RÈGLEMENT DÉLÉGUÉ (UE) N° 876/2013 DE LA COMMISSION

du 28 mai 2013

complétant le règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du Conseil en ce qui concerne les normes techniques de réglementation régissant les collèges pour contreparties centrales

(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 18, paragraphe 6,

considérant ce qui suit:

(1) Afin de garantir un fonctionnement cohérent des collèges dans l'ensemble de l'Union, il est nécessaire de préciser les modalités de participation aux collèges pour contreparties centrales afin de simplifier l'exécution des tâches énoncées dans le règlement (UE) n° 648/2012.

(2) L'exclusion d'une banque centrale d'émission d'une monnaie de l'Union pertinente dans laquelle sont libellés des instruments financiers compensés par la contrepartie centrale n'affecte pas le droit de ladite banque de demander et de recevoir des informations en vertu de l'article 18, paragraphe 3, et de l'article 84 du règlement (UE) n° 648/2012.

(3) L'activité d'une contrepartie centrale peut être pertinente pour une banque centrale d'émission au vu des volumes compensés dans la monnaie émise par cette banque centrale. Toutefois, la pertinence d'une monnaie pour la participation d'une banque centrale d'émission au collège de la contrepartie centrale devrait être établie en fonction de la part représentée par cette monnaie dans la moyenne des positions ouvertes compensées par la contrepartie centrale, afin que le collège conserve une taille proportionnée.

(4) Pour garantir que les réunions du collège donnent des résultats effectifs, les objectifs de chaque réunion ou activité devraient être clairement définis par l'autorité compétente de la contrepartie centrale, en consultation avec les membres du collège. Ces objectifs devraient être communiqués suffisamment à l'avance aux participants et sont assortis des documents préparés par l'autorité compétente de la contrepartie centrale ou par d'autres membres du collège afin de favoriser des discussions effectives.

(5) Le rôle des collèges est de simplifier la réalisation des tâches énoncées dans le règlement (UE) n° 648/2012. Les tâches confiées aux membres des collèges, ainsi que la composition, la création et la gestion des collèges ont été établies dans le règlement par le législateur comme des obligations légales et, dès lors, elles sont contraignantes et directement applicables dans tous les États membres. Aux fins du bon fonctionnement d'un collège, un accord écrit devrait être conclu entre les membres dudit collège. Afin de garantir l'utilisation d'accords écrits standard, contenant des bonnes pratiques concernant les activités du collège, et d'approches cohérentes par les autorités compétentes, et afin de faciliter la création des collèges pour contreparties centrales dans le délai prévu à l'article 18, paragraphe 1, du règlement (UE) n° 648/2012, l'AEMF devrait émettre des orientations et des recommandations conformément à l'article 16 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) [2].

(6) Le présent règlement ne devrait pas porter atteinte à la faculté de la Commission de lancer une procédure d'infraction conformément à l'article 258 du TFUE ou de former un recours prévu par l'article 265 et l'article 271, point d), du TFUE.

(7) Pour assurer l'échange d'informations à jour et en temps utile entre les membres du collège, le collège devrait se réunir régulièrement et donner la possibilité aux membres du collège de discuter et d'apporter une contribution à l'examen par l'autorité compétente des arrangements, de la stratégie, du processus et du mécanisme utilisés par la contrepartie centrale pour se conformer au règlement (UE) n° 648/2012, ainsi que de discuter de l'évaluation par l'autorité compétente des risques auxquels la contrepartie centrale est exposée ou pourrait être exposée et qu'elle pourrait poser.

(8) Pour faire en sorte que toutes les opinions des membres du collège soient dûment prises en compte, l'autorité compétente devrait faire tout son possible pour veiller à ce que tout désaccord entre les autorités qui vont devenir membres d'un collège soit réglé avant de finaliser l'accord écrit sur la création et le fonctionnement du collège. Dans son rôle de médiateur, l'AEMF devrait faciliter la finalisation de l'accord, le cas échéant.

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

[1] JO L 201 du 27.7.2012, p. 1.

[2] JO L 331 du 15.12.2010, p. 84.

(10) L'AEMF a consulté, lorsqu'il y avait lieu, l'Autorité bancaire européenne (ABE), le Comité européen du risque systémique (CERS) et les membres du Système européen de banques centrales (SEBC) avant de soumettre le projet de normes techniques sur lequel est fondé le présent règlement. Conformément à l'article 10 du règlement (UE) n° 1095/2010, l'AEMF a mené des consultations publiques ouvertes sur ces projets de normes techniques de réglementation, analysé leurs coûts et avantages potentiels et demandé l'avis du groupe des parties intéressées au secteur financier établi conformément à l'article 37 dudit règlement,

A ADOPTÉ LE PRÉSENT RÈGLEMENT:

Article premier

Définition des monnaies les plus pertinentes

1. Les monnaies de l'Union les plus pertinentes devraient être définies en fonction de la part relative de chaque monnaie dans la moyenne des positions ouvertes en fin de journée de la contrepartie centrale pour tous les instruments financiers qu'elle compense, cette part étant calculée sur une période d'un an.

2. Les monnaies de l'Union les plus pertinentes sont les trois monnaies dont la part relative, calculée conformément au paragraphe 1, est la plus élevée, à condition que la part de chaque monnaie soit supérieure à 10 %.

3. La part relative des monnaies est calculée annuellement.

Article 2

Organisation opérationnelle des collèges

1. Après avoir vérifié que la demande est complète, conformément à l'article 17, paragraphe 3, du règlement (UE) n° 648/2012, l'autorité compétente de la contrepartie centrale transmet une proposition d'accord écrit tel que prévu à l'article 18, paragraphe 5, du règlement (UE) n° 648/2012 aux membres du collège désignés conformément à l'article 18, paragraphe 2, du règlement (UE) n° 648/2012 Cet accord écrit prévoit une procédure de réexamen annuel. Il prévoit aussi une procédure de modification permettant à l'autorité compétente de la contrepartie centrale ou à tout autre membre du collège d'introduire à tout moment un changement, moyennant l'approbation du collège conformément à la procédure définie au présent article.

2. Si les membres du collège mentionnés au paragraphe 1 ne formulent aucun commentaire dans un délai de dix jours civils, l'autorité compétente de la contrepartie centrale procède à l'adoption de l'accord écrit par le collège et à la mise en place de ce dernier, conformément à l'article 18, paragraphe 1, du règlement (UE) n° 648/2012.

3. Si les membres du collège formulent des commentaires concernant la proposition d'accord écrit transmise conformément au paragraphe 1, ils présentent ces commentaires, assortis d'une explication détaillée, à l'autorité compétente de la contrepartie centrale dans un délai de dix jours civils. Le cas échéant, l'autorité compétente de la contrepartie centrale prépare une proposition révisée et organise une réunion pour convenir de la version finale de l'accord écrit en tenant compte du délai visé à l'article 18, paragraphe 1, du règlement (UE) n° 648/2012.

4. Le collège est réputé avoir été mis en place après l'adoption de l'accord écrit.

5. Tous les membres du collège sont liés par l'accord écrit adopté conformément aux paragraphes 1 à 3 du présent article.

Article 3

Participants aux collèges

1. Lorsqu'une demande d'informations est présentée à un collège par une autorité compétente d'un État membre qui n'est pas membre du collège conformément à l'article 18, paragraphe 3, du règlement (UE) n° 648/2012, l'autorité compétente de la contrepartie centrale, après consultation du collège, décide de la manière la plus appropriée de fournir et de demander des informations aux autorités qui ne sont pas membres du collège.

2. Chaque membre du collège désigne un participant pour assister aux réunions du collège et peut désigner un suppléant, à l'exception de l'autorité compétente de la contrepartie centrale, qui peut avoir besoin de désigner des participants supplémentaires qui n'auront pas de droit de vote.

3. Lorsque la banque centrale d'émission de l'une des monnaies de l'Union les plus pertinentes correspond à plusieurs banques centrales, les banques centrales concernées désignent le représentant unique qui participera au collège.

4. Lorsqu'une autorité a le droit de participer au collège au titre de plusieurs des points c) à h) de l'article 18, paragraphe 2, du règlement (UE) n° 648/2012, elle peut désigner des participants supplémentaires qui n'auront pas de droit de vote.

5. Lorsqu'en vertu du présent article, le collège comporte plusieurs participants pour un membre donné, ou lorsque le nombre de membres du collège appartenant au même État membre est supérieur au nombre de votes que ceux-ci détiennent conformément à l'article 19, paragraphe 3, du règlement (UE) n° 648/2012, ledit ou lesdits membres du collège communiquent au collège le nom des participants qui exercent le droit de vote.

Article 4

Gouvernance des collèges

1. L'autorité compétente de la contrepartie centrale veille à ce que les travaux du collège facilitent la réalisation des tâches conformément au règlement (UE) n° 648/2012.

2. Le collège informe l'AEMF de toute tâche qu'il accomplit conformément au paragraphe 1. L'AEMF coordonne le suivi des tâches réalisées par un collège et veille à ce que ses objectifs correspondent le plus possible à ceux des autres collèges.

3. L'autorité compétente de la contrepartie centrale veille au moins à ce que:

a) les objectifs de chaque réunion ou activité du collège soient clairement définis;

b) les réunions ou activités du collège restent efficaces tout en faisant en sorte que tous les membres du collège soient pleinement informés des activités du collège qui les concernent;

c) le calendrier des réunions ou des activités du collège soit établi de telle manière que leur résultat contribue à l'exercice la surveillance de la contrepartie centrale;

d) la contrepartie centrale et les autres parties prenantes clés aient une compréhension claire du rôle et du fonctionnement du collège;

e) les activités du collège soient régulièrement réexaminées et, si le collège ne fonctionne pas de manière efficace, des mesures correctives soient prises;

f) le programme contienne une réunion annuelle de planification de gestion de crise entre membres du collège, en collaboration avec la contrepartie centrale si nécessaire.

4. Pour garantir l'efficacité et l'efficience des travaux du collège, l'autorité compétente de la contrepartie centrale assume le rôle de point de contact central pour toute question relative à l'organisation pratique du collège. L'autorité compétente de la contrepartie centrale accomplit au moins les tâches suivantes:

a) élaborer, actualiser et diffuser la liste de contact des membres du collège;

b) diffuser le programme ainsi que la documentation pour les réunions et les activités du collège;

c) établir les comptes rendus des réunions et officialiser les points d'action;

d) gérer le site web du collège ou un autre système électronique d'échange d'informations, le cas échéant;

e) si possible, fournir des informations et des équipes spécialisées le cas échéant, pour assister le collège dans ses tâches;

f) assurer une diffusion adéquate d'informations aux membres du collège.

5. La fréquence des réunions du collège est décidée par l'autorité compétente de la contrepartie centrale en fonction de la taille de la contrepartie centrale, de sa nature, de son importance et de sa complexité, des répercussions systémiques de la contrepartie centrale sur les différents ressorts territoriaux et monnaies, des éventuelles incidences des activités de la contrepartie centrale, des circonstances externes et des demandes potentielles des membres du collège. Le collège se réunit au moins une fois par an et, si l'autorité compétente de la contrepartie centrale le juge nécessaire, à chaque fois qu'une décision doit être prise conformément aux dispositions du règlement (UE) n° 648/2012. L'autorité compétente de la contrepartie centrale organise régulièrement des réunions entre les membres du collège et les instances dirigeantes de la contrepartie centrale.

6. L'accord écrit visé à l'article 2 prévoit un quorum de deux tiers pour les réunions du collège.

7. L'autorité compétente de la contrepartie centrale s'efforce de garantir que le quorum est atteint à chaque réunion du collège afin que les décisions puissent être prises. À défaut, le président veille à ce que toute décision devant être prise soit reportée jusqu'à ce que le quorum soit atteint en tenant compte des délais applicables définis dans le règlement (UE) n° 648/2012.

Article 5

Échange d'informations entre autorités

1. Chaque membre de collège fournit en temps utile à l'autorité compétente de la contrepartie centrale toutes les informations nécessaires au bon fonctionnement du collège et à la réalisation des activités clés auxquelles participe le membre. L'autorité compétente de la contrepartie centrale fournit en temps utile des informations similaires aux membres du collège.

2. L'autorité compétente de la contrepartie centrale fournit au collège au moins les informations suivantes:

a) les changements significatifs de la structure et de l'actionnariat du groupe de la contrepartie centrale;

b) les changements importants en ce qui concerne le niveau de capital de la contrepartie centrale;

c) les changements dans l'organisation, les instances dirigeantes, les procédures ou les arrangements lorsque ces changements ont une incidence significative sur la gouvernance ou la gestion des risques;

d) une liste des membres compensateurs de la contrepartie centrale;

e) les renseignements concernant les autorités participant à la surveillance de la contrepartie centrale, notamment tout changement dans leurs responsabilités;

f) les informations sur toute menace significative susceptible de faire obstacle au respect, par la contrepartie centrale, du règlement (UE) n° 648/2012 et des règlements délégués et d'exécution pertinents;

g) les difficultés ayant des retombées potentiellement significatives;

h) les facteurs qui suggèrent un risque de contagion potentiellement élevé;

i) les évolutions significatives de la situation financière de la contrepartie centrale;

j) les alertes précoces en cas d'éventuelles difficultés en matière de liquidité ou de fraude importante;

k) les cas de défaillance d'un membre et toute action de suivi;

l) les sanctions et mesures exceptionnelles de surveillance;

m) les rapports sur les problèmes ou incidents opérationnels qui se sont produits et sur les mesures correctives prises;

n) des données régulières sur l'activité de la contrepartie centrale, dont la portée et la fréquence sont convenues dans l'accord écrit prévu à l'article 2;

o) un aperçu des principales propositions commerciales, notamment les nouveaux produits ou services offerts;

p) les modifications apportées au modèle de risque de la contrepartie centrale, aux simulations de crise et aux tests a posteriori;

q) les modifications apportées aux accords d'interopérabilité de la contrepartie centrale, le cas échéant.

3. L'échange d'informations entre les membres du collège reflète leurs responsabilités et leurs besoins d'information. Afin d'éviter des flux d'informations inutiles, l'échange d'informations reste proportionné et centré sur le risque.

4. Les membres du collège prennent en considération les moyens les plus efficaces de se communiquer des informations afin de garantir un échange d'informations continu, en temps opportun et proportionné.

5. Le rapport d'évaluation des risques que l'autorité compétente d'une contrepartie centrale est tenue de préparer conformément à l'article 19, paragraphe 1, du règlement (UE) n° 648/2012 est présenté au collège suffisamment tôt pour que les membres du collège puissent l'analyser et y contribuer si nécessaire.

Article 6

Partage et délégation volontaires de tâches

1. Les membres du collège conviennent de conditions détaillées pour tout arrangement spécifique concernant la délégation de tâches et leur attribution volontaire à d'autres membres, notamment en cas de délégations qui entraînent la délégation des principales tâches de surveillance d'un membre.

2. Les parties aux arrangements de délégation spécifique et d'attribution volontaire de tâches conviennent de conditions détaillées qui couvrent au moins les points suivants:

a) les activités spécifiques, dans des domaines clairement définis, qui seront confiées ou déléguées;

b) les procédures et processus à appliquer;

c) le rôle et les responsabilités de chaque partie;

d) le type d'informations à échanger entre les parties.

3. Le partage et la délégation de tâches ne peuvent viser à modifier la répartition du pouvoir décisionnel de l'autorité compétente de la contrepartie centrale.

Article 7

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 28 mai 2013.

Par la Commission

Le président

José Manuel BARROSO