

RÈGLEMENT D'EXÉCUTION (UE) N° 1249/2012 DE LA COMMISSION**du 19 décembre 2012**

définissant les normes techniques d'exécution en ce qui concerne le format des enregistrements à conserver par les contreparties centrales conformément au 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

(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 29, paragraphe 5,

considérant ce qui suit:

- (1) Conformément à l'article 29, paragraphe 4, du règlement (UE) n° 648/2012, aux articles 13, 14 et 15 du règlement délégué concernant les normes techniques de réglementation précisant les détails des enregistrements et des informations à conserver par les contreparties centrales (CCP), adoptées en vertu de l'article 29, paragraphe 4 du règlement (UE) n° 648/2012, il convient d'établir aussi des règles pour préciser le format de l'enregistrement et des informations conservées conformément auxdits articles.
- (2) Pour exercer leurs missions de manière efficace et cohérente, les autorités compétentes concernées devraient disposer de données qui sont comparables entre contreparties centrales. L'utilisation de formats communs facilite également le rapprochement de données entre contreparties centrales.
- (3) Il convient d'exiger que les contreparties centrales conservent les données à des fins d'enregistrement dans un format compatible avec celui des données conservées par les référentiels centraux, étant donné que dans certaines circonstances, les contreparties centrales et les référentiels centraux doivent conserver ou déclarer les mêmes informations. L'utilisation d'un même format par les différentes infrastructures des marchés financiers encourage une utilisation plus fréquente de ce format par un large éventail de participants au marché, favorisant ainsi la normalisation.
- (4) Afin de permettre un traitement automatique et une réduction des coûts pour les participants au marché, il importe d'utiliser le plus possible des procédures et des formats de données normalisés entre contreparties centrales.

(5) Le sous-jacent devrait être identifiable au moyen d'un seul identifiant; or il n'existe pas, à l'heure actuelle, de code utilisé de manière généralisée sur les marchés pour identifier les sous-jacents d'un panier. Les contreparties centrales devraient donc indiquer, au minimum, que le sous-jacent est un panier et utiliser les codes ISIN (International Securities Identification number) pour les indices standard lorsque c'est possible.

(6) Le présent règlement se fonde sur les projets de normes techniques d'exécution soumis à la Commission par l'Autorité européenne des marchés financiers (AEMF).

(7) Conformément à l'article 15 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⁾, l'AEMF a mené une consultation publique ouverte avant de soumettre les projets de normes techniques d'exécution sur lesquels se fonde le présent règlement, a analysé les coûts et avantages potentiels que ces normes impliquent et a demandé l'avis du groupe des parties intéressées au secteur financier établi conformément à l'article 37 du règlement (UE) n° 1095/2010,

A ADOPTÉ LE PRÉSENT RÈGLEMENT:

Article premier

Formats des enregistrements

1. Pour chaque contrat qu'elles traitent, les contreparties centrales conservent les enregistrements prévus à l'article 20 du règlement délégué concernant les normes techniques de réglementation sur les exigences précisant les détails des enregistrements et des informations à conserver par les contreparties centrales, adoptées en vertu de l'article 29, paragraphe 4, du règlement (UE) n° 648/2012, en respectant le format établi au tableau 1 de l'annexe.

2. Pour chacune de leurs positions, les contreparties centrales conservent les enregistrements prévus à l'article 21 du règlement délégué concernant les normes techniques de réglementation sur les exigences précisant les détails des enregistrements et des informations à conserver par les contreparties centrales, adoptées en vertu de l'article 29, paragraphe 4, du règlement (UE) n° 648/2012, en respectant le format établi au tableau 2 de l'annexe.

⁽¹⁾ Non encore parue au Journal officiel.

⁽²⁾ JO L 201 du 27.7.2012, p. 1.

⁽³⁾ JO L 331 du 15.12.2010, p. 84.

3. Pour les faits et événements relatifs à leurs activités et à leur organisation interne, les contreparties centrales conservent les enregistrements prévus à l'article 22 du règlement délégué concernant les normes techniques de réglementation sur les exigences précisant les détails des enregistrements et des informations à conserver par les contreparties centrales, adoptées en vertu de l'article 29, paragraphe 4, du règlement (UE) n° 648/2012, en respectant le format établi au tableau 3 de l'annexe.

4. Les contreparties centrales présentent à l'autorité compétente les enregistrements et les informations visés aux para-

graphes 1, 2 et 3 suivant un format qui permet un flux de données direct entre contrepartie centrale et autorité compétente. Les contreparties centrales établissent ce flux de données dans un délai de six mois après la demande formulée par l'autorité compétente.

Article 2

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

ANNEXE

Tableaux des champs à enregistrer conformément à l'article 1^{er}

Tableau 1

Enregistrements des transactions traitées

	Champ	Format	Description
1	Horodatage de la déclaration	<i>Format de date ISO 8601, format de temps UTC</i>	Date et heure de la déclaration
2	Prix / taux	<i>Jusqu'à 20 caractères numériques au format xxxx.yyyyy.</i>	Le prix par titre ou contrat dérivé à l'exclusion de la commission et (s'il y a lieu) des intérêts dus. Dans le cas d'un titre de créance, le prix peut s'exprimer soit en termes de monnaie soit en pourcentage.
2a	Unité de prix	<i>Par exemple code monnaie ISO 4217, trois caractères alphabétiques, pourcentage.</i>	La manière dont est exprimé le prix.
3	Monnaie notionnelle	<i>Code monnaie ISO 4217, trois caractères alphabétiques.</i>	La monnaie dans laquelle est exprimé le prix. Si, dans le cas d'une obligation ou de toute autre forme de titre de créance, le prix est exprimé en pourcentage, ce pourcentage est pris en compte.
3a	Monnaie du règlement	<i>Code monnaie ISO 4217, trois caractères alphabétiques.</i>	La monnaie à fournir.
4	Quantité	<i>Jusqu'à 10 caractères numériques.</i>	Le nombre d'unités d'instruments financiers, la valeur nominale des obligations ou le nombre de contrats dérivés concernés par la transaction.
5	Unité de quantité	<i>Jusqu'à 10 caractères numériques.</i>	Indication sur la quantité: si elle équivaut au nombre d'unités d'instruments financiers, à la valeur nominale des obligations ou au nombre de contrats dérivés.
6	Côté de la CCP	<i>B = acheteur, S = vendeur</i>	
7	Identifiant du produit	<i>Taxonomie provisoire conformément aux informations prévues à l'article 4 du règlement (UE) xx/2012 [projet de norme technique d'exécution sur le format et la fréquence des déclarations de transactions aux référentiels centraux], à l'ISIN ou à l'identifiant unique de produit (IUP).</i>	Le contrat est identifié au moyen d'un identifiant de produit, s'il est disponible.
8	Identifiant du membre compensateur	<i>Identifiant d'entité juridique (IEJ) (20 caractères alphanumériques), identifiant provisoire d'entité (20 caractères alphanumériques), code BIC (11 caractères alphanumériques) ou code client (50 caractères alphanumériques).</i>	Si la contrepartie qui effectue la déclaration n'est pas elle-même membre compensateur, ce champ est utilisé pour identifier son membre compensateur au moyen d'un code unique. S'il s'agit d'un individu, le code à employer est le code client qui lui est attribué par la CCP.

	Champ	Format	Description
9	Identifiant du bénéficiaire	Identifiant d'entité juridique (IEJ) (20 caractères alphanumériques), identifiant provisoire d'entité (20 caractères alphanumériques), code BIC (11 caractères alphanumériques) ou code client (50 caractères alphanumériques).	Si le bénéficiaire du contrat n'est pas une contrepartie au contrat, il doit être identifié au moyen d'un code unique ou, dans le cas d'un individu, du code client qui lui est attribué par l'entité juridique à laquelle il recourt.
10	Partie qui a transféré le contrat (en cas de cession)	Identifiant d'entité juridique (IEJ) (20 caractères alphanumériques), identifiant provisoire d'entité (20 caractères alphanumériques), code BIC (11 caractères alphanumériques) ou code client (50 caractères alphanumériques).	
11	Lieu d'exécution	Code d'identification de marché (MIC) ISO 10383 s'il y a lieu, XOFF pour les dérivés cotés qui sont négociés hors marché ou XXXX pour les dérivés de gré à gré.	Identification du lieu où la transaction a été exécutée. Dans le cas d'un contrat conclu de gré à gré, il sera précisé si l'instrument concerné est admis à la négociation mais négocié de gré à gré, ou non admis à la négociation et négocié de gré à gré.
12	Date d'interposition	Format de date ISO 8601.	Le jour où l'interposition de la CCP dans le contrat a été exécutée.
13	Heure d'interposition	Format de temps UTC	L'heure à laquelle l'interposition de la CCP dans le contrat a été exécutée, traduite en heure locale de l'autorité compétente à laquelle la transaction est déclarée, et fuseau horaire dans lequel la transaction est déclarée, exprimé en temps universel coordonné (UTC) +/- x heures.
14	Date de cessation du contrat	Format de date ISO 8601.	Le jour où la cessation du contrat a lieu.
15	Heure de cessation du contrat	Format de temps UTC	L'heure à laquelle la cessation du contrat a lieu, traduite en heure locale de l'autorité compétente à laquelle la transaction est déclarée, et fuseau horaire dans lequel la transaction est déclarée, exprimé en temps universel coordonné (UTC) +/- x heures.
16	Type de livraison	C = espèces, P = physique, O = optionnel pour la contrepartie.	Précise si le contrat est réglé physiquement ou en espèces.
17	Date de règlement	Format de date ISO 8601.	Le jour où le règlement ou le rachat du contrat a été exécuté. S'il existe plusieurs dates, d'autres champs seront ajoutés.
18	Heure du règlement ou du rachat du contrat	Format de temps UTC	L'heure à laquelle le règlement ou le rachat du contrat a été exécuté, traduite en heure locale de l'autorité compétente à laquelle la transaction est déclarée, et fuseau horaire dans lequel la transaction est déclarée, exprimé en temps universel coordonné (UTC) +/- x heures.

	Champ	Format	Description
Détails des conditions initiales des contrats soumis à une obligation de compensation, à fournir dans la mesure où ils sont applicables			
19	Date	<i>Format de date ISO 8601.</i>	Le jour où le contrat a été initialement conclu.
20	Heure	<i>Format de temps UTC</i>	L'heure à laquelle le contrat original a été initialement conclu, traduite en heure locale de l'autorité compétente à laquelle la transaction est déclarée, et fuseau horaire dans lequel la transaction est déclarée, exprimé en temps universel coordonné (UTC) +/- x heures.
21	Identifiant du produit	<i>Taxonomie provisoire conformément aux informations prévues à l'article 4 du règlement (UE) xx/2012 [projet de norme technique d'exécution sur le format et la fréquence des déclarations de transactions aux référentiels centraux], à l'ISIN ou à l'identifiant unique de produit (IUP).</i>	Le contrat est identifié au moyen d'un identifiant de produit unique, s'il est disponible.
22	Sous-jacent	<i>Identifiant de produit unique, ISIN (12 caractères alphanumériques) et CFI (6 caractères alphanumériques). Identifiant d'entité juridique (IEJ) (20 caractères alphanumériques), identifiant provisoire d'entité (20 caractères alphanumériques), B= panier ou I= indice.</i>	L'identification du titre qui sert de sous-jacent à un contrat dérivé ainsi que de la valeur mobilière visée à l'article 4, paragraphe 1, point 18 c) de la directive 2004/39/CE.
23	Type d'instrument dérivé (en cas de contrat dérivé)	La description harmonisée du type d'instrument dérivé doit être conforme à l'une des catégories de niveau supérieur prévues par une norme uniforme internationalement admise pour la classification des instruments financiers.	
24	Inscription de l'instrument au registre des contrats qui sont soumis à l'obligation de compensation tenu par l'AEMF (en cas de contrat dérivé)	<i>Y = oui / N = non.</i>	
Autres informations à fournir dans la mesure où elles sont applicables			
25	Identification de la CCP interopérable compensant l'une des jambes de la transaction	<i>Identifiant d'entité juridique (IEJ) (20 caractères alphanumériques), identifiant provisoire d'entité (20 caractères alphanumériques), code BIC (11 caractères alphanumériques) ou code client (50 caractères alphanumériques).</i>	

Tableau 2

Enregistrements des positions

	Champ	Format
1	Identifiant du membre compensateur	Identifiant d'entité juridique (IEJ), identifiant provisoire d'entité ou code BIC
2	Identifiant du bénéficiaire	Identifiant d'entité juridique (IEJ), identifiant provisoire d'entité, code BIC ou code client
3	CCP interopérable maintenant la position	Identifiant d'entité juridique (IEJ), identifiant provisoire d'entité, code BIC ou code client
4	Signe de la position	B = acheteur / S = vendeur.
5	Valeur de la position	Jusqu'à 10 caractères numériques (xxxx,yy).
6	Prix auquel les contrats sont valorisés	Jusqu'à 10 caractères numériques (xxxx,yy).
7	Monnaie	Code monnaie ISO
8	Autres informations nécessaires	Texte libre
9	Montant des appels de marges de la CCP	Jusqu'à 10 caractères numériques (xxxx,yy).
10	Montant des contributions aux fonds de défaillance appelées par la CCP	Jusqu'à 10 caractères numériques (xxxx,yy).
11	Montant des autres ressources financières appelées par la CCP	Jusqu'à 10 caractères numériques (xxxx,yy).
12A	Montant des marges fournies par le membre compensateur en rapport avec le compte client A	Jusqu'à 10 caractères numériques (xxxx,yy).
13A	Montant des contributions aux fonds de défaillance fournies par le membre compensateur en rapport avec le compte client A	Jusqu'à 10 caractères numériques (xxxx,yy).
14A	Montant des autres ressources financières fournies par le membre compensateur en rapport avec le compte client A	Jusqu'à 10 caractères numériques (xxxx,yy).
15B	Montant des marges fournies par le membre compensateur en rapport avec le compte client B	Jusqu'à 10 caractères numériques (xxxx,yy).
16B	Montant des contributions aux fonds de défaillance fournies par le membre compensateur en rapport avec le compte client B	Jusqu'à 10 caractères numériques (xxxx,yy).
17B	Montant des autres ressources financières fournies par le membre compensateur en rapport avec le compte client B	Jusqu'à 10 caractères numériques (xxxx,yy).

Tableau 3

Enregistrements des faits et événements relatifs à l'entreprise

	Champ	Format	Description
1	Organigrammes	Texte libre	Conseil d'administration et comités qui en relèvent, unité de compensation, unité de gestion du risque et toute autre unité ou division pertinente

Actionnaires ou associés détenant une participation qualifiée (champs à ajouter pour chaque actionnaire/associé pertinent)

2	Type	S= actionnaire / M= associé.	
3	Type de participation qualifiée	D=directe / I=indirecte.	
4	Type d'entité	N= personne physique / L= personne morale.	
5	Montant de la participation	Jusqu'à 10 caractères numériques (xxxx,yyyy).	

Autres documents

6	Politiques, procédures et processus requis en vertu d'exigences organisationnelles	Documents	
7	Comptes rendus des réunions du conseil d'administration, des sous-comités (le cas échéant) et des comités de direction (le cas échéant)	Documents	
8	Comptes rendus des réunions du comité des risques	Documents	
9	Comptes rendus du groupe de consultation réunissant les membres compensateurs et les clients (le cas échéant)	Documents	
10	Rapports d'audit interne et externe, de gestion du risque, de conformité et de consultants	Documents	
11	Politique de continuité des activités et plan de rétablissement après sinistre	Documents	
12	Plan de liquidité et rapports quotidiens sur la liquidité	Documents	
13	Documents présentant tous les actifs et passifs et comptes de capitaux	Documents	

	Champ	Format	Description
14	Plaintes reçues	<i>Texte libre</i>	Pour chaque plainte: intitulé de la plainte, adresse et numéro de compte; date de réception de la plainte; noms de toutes les personnes impliquées dans la plainte; description de la nature de la plainte; décision concernant la plainte; date à laquelle la plainte a été résolue.
15	Informations relatives à une interruption des services ou à un dysfonctionnement	<i>Texte libre</i>	Informations sur toute interruption des services ou tout dysfonctionnement, notamment un rapport détaillé sur la chronologie, les conséquences et les mesures correctives.
16	Résultats de la simulation de crise et du test a posteriori	<i>Texte libre</i>	
17	Communications écrites avec les autorités compétentes, l'AEMF et les membres compétents du SEBC	<i>Documents</i>	
18	Avis juridiques reçus conformément aux exigences organisationnelles	<i>Documents</i>	
19	Accords d'interopérabilité avec d'autres CCP (le cas échéant)	<i>Documents</i>	
20	Liste de tous les membres compensateurs [article 17 du règlement (UE) n° XXX/2012]	<i>Texte libre / document</i>	Liste dressée en vertu de l'article 17 du règlement (UE) n° XXX/2012.
21	Informations exigées en vertu de l'article 17 du règlement (UE) n° XXX/2012.	<i>Texte libre / documents</i>	Droit et réglementations régissant i) l'accès à la CCP, ii) les contrats conclus par la CCP avec les membres compensateurs et, dans la mesure du possible, avec les clients, iii) les contrats que la CCP accepte de compenser, iv) tout accord d'interopérabilité, v) le recours aux garanties (collatéral) et contributions aux fonds de défaillance, notamment la liquidation des positions et du collatéral et le degré de protection du collatéral à l'encontre de prérogatives de tiers (degré de ségrégation).
22	Processus relatifs au développement de nouvelles initiatives	<i>Texte libre</i>	En cas de fourniture de nouveaux services.