



European Securities and
Markets Authority

Orientamenti

sulle informazioni periodiche e sulle notifiche di modifiche importanti da presentare all'ESMA da parte dei repertori di dati sulle negoziazioni



Indice

1. Riferimenti normativi, abbreviazioni e definizioni	5
2. Sintesi	9
3. Ambito di applicazione	11
4. Scopo	11
5. Specifiche di segnalazione.....	13
5.1. Aspetti generali	13
5.2. Canali di segnalazione.....	14
5.3. Convenzione per i nomi dei file.....	14
5.4. Convalida dei modelli.....	14
5.5. Calendari e termini per le segnalazioni.....	14
6. Segnalazione delle informazioni periodiche.....	20
6.1. Modulo: Segnalazioni relative alla <i>governance</i> e all'attività.....	20
6.2. Modulo: Informativa finanziaria	23
6.3. Modulo: Segnalazione dei controlli interni	23
6.4. Modulo: Segnalazioni sulla sicurezza informatica e la sicurezza delle informazioni.....	25
6.5. Modulo: Comunicazione dei dati.....	26
6.6. Modulo: Segnalazioni per il calcolo dei contributi per le attività di vigilanza	27
7. Segnalazione delle informazioni ad hoc.....	28
7.1. Notifiche di modifiche importanti delle condizioni iniziali richieste per la registrazione e delle pertinenti informazioni di vigilanza	28
7.2. Altre notifiche	31
7.3. Piano di liquidazione – Documenti essenziali da presentare all'ESMA	31

1. Riferimenti normativi, abbreviazioni e definizioni

Riferimenti normativi

<i>EMIR</i>	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 (Testo rilevante ai fini del SEE)
<i>NTR in materia di accesso ai dati (EMIR)</i>	Regolamento delegato (UE) n. 151/2013 della Commissione, del 19 dicembre 2012, che integra il regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio sugli strumenti derivati OTC, le controparti centrali e i repertori di dati sulle negoziazioni per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione che specificano le informazioni da pubblicare e mettere a disposizione in tali repertori e gli standard operativi richiesti per aggregare e comparare i dati tra i repertori e accedervi
<i>NTR in materia di accesso ai dati (SFTR)</i>	Regolamento delegato (UE) 2019/357 della Commissione, del 13 dicembre 2018, che integra il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione sull'accesso alle informazioni sulle operazioni di finanziamento tramite titoli registrate nei repertori di dati sulle negoziazioni
<i>NTR in materia di registrazione (EMIR)</i>	Regolamento delegato (UE) n. 150/2013 della Commissione, del 19 dicembre 2012, che integra il regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio sugli strumenti derivati OTC, le controparti centrali e i repertori di dati sulle negoziazioni per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione che specificano i dettagli della domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni
<i>NTR in materia di registrazione (SFTR)</i>	Regolamento delegato (UE) 2019/359 della Commissione, del 13 dicembre 2018, che integra il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione che specificano i dettagli della domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni e della domanda di estensione della registrazione

NTR modificate in materia di registrazione (EMIR)

Regolamento delegato (UE) 2019/362 della Commissione, del 13 dicembre 2018, che modifica il regolamento delegato (UE) n. 150/2013 della Commissione per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione che specificano i dettagli della domanda di registrazione come repertorio di dati sulle negoziazioni

RDC in materia di commissioni (EMIR)

Regolamento delegato (UE) n. 1003/2013 della Commissione, del 12 luglio 2013, che integra il regolamento (UE) n. 648/2012 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le commissioni imposte ai repertori di dati sulle negoziazioni dall'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati

RDC in materia di commissioni (SFTR)

Regolamento delegato (UE) 2019/360 della Commissione, del 13 dicembre 2018, che integra il regolamento (UE) 2015/2365 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le commissioni imposte ai repertori di dati sulle negoziazioni dall'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati

Regolamento ESMA

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 ⁽¹⁾

SFTR

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

Abbreviazioni

<i>ANC</i>	Autorità nazionale competente
<i>BCP</i>	Piano di continuità operativa
<i>CCP</i>	Stanza di compensazione funzionante come controparte centrale
<i>CEO</i>	Amministratore delegato

⁽¹⁾ GU L 331 del 15.12.2010, pag. 84.

<i>CISO</i>	Responsabile della sicurezza informatica a livello centrale
<i>CM</i>	Controllo della conformità
<i>COO</i>	Direttore operativo
<i>CRA</i>	Agenzia di rating del credito
<i>CRO</i>	Direttore rischi
<i>CTO</i>	Responsabile per le tecnologie
<i>DC</i>	Documento di consultazione
<i>ESMA</i>	Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati
<i>ETP</i>	Equivalente a tempo pieno
<i>IA</i>	Audit interno
<i>IS</i>	Sicurezza delle informazioni
<i>IT</i>	Tecnologie dell'informazione
<i>Ldl</i>	Libro di lavoro
<i>CCO</i>	Responsabile del controllo della conformità
<i>NTR</i>	Norme tecniche di regolamentazione
<i>SFTP</i>	Protocollo «SSH File Transfer» (protocollo di trasferimento file)
<i>SLA</i>	Accordo sul livello dei servizi (SLA)
<i>TR</i>	Repertorio di dati sulle negoziazioni (<i>Trade Repository</i>)
<i>TRACE</i>	Sistema per l'accesso singolo ai dati del repertorio sulle negoziazioni
<i>UE</i>	Unione europea

Concetti

*Formato leggibile
meccanicamente*

- a) Un formato elettronico atto a essere letto direttamente e automaticamente da un computer. Il formato elettronico dovrebbe essere specificato in base a standard gratuiti, non proprietari e aperti e indicare il tipo di file o messaggi, le regole per identificarli, nonché il nome e il tipo di dati dei campi che contengono;
- b) viene conservato in un'architettura informatica che consente l'accesso automatico;
- c) viene gestito da un sistema sufficientemente solido da assicurare la continuità e la regolarità dei servizi prestati e tale da permettere una velocità di accesso adeguata;
- d) è accessibile, leggibile, utilizzabile e copiabile da un software informatico disponibile gratuitamente e pubblicamente.

Informazioni ad hoc

Dati di vigilanza forniti dai TR all'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati a seguito di una modifica importante dei dati già forniti alla medesima.

Informazioni periodiche

Dati di vigilanza forniti dai repertori di dati sulle negoziazioni all'ESMA alla cadenza prestabilita.

*Partecipante al repertorio
di dati sulle negoziazioni*

Un soggetto che ha stipulato un accordo contrattuale con almeno un TR registrato o riconosciuto ai fini della segnalazione di contratti derivati a norma dell'articolo 9 EMIR ovvero di operazioni di finanziamento tramite titoli (SFT) a norma dell'articolo 4 dell'SFTR. Il partecipante al TR può essere un soggetto che trasmette la segnalazione, un soggetto responsabile della segnalazione, una controparte segnalante o un CCP, o un soggetto con accesso di sola visualizzazione del repertorio di dati sulle negoziazioni.

Quanto prima

I dati di vigilanza dovranno essere forniti dai repertori di dati sulle negoziazioni senza indebiti ritardi

Soggetto associato

Un soggetto che controlla direttamente o indirettamente il TR, o che è direttamente o indirettamente controllato dal TR, ovvero che è soggetto a un controllo comune insieme al TR.

2. Sintesi

Motivazioni della pubblicazione

I presenti orientamenti definiscono le informazioni che i repertori di dati sulle negoziazioni (TR) hanno l'obbligo di presentare all'ESMA per agevolare a quest'ultima l'esercizio di una supervisione continua e uniforme sui TR medesimi. Pertanto, questi orientamenti si prefiggono principalmente di ottimizzare gli aspetti ricorrenti di questo processo di raccolta delle informazioni, garantendone un completo allineamento ai processi di supervisione e valutazione del rischio da parte dell'ESMA.

Gli orientamenti chiariscono le aspettative dell'ESMA circa il formato e la cadenza previsti per le diverse categorie di informazioni che devono esserle presentate in quanto autorità di vigilanza preposta alla supervisione dei repertori di dati sulle negoziazioni ai sensi del regolamento EMIR e /o SFTR, nonché i rispettivi obblighi in capo ai TR ai sensi dell'articolo 55, paragrafo 4, dell'EMIR e dell'articolo 5, paragrafo 4, del SFTR.

Le aspettative dell'ESMA con riguardo ai vantaggi ottenibili dall'applicazione dei presenti orientamenti sono le seguenti:

- a. contenere gli sforzi relativi alle richieste ad hoc di informazioni e assicurare che nessuna informazione venga omessa;
- b. ridurre i tempi di elaborazione delle informazioni ricevute;
- c. assicurare condizioni di parità tra tutti i TR in termini di informazioni da fornire mediante la definizione di modelli armonizzati di segnalazione;
- d. accrescere la prevedibilità delle informazioni richieste e l'ottimizzazione dei processi a livello di TR;
- e. accrescere la trasparenza sui TR sottoposti a supervisione;
- f. assicurare la disponibilità di informazioni complete, necessarie all'ESMA per esercitare una supervisione basata sui rischi;
- g. migliorare la pianificazione interna dei team dell'ESMA incaricate della supervisione, con riguardo all'esame delle informazioni, agevolandone l'elaborazione;
- h. standardizzare le prassi già adottate per i TR sulla base della massima diligenza possibile;
- i. ottenere economie di scala grazie alla coerenza con le specifiche applicabili alle CRA sottoposte alla supervisione dell'ESMA (cfr. la Relazione finale degli orientamenti sulle informazioni periodiche da presentare all'ESMA da parte delle agenzie di rating del credito – 2^a edizione ⁽²⁾, ESMA33-9-295);
- j. garantire la precisione delle informazioni utilizzate per il calcolo dei contributi per le attività di vigilanza.

⁽²⁾ Relazione finale sugli orientamenti https://www.ESMA.europa.eu/sites/default/files/library/ESMA_33-9-295_final_report_guidelines_on_the_submission_of_periodic_information_to_ESMA_by_credit_rating_agencies.pdf

Contenuti

La sezione 3 del documento delinea l'ambito di applicazione degli orientamenti, la sezione 4 illustra le finalità perseguite dagli orientamenti in materia di segnalazione delle informazioni periodiche e delle modifiche importanti. La sezione 5 dettaglia le specifiche di segnalazione concernenti gli elementi di segnalazione, i canali di segnalazione, i modelli, le convenzioni per i nomi dei file, le convalide dei modelli, i calendari di segnalazione e le relative tempistiche. La sezione 6 offre una spiegazione dettagliata di ciascun elemento richiesto per la segnalazione delle informazioni periodiche. La sezione 7 offre una spiegazione dettagliata di ciascun elemento richiesto per la segnalazione delle informazioni ad hoc, nonché il modello da usare per la notifica di un piano di liquidazione in caso di revoca della registrazione.

Fasi successive

Gli orientamenti vengono pubblicati sul sito web dell'ESMA. Si applicano a partire dal 30 giugno 2021.

3. Ambito di applicazione

Destinatari

1. I presenti orientamenti si applicano ai repertori di dati sulle negoziazioni (TR) come definiti all'articolo 2, paragrafo 2, dell'EMIR e all'articolo 3, paragrafo 1, del SFTR e registrati ai sensi dei Titoli VI e VII dell'EMIR e del capo III del SFTR.

Oggetto

2. I presenti orientamenti si applicano in relazione all'articolo 55, paragrafo 4, dell'EMIR e all'articolo 5, paragrafo 4, del SFTR. Non si applicano ai TR di paesi terzi riconosciuti ai sensi dell'EMIR o del SFTR. Gli orientamenti contengono tutti i relativi modelli e calendari di segnalazione. Per renderli più visibili e migliorarne l'integrazione con i processi interni dei TR, il calendario di segnalazione e le versioni Excel dei modelli vengono pubblicati dall'ESMA anche come elementi a sé stanti, scaricabili dal suo sito web.

Tempistica

3. I presenti orientamenti si applicano a partire dal 30 giugno 2021. Tutti gli elementi relativi alle informazioni periodiche aventi cadenza annuale e con un termine di segnalazione entro il 31 gennaio dovranno essere forniti, per il primo anno, entro il 30 giugno 2021.

4. Scopo

4. L'ESMA è incaricata di registrare e vigilare sui TR ai sensi dei titoli VI e VII dell'EMIR e del capo III del SFTR.
5. Le NTR in materia di registrazione (EMIR), le NTR modificate in materia di registrazione (EMIR) e le NTR in materia di registrazione (SFTR) specificano le informazioni che i repertori di dati sulle negoziazioni devono fornire affinché l'ESMA possa valutarne la conformità con le condizioni di registrazione previste dall'EMIR e dal SFTR.
6. A tale scopo, l'articolo 55, paragrafo 4, EMIR e l'articolo 5, paragrafo 4, del SFTR impongono ai TR registrati di soddisfare «in ogni momento le condizioni richieste per la registrazione» e di informare «immediatamente l'ESMA di ogni modifica importante delle condizioni di registrazione».
7. Lo scopo dei presenti orientamenti consiste, pertanto, nel chiarire il formato e la cadenza previsti per le diverse categorie di informazioni che l'ESMA si aspetta di ricevere in quanto autorità di vigilanza preposta alla supervisione dei TR registrati conformemente all'EMIR e/o al SFTR, nonché di chiarire i rispettivi obblighi ai sensi dell'articolo 55, paragrafo 4, dell'EMIR e dell'articolo 5, paragrafo 4, del SFTR.
8. Gli orientamenti si propongono, dunque, di garantire una vigilanza sui TR da parte dell'ESMA, che sia coerente, continua, efficiente e basata sul rischio. Nello specifico, gli orientamenti proposti hanno lo scopo di migliorare l'uniformità e la fruibilità delle informazioni fornite dai TR. A tale proposito vengono fornite specifiche istruzioni per ciascun aspetto della segnalazione e i modelli standardizzati di segnalazione, ove possibile. Gli orientamenti proposti chiariscono anche determinate informazioni allo scopo

di migliorare ulteriormente le procedure di vigilanza dell'ESMA in modo efficiente ed efficace.

9. Per garantire l'efficienza della traduzione degli eventuali documenti trasmessi dai TR in una lingua diversa dall'inglese, gli orientamenti precisano che qualsiasi documento fornito in una lingua diversa dall'inglese dovrà essere sempre presentato in un formato leggibile meccanicamente, mentre i documenti redatti in inglese andranno presentati in un formato leggibile meccanicamente ove possibile.
10. Ai fini della valutazione del rischio concernente i TR, l'ESMA adotta modalità dinamiche, che tengono conto dei rischi a livello di soggetto e dei rischi a livello di settore. L'ESMA basa le proprie valutazioni sulle informazioni a sua disposizione. Queste informazioni possono provenire da un'ampia varietà di fonti, vale a dire informazioni (periodiche) segnalate dalle entità sottoposte a vigilanza, informazioni comunicate all'ESMA dalle autorità nazionali competenti, attività di vigilanza o richieste di informazioni (disciplinate dagli articoli 61 e 62 dell'EMIR ed ugualmente applicabili ai TR registrati ai sensi del SFTR in virtù dell'articolo 9 del SFTR), informazioni fornite dagli operatori del mercato e dalle autorità di regolamentazione di paesi terzi, nonché informazioni sull'andamento del mercato raccolte direttamente dall'ESMA.
11. Al momento, i TR forniscono all'ESMA alcune informazioni su base periodica e ad hoc, tra cui i verbali delle riunioni del consiglio di amministrazione, le relazioni di conformità o le statistiche pertinenti alla qualità dei dati. Tuttavia, l'assenza di un formato uniforme e di scadenze entro cui trasmettere le segnalazioni pregiudica la completezza e comparabilità delle informazioni a fini di vigilanza.
12. Inoltre, in base alle procedure di vigilanza continua in essere, l'ESMA ha maturato una sufficiente comprensione di quale sia la cadenza opportuna per ricevere le informazioni rilevanti dai TR e di come le informazioni attualmente fornite possano essere standardizzate attraverso l'introduzione di particolari modelli. Con ciò l'ESMA potrà impostare le proprie attività di vigilanza sui TR in modo più sistematico.
13. I presenti orientamenti prendono in considerazione e si basano sulle informazioni richieste ai sensi delle NTR in materia di registrazione. Inoltre, l'ESMA fa leva sull'esperienza maturata durante le proprie attività di supervisione dei TR ai sensi del regolamento EMIR e precisa anche il formato e la cadenza con cui i TR registrati ai sensi del regolamento SFTR devono fornire le informazioni periodiche e ad hoc.
14. Determinate informazioni, in particolare quelle societarie, quali i verbali delle riunioni del consiglio di amministrazione, sono le stesse per i TR registrati ai sensi dell'EMIR e del SFTR e, pertanto, non dovranno essere duplicate se il TR è registrato ai sensi di entrambi i regimi ed entrambi i regimi richiedono l'informazione. I presenti orientamenti indicano con chiarezza quando i modelli valgono anche per i TR registrati ai sensi del regolamento SFTR.
15. I presenti orientamenti definiscono le informazioni che i repertori di dati sulle negoziazioni hanno l'obbligo di presentare all'ESMA per agevolare quest'ultima nell'esercizio di una supervisione continua e uniforme sui TR medesimi. Pertanto, questi orientamenti si prefiggono principalmente di ottimizzare gli aspetti ricorrenti di questo processo di generazione e raccolta delle informazioni, garantendone un completo allineamento ai processi di supervisione e valutazione del rischio dell'ESMA.

16. Un obiettivo secondario degli orientamenti consiste nell'incrementare la trasparenza e nel definire un quadro armonizzato per le interazioni tra ESMA e TR relativamente all'esercizio delle sue attività di vigilanza. A tale riguardo si prevede che, aumentando la qualità e la fruibilità delle informazioni presentate periodicamente dai TR all'ESMA, gli orientamenti proposti ridurranno la necessità, per l'ESMA, di richiedere informazioni ai TR su base bilaterale per il tramite di richieste di informazioni.
17. Gli orientamenti proposti raggruppano le specifiche di segnalazione in due macro-categorie: «Periodiche» e «Ad hoc». All'interno di ciascuna macrocategoria, i singoli elementi di segnalazione vengono poi raggruppati in moduli differenti. Ciò assicura che specifiche simili siano trattate in parallelo, migliorando la trasparenza delle informazioni richieste dall'ESMA.
18. L'ESMA propone di incrementare l'utilizzo di modelli comuni di segnalazione per la raccolta in un formato standardizzato di specifiche informazioni quantitative e qualitative, tra cui l'elenco dei partecipanti al TR, i proventi e gli oneri, gli incidenti informatici, il numero degli ETP, le relazioni riguardanti le prestazioni relative all'elaborazione dei dati, la qualità dei dati ecc. Ciò consentirà al personale dell'ESMA e agli strumenti di vigilanza dalla stessa sviluppati di elaborare i dati forniti in modo efficiente.
19. Gli orientamenti prevedono, comunque, la possibilità che i modelli possano essere cambiati e modificati. Il file del modello è disponibile sul sito web dell'ESMA. Le eventuali modifiche del modello vengono subito comunicate ai TR, i quali dovranno presentare le informazioni all'ESMA utilizzando sempre la versione più recente del modello. Le informazioni presentate utilizzando le versioni anteriori saranno respinte.
20. Quanto sopra contribuirà, peraltro, a rendere più proporzionale la *compliance* con gli orientamenti.

5. Specifiche di segnalazione

5.1. Aspetti generali

Guideline 1. **Orientamento.** Per ogni elemento di segnalazione, i TR devono attenersi alle specifiche di segnalazione in termini di contenuto, formato, scadenze di presentazione ed eventuali modelli. Il TR dovrà seguire l'orientamento per ogni regolamento in base al quale è stata effettuata la sua registrazione.

Guideline 2. I documenti presentati dai TR in lingua inglese devono essere forniti, ove possibile, in formato leggibile meccanicamente. I documenti presentati dai TR in lingua diversa dall'inglese devono essere trasmessi in formato leggibile meccanicamente, tale da poter essere tradotto in maniera automatica dagli strumenti di vigilanza dell'ESMA. Per agevolare il processo traduttivo, i TR devono presentare tali documenti in formato PDF o, altrimenti, in un formato di tipo aperto e leggibile da un dispositivo automatico.

5.2. **Canali di segnalazione**

Guideline 3. Per la trasmissione all'ESMA delle informazioni di cui ai presenti orientamenti, i TR devono fare uso dei canali di segnalazione comunicati in anticipo dall'ESMA.

5.3. **Convenzione per i nomi dei file**

Guideline 4. Le informazioni trasmesse dai TR per ciascun elemento di segnalazione devono rispettare la seguente convenzione sui nomi: TRAAA_REGU_TY_ST_PD_ITEMXX_YYYYMMDD.zip. Laddove si faccia uso di un modello di segnalazione, utilizzare il formato file CSV per i modelli relativi ai dati e il formato file XLS per gli altri modelli. Per i modelli da includere in uno stesso file di archiviazione, il TR dovrà seguire la stessa convenzione di cui sopra e utilizzare un file .csv per gli elementi dati e un file .xls per gli elementi non-dati. Gli altri file inclusi nei file di archiviazione che non corrispondono a modelli possono essere forniti con il loro nome/tipo di file originale.

5.4. **Convalida dei modelli**

Guideline 5. I TR devono compilare i modelli secondo le istruzioni dei modelli applicabili, evitando di alterare o modificare il formato del modello, compresa l'aggiunta o eliminazione di un qualsiasi campo. I TR devono sempre utilizzare l'ultima versione disponibile del modello, in quanto le versioni precedenti saranno respinte dall'ESMA e i TR dovranno ripresentare le informazioni pertinenti secondo l'ultima versione disponibile.

5.5. **Calendari e termini per le segnalazioni**

Orientamento 6. I TR hanno l'obbligo di presentare le informazioni periodiche alla cadenza e nei termini previsti da ogni regolamento in base al quale è stata effettuata la loro registrazione, come indicato nella tabella seguente

Guideline 6. Tabella 1: CALENDARIO DELLE SEGNALAZIONI PERIODICHE. Le informazioni da includere devono riferirsi al periodo di segnalazione di riferimento, determinato in funzione della cadenza di presentazione delle informazioni.

Guideline 7. I TR sono tenuti a comunicare «quanto prima» qualsiasi modifica importante delle condizioni iniziali richieste per la registrazione, nonché un certo numero di altri eventi specificati, che l'ESMA ritiene pertinenti per le proprie responsabilità in materia di vigilanza di cui alla Tabella 2: SEGNALAZIONI AD HOCE**Error! Reference source not found..**

Un TR registrato ai sensi di entrambi i regolamenti EMIR e SFTR, dovrà seguire le indicazioni fornite nella

Guideline 8. Tabella 1: CALENDARIO DELLE SEGNALAZIONI PERIODICHE e nella Tabella 2: SEGNALAZIONI AD HOC per determinare se presentare il relativo elemento di segnalazione distintamente o congiuntamente. Se viene indicato che l'elemento deve essere fornito distintamente per il regolamento EMIR e il regolamento SFTR, il TR dovrà indicare chiaramente nel modello ai sensi di quale dei due regolamenti sta segnalando le informazioni richieste. Se invece l'elemento può essere fornito congiuntamente per entrambi i regolamenti EMIR e SFTR, i dati da fornire ai sensi di ciascun regolamento saranno identici e il TR dovrà presentarli un'unica volta per entrambi i regolamenti.

TABELLA 1: CALENDARIO DELLE SEGNALAZIONI PERIODICHE

Segnalazioni periodiche da effettuare da parte dei TR					
Elemento	Elemento di segnalazione	Applicabile a	Cadenza di segnalazione	Scadenza di segnalazione	Modello disponibile
Governance e attività					
1	Documenti del consiglio di amministrazione	EMIR e SFTR congiuntamente	Semestrale	31 gennaio, 31 luglio	No
2	Programma, sedi e ordini del giorno delle riunioni del consiglio d'amministrazione	EMIR e SFTR congiuntamente	Annuale	31 gennaio	No
3	Assetto proprietario o attestazione	EMIR e SFTR congiuntamente	Annuale	31 gennaio	No
4	Organigramma	EMIR e SFTR congiuntamente	Annuale	31 gennaio	No
5	Personale e lavoratori dipendenti a tempo pieno (ETP)	EMIR e SFTR distintamente	Annuale	31 gennaio	Modello per l'elemento 5
6	Inventario dei servizi accessori erogati dal TR o dal gruppo	EMIR e SFTR distintamente	Annuale	31 gennaio	Modello per l'elemento 6
7	Inventario degli altri servizi erogati dal TR	EMIR e SFTR congiuntamente	Annuale	31 gennaio	Modello per l'elemento 7
8	Uso commerciale dei dati del TR	EMIR e SFTR distintamente	Annuale	31 gennaio	Modello per l'elemento 8
9	Inventario degli accordi di esternalizzazione ed elenco dei servizi esternalizzati	EMIR e SFTR distintamente	Annuale	31 gennaio	Modello per l'elemento 9
10	Politiche e procedure interne	EMIR e SFTR congiuntamente	Annuale	31 gennaio	Modello per l'elemento 10
11	Elenco dei contatti principali del TR	EMIR e SFTR distintamente	Annuale	31 gennaio	Modello per l'elemento 11
Informativa finanziaria					
12	Distinta delle entrate e uscite dei servizi del TR	EMIR e SFTR distintamente	Annuale	31 luglio	Modello per l'elemento 12
13	Conto finanziario infrannuale	EMIR e SFTR congiuntamente	Semestrale	31 gennaio e 31 luglio	No
14	Bilancio sottoposto a revisione	EMIR e SFTR congiuntamente	Annuale	30 giugno	No
15	Risorse finanziarie	EMIR e SFTR congiuntamente	Annuale	31 luglio	Modello per l'elemento 15
16	Valutazioni della politica di fissazione dei prezzi	EMIR e SFTR distintamente	Annuale	31 luglio	No
Controllo interno					
17	Programma di lavoro sul rispetto delle norme (compliance)	EMIR e SFTR distintamente	Annuale	31 gennaio	No
18	Relazioni di valutazione della conformità	EMIR e SFTR distintamente	Semestrale	31 gennaio e 31 luglio	No

Segnalazioni periodiche da effettuare da parte dei TR					
Elemento	Elemento di segnalazione	Applicabile a	Cadenza di segnalazione	Scadenza di segnalazione	Modello disponibile
19	Piano di audit interno	EMIR e SFTR distintamente	Annuale	31 gennaio	No
20	Relazioni di audit interno	EMIR e SFTR distintamente	Semestrale	31 gennaio e 31 luglio	No
21	Relazioni sui rischi	EMIR e SFTR distintamente	Annuale	31 gennaio	No
22	Quadro dei rischi	EMIR e SFTR distintamente	Annuale	31 gennaio	No
23	Riepilogo dei controlli di conformità e degli audit interni	EMIR e SFTR distintamente	Semestrale	31 gennaio e 31 luglio	Modello per l'elemento 23
24	Elenco dei casi di inosservanza potenziali e reali	EMIR e SFTR distintamente	Annuale	31 gennaio	Modello per l'elemento 24
Segnalazioni sulla sicurezza informatica e la sicurezza delle informazioni					
25	Strategia informatica	EMIR e SFTR congiuntamente	Annuale	31 gennaio	No
26	Libro di lavoro	EMIR e SFTR distintamente	Trimestrale	31 gennaio, 30 aprile, 31 luglio, 31 ottobre	Modello per l'elemento 26
27	Prospetto delle tecnologie utilizzate o attestazione	EMIR e SFTR distintamente	Annuale	31 gennaio	Modello per l'elemento 27
28	Risultati dei test del piano di continuità operativa (BCP)	EMIR e SFTR distintamente	Annuale	31 gennaio	No
29	Attestazione dei test sulla sicurezza delle informazioni	EMIR e SFTR distintamente	Annuale	31 gennaio	No
30	Metriche per la cybersicurezza	EMIR e SFTR distintamente	Semestrale	31 gennaio e 31 luglio	Modello per l'elemento 30
Segnalazione dei dati					
31	Riepilogo dei partecipanti al TR	EMIR e SFTR distintamente	Semestrale	31 gennaio e 31 luglio	Modello per l'elemento 31
32	Stato dell'accesso ai dati da parte delle autorità di regolamentazione	EMIR e SFTR distintamente	Trimestrale	31 gennaio, 30 aprile, 31 luglio, 31 ottobre	Modello per l'elemento 32
33	Volume dei dati	EMIR e SFTR distintamente	Trimestrale	31 gennaio, 30 aprile, 31 luglio, 31 ottobre	Modello per l'elemento 33
34	Riepilogo dello stato delle richieste di portabilità	EMIR e SFTR distintamente	Annuale	31 gennaio	Modello per l'elemento 34
35	Prestazioni delle attività di segnalazione dati e metriche di capacità	EMIR e SFTR distintamente	Mensile	Entro il 15 del mese successivo	Modelli per l'elemento 35
36	Statistiche sulle attività di riconciliazione	EMIR e SFTR distintamente	Mensile	Entro il 15 del mese successivo	Modello per l'elemento 36
Segnalazioni per il calcolo dei contributi per le attività di vigilanza					

Segnalazioni periodiche da effettuare da parte dei TR					
Elemento	Elemento di segnalazione	Applicabile a	Cadenza di segnalazione	Scadenza di segnalazione	Modello disponibile
37	Informazioni necessarie al calcolo dei contributi per le attività di vigilanza	EMIR e SFTR distintamente	Annuale	30 giugno	Modello per l'elemento 37

Tabella 2: SEGNALAZIONI AD HOC

Obblighi di segnalazione ad hoc in capo ai TR				
Elemento	Elemento di segnalazione	Segnalazioni ad hoc applicabili a	Calendario di segnalazione	Modello disponibile
Notifica di modifiche importanti delle condizioni richieste per la registrazione				
38	Dati dei membri del consiglio d'amministrazione	EMIR e SFTR congiuntamente	L'elenco iniziale deve essere trasmesso non appena gli orientamenti iniziano ad applicarsi. In seguito, tutte le modifiche delle informazioni trasmesse inizialmente dovranno essere comunicate con nuova e immediata notifica.	Modello per l'elemento 38
39	Personale rilevante	EMIR e SFTR distintamente	L'elenco iniziale deve essere trasmesso non appena gli orientamenti iniziano ad applicarsi. In seguito, tutte le modifiche delle informazioni trasmesse inizialmente dovranno essere comunicate con nuova e immediata notifica.	Modello per l'elemento 39
40	Modifica dell'assetto proprietario	EMIR e SFTR congiuntamente	Il primo elenco dei soggetti fisici o giuridici che detengono direttamente o indirettamente il 5 % o più dovrà essere fornito in un modello non appena gli orientamenti iniziano ad applicarsi. In seguito, tutte le modifiche delle informazioni trasmesse inizialmente dovranno essere comunicate con nuova e immediata notifica.	Modello per l'elemento 40
41	Lancio di nuovi servizi (compresi i servizi accessori o qualsiasi altro servizio)	EMIR e SFTR distintamente	Non appena possibile	Modello per l'elemento 41
42	Modifica della struttura delle commissioni/politica di fissazione dei prezzi	EMIR e SFTR distintamente	Non appena possibile	No
43	Costituzione di filiali e succursali, riorganizzazione o ristrutturazione delle attività del TR o variazione di ragione sociale, sede, documenti societari o status giuridico	EMIR e SFTR congiuntamente	Non appena possibile	No
44	Nuovi contenziosi/procedimenti che possono produrre effetti	EMIR e SFTR congiuntamente	Non appena possibile	No

Obblighi di segnalazione ad hoc in capo ai TR				
Elemento	Elemento di segnalazione	Segnalazioni ad hoc applicabili a	Calendario di segnalazione	Modello disponibile
	potenzialmente rilevanti per il TR			
45	Copie dei modelli delle autorità di regolamentazione	EMIR e SFTR distintamente	Non appena interviene una modifica.	No
46	Copie dei modelli di contratto per i partecipanti al TR	EMIR e SFTR distintamente	Non appena interviene una modifica.	No
47	Casi di inosservanza dei regolamenti in base ai quali è stata effettuata la registrazione del TR potenziali e reali, tra cui violazioni sostanziali delle politiche e procedure del TR, rilevazione di attività fraudolente/irregolari	EMIR e SFTR distintamente	Non appena rilevati	Modello per l'elemento 47
48	Modifiche della struttura e della metodologia per l'audit interno	EMIR e SFTR distintamente	Non appena possibile	No
49	Garanzia della qualità dell'audit interno	EMIR e SFTR congiuntamente	Non appena ottenuta	No
50	Modifiche importanti del piano di continuità operativa e di qualsiasi sua caratteristica	EMIR e SFTR distintamente	Non appena possibile	No
51	Modifiche importanti o aggiornamenti dei sistemi e dell'infrastruttura del TR	EMIR e SFTR distintamente	Non appena interviene una modifica importante.	Modello per l'elemento 51
52	Notifica di esternalizzazione in <i>cloud computing</i>	EMIR e SFTR distintamente	Una notifica da fornire il prima possibile laddove il piano di esternalizzazione preveda l'esternalizzazione a fornitori di servizi in <i>cloud</i> di funzioni critiche o importanti, o siano intervenute delle modifiche negli accordi correnti di esternalizzazione in <i>cloud</i> .	Modello per l'elemento 52
53	Modifiche degli accordi di esternalizzazione	EMIR e SFTR distintamente	Non appena possibile	No
54	Qualsiasi altra modifica importante delle condizioni richieste per la registrazione	EMIR e SFTR distintamente	Non appena possibile	No
Altro				
55	Incidenti informatici e di sicurezza delle informazioni	EMIR e SFTR distintamente	Notifica dell'incidente entro e non oltre il termine del giorno lavorativo di rilevazione dell'incidente, con le informazioni disponibili in quel momento. Successiva notifica dell'incidente con informazioni complete sull'accaduto e un'analisi delle cause all'origine dell'incidente dopo 30 giorni di calendario	Modello per l'elemento 55
56	Notifica di una richiesta di portabilità	EMIR e SFTR distintamente	Non appena possibile	Modello per l'elemento 56

Obblighi di segnalazione ad hoc in capo ai TR				
Elemento	Elemento di segnalazione	Segnalazioni ad hoc applicabili a	Calendario di segnalazione	Modello disponibile
	Piano di liquidazione			
57	Cessazione dell'attività	EMIR e SFTR distintamente	Non appena possibile	Modello per l'elemento 57

6. Segnalazione delle informazioni periodiche

6.1. Modulo: Segnalazioni relative alla governance e all'attività

Elemento 1 – Documenti del consiglio di amministrazione

Guideline 9. I TR devono trasmettere all'ESMA i fascicoli dei documenti delle riunioni del consiglio di amministrazione tenutesi nel periodo di riferimento, comprendenti: i) i verbali delle riunioni del consiglio, ii) le copie dei documenti trasmessi ai membri del consiglio in relazione alle rispettive riunioni del consiglio, iii) qualsiasi altro documento discusso in sede di riunione. Qualora il verbale sia disponibile solo in una versione provvisoria, che necessita dell'approvazione del consiglio d'amministrazione successivo, occorrerà fornire all'ESMA la bozza del documento. Laddove il TR abbia istituito dei comitati in seno al consiglio, il TR dovrà trasmettere anche i verbali e i materiali delle riunioni di tali comitati.

Elemento 2 – Programma, sedi e ordini del giorno delle riunioni del consiglio d'amministrazione

Guideline 10. I TR devono trasmettere all'ESMA il programma, le sedi e gli ordini del giorno, se disponibili, delle riunioni del consiglio d'amministrazione previste per l'esercizio corrente. Se dopo la notifica all'ESMA interviene una modifica, i TR dovranno trasmettere all'ESMA le informazioni aggiornate non appena la modifica viene confermata.

Elemento 3 – Assetto proprietario

Guideline 11. I TR sono tenuti a inviare all'ESMA l'ultimo prospetto dell'assetto proprietario indicante i legami proprietari tra l'impresa madre, le filiali e ogni altra entità collegata o succursale, identificata dalla rispettiva ragione sociale completa, forma giuridica e sede legale. Le informazioni devono includere tutte le modifiche notificate all'ESMA nel corso dell'ultimo esercizio a seguito della modifica importante delle condizioni richieste per la registrazione. Se dopo l'ultima segnalazione annuale non sono intervenute altre modifiche, il TR deve presentare

un'attestazione con la quale conferma che le informazioni fornite in precedenza sono tuttora accurate.

Elemento 4 – Organigrammi

Guideline 12. I TR devono trasmettere all'ESMA i loro organigrammi interni. Gli organigrammi devono includere le funzioni di management, di controllo, operative e di assistenza, con chiare linee di riporto, sedi geografiche e numero/bacino di risorse assegnate o disponibili per ogni funzione. Le informazioni devono includere tutte le modifiche importanti notificate all'ESMA nel corso dell'ultimo esercizio.

Elemento 5 – Personale e ETP

Guideline 13. I TR devono trasmettere all'ESMA il numero esatto di dipendenti direttamente impiegati o dedicati a livello di persona giuridica e indicare quanti dipendenti sono disponibili a livello di gruppo, ad esempio, fornendo una distinta degli equivalenti a tempo pieno (ETP) per le singole aree di *compliance* (conformità), servizi informatici, sicurezza informatica, gestione dei rischi e audit interno, secondo l'apposito modello.

Elemento 6 – Inventario dei servizi accessori erogati dal TR o dal gruppo

Guideline 14. I TR devono inviare all'ESMA l'elenco dei servizi accessori offerti da loro o da una società dello stesso gruppo, secondo la definizione di servizi accessori data all'articolo 17 delle NTR in materia di registrazione (EMIR) e all'articolo 17 delle NTR in materia di registrazione (SFTR). L'elenco deve indicare il numero di partecipanti del TR che fanno uso di tali servizi, secondo l'apposito modello. L'elenco deve recare una descrizione dei servizi accessori erogati dal TR o dall'impresa del suo gruppo e una descrizione di qualsiasi accordo che il TR abbia stretto con aziende che offrono tali servizi accessori. Le copie di tali accordi dovranno essere trasmesse unitamente al modello.

Elemento 7 – Inventario degli altri servizi erogati dal TR

Guideline 15. I TR devono trasmettere all'ESMA un elenco degli eventuali altri servizi erogati dal TR in qualità di persona giuridica in aggiunta ai servizi principali e ai servizi accessori forniti ai sensi del regolamento in base al quale è stata effettuata la registrazione del TR, indicando il numero di partecipanti del TR, che fruiscono di tali servizi, secondo l'apposito modello.

Elemento 8 – Uso commerciale dei dati del TR

Guideline 16.I TR devono trasmettere all'ESMA un elenco di tutti i casi in cui i dati comunicati ai TR ai sensi dell'EMIR o del SFTR sono stati utilizzati a scopo commerciale durante l'ultimo esercizio, laddove tale utilizzo sia avvenuto, secondo l'apposito modello.

Elemento 9 – Inventario degli accordi di esternalizzazione ed elenco dei servizi esternalizzati

Guideline 17.I TR devono fornire all'ESMA l'inventario degli accordi di esternalizzazione, compresi gli SLA, secondo l'apposito modello. L'inventario dovrebbe contenere sia i servizi esternalizzati dal TR che i servizi esternalizzati al TR. Le informazioni dovrebbero includere la definizione dettagliata dei servizi da fornire, compresa la portata misurabile di tali servizi, la granularità delle attività, nonché le condizioni alle quali tali attività vengono prestate e il loro calendario, secondo quanto stabilito all'articolo 16, lettera d), delle NTR in materia di registrazione (EMIR) e all'articolo 16, lettera d), delle NTR in materia di registrazione (SFTR). L'inventario dovrebbe comprendere le informazioni di tutte le notifiche rilevanti trasmesse nel corso dell'ultimo esercizio.

Elemento 10 – Politiche e procedure interne

Guideline 18.I TR devono trasmettere all'ESMA un riepilogo di tutte le politiche e procedure interne attive, secondo l'apposito modello. Queste politiche comprendono, tra l'altro, politiche in materia di conflitti di interesse, protezione della riservatezza dei dati, accesso ai dati da parte di fornitori terzi, processo di filtraggio degli accessi, disposizioni contrattuali vigenti tra il TR e i soggetti segnalanti, canali di segnalazione e conservazione delle informazioni, remunerazione/indennizzi. Se intervengono modifiche delle politiche e procedure vigenti, il TR dovrà segnalare tali modifiche, spiegarne la ratio e allegare la versione aggiornata del documento, mostrando le revisioni.

Elemento 11 – Elenco dei contatti principali del TR

Guideline 19.I TR devono tenere aggiornato l'elenco dei referenti forniti all'ESMA per le comunicazioni riguardanti specifiche aree. Tale elenco dovrebbe essere strutturato per area di responsabilità (per esempio, referente per questioni di compliance, amministrazione, TRACE, contabilità ecc.).

6.2. Modulo: Informativa finanziaria

Elemento 12 – Distinta delle entrate e uscite relative ai servizi del TR

Guideline 20. I TR devono comunicare all'ESMA la distinta delle entrate e delle uscite concernenti i servizi del TR, determinate secondo gli stessi principi contabili utilizzati ai fini della preparazione del bilancio del TR sottoposto a revisione e, se del caso, qualsiasi altra modalità contabile interna (quale la contabilità gestionale).

Elemento 13 – Conto finanziario infrannuale

Guideline 21. I TR devono comunicare all'ESMA i rispettivi conti finanziari infrannuali, preparati in applicazione degli stessi principi contabili utilizzati per la preparazione del bilancio del TR sottoposto a revisione.

Elemento 14 – Bilancio sottoposto a revisione

Guideline 22. I TR devono trasmettere all'ESMA il loro bilancio sottoposto a revisione. Se l'esercizio contabile non coincide con l'anno solare, i TR devono presentare, entro la scadenza, una distinta delle entrate e delle uscite certificata da un revisore contabile indipendente.

Elemento 15 – Risorse finanziarie

Guideline 23. I TR devono informare l'ESMA sulle risorse finanziarie a loro disposizione, che devono essere adeguate a coprire i costi operativi per un periodo di almeno sei mesi, di cui all'articolo 21, lettera b), delle NTR modificate in materia di registrazione (EMIR) e/o all'articolo 21, lettera b), delle NTR in materia di registrazione (SFTR), secondo l'apposito modello.

Elemento 16 – Valutazioni della politica di fissazione dei prezzi

Guideline 24. I TR devono trasmettere all'ESMA le copie delle valutazioni condotte durante l'ultimo esercizio riguardanti commissioni, costi e strategia di fissazione dei prezzi.

6.3. Modulo: Segnalazione dei controlli interni

Elemento 17 – Programma di lavoro sul rispetto delle norme (compliance)

Guideline 25. I TR devono presentare all'ESMA una copia del proprio programma di lavoro sulla compliance. Se le priorità di compliance dovessero cambiare in seguito

alla trasmissione del programma, i TR dovranno presentare quanto prima un programma di lavoro aggiornato.

Elemento 18 – Relazioni di valutazione della conformità

Guideline 26.I TR devono presentare all'ESMA le copie di ogni relazione sulla compliance, comprese le eventuali valutazioni della conformità e relazioni di verifica relative alle attività, ai sistemi, ai processi e alle attività operative del TR condotte dalla funzione di controllo della compliance (anche a livello di gruppo).

Elemento 19 – Piano di audit interno

Guideline 27.A prescindere che un TR abbia istituito una funzione di audit interno o commissionato gli audit interni a un soggetto esterno, il TR deve presentare una copia di un piano di lavoro annuale per l'audit interno.

Elemento 20 – Relazioni di audit interno

Guideline 28.A prescindere che il TR abbia istituito una funzione di audit interno o commissionato gli audit interni a un soggetto esterno, il TR deve presentare all'ESMA una copia delle relazioni di audit interno elaborate con riguardo all'attività, ai sistemi, ai processi e all'operatività del TR.

Elemento 21 – Relazione sui rischi

Guideline 29.I TR devono produrre copia di qualsiasi valutazione del rischio condotta dalla funzione di gestione del rischio durante il periodo di riferimento, che riguardi l'attività, i sistemi, i processi e l'operatività delle TR. La relazione sui rischi dovrebbe includere la struttura della valutazione dei rischi nonché la metodologia applicata ai fini della valutazione, o farvi riferimento.

Elemento 22 – Quadro dei rischi

Guideline 30.I TR devono presentare il proprio quadro di gestione dei rischi, che deve includere i rischi più alti identificati nel contesto del rispettivo processo di gestione dei rischi. Questo elemento è complementare al precedente nel fornire una visione più dettagliata dei rischi individuati in relazione ad alcuni aspetti critici dell'operatività del TR. I TR che dispongono di quadri distinti per i rischi informatici e i rischi per la sicurezza delle informazioni devono presentare entrambi i documenti.

Elemento 23 – Riepilogo dei controlli di conformità e degli audit interni

Guideline 31. I TR devono presentare un riepilogo che rechi i risultati completi e le azioni di *follow-up* adottate a seguito delle valutazioni condotte nell'ambito del controllo di conformità e degli audit interni, secondo l'apposito modello.

Elemento 24 – Elenco dei casi di non compliance potenziali e reali

Guideline 32. I TR devono presentare un elenco annuale dei casi di non compliance potenziali e reali, secondo l'apposito modello. Questo elemento di segnalazione si riferisce ai casi di non compliance potenziali e reali, che pur rientrando nell'ambito di applicazione del regolamento EMIR o del regolamento SFTR, non possono essere segnalati all'ESMA come incidenti relativi alla sicurezza informatica o incidenti relativi alla sicurezza delle informazioni ai sensi dei presenti orientamenti. I casi segnalabili riguardano le violazioni delle procedure interne del TR previste per l'osservanza dei relativi regolamenti, i reclami interni ricevuti dalla funzione di controllo della compliance, l'individuazione di potenziali conflitti di interesse, la rilevazione di attività fraudolente/irregolari o altre situazioni che potrebbero comportare un'inosservanza dell'EMIR/del SFTR. I TR devono indicare nell'apposito modello l'elenco dei casi di non compliance potenziali e reali, tra cui:

- a) tutti i casi aperti rilevati nel periodo;
- b) tutti i casi aperti rilevati in un periodo precedente e non chiusi durante il periodo;
- c) tutti i casi chiusi durante il periodo.

6.4. Modulo: Segnalazioni sulla sicurezza informatica e la sicurezza delle informazioni

Elemento 25 – Strategia informatica

Guideline 33. I TR devono comunicare all'ESMA la strategia informatica perseguita, soprattutto, in relazione alle decisioni principali che riguardano i propri sistemi informatici, quali il ricorso all'*outsourcing*, l'utilizzo del *cloud computing* ecc.

Elemento 26 – Libro di lavoro (Ldl)

Guideline 34. I TR devono trasmettere le informazioni riguardanti i propri progetti informatici e il relativo avanzamento mediante l'apposito modello. Ad ogni trasmissione del Libro di lavoro (Ldl), i TR devono indicare i progetti/interventi chiusi rispetto alla presentazione del precedente Ldl. Il modello deve dettagliare i

progetti aperti e pianificati, i progetti chiusi rispetto alla presentazione del precedente Ldl, gli interventi aperti e pianificati, nonché le correzioni implementate e chiuse rispetto alla segnalazione del precedente Ldl.

Elemento 27 – Prospetto delle tecnologie utilizzate

Guideline 35. I TR devono presentare all'ESMA un prospetto delle tecnologie utilizzate, secondo l'apposito modello. Il prospetto delle tecnologie utilizzate dovrà includere l'elenco delle applicazioni, dei sistemi operativi, dei database ecc., utilizzati dal TR, nonché la descrizione delle modalità di mappatura dei processi principali dei TR. Se dopo l'ultima segnalazione annuale non sono intervenute altre modifiche, il TR deve presentare un'attestazione con la quale conferma che le informazioni fornite in precedenza sono tuttora accurate.

Elemento 28 – Risultati dei test del piano di continuità operativa (BCP)

Guideline 36. I TR devono comunicare all'ESMA qualsiasi test BCP condotto nel corso dell'ultimo esercizio, insieme ai relativi risultati e alle azioni di *follow-up*. Il test BCP deve indicare, come minimo, la data in cui è stato condotto, la portata e i criteri/la metodologia/lo scenario di test.

Elementi 29 e 30 – Segnalazione dei test sulla sicurezza delle informazioni e delle metriche per la cybersicurezza

Guideline 37. I TR devono trasmettere all'ESMA un'attestazione con cui confermano di aver effettuato i vari test sulla sicurezza delle informazioni, insieme all'apposito modello.

6.5. Modulo: Comunicazione dei dati

Elemento 31 – Riepilogo dei partecipanti al TR

Guideline 38. I TR devono trasmettere le statistiche e il profilo dei partecipanti al TR, secondo l'apposito modello. Le informazioni da presentare con il modello comprendono, tra l'altro, il regolamento ai sensi del quale viene effettuata la segnalazione, il tipo di partecipante (per esempio finanziario/non finanziario e indicazione del settore d'attività), il paese, l'indicazione se si tratta di un soggetto che effettua la segnalazione direttamente o indirettamente e la rispettiva quota ecc.

Elemento 32 – Stato dell’accesso ai dati da parte delle autorità di regolamentazione

Guideline 39.I TR devono presentare l’elenco delle autorità di regolamentazione che hanno richiesto l’accesso ai dati del TR e di quelle a cui tale accesso è stato accordato, anche tramite TRACE, secondo l’apposito modello.

Elemento 33 – Volume di dati

Guideline 40.I TR devono segnalare, tra l’altro, le statistiche riguardanti i) il numero complessivo di segnalazioni (e relativo numero di contratti) pervenute dall’inizio dell’attività di segnalazione ai sensi di ciascun regolamento e ii) il numero di derivati e operazioni di finanziamento tramite titoli per singola giurisdizione, i soggetti partecipanti all’attività di segnalazione e la categoria della qualità dei dati (nel caso del regolamento EMIR), secondo l’apposito modello.

Elemento 34 – Riepilogo dello stato delle richieste di portabilità

Guideline 41.I TR devono fornire all’ESMA l’elenco dei partecipanti al TR che hanno richiesto la portabilità nell’arco degli ultimi 12 mesi, comprese le eventuali richieste rimaste aperte dai periodi precedenti, e riportare tutti i dati previsti dall’apposito modello.

Elemento 35 – Prestazioni delle attività di segnalazione dati e metriche di capacità

Guideline 42.I TR devono fornire all’ESMA le statistiche sulle attività di acquisizione dei dati, la generazione di report (vale a dire al cliente, inter-TR e regolamentare), la capacità di sistema (in termini di memoria e calcolo), secondo gli appositi modelli.

Elemento 36 – Statistiche sulle attività di riconciliazione

Guideline 43.I TR devono fornire all’ESMA le statistiche sulle attività di riconciliazione di derivati e SFT, secondo gli appositi modelli.

6.6. Modulo: Segnalazioni per il calcolo dei contributi per le attività di vigilanza

Elemento 37 – Informazioni necessarie per il calcolo dei contributi per le attività di vigilanza

Guideline 44.I TR devono trasmettere all’ESMA le informazioni necessarie ai fini del calcolo del fatturato applicabile, come previsto dal regolamento delegato (UE) n. 1003/2013 della Commissione e/o dal regolamento delegato (UE) 2019/360

della Commissione, secondo l'apposito modello. Tali informazioni devono essere certificate da un revisore indipendente.

7. Segnalazione delle informazioni ad hoc

7.1. Notifiche di modifiche importanti delle condizioni iniziali richieste per la registrazione e delle pertinenti informazioni di vigilanza

Elemento 38 – Dati dei membri del consiglio d'amministrazione

Guideline 45.I TR devono fornire un elenco iniziale completo dei membri del consiglio (tra cui il consiglio di amministrazione, il consiglio di vigilanza, i comitati del consiglio di amministrazione), con i rispettivi profili. Le eventuali modifiche dovranno essere subito notificate con l'apposito modello insieme ai documenti giustificativi, come specificato nell'articolo 9 delle NTR modificate sulla registrazione (EMIR) e/o nell'articolo 9 delle NTR sulla registrazione (SFTR), da allegare.

Elemento 39 – Personale rilevante

Guideline 46.I TR devono fornire un elenco iniziale completo dei membri chiave del personale del TR (amministratore delegato, CCO, CTO, COO, CRO, CISO e qualsiasi altro membro chiave del personale), con i rispettivi profili. Le eventuali modifiche dovranno essere subito segnalate dal TR con una nuova notifica, utilizzando il modello. Per i vertici aziendali dovranno essere allegati i documenti di cui all'articolo 9 delle NTR modificate in materia di registrazione (EMIR) e/o articolo 9 delle NTR in materia di registrazione (SFTR).

Elemento 40 – Modifica dell'assetto proprietario

Guideline 47.I TR devono comunicare tutte le modifiche dell'assetto proprietario che implicano l'acquisizione o la cessione di quote superiori al 5 % del capitale sociale emesso o dei diritti di voto del TR. Conformemente al modello di segnalazione, i TR devono includere l'elenco aggiornato delle persone fisiche o giuridiche che, direttamente o indirettamente, detengono il 5 % o più del capitale o dei diritti di voto del repertorio o che grazie alla partecipazione detenuta sono nella posizione di esercitare un'influenza significativa sulla gestione del TR.

Elemento 41– Lancio di nuovi servizi (compresi i servizi accessori o qualsiasi altro servizio)

Guideline 48.I TR devono notificare all'ESMA con debito anticipo l'intenzione di lanciare nuovi servizi, fornendo spiegazioni su aspetti quali la segregazione

operativa, la fissazione del prezzo, i potenziali conflitti di interesse, l'impatto sulle risorse ecc., come da modello.

Elemento 42 – Modifica della struttura delle commissioni/politica di fissazione dei prezzi

Guideline 49. I TR devono trasmettere all'ESMA tutti i documenti pertinenti alla nuova struttura delle commissioni/politica di fissazione dei prezzi, compresi gli sconti e gli abbuoni in essere o proposti e le condizioni per poter beneficiare di tali riduzioni.

Elemento 43 – Costituzione di filiali e succursali, riorganizzazione o ristrutturazione delle attività del TR o modifica della ragione sociale, sede, documenti societari o status giuridico

Guideline 50. In relazione alla costituzione di filiali e succursali, la riorganizzazione o la ristrutturazione delle attività del TR o la modifica della ragione sociale, della sede, dei documenti societari o dello status giuridico, i TR devono trasmettere all'ESMA una descrizione delle modifiche, la nuova struttura, il nuovo indirizzo e tutte le informazioni di supporto pertinenti.

Elemento 44 – Nuovi contenziosi/ procedimenti che possono produrre effetti potenzialmente rilevanti per il TR

Guideline 51. I TR devono trasmettere all'ESMA una descrizione dei nuovi contenziosi (giudiziari, amministrativi, arbitrari o di qualsiasi altro tipo) che possano produrre effetti rilevanti per il TR, con particolare riguardo per le questioni fiscali e di insolvenza, e una valutazione delle potenziali conseguenze ed effetti per il TR.

Elemento 45 – Copie dei modelli di contratto per le autorità di regolamentazione

Guideline 52. I TR devono trasmettere all'ESMA le copie di tutti i tipi di modelli di contratto/condizioni d'uso che accordano alle autorità di regolamentazione l'accesso ai dati segnalati ai sensi del regolamento in base al quale è stata effettuata la registrazione del TR.

Elemento 46 – Copie dei modelli di contratto per i partecipanti al TR

Guideline 53. I TR devono trasmettere all'ESMA le copie di tutti i tipi di modelli di contratto per la prestazione di servizi di segnalazione ai sensi del regolamento in base al quale è stata effettuata la registrazione del TR.

Elemento 47 – Casi di inosservanza potenziali e reali dei regolamenti in base a quali è stata effettuata la registrazione del TR , comprese le violazioni rilevanti di politiche e procedure del TR, rilevazione di attività fraudolente/irregolari

Guideline 54. I TR devono fornire all'ESMA le informazioni relative ai casi potenziali e reali che potrebbero comportare o hanno comportato un'inosservanza del regolamento in base al quale è stata effettuata la registrazione del TR, non appena

l'inosservanza viene rilevata. Le informazioni devono essere fornite nell'apposito modello e devono riguardare un caso di inosservanza che, pur rientrando nell'ambito di applicazione dell'EMIR o del SFTR, non è segnalabile all'ESMA come incidente informatico o di sicurezza informatica ai sensi dei presenti orientamenti (quali le violazioni delle procedure interne del TR atte a garantire l'osservanza dei rispettivi regolamenti, reclami interni pervenuti alla funzione di controllo della compliance, l'identificazione di potenziali conflitti di interesse, la rilevazione di attività fraudolente/irregolari o altre situazioni che potrebbero comportare un'inosservanza dell'EMIR o del SFTR). Queste informazioni dovranno essere fornite contestualmente alle notifiche periodiche di non conformità.

Elemento 48 – Struttura e metodologia dell'audit interno

Guideline 55. I TR devono comunicare la loro struttura e metodologia di audit interno e le eventuali modifiche delle stesse.

Elemento 49 – Garanzia della qualità dell'audit interno

Guideline 56. Il TR che abbia ottenuto una valutazione indipendente dell'operato della funzione di audit interno nel periodo di riferimento deve trasmettere una copia di tale relazione di valutazione.

Elemento 50 – Modifiche importanti del piano di continuità operativa e di qualsiasi sua caratteristica

Guideline 57. I TR devono trasmettere all'ESMA una descrizione della modifica, le ragioni che hanno portato alla modifica del BCP e le sue conseguenze, secondo il modello.

Elemento 51 – Prospetto delle tecnologie – Modifiche importanti dei sistemi e dell'infrastruttura del TR

Guideline 58. I TR devono utilizzare il modello per segnalare all'ESMA le modifiche che riguardano l'infrastruttura e i sistemi.

Elemento 52 – Notifica di esternalizzazione in *cloud computing*

Guideline 59. I TR devono segnalare tempestivamente all'ESMA qualsiasi piano di esternalizzazione di processi e dati di una funzione critica o importante del TR a fornitori di servizi in *cloud*, secondo l'apposito modello. Usando lo stesso modello, il TR deve notificare tempestivamente anche gli accordi di esternalizzazione in *cloud* che riguardano una funzione, che pur essendo precedentemente classificata come non essenziale o non importante, diviene, in seguito, essenziale o importante, o altre modifiche che vanno a modificare l'attuale accordo di esternalizzazione in *cloud computing*. Questa comunicazione soddisfa gli obblighi

di notifica previsti per il TR dagli orientamenti ESMA in materia di *cloud computing* ⁽³⁾.

Elemento 53 – Modifiche agli accordi di esternalizzazione

Guideline 60. Le modifiche importanti agli accordi di esternalizzazione, compresi gli SLA, devono essere segnalate dal TR all'ESMA con l'apposito modello non appena intervengono. Devono essere notificati sia i servizi esternalizzati dal TR che i servizi esternalizzati al TR. Le informazioni devono includere la definizione dettagliata dei servizi da fornire, compresa la portata misurabile di tali servizi, la granularità delle attività, nonché le condizioni alle quali tali attività vengono prestate e il loro calendario. I TR devono allegare qualsiasi copia rilevante della documentazione di *outsourcing*.

Elemento 54 – Qualsiasi altra modifica importante delle condizioni richieste per la registrazione

Guideline 61. I TR devono fornire all'ESMA una descrizione della modifica.

7.2. Altre notifiche

Elemento 55 – Incidenti informatici e di sicurezza delle informazioni

Guideline 62. I TR devono trasmettere all'ESMA una notifica iniziale dell'incidente entro 24 ore dal momento in cui sono venuti a conoscenza dell'incidente e una notifica di *follow-up* entro un mese. I TR devono presentare tali notifiche con l'apposito modello.

Elemento 56 – Notifica di una richiesta di portabilità

Guideline 63. I TR devono segnalare all'ESMA l'eventuale ricezione di una richiesta di portabilità di un partecipante del TR, secondo l'apposito modello.

7.3. Piano di liquidazione – Documenti essenziali da presentare all'ESMA

Elemento 57 – Cessazione dell'attività

Guideline 64. I TR devono fornire all'ESMA un piano di liquidazione ai sensi dell'articolo 79, paragrafo 3, dell'EMIR e articolo 5, paragrafo 2, del SFTR nel caso di revoca della registrazione prevista dall'articolo 71, paragrafo 1, dell'EMIR o articolo 73, lettera d), dell'EMIR e dall'articolo 9, paragrafo 1, o articolo 10,

⁽³⁾ [Orientamenti ESMA in materia di esternalizzazione a fornitori di servizi cloud](#) pubblicata nel dicembre 2020.

paragrafo 1, del SFTR, utilizzando l'apposito modello e nel rispetto del relativo calendario indicato nel modello.