

RÈGLEMENT DÉLÉGUÉ (UE) N° 151/2013 DE LA COMMISSION

du 19 décembre 2012

complétant le règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du Conseil sur les produits dérivés de gré à gré, les contreparties centrales et les référentiels centraux par des normes techniques de réglementation précisant les informations à publier et à mettre à disposition par les référentiels centraux, ainsi que les normes opérationnelles à respecter pour l'agrégation, la comparaison et l'accessibilité des données

(Texte présentant de l'intérêt pour l'EEE)

LA COMMISSION EUROPÉENNE,

vu le traité sur le fonctionnement de l'Union européenne,

vu l'avis de la Banque centrale européenne ⁽¹⁾,vu le règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du Conseil du 4 juillet 2012 sur les produits dérivés de gré à gré, les contreparties centrales et les référentiels centraux ⁽²⁾, et notamment son article 81, paragraphe 5,

considérant ce qui suit:

- (1) Il est essentiel d'identifier clairement les contrats concernés et leurs contreparties respectives. Dans une optique fonctionnelle, il convient d'envisager les entités ayant accès aux données détenues par les référentiels centraux en fonction de leurs compétences et des fonctions qu'elles exercent.
- (2) L'Autorité européenne des marchés financiers (AEMF) devrait avoir accès à toutes les données de transaction détenues par les référentiels centraux pour pouvoir exercer une surveillance sur ces référentiels, demander des informations, prendre des mesures de surveillance appropriées et vérifier s'il y a lieu de maintenir ou de retirer leur enregistrement en tant que référentiel central.
- (3) Compte tenu des responsabilités qui lui incombent en vertu du règlement (UE) n° 1095/2010 du Parlement européen et du Conseil du 24 novembre 2010 instituant une Autorité européenne de surveillance (Autorité européenne des marchés financiers) ⁽³⁾ et du règlement (UE) n° 648/2012, l'AEMF devrait disposer d'un accès aux données aux fins de ces différents mandats. L'accès individuel de membres du personnel de l'AEMF aux données devrait être conforme à chacun de ces mandats spécifiques.
- (4) Le Comité européen du risque systémique (CERS), l'AEMF et les membres concernés du Système européen de banques centrales (SEBC), dont certaines banques centrales nationales et autorités de l'Union compétentes en matière de valeurs mobilières et de marchés, ont pour mandat de veiller à la stabilité financière dans l'Union et

devraient donc avoir accès aux données de transaction pour l'ensemble des contreparties, aux fins de leurs missions respectives à cet égard.

- (5) Les autorités de surveillance et de contrôle des contreparties centrales ont besoin de pouvoir accéder aux données pour exercer effectivement leurs fonctions à l'égard de ces entités, elles devraient donc disposer d'un accès à toutes les informations nécessaires à un tel mandat.
- (6) Le fait pour certains membres du SEBC d'avoir accès aux données leur permet de s'acquitter de leurs missions fondamentales, à savoir notamment les fonctions de banque centrale d'émission, leur mandat consistant à assurer la stabilité financière et, dans certains cas, l'exercice d'une surveillance prudentielle sur certaines contreparties. Certains membres du SEBC ayant des mandats différents en vertu de leur législation nationale, il convient de leur accorder l'accès aux données conformément aux différents mandats visés à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) n° 648/2012.
- (7) Les autorités des marchés financiers de l'Union compétentes ont pour mission principale de protéger les investisseurs de leurs ressorts respectifs et devraient avoir accès aux données de transaction concernant les marchés, les participants, les produits et les sous-jacents couverts qui relèvent de leurs mandats de surveillance et d'exécution.
- (8) Les autorités désignées conformément à l'article 4 de la directive 2004/25/CE du Parlement européen et du Conseil du 21 avril 2004 concernant les offres publiques d'acquisition ⁽⁴⁾ devraient avoir accès aux données de transactions portant sur des produits dérivés sur actions, lorsque l'émetteur du sous-jacent soit est admis à la négociation sur un marché réglementé de leur ressort, soit a son adresse légale dans leur ressort territorial, soit agit en tant qu'offrant pour une telle entreprise et propose une contrepartie incluant des titres.
- (9) L'Agence de coopération des régulateurs de l'énergie (ACER) devrait avoir accès aux données pour pouvoir surveiller les marchés de gros de l'énergie en vue de détecter et de décourager les abus de marché en coopération avec les autorités de régulation nationales, et pour pouvoir exercer cette surveillance conformément au règlement (UE) n° 1227/2011 du Parlement européen et du Conseil du 25 octobre 2011 concernant l'intégrité et la transparence du marché de gros de l'énergie (règlement «REMIT») ⁽⁵⁾. L'ACER devrait donc avoir accès à toutes les données relatives aux produits dérivés sur l'énergie détenues par les référentiels centraux.

⁽¹⁾ Non encore paru au Journal officiel.⁽²⁾ JO L 201 du 27.7.2012, p. 1.⁽³⁾ JO L 331 du 15.12.2010, p. 84.⁽⁴⁾ JO L 142 du 30.4.2004, p. 12.⁽⁵⁾ JO L 326 du 8.12.2011, p. 1.

- (10) Le règlement (UE) n° 648/2012 ne couvre que l'accès aux données de transaction, et non aux données de prénégociation telles que les ordres, contrairement au règlement (UE) n° 1227/2011. À cet égard, les référentiels centraux ne devraient donc pas être considérés comme la source d'informations appropriée pour l'ACER.
- (11) D'un point de vue fonctionnel, la surveillance prudentielle est une composante essentielle pour l'accès aux données des référentiels centraux. De même, plusieurs autorités différentes peuvent avoir un mandat de surveillance prudentielle. Toutes les autorités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) n° 648/2012 devraient donc se voir garantir l'accès aux données de transaction relatives aux entités concernées.
- (12) Les entités ayant accès aux données de référentiels centraux en vertu de l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) n° 648/2012 doivent veiller à avoir et à faire respecter des politiques garantissant que ces informations ne soient accessibles qu'à des personnes compétentes poursuivant un but bien précis et juridiquement fondé, et indiquer clairement les autres personnes éventuellement autorisées à accéder à ces données.
- (13) L'accès aux données devrait être envisagé sur trois niveaux d'agrégation. Les données de transaction devraient inclure les détails de chaque transaction; les données de position devraient consister en données de position agrégées par sous-jacent/produit pour chaque contrepartie; et les données notionnelles agrégées devraient correspondre aux positions globales par sous-jacent/produit, sans précision quant aux contreparties. L'accès aux données de transaction donnerait aussi accès aux données de position et aux données agrégées. L'accès aux données de position donnerait aussi accès aux données agrégées, mais non aux données de transaction. Enfin, l'accès aux données notionnelles agrégées, qui constitueraient la catégorie la moins détaillée, ne devrait pas donner accès aux données de position ou de transaction.
- (14) Le présent règlement se fonde sur les projets de normes techniques de réglementation soumis à la Commission par l'AEMF.
- (15) Conformément à l'article 10 du règlement (UE) n° 1095/2010, l'AEMF a consulté les autorités compétentes et les membres du Système européen de banques centrales avant de soumettre le projet de normes techniques de réglementation sur lequel est fondé le présent règlement. L'AEMF a aussi mené des consultations publiques ouvertes sur ces projets de normes techniques de réglementation, a analysé les coûts et avantages potentiels qu'elles impliquent et a demandé l'avis du groupe des parties intéressées au secteur financier établi conformément à l'article 37 dudit règlement,
- a) une ventilation des positions ouvertes agrégées correspondant aux catégories de dérivés suivantes:
- i) matières premières;
 - ii) crédit;
 - iii) devises;
 - iv) actions;
 - v) taux d'intérêt;
 - vi) autres.
- b) une ventilation des volumes de transaction agrégés correspondant aux catégories de dérivés suivantes:
- i) matières premières;
 - ii) crédit;
 - iii) devises;
 - iv) actions;
 - v) taux d'intérêt;
 - vi) autres.
- c) une ventilation des valeurs agrégées correspondant aux catégories de produits dérivés suivantes:
- i) matières premières;
 - ii) crédit;
 - iii) devises;
 - iv) actions;
 - v) taux d'intérêt;
 - vi) autres.
2. Ces données sont publiées sur un site web ou un portail en ligne facilement accessible au public et mis à jour au moins une fois par semaine.

A ADOPTÉ LE PRÉSENT RÈGLEMENT:

Article premier

Publication de données agrégées

1. Les référentiels centraux publient les données prévues à l'article 81, paragraphe 1, du règlement (UE) n° 648/2012, dont au moins:

Article 2

Accès des autorités compétentes aux données

1. Les référentiels centraux permettent à l'Autorité européenne des marchés financiers (AEMF) d'accéder à toutes les données de transaction aux fins de l'exercice de ses compétences en matière de surveillance.

2. L'AEMF adopte des procédures internes propres à garantir un accès approprié à son personnel, ainsi que toute limitation d'accès pertinente concernant les activités prévues par son mandat qui ne relèvent pas de la surveillance.

3. Les référentiels centraux permettent à l'autorité pour la coopération des régulateurs de l'énergie (ACER) d'accéder à toutes les données de transaction portant sur des produits dérivés ayant pour sous-jacent l'énergie ou des quotas d'émission.

4. Les référentiels centraux permettent aux autorités compétentes pour la surveillance d'une contrepartie centrale et, le cas échéant, aux membres du Système européen de banques centrales (SEBC) compétents pour le contrôle de cette dernière, d'accéder à toutes les données des transactions compensées ou déclarées par la contrepartie centrale.

5. Les référentiels centraux permettent aux autorités compétentes pour la surveillance des plates-formes d'exécution des contrats déclarés d'accéder à toutes les données de transaction relatives aux contrats exécutés sur ces plates-formes.

6. Les référentiels centraux permettent aux autorités de surveillance désignées conformément à l'article 4 de la directive 2004/25/CE d'accéder à toutes les données de transaction sur des produits dérivés dont le sous-jacent est un titre émis par une entreprise qui remplit l'une des conditions suivantes:

- a) elle est admise à la négociation sur un marché réglementé de leur ressort;
- b) son siège statutaire ou, à défaut, son siège social est dans leur ressort;
- c) elle agit en tant qu'offrant pour une entreprise visée au point a) ou b) et la contrepartie qu'elle offre inclut des titres.

7. Les données à fournir conformément au paragraphe 6 comprennent les informations suivantes:

- a) les titres sous-jacents;
- b) la catégorie de dérivé;
- c) le signe de la position;
- d) le nombre de titres de référence;
- e) les contreparties au contrat dérivé.

8. Les référentiels centraux permettent aux autorités de l'Union compétentes en matière de valeurs mobilières et de marché visées à l'article 81, paragraphe 3, point h), du règlement (UE) n° 648/2012 d'accéder à toutes les données de transaction relatives aux marchés, aux participants, aux contrats

et aux sous-jacents qui relèvent de ces autorités en vertu de leurs responsabilités et mandats respectifs en matière de surveillance.

9. Les référentiels centraux permettent au Comité européen du risque systémique, à l'AEMF et, le cas échéant, aux membres concernés du SEBC d'accéder aux données de transaction:

- a) pour toutes les contreparties de leur ressort;
- b) pour les contrats dérivés dont l'entité de référence se situe dans leur ressort, ou dont l'obligation de référence est une dette souveraine de leur ressort.

10. Les référentiels centraux permettent aux membres concernés du SEBC d'accéder aux données de position concernant les contrats dérivés libellés dans la monnaie émise par ces membres.

11. Les référentiels centraux permettent aux entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) n° 648/2012 d'accéder, aux fins de la surveillance prudentielle des contreparties soumises à l'obligation de déclaration, à toutes les données de transaction de ces contreparties.

Article 3

Autorités de pays tiers

1. Les référentiels centraux permettent aux autorités compétentes de pays tiers ayant conclu un accord international avec l'Union au sens de l'article 75 du règlement (UE) n° 648/2012 d'accéder aux données, en tenant compte du mandat et des responsabilités de ces autorités et conformément aux dispositions de cet accord international.

2. Les référentiels centraux permettent aux autorités compétentes de pays tiers ayant établi des modalités de coopération avec l'Union au sens de l'article 76 du règlement (UE) n° 648/2012 d'accéder aux données, en tenant compte du mandat et des responsabilités de ces autorités et conformément à ces modalités de coopération.

Article 4

Normes opérationnelles d'agrégation et de comparaison des données

1. Les référentiels centraux permettent aux entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) n° 648/2012 d'accéder aux données conformément aux procédures de communication, aux normes de messagerie et aux données de référence communément en usage au niveau international.

2. Les contreparties à une transaction génèrent un identifiant de transaction unique pour chaque contrat dérivé afin de permettre aux référentiels centraux d'agrégier et de comparer les données de plusieurs référentiels centraux.

*Article 5***Normes opérationnelles d'accès aux données**

1. Les référentiels centraux enregistrent les informations fournies aux entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) n° 648/2012 concernant l'accès aux données.

2. Les informations visées au paragraphe 1 comprennent:

a) l'ampleur des données accessibles;

b) une référence aux dispositions légales permettant d'accorder l'accès à ce type de données dans le cadre du règlement (UE) n° 648/2012 et du présent règlement.

*Article 6***Entrée en vigueur**

Le présent règlement entre en vigueur le vingtième jour suivant celui de sa publication au *Journal officiel de l'Union européenne*.

Le présent règlement est obligatoire dans tous ses éléments et directement applicable dans tout État membre.

Fait à Bruxelles, le 19 décembre 2012.

Par la Commission
Le président
José Manuel BARROSO
