERM» — bermudiano «OTHR» — altro
34	Tipo di consegna	«PHYS» — regolato fisicamente «CASH» — regolato in contanti «OPTN» — facoltativo per la controparte o quando stabilito da terzi

N.	CAMPO	CRITERI E FORMATI PER LE SEGNALAZIONI
Derivati su merci e su quote di emissione		
35	Categoria di prodotti	Sono ammessi solo i valori della colonna «Categoria di prodotti» secondo la tabella della classificazione dei derivati su merci e su quote di emissione.
36	Sottocategoria di prodotti	Sono ammessi solo i valori della colonna «Sottocategoria di prodotti» secondo la tabella della classificazione dei derivati su merci e su quote di emissione.
37	Ulteriore sottocategoria di prodotti	Sono ammessi solo i valori della colonna «Ulteriore sottocategoria di prodotti» secondo la tabella della classificazione dei derivati su merci e su quote di emissione.
38	Tipo di operazione	«FUTR» — <i>future</i> «OPTN» — <i>opzioni</i> «TAPO» — <i>TAPO</i> «SWAP» — <i>swap</i> «MINI» — <i>mini</i> «OTCT» — <i>OTC</i> «ORIT» — <i>vendita a fermo</i> «CRCK» — <i>crack</i> «DIFF» — <i>differenziale</i> «OTHR» — <i>Altro</i>
39	Tipo di prezzo finale	«ARGM» — <i>Argus/McCloskey</i> «BLTC» — <i>Baltic</i> «EXOF» — <i>Exchange</i> «GBCL» — <i>GlobalCOAL</i> «IHSM» — <i>IHS McCloskey</i> «PLAT» — <i>Platts</i> «OTHR» — <i>Altro</i>

Derivati su tassi di interesse

— Compilare solo per gli strumenti il cui sottostante è uno strumento non finanziario su tassi di interesse.

40	Tasso di riferimento	{INDEX} oppure {ALPHANUM-25} — se il tasso di riferimento non è compreso nell'elenco {INDEX}
----	----------------------	---

N.	CAMPO	CRITERI E FORMATI PER LE SEGNALAZIONI
41	Termine del contratto su tassi di interesse	{INTEGER-3}+«DAYS» — giorni {INTEGER-3}+«WEEK» — settimane {INTEGER-3}+«MNTH» — mesi {INTEGER-3}+«YEAR» — anni
42	Valuta nozionale 2	{CURRENCYCODE_3}
43	Tasso fisso della gamba 1	{DECIMAL -11/10} espresso in percentuale (ad esempio, 7.0 indica 7 % e 0.3 indica 0,3 %)
44	Tasso fisso della gamba 2	{DECIMAL -11/10} espresso in percentuale (ad esempio, 7.0 indica 7 % e 0.3 indica 0,3 %)
45	Tasso variabile della gamba 2	{INDEX} oppure {ALPHANUM-25} — se il tasso di riferimento non è compreso nell'elenco {INDEX}
46	Termine del contratto su tassi di interesse della gamba 2	{INTEGER-3}+«DAYS» — giorni {INTEGER-3}+«WEEK» — settimane {INTEGER-3}+«MNTH» — mesi {INTEGER-3}+«YEAR» — anni

Derivati su cambi

— Compilare solo per gli strumenti il cui sottostante è uno strumento non finanziario del tipo cambi.

47	Valuta nozionale 2	{CURRENCYCODE_3}
48	Tipo FX	«FXCR» — FX valute incrociate «FXEM» — FX mercati emergenti «FXMJ» — FX Majors