

REGOLAMENTO DELEGATO (UE) 2018/1643 DELLA COMMISSIONE**del 13 luglio 2018**

che integra il regolamento (UE) 2016/1011 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione che specificano ulteriormente il contenuto della dichiarazione sull'indice di riferimento che l'amministratore dell'indice di riferimento è tenuto a pubblicare e i casi in cui sono necessari aggiornamenti della dichiarazione stessa

(Testo rilevante ai fini del SEE)

LA COMMISSIONE EUROPEA,

visto il trattato sul funzionamento dell'Unione europea,

visto il regolamento (UE) 2016/1011 del Parlamento europeo e del Consiglio, dell'8 giugno 2016, sugli indici usati come indici di riferimento negli strumenti finanziari e nei contratti finanziari o per misurare la performance di fondi di investimento e recante modifica delle direttive 2008/48/CE e 2014/17/UE e del regolamento (UE) n. 596/2014 ⁽¹⁾, in particolare l'articolo 27, paragrafo 3,

considerando quanto segue:

- (1) L'articolo 27, paragrafo 1, del regolamento (UE) 2016/1011 impone agli amministratori di pubblicare una dichiarazione per l'indice di riferimento o, se del caso, per la famiglia di indici di riferimento se tale indice di riferimento o famiglia di indici di riferimento possono essere utilizzati nell'Unione.
- (2) La dichiarazione sull'indice di riferimento dovrebbe includere informazioni complete sul mercato o sulla realtà economica che l'indice di riferimento o la famiglia di indici di riferimento intende misurare e spiegare quando la misurazione del mercato o della realtà economica potrebbe diventare inaffidabile. Tali informazioni sono necessarie agli utenti e ai potenziali utenti per comprendere appieno l'indice di riferimento o la famiglia di indici di riferimento.
- (3) La dichiarazione sull'indice di riferimento dovrebbe indicare gli elementi discrezionali della metodologia dell'indice di riferimento, come pure il processo di valutazione ex post dell'esercizio della discrezionalità. Tali informazioni sono fondamentali per consentire agli utenti e potenziali utenti di comprendere che l'indice di riferimento o la famiglia di indici di riferimento sono suscettibili di manipolazione.
- (4) I requisiti cui sono soggetti gli indici di riferimento a norma del regolamento (UE) 2016/1011 variano a seconda della tipologia (indici di riferimento basati su dati regolamentati, indici di riferimento per la determinazione dei tassi di interesse, indici di riferimento per le merci, indici di riferimento critici, indici di riferimento significativi e indici di riferimento non significativi). La dichiarazione sull'indice di riferimento dovrebbe pertanto identificare in maniera chiara e inequivocabile la tipologia o le tipologie cui appartiene l'indice di riferimento o la famiglia di indici di riferimento.
- (5) Per quanto riguarda gli indici di riferimento critici, la dichiarazione dovrebbe includere informazioni supplementari che spieghino la ragione per cui l'indice di riferimento è riconosciuto come critico ai sensi del regolamento (UE) 2016/1011, in modo tale che utenti e potenziali utenti dispongano delle informazioni necessarie a comprendere su quale base esso è stato riconosciuto come critico.
- (6) L'uso di dati regolamentati esonera gli amministratori e i relativi contributori di dati da taluni obblighi imposti dal regolamento (UE) 2016/1011. Per gli indici di riferimento basati su dati regolamentati, gli amministratori dovrebbero pertanto essere tenuti a indicare le fonti di dati utilizzate e a precisare in base a quali parametri l'indice di riferimento è considerato un indice di riferimento basato su dati regolamentati.
- (7) Tenuto conto della loro particolare natura, gli indici di riferimento per la determinazione dei tassi di interesse e gli indici di riferimento per le merci devono conformarsi alle disposizioni contenute in allegati specifici del regolamento (UE) 2016/1011, anziché o in aggiunta alle disposizioni di cui al titolo II dello stesso regolamento. Gli amministratori di detti indici di riferimento dovrebbero precisarlo nella dichiarazione sull'indice di riferimento, in modo tale che utenti e potenziali utenti ne siano a conoscenza.
- (8) Gli amministratori degli indici di riferimento critici sono tenuti a rispettare il regime regolamentare potenziato a norma del regolamento (UE) 2016/1011. È quindi importante che gli utenti e i potenziali utenti siano adeguatamente informati al riguardo.

⁽¹⁾ GUL 171 del 29.6.2016, pag. 1.

