

RÈGLEMENT DÉLÉGUÉ (UE) 2019/361 DE LA COMMISSION**du 13 décembre 2018****modifiant le règlement délégué (UE) n° 151/2013 en ce qui concerne l'accès aux données détenues par 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 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 ⁽¹⁾, et notamment son article 81, paragraphe 5,

considérant ce qui suit:

- (1) L'article 32, paragraphe 3, du règlement (UE) 2015/2365 du Parlement européen et du Conseil ⁽²⁾ a modifié l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) n° 648/2012 en ajoutant un certain nombre d'entités à la liste des entités auxquelles un référentiel central doit fournir des informations sur les instruments dérivés afin de leur permettre d'exercer leurs responsabilités et mandats. Il y a donc lieu d'intégrer aussi ces entités dans le règlement délégué (UE) n° 151/2013 de la Commission ⁽³⁾, en précisant les informations à leur fournir et le niveau d'accès aux éléments des contrats dérivés à leur accorder. Il est par conséquent essentiel que les référentiels centraux soient en mesure d'identifier de manière précise les contreparties et les opérations concernées. L'accès fourni par les référentiels centraux devrait comprendre l'accès aux éléments des données de transaction portant sur les contrats dérivés conclus par une contrepartie, que cette contrepartie soit une société mère ou la filiale d'une autre société, pour autant que l'accès demandé concerne des informations nécessaires à l'exercice des responsabilités et mandats de l'entité concernée.
- (2) Bon nombre des entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) n° 648/2012 ont plusieurs responsabilités et mandats différents. Pour éviter aux référentiels centraux de devoir vérifier constamment en vertu de quel mandat ou pour quel besoin particulier une entité fait une demande d'accès, et leur épargner ainsi une charge administrative superflue, il convient de leur permettre d'accorder à chaque entité un accès unique couvrant les responsabilités et mandats qui sont les siens.
- (3) L'accès des entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) n° 648/2012 à tous les éléments des contrats dérivés, y compris les éléments des contrats dérivés qui n'ont pas été acceptés par le référentiel central et les éléments des contrats dérivés ayant fait l'objet du rapprochement entre référentiels centraux visé par l'article 19 du règlement délégué (UE) n° 150/2013 de la Commission ⁽⁴⁾, est de la plus haute importance pour que ces entités puissent s'acquitter de leurs responsabilités et de leurs mandats.
- (4) Certaines des entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) n° 648/2012 sont chargées de surveiller les risques systémiques pour la stabilité financière. Pour pouvoir exercer correctement leurs tâches, ces entités doivent avoir accès au plus large éventail possible d'acteurs du marché, aux plateformes de négociation et aux éléments de contrats dérivés les plus complets et les plus détaillés disponibles pour leur zone de compétence, laquelle peut être, selon l'entité concernée, un État membre, la zone euro ou l'Union.

⁽¹⁾ JO L 201 du 27.7.2012, p. 1.

⁽²⁾ Règlement (UE) 2015/2365 du Parlement européen et du Conseil du 25 novembre 2015 relatif à la transparence des opérations de financement sur titres et de la réutilisation et modifiant le règlement (UE) n° 648/2012 (JO L 337 du 23.12.2015, p. 1).

⁽³⁾ 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 (JO L 52 du 23.2.2013, p. 33).

⁽⁴⁾ Règlement délégué (UE) n° 150/2013 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 en ce qui concerne les normes techniques de réglementation précisant les détails de la demande d'enregistrement en tant que référentiel central (JO L 52 du 23.2.2013, p. 25).

- (5) En raison des liens existant entre contrats dérivés et politique monétaire, les membres du système européen de banques centrales (SEBC) devraient, conformément à l'article 81, paragraphe 3, point g), du règlement (UE) n° 648/2012, avoir accès aux données de position concernant les contrats dérivés libellés dans la monnaie émise par ces membres. Ces données de position devraient inclure des données sur les contrats dérivés agrégées par critères, c'est-à-dire par sous-jacent, par produit et par échéance pour chacune des contreparties.
- (6) L'Autorité bancaire européenne (ABE), l'Autorité européenne des assurances et des pensions professionnelles (AEAPP) et le comité européen du risque systémique (CERS) font partie du système européen de surveillance financière et exercent, en matière de stabilité financière et de risque systémique, des mandats et des responsabilités très similaires à ceux de l'Autorité européenne des marchés financiers (AEMF). Il importe donc que ces autorités aient accès, à l'instar de l'AEMF, à toutes les données de transaction portant sur des contrats dérivés.
- (7) Le règlement (UE) n° 1024/2013 du Conseil ⁽⁵⁾ a institué un mécanisme de surveillance unique. Les référentiels centraux devraient donc veiller à ce que la Banque centrale européenne (BCE) ait accès à toutes les données de transaction concernant les contrats dérivés conclus par toute contrepartie qui, dans le cadre du mécanisme de surveillance unique, est soumise à la surveillance de la BCE en application du règlement (UE) n° 1024/2013.
- (8) En vertu de la directive 2014/59/UE du Parlement européen et du Conseil ⁽⁶⁾, les autorités de résolution doivent être dotées de moyens d'action efficaces à l'égard des entités visées à l'article 1^{er}, paragraphe 1, de ladite directive afin de prévenir toute contagion. Chaque autorité de résolution devrait donc avoir accès aux données de transaction sur les contrats dérivés déclarées par ces entités.
- (9) En vertu du règlement (UE) n° 806/2014 du Parlement européen et du Conseil ⁽⁷⁾, le Conseil de résolution unique (CRU) est responsable du fonctionnement efficace et cohérent du mécanisme de résolution unique, notamment pour ce qui est d'établir les plans de résolution destinés aux entités visées à l'article 2 dudit règlement. Pour permettre au Conseil de résolution unique d'établir ces plans de résolution, les référentiels centraux doivent lui donner accès aux données de transaction sur les contrats dérivés conclus par toute contrepartie relevant du règlement (UE) n° 806/2014.
- (10) Pour que les autorités visées à l'article 81, paragraphe 3, points o) et p), du règlement (UE) n° 648/2012 puissent exercer leurs responsabilités et leurs mandats, il convient qu'elles aient accès aux données déclarées par les contreparties qui relèvent de ces responsabilités et de ces mandats.
- (11) Le présent règlement se fonde sur le projet de normes techniques de réglementation soumis à la Commission européenne par l'AEMF.
- (12) L'AEMF a consulté les autorités concernées et les membres du SEBC avant de soumettre le projet de normes techniques de réglementation sur lesquels se fonde le présent règlement. L'AEMF a procédé à des consultations publiques ouvertes sur ce projet, en a analysé les coûts et avantages potentiels et a sollicité l'avis du groupe des parties intéressées au secteur financier institué conformément à l'article 37 du règlement (UE) n° 1095/2010 du Parlement européen et du Conseil ⁽⁸⁾.
- (13) Le règlement délégué (UE) n° 151/2013 devrait donc être modifié en conséquence,

⁽⁵⁾ Règlement (UE) n° 1024/2013 du Conseil du 15 octobre 2013 confiant à la Banque centrale européenne des missions spécifiques ayant trait aux politiques en matière de surveillance prudentielle des établissements de crédit (JO L 287 du 29.10.2013, p. 63).

⁽⁶⁾ Directive 2014/59/UE du Parlement européen et du Conseil du 15 mai 2014 établissant un cadre pour le redressement et la résolution des établissements de crédit et des entreprises d'investissement et modifiant la directive 82/891/CEE du Conseil ainsi que les directives du Parlement européen et du Conseil 2001/24/CE, 2002/47/CE, 2004/25/CE, 2005/56/CE, 2007/36/CE, 2011/35/UE, 2012/30/UE et 2013/36/UE et les règlements du Parlement européen et du Conseil (UE) n° 1093/2010 et (UE) n° 648/2012 (JO L 173 du 12.6.2014, p. 190).

⁽⁷⁾ Règlement (UE) n° 806/2014 du Parlement européen et du Conseil du 15 juillet 2014 établissant des règles et une procédure uniformes pour la résolution des établissements de crédit et de certaines entreprises d'investissement dans le cadre d'un mécanisme de résolution unique et d'un Fonds de résolution bancaire unique, et modifiant le règlement (UE) n° 1093/2010 (JO L 225 du 30.7.2014, p. 1).

⁽⁸⁾ 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), modifiant la décision n° 716/2009/CE et abrogeant la décision 2009/77/CE de la Commission (JO L 331 du 15.12.2010, p. 84).

A ADOPTÉ LE PRÉSENT RÈGLEMENT:

Article premier

L'article 2 du règlement délégué (UE) n° 151/2013 est remplacé par le texte suivant:

«Article 2

Accès aux éléments des contrats dérivés conformément aux responsabilités et au mandat de chaque autorité concernée

1. Les référentiels centraux veillent à ce que les éléments des données de transaction portant sur des contrats dérivés rendus accessibles aux entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) n° 648/2012 conformément aux paragraphes 3 à 17 du présent article incluent les données suivantes:

- a) les déclarations de contrats dérivés établies conformément aux tableaux 1 et 2 de l'annexe du règlement délégué (UE) n° 148/2013 (*), notamment les données d'encours les plus récentes des contrats dérivés qui ne sont pas arrivés à échéance ou qui n'ont pas fait l'objet d'une déclaration mentionnant les types d'action «erreur», «résiliation anticipée», «compression» ou «composante de position» dans le champ 93 du tableau 2 de l'annexe du règlement délégué (UE) n° 148/2013;
- b) les éléments pertinents des déclarations de contrats dérivés rejetées par le référentiel central, y compris des déclarations de contrats dérivés rejetées le jour ouvrable précédent et les motifs du rejet;
- c) l'état de rapprochement de tous les contrats dérivés déclarés pour lesquels le référentiel central a conduit le processus de rapprochement conformément à l'article 19 du règlement délégué (UE) n° 150/2013.

2. Les référentiels centraux fournissent aux entités exerçant plusieurs responsabilités ou mandats visés à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) n° 648/2012 un point d'accès unique aux contrats dérivés relevant de ces responsabilités ou mandats.

3. Les référentiels centraux fournissent à l'AEMF l'accès à toutes les données de transaction portant sur des contrats dérivés en vue de l'exercice de ses compétences conformément à ses responsabilités et mandats.

4. Les référentiels centraux fournissent à l'Autorité bancaire européenne (ABE), à l'Autorité européenne des assurances et des pensions professionnelles (AEAPP) et au comité européen du risque systémique (CERS) l'accès à toutes les données de transaction portant sur des contrats dérivés.

5. Les référentiels centraux fournissent à l'autorité pour la coopération des régulateurs de l'énergie (ACER) l'accès à toutes les données de transaction portant sur des contrats dérivés ayant pour sous-jacent l'énergie.

6. Les référentiels centraux fournissent à l'autorité chargée de surveiller les plateformes de négociation l'accès à toutes les données de transaction portant sur des contrats dérivés exécutés sur ces plateformes.

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

- a) l'entreprise est admise à la négociation sur un marché réglementé établi dans l'État membre de l'autorité concernée et les offres publiques d'acquisition portant sur les titres de cette entreprise relèvent des responsabilités et mandats de surveillance de cette autorité;
- b) l'entreprise a son siège statutaire ou son administration centrale dans l'État membre de cette autorité et les offres publiques d'acquisition portant sur les titres de cette entreprise relèvent des responsabilités et mandats de surveillance de cette autorité;
- c) l'entreprise agit en tant qu'offrant au sens de l'article 2, paragraphe 1, point c), de la directive 2004/25/CE pour les entreprises visées aux points a) ou b) et propose une contrepartie incluant des titres.

8. Les référentiels centraux fournissent aux autorités visées à l'article 81, paragraphe 3, point j), du règlement (UE) n° 648/2012 l'accès à toutes les données de transaction portant sur des contrats dérivés pour les marchés, contrats, sous-jacents, indices de référence et contreparties qui relèvent des responsabilités et mandats de surveillance de ces autorités.

9. Les référentiels centraux fournissent à tout membre du SEBC dont l'État membre a pour monnaie l'euro l'accès:
- à toutes les données de transaction portant sur des contrats dérivés dont l'entité de référence est établie dans l'État membre de ce membre du SEBC, ou dans un autre État membre dont la monnaie est l'euro, et relève des compétences de ce membre en vertu de ses responsabilités et mandats de surveillance, ou dont l'obligation de référence est une dette souveraine de l'État membre de ce membre du SEBC ou d'un autre État membre dont la monnaie est l'euro;
 - aux données de position concernant les contrats dérivés libellés en euros.
10. Les référentiels centraux fournissent aux autorités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) n° 648/2012 qui sont chargées de surveiller les risques systémiques pour la stabilité financière et dont l'État membre a pour monnaie l'euro l'accès à toutes les données de transaction portant sur des contrats dérivés conclus sur des plateformes de négociation ou par des contreparties et contreparties centrales relevant des responsabilités et mandats de ces autorités lorsqu'elles surveillent les risques systémiques pour la stabilité financière au sein de la zone euro.
11. Les référentiels centraux fournissent à tout membre du SEBC dont l'État membre n'a pas pour monnaie l'euro l'accès:
- à toutes les données au niveau des transactions pour les contrats dérivés dont l'entité de référence est établie dans l'État membre de ce membre du SEBC et relève des compétences de ce membre en vertu des responsabilités et mandats de surveillance de celui-ci, ou dont l'obligation de référence est une dette souveraine de l'État membre de ce membre du SEBC;
 - aux données de position pour les contrats dérivés libellés dans la monnaie émise par ce membre du SEBC.
12. Les référentiels centraux fournissent aux autorités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) n° 648/2012 qui sont chargées de surveiller les risques systémiques pour la stabilité financière et dont l'État membre n'a pas pour monnaie l'euro l'accès à toutes les données de transaction portant sur des contrats dérivés conclus sur des plateformes de négociation ou par des contreparties et contreparties centrales relevant des responsabilités et mandats de ces autorités lorsqu'elles surveillent les risques systémiques pour la stabilité financière dans un État membre dont la monnaie n'est pas l'euro.
13. Les référentiels centraux fournissent à la BCE, dans l'exercice des tâches qui lui sont confiées au titre du mécanisme de surveillance unique par le règlement (UE) n° 1024/2013 du Conseil, l'accès à toutes les données de transaction portant sur des contrats dérivés conclus par toute contrepartie qui, dans le cadre du mécanisme de surveillance unique, est soumise à la surveillance de la BCE en vertu dudit règlement (**).
14. Les référentiels centraux fournissent aux autorités compétentes visées à l'article 81, paragraphe 3, points o) et p), du règlement (UE) n° 648/2012 l'accès à toutes les données de transaction portant sur les contrats dérivés conclus par toutes les contreparties relevant des responsabilités et mandats de surveillance de ces autorités.
15. Les référentiels centraux fournissent aux autorités de résolution visées à l'article 81, paragraphe 3, point m), du règlement (UE) n° 648/2012 l'accès à toutes les données de transaction portant sur des contrats dérivés conclus par des contreparties relevant des responsabilités et mandats de surveillance de ces autorités.
16. Les référentiels centraux fournissent au Conseil de résolution unique l'accès à toutes les données de transaction portant sur des contrats dérivés conclus par des contreparties relevant du règlement (UE) n° 806/2014.
17. Les référentiels centraux fournissent aux autorités chargées de la surveillance d'une contrepartie centrale et, le cas échéant, au membre du système européen de banques centrales (SEBC) supervisant cette dernière l'accès à toutes les données de transaction portant sur des contrats dérivés compensés par cette contrepartie centrale.
- (*) Règlement délégué (UE) n° 148/2013 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 en ce qui concerne les normes techniques de réglementation sur les informations minimales à déclarer aux référentiels centraux (JO L 52 du 23.2.2013, p. 1).
- (**) Règlement (UE) n° 1024/2013 du Conseil du 15 octobre 2013 confiant à la Banque centrale européenne des missions spécifiques ayant trait aux politiques en matière de surveillance prudentielle des établissements de crédit (JO L 287 du 29.10.2013, p. 63).»

Article 2

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 13 décembre 2018.

Par la Commission
Le président
Jean-Claude JUNCKER
