

15° AGGIORNAMENTO DELLA CIRCOLARE n. 148

“MANUALE DELLE SEGNALAZIONI STATISTICHE E DI VIGILANZA PER GLI INTERMEDIARI DEL MERCATO MOBILIARE”

RESOCONTO DELLA CONSULTAZIONE

ARGOMENTO	COMMENTI	VALUTAZIONI	EVENTUALI EMENDAMENTI
Rispondenti	Assosim		
Aspetti generali	Relativamente alla principale modifica riguardante l'istituzione delle segnalazioni consolidate dei gruppi di SIM, apportata con il 15° aggiornamento del Manuale delle segnalazioni statistiche e di vigilanza per gli intermediari del mercato mobiliare, non si segnalano criticità alla loro introduzione.		
Parte prima - Sezione IV Patrimonio di Vigilanza- “Rischio di regolamento”	<p>Con lettera Circolare della Banca d'Italia n. 63016 del 18 gennaio 2008, emanata per gestire il periodo transitorio per l'aggiornamento degli schemi segnaletici al Regolamento della Banca d'Italia del 24 ottobre 2007, si prevedeva, nell'ambito del rischio di regolamento, che, in presenza di transazioni non dvp sospese da più di 4 giorni rispetto alla data di regolamento, gli importi venissero dedotti dal patrimonio di vigilanza utilizzando la voce 4424202 (Elementi da dedurre - Altri elementi da dedurre).</p> <p>L'aggiornamento del manuale non ha, né in sede di trattazione del patrimonio di vigilanza, né in sede di trattazione del rischio di regolamento, ripreso tale previsione normativa. Si chiede pertanto se occorra continuare a valorizzare la voce 4424202 (Elementi da dedurre - Altri elementi da dedurre).</p>	La voce in questione va compilata sulla base delle indicazioni contenute nella richiamata lettera circolare.	Tale aspetto, unitamente a tutte le altre modifiche agli schemi prudenziali, verrà affrontato esplicitamente nel prossimo aggiornamento della Circolare n. 148, che recepirà la Direttiva CRD II.
Parte prima - Sezione III Strumenti finanziari in portafoglio e pronti contro termine. Sottosezione 1 – “Strumenti finanziari in portafoglio: dati di flusso”.	È stato chiesto di meglio specificare se nella sezione in esame vada segnalato l'intero ammontare dell'attività in conto proprio (per finalità di investimento, in qualità di market maker, in contropartita diretta e in relazione a ordini dei clienti),		Il testo delle istruzioni di compilazione della voce segnaletica in questione è stato emendato per specificare che all'interno della voce va rilevato l'intero ammontare delle operazioni che hanno ad oggetto titoli presenti nell'attivo dello

15° AGGIORNAMENTO DELLA CIRCOLARE n. 148
“MANUALE DELLE SEGNALAZIONI STATISTICHE E DI VIGILANZA PER GLI INTERMEDIARI DEL MERCATO MOBILIARE”

RESOCONTO DELLA CONSULTAZIONE

ARGOMENTO	COMMENTI	VALUTAZIONI	EVENTUALI EMENDAMENTI
	oppure esclusivamente l'attività in conto proprio dalla SIM posta in essere per finalità di investimento o di gestione della tesoreria.		stato patrimoniale delle SIM, a prescindere dalle finalità delle operazioni.

Con la pubblicazione del presente resoconto e della “relazione illustrativa” contenuta nel Documento di consultazione di giugno 2010 si assolve l'obbligo di cui all'art. 6, comma 1, del Regolamento 24 marzo 2010 in materia di procedimenti normativi della Banca d'Italia nell'esercizio delle funzioni di vigilanza bancaria e finanziaria.