

Comunicazione del 3 settembre 2020: Segnalazioni dei Fondi Comuni Monetari: avvio nuova rilevazione.

La Consob ha dichiarato all’Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (ESMA) l’intenzione di conformarsi agli “Orientamenti in materia di informativa alle autorità competenti ai sensi dell’art. 37 del Regolamento FCM” pubblicati dall’ESMA il 22 giugno u.s. (ESMA34-49-173) ⁽¹⁾.

Gli Orientamenti forniscono le istruzioni e le specifiche tecniche per la compilazione delle segnalazioni che i gestori di Fondi Comuni Monetari (FCM) devono trasmettere all’Autorità Nazionale Competente ai sensi dell’art. 37 del Regolamento UE 2017/1131 del Parlamento europeo e del Consiglio del 14 giugno 2017 ⁽²⁾ e delle norme tecniche di attuazione previste dal Regolamento di esecuzione (UE) 2018/708 della Commissione del 17 aprile 2018 ⁽³⁾.

Con la presente comunicazione della Banca d’Italia viene data attuazione a tali Orientamenti.

Gli enti segnalanti dovranno predisporre le segnalazioni seguendo quanto indicato dalla documentazione tecnica dell’ESMA consultabile al link: <https://www.esma.europa.eu/policy-activities/fund-management/fund-management-reporting> nonché alle istruzioni, fornite in allegato, relative alle modalità di invio dei dati alla Banca d’Italia.

Si rammenta che l’art. 37 del Regolamento UE 2017/1131 prevede una frequenza trimestrale per l’invio delle segnalazioni dei FCM le cui attività gestite siano pari almeno a 100 000 000 EUR e una frequenza annuale per gli altri FCM; la scadenza per l’invio è fissata dagli Orientamenti entro i 30 giorni successivi alla scadenza del trimestre o dell’anno di riferimento. Per ciò che concerne l’invio delle segnalazioni riferite ai primi due trimestri del 2020, i termini di inoltro sono stati fissati dall’ESMA al 30 settembre con nota del 31 marzo 2020 ⁽⁴⁾

La presente comunicazione entra in vigore il giorno della pubblicazione sul sito web della Banca d’Italia e sarà recepita nella Circolare n. 189 “Manuale delle Segnalazioni Statistiche e di Vigilanza per gli Organismi di Investimento Collettivo del Risparmio” in occasione di prossimi aggiornamenti.

¹ https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/esma34-49-173_guidelines_mmf_reporting_it.pdf

² https://eur-lex.europa.eu/legal-content/IT/ALL/?uri=uriserv:OJ.L_.2017.169.01.0008.01.ITA

³ https://eur-lex.europa.eu/eli/reg_impl/2018/708/oj?locale=it

⁴ <https://www.esma.europa.eu/press-news/esma-news/esma-announces-update-reporting-under-money-market-funds-regulation>

Modalità tecniche per inoltrare alla Banca d'Italia delle segnalazioni dei fondi comuni monetari ex art. 37 del Regolamento UE 2017/1131.

Il Regolamento UE 2017/1131 del Parlamento europeo e del Consiglio del 14 giugno 2017, sui fondi comuni monetari introduce all'art. 37 obblighi segnaletici nei confronti dei rispettivi gestori verso l'Autorità Nazionale Competente, per il cui espletamento l'ESMA ha emanato il Regolamento di esecuzione (UE) 2018/708 della Commissione del 17 aprile 2018 ⁽¹⁾, contenente le norme tecniche di attuazione sul modulo che i gestori di fondi comuni monetari devono utilizzare. L'ESMA ha altresì prodotto e pubblicato una documentazione tecnica specifica ⁽²⁾ che include: (i) le linee guida di supporto alla produzione delle segnalazioni; (ii) gli standard di qualità richiesti per i report segnaletici, declinati attraverso una serie di regole di controllo; (iii) lo schema XML secondo lo standard ISO 20022 cui i file segnaletici devono attenersi.

Termini di inoltrare

La segnalazione ex art. 37 del Regolamento UE 2017/1131 va trasmessa alla Banca d'Italia attraverso la piattaforma INFOSTAT con periodicità trimestrale (annuale per i fondi c.d. "sotto soglia" le cui attività gestite non superano complessivamente i 100 milioni di euro), entro il 30° giorno di calendario successivo alla data di riferimento della segnalazione.

Modalità di trasmissione delle segnalazioni

Le informazioni richieste devono essere organizzate secondo lo schema ed il formato tecnico pubblicati dall'ESMA sopra richiamato (schema XML secondo lo standard ISO 20022) e trasmesse attraverso la survey "DATM37" dell'applicazione INFOSTAT.

Per l'utilizzo della piattaforma INFOSTAT sono valide le credenziali di accesso già in essere per le statistiche di vigilanza, conseguentemente le utenze in uso per tali segnalazioni con profilo da gestore saranno automaticamente abilitate a trattare la nuova base informativa. Gli intermediari che non sono ancora censiti nell'applicazione INFOSTAT dovranno richiedere un PIN di accesso e, a tal fine, potranno fare riferimento a rdvi.helpdesk@bancaditalia.it.

La piattaforma INFOSTAT consente di effettuare le seguenti attività connesse con la gestione delle segnalazioni in argomento:

- "Upload" del file di segnalazione precedentemente creato secondo le specifiche tecniche indicate dall'ESMA;
- verifica delle coerenze tra le informazioni prodotte (funzionalità di diagnostica);

¹ https://eur-lex.europa.eu/eli/reg_impl/2018/708/oj?locale=it

² <https://www.esma.europa.eu/policy-activities/fund-management/fund-management-reporting>

- - trasmissione dei dati (invii completi, conferme) alla Banca d'Italia.

Si precisa che:

- 1) non sarà resa disponibile la funzionalità del “Data entry”;
- 2) La denominazione del file segnaletico, da inviare obbligatoriamente in modalità upload, dovrà seguire la seguente naming convention:

<NOME SURVEY>_<CODABI>_<DATARIF>_<Timestamp>.xml

essendo

<NOME SURVEY> = DATM37

<CODABI> = codice abi del gestore segnalante

<DATARIF> = data contabile, in formato aaaammgg, riferita alla fine del periodo segnaletico del report (es 1 trim 2020=20200331)

<Timestamp> = timestamp di trasmissione del file in formato AAAAMMGGhhmm (es: 202009011230).

In caso di spedizione di un file compresso, la naming convention dovrà essere rispettata dal file contenuto nell'archivio: non sarà applicato alcun controllo sul nome dell'archivio stesso;

- 3) il file segnaletico dovrà essere prodotto, come indicato dall'ESMA, in formato XML secondo lo standard ISO 20022;
- 4) il tag dello schema xsd relativo al processo di trasmissione dei dati del fondo presente nella struttura del file segnaletico, dovrà sempre essere valorizzato con “<Upd>”; eventuali segnalazioni con tag difforme (ad esempio quelle con valore “<Cxl>” che equivale a cancellazione) saranno scartate. Il tag dello schema xsd relativo alle informazioni aggiuntive (<ElmtJustfn>) sarà accettato solamente in associazione al tag “<Upd>”;
- 5) per quanto indicato al precedente punto 4, eventuali segnalazioni di rettifica dovranno necessariamente configurarsi come nuovi invii completi dei report segnaletici, sostitutivi di quelli precedentemente inviati;
- 6) eventuali conferme ai rilievi potranno essere inoltrate utilizzando la funzionalità “Conferme” disponibile sul portale Infostat (cfr. Manuale Infostat, paragrafo 2.2.5).

Standard di qualità richiesti per le segnalazioni.

Per gli aspetti inerenti alle verifiche sull'affidabilità delle segnalazioni, alla trasmissione di file correttivi e delle conferme e, più in generale, al presidio della qualità delle informazioni, gli enti dovranno far riferimento alle regole di controllo pubblicate sul sito dell'ESMA già richiamate.

Gli errori segnaletici, come anche indicato nella documentazione tecnica dell'ESMA (cfr. nota 2) possono essere di tre tipi:

- “file errors” ovvero errori di compatibilità rispetto agli schemi xsd pubblicati dall'ESMA;
- “content errors” ovvero errori nel contenuto della segnalazione;

- “*content warnings*” ovvero errori “potenziali” nel contenuto della segnalazione.

I primi due tipi di errore danno luogo allo scarto dell’intera segnalazione e sono sanabili esclusivamente tramite invio di un nuovo file corretto; nel terzo caso invece sarà prodotto un flusso di ritorno per i segnalanti contenente i rilievi evidenziati (eventualmente confermabili).

Gli scarti e i rilievi sui dati trasmessi prodotti dalle regole di controllo saranno inviati ai segnalanti dalla Banca d’Italia che curerà di norma anche la successiva interlocuzione con questi ultimi.

In circostanze particolari, specifiche richieste di approfondimento originate dall’ESMA potranno pervenire ai segnalanti direttamente dalla Consob.

Resta fermo che eventuali file rettificativi dovranno in ogni caso essere inviati alla Banca d’Italia, responsabile del processo di raccolta dei dati.

Decorrenza degli interventi

Le prime informazioni, riferite al primo e al secondo trimestre del 2020, dovranno pervenire entro il 30 settembre 2020.