RÈGLEMENT DÉLÉGUÉ (UE) 2022/1856 DE LA COMMISSION

du 10 juin 2022

modifiant les normes techniques de réglementation définies par le règlement délégué (UE) nº 151/2013 en définissant plus précisément la procédure ainsi que les modalités techniques et opérationnelles pour accéder aux éléments des contrats dérivés

(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) nº 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, quatrième alinéa, en liaison avec son article 81, paragraphe 5, premier alinéa, point d),

considérant ce qui suit:

(1) Afin de comparer et d'agréger les données de manière efficace et efficiente, les référentiels centraux devraient utiliser des modèles au format XML et des messages XML élaborés conformément à la méthodologie ISO 20022 pour donner accès aux éléments des contrats dérivés et communiquer avec les entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) nº 648/2012. Cela ne devrait pas empêcher les référentiels centraux et les entités concernées de convenir de l'utilisation d'autres formats que le XML pour assurer la communication ou donner accès aux éléments des contrats dérivés.

(2) Les éléments des contrats dérivés déclarés auxquels les référentiels centraux donnent accès dans des modèles au format XML élaborés conformément à la méthodologie ISO 20022 aux entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) nº 648/2012 devraient contenir les mêmes informations que celles fournies par les contreparties, les entités responsables de la déclaration et les entités soumettant une déclaration, selon le cas.

(3) Les informations auxquelles les entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) nº 648/2012 devraient pouvoir accéder devraient inclure les éléments des contrats dérivés que les référentiels centraux ont rejetés ou les éléments des contrats dérivés qu'ils ont acceptés mais pour lesquels ils ont émis un avertissement, ainsi que les éléments des contrats dérivés ayant fait l'objet du processus de rapprochement entre référentiels centraux visé à l'article 19 du règlement délégué (UE) nº 150/2013 de la Commission ([2]).

(4) Lorsque la Commission a adopté un acte d'exécution indiquant que le cadre juridique d'un pays tiers satisfait aux conditions énoncées à l'article 76 *bis*, paragraphe 2, du règlement (UE) nº 648/2012, un référentiel central devrait permettre aux autorités compétentes de ce pays tiers d'accéder aux données, en tenant compte du mandat et des responsabilités de ces autorités.

(5) Afin de garantir une approche normalisée et harmonisée pour accéder aux éléments des contrats dérivés et de réduire la charge administrative tant pour les entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) nº 648/2012 que pour les référentiels centraux, il convient de préciser davantage les tâches des référentiels centraux pour donner accès aux éléments des contrats dérivés. Les référentiels centraux devraient désigner une personne chargée d'assurer la liaison avec les entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) nº 648/2012. Ils devraient également publier sur leur site web les instructions destinées à ces entités, en expliquant comment demander accès aux données détenues par les référentiels centraux. Par ailleurs, pour faciliter les demandes d'accès de ces entités aux données pertinentes, les référentiels centraux devraient préparer un formulaire normalisé qui aiderait ces entités à fournir aux référentiels centraux les informations permettant à ces derniers d'établir les exigences d'accès aux données. Enfin, les référentiels centraux devraient mettre en place les dispositifs techniques nécessaires pour permettre aux entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) nº 648/2012 d'accéder aux éléments des contrats dérivés déclarés.

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

([2]) Règlement délégué (UE) nº 150/2013 de la Commission du 19 décembre 2012 complétant le règlement (UE) nº 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 (texte présentant de l'intérêt pour l'EEE) (JO L 52 du 23.2.2013, p. 25).

(6) Il convient dès lors de modifier en conséquence le règlement délégué (UE) n° 151/2013 de la Commission ([3]).

(7) Le présent règlement se fonde sur les projets de normes techniques de réglementation soumis à la Commission par l'Autorité européenne des marchés financiers après consultation des membres du Système européen de banques centrales.

(8) L'Autorité européenne des marchés financiers a procédé à des consultations publiques ouvertes sur les projets de normes techniques de réglementation sur lesquels se fonde le présent règlement, analysé les coûts et avantages potentiels qu'ils impliquent et sollicité l'avis du groupe des parties intéressées au secteur financier institué par l'article 37 du règlement (UE) nº 1095/2010 du Parlement européen et du Conseil ([4]).

(9) Afin que les contreparties et les référentiels centraux disposent de suffisamment de temps pour s'adapter aux nouvelles exigences au titre du règlement d'exécution (UE) 2022/1860 de la Commission ([5]), il convient de reporter la date d'application des dispositions relatives aux nouveaux champs de données,

A ADOPTÉ LE PRÉSENT RÈGLEMENT:

Article premier

Modifications du règlement délégué (UE) nº 151/2013

Le règlement délégué (UE) nº 151/2013 est modifié comme suit:

1) L'article 2 est remplacé par le texte suivant:

«*Article 2*

Accès aux éléments des contrats dérivés

1. Les référentiels centraux mettent directement et immédiatement les éléments des contrats dérivés, conformément aux articles 2 et 3 du présent règlement, à disposition des entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) nº 648/2012, y compris lorsque des accords de délégation existent en vertu de l'article 28 du règlement (UE) nº 1095/2010.

Aux fins du premier alinéa, les référentiels centraux utilisent le format XML et le modèle élaboré conformément à la méthodologie ISO 20022.

2. Les référentiels centraux veillent à ce que les éléments des données de transaction portant sur des contrats dérivés rendues accessibles aux entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) nº 648/2012 conformément au présent article et conformément aux calendriers fixés aux articles 4 et 5 du présent règlement incluent les données suivantes:

a) les déclarations de contrats dérivés établies conformément aux tableaux 1, 2 et 3 de l'annexe du règlement délégué (UE) 2022/1855 de la Commission (*), y compris les valeurs les plus récentes des contrats dérivés en cours visées à l'article 2, paragraphe 2, du règlement d'exécution (UE) 2022/1860 de la Commission (**);

b) les éléments pertinents des déclarations de contrats dérivés que le référentiel central a rejetées ou à propos desquelles il a émis un avertissement le jour ouvrable précédent et les motifs du rejet ou de l'avertissement comme indiqué dans le règlement délégué (UE) 2022/1858 de la Commission (***);

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 3 du règlement délégué (UE) 2022/1855.

([3]) Règlement délégué (UE) nº 151/2013 de la Commission du 19 décembre 2012 complétant le règlement (UE) nº 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 (UE) nº 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 nº 716/2009/CE et abrogeant la décision 2009/77/CE de la Commission (JO L 331 du 15.12.2010, p. 84).

([5]) Règlement d'exécution (UE) 2022/1860 de la Commission du 10 juin 2022 définissant des normes techniques d'exécution pour l'application du règlement (UE) nº 648/2012 du Parlement européen et du Conseil en ce qui concerne les normes, les formats, la fréquence et les méthodes et modalités de déclaration (voir page 68 du présent Journal officiel).

3. Les référentiels centraux fournissent aux entités exerçant plusieurs responsabilités ou mandats visés à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) nº 648/2012 un point d'accès unique aux contrats dérivés relevant de ces responsabilités ou mandats.

4. Les référentiels centraux fournissent à l'Autorité européenne des marchés financiers (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.

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

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

7. 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.

8. 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) et b) du présent paragraphe et propose une contrepartie incluant des titres.

9. Les référentiels centraux fournissent aux autorités visées à l'article 81, paragraphe 3, point j), du règlement (UE) nº 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.

10. Les référentiels centraux fournissent à la Banque centrale européenne (BCE) et à tout membre du système européen de banques centrales (SEBC) dont l'État membre a pour monnaie l'euro l'accès aux données suivantes:

a) toutes les données de transaction portant sur des contrats dérivés dans l'un des cas suivants:

   i) lorsque l'entité de référence du contrat dérivé est établie au sein d'un État membre dont la monnaie est l'euro et relève des responsabilités et mandats de surveillance de ce membre du SEBC;

   ii) lorsque l'obligation de référence est une dette souveraine d'un État membre dont la monnaie est l'euro;

b) les données de position concernant les contrats dérivés libellés en euros.

11. Les référentiels centraux fournissent aux autorités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) nº 648/2012 qui sont chargées de surveiller les risques systémiques pour la stabilité financière au sein de la zone euro et dont l'État membre a pour monnaie l'euro, y compris à la BCE, 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.

12. Les référentiels centraux fournissent à tout membre du SEBC dont l'État membre n'a pas pour monnaie l'euro l'accès aux données suivantes:

a) toutes les données de transaction portant sur des contrats dérivés dans l'un des cas suivants:

   i) lorsque l'entité de référence du contrat dérivé est établie au sein de l'État membre de ce membre du SEBC et lorsque cette entité relève des responsabilités et mandats de surveillance de ce membre du SEBC;

   ii) lorsque l'obligation de référence est une dette souveraine de l'État membre de ce membre du SEBC;

b) les données de position pour les contrats dérivés libellés dans la monnaie émise par ce membre du SEBC.

13. Les référentiels centraux fournissent aux autorités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) nº 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.

14. 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) nº 1024/2013 du Conseil (****), l'accès à toutes les données de transaction portant sur des contrats dérivés conclus par les contreparties qui, dans le cadre du mécanisme de surveillance unique, sont soumises à la surveillance de la BCE en vertu dudit règlement.

15. Les référentiels centraux fournissent aux autorités compétentes visées à l'article 81, paragraphe 3, points o) et p), du règlement (UE) nº 648/2012 l'accès à toutes les données de transaction portant sur les contrats dérivés conclus par les contreparties relevant des responsabilités et mandats de surveillance de ces autorités.

16. Les référentiels centraux fournissent aux autorités de résolution visées à l'article 81, paragraphe 3, point m), du règlement (UE) nº 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.

17. Les référentiels centraux fournissent au Conseil de résolution unique (CRU) l'accès à toutes les données de transaction portant sur des contrats dérivés conclus par des contreparties relevant du règlement (UE) nº 806/2014 du Parlement européen et du Conseil (*****).

18. Les référentiels centraux fournissent aux autorités chargées de la surveillance d'une contrepartie centrale et, le cas échéant, au membre du 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) 2022/1855 de la Commission du 10 juin 2022 complétant le règlement (UE) nº 648/2012 du Parlement européen et du Conseil par des normes techniques de réglementation précisant les informations minimales à déclarer aux référentiels centraux et le type de déclarations à utiliser (JO L 262, 7.10.2022, p. 1).

(**) Règlement d'exécution (UE) 2022/1860 de la Commission du 10 juin 2022 définissant des normes techniques d'exécution pour l'application du règlement (UE) nº 648/2012 du Parlement européen et du Conseil en ce qui concerne les normes, les formats, la fréquence et les méthodes et modalités de déclaration (JO L 262, 7.10.2022, p. 68).

(***) Règlement délégué (UE) 2022/1858 de la Commission du 10 juin 2022 complétant le règlement (UE) nº 648/2012 du Parlement européen et du Conseil par des normes techniques de réglementation précisant les procédures de rapprochement des données entre référentiels centraux et les procédures à appliquer par le référentiel central pour vérifier le respect des obligations de déclaration par la contrepartie déclarante ou par l'entité qui soumet la déclaration et pour vérifier l'exhaustivité et l'exactitude des données déclarées (JO L 262, 7.10.2022, p. 46).

(****) Règlement (UE) nº 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).

(*****) Règlement (UE) nº 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) nº 1093/2010 (OJ L 225 du 30.7.2014, p. 1)».

2) À l'article 3, le paragraphe 3 suivant est ajouté:

«3. Les référentiels centraux permettent aux autorités compétentes de pays tiers pour lesquels la Commission a adopté un acte d'exécution indiquant que le cadre juridique satisfait aux conditions énoncées à l'article 76 *bis*, paragraphe 2, du règlement (UE) nº 648/2012, d'accéder aux données, en tenant compte du mandat et des responsabilités de ces autorités.».

3) L'article 4 est remplacé par le texte suivant:

«*Article 4*

Mise en place de l'accès aux éléments des contrats dérivés

1. Les référentiels centraux exercent les missions suivantes:

a) désignent une ou plusieurs personnes chargées d'assurer la liaison avec les entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) nº 648/2012;

b) publient sur leur site web les instructions que les entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) nº 648/2012 doivent suivre pour demander l'accès aux éléments des données de transaction portant sur des contrats dérivés;

c) fournissent aux entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) nº 648/2012 le formulaire prévu au paragraphe 2 du présent article;

d) mettent en place l'accès des entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) nº 648/2012 aux éléments des données de transaction portant sur des contrats dérivés, sur la base des informations fournies dans le formulaire visé au paragraphe 2 du présent article;

e) mettent en place les dispositifs techniques nécessaires pour permettre aux entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) nº 648/2012 d'accéder aux éléments des données de transaction portant sur des contrats dérivés conformément au paragraphe 2 du présent article;

f) fournissent aux entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) nº 648/2012 un accès direct et immédiat aux éléments des contrats dérivés dans les trente jours calendaires suivant la soumission d'une demande de mise en place d'un tel accès par l'entité concernée.

2. Les entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) nº 648/2012 demandent à accéder aux éléments de contrats dérivés en utilisant un formulaire élaboré et mis à disposition par un référentiel central et en indiquant au minimum les informations suivantes:

a) le nom de l'entité;

b) la personne de contact au sein de l'entité;

c) les responsabilités et mandats légaux de l'entité;

d) les données de sécurité permettant une connexion SSH FTP sécurisée;

e) toute autre information technique pertinente pour l'accès de l'entité aux éléments de contrats dérivés;

f) une mention indiquant si l'entité est compétente pour les contreparties établies dans son État membre, dans la zone euro ou dans l'Union;

g) les types de contreparties pour lesquels l'entité est compétente selon la classification du tableau 1 de l'annexe du règlement d'exécution (UE) 2022/1860;

h) les types de sous-jacents de contrats dérivés pour lesquels l'entité est compétente;

i) les plateformes de négociation surveillées par l'entité, le cas échéant;

j) les contreparties centrales surveillées ou supervisées par l'entité, le cas échéant;

k) la monnaie émise par l'entité, le cas échéant;

l) les points de livraison et d'interconnexion;

m) les indices de référence utilisés dans l'Union dont l'administrateur est surveillé par l'entité;

n) les caractéristiques des sous-jacents surveillés par l'entité;

o) les caractéristiques des parties visées aux champs 16 «membre compensateur», 15 «courtier» du tableau 1 et au champ 142 «entité de référence» du tableau 2 de l'annexe du règlement d'exécution (UE) 2022/1860 qui sont surveillées par l'entité, le cas échéant.».

4) L'article 5 est modifié comme suit:

a) le paragraphe 4 est supprimé;

b) le paragraphe 5 est remplacé par le texte suivant:

«5. Les référentiels centraux mettent en place et tiennent à jour les dispositifs techniques nécessaires pour permettre aux entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) nº 648/2012 de préparer des demandes périodiques prédéfinies d'accès aux éléments de contrats dérivés visés aux articles 2 et 3 du présent règlement dont elles ont besoin pour exercer leurs responsabilités et leurs mandats»;

c) le paragraphe 6 est remplacé par le texte suivant:

«6. Les référentiels centraux fournissent aux entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) nº 648/2012 qui en font la demande l'accès aux éléments des contrats dérivés correspondant à toute combinaison des champs suivants, tels qu'ils figurent à l'annexe du règlement d'exécution (UE) 2022/1860:

a) horodatage de la déclaration;

b) contrepartie 1;

c) contrepartie 2;

d) entité responsable de la déclaration;

e) secteur d'activité de la contrepartie 1;

f) nature de la contrepartie 1;

g) identifiant du courtier;

h) identifiant de l'entité qui soumet la déclaration;

i) catégorie d'actif;

j) classification du produit;

k) type de contrat;

l) code ISIN;

m) identifiant unique de produit;

n) identification du sous-jacent;

o) lieu d'exécution;

p) horodatage de l'exécution;

q) date de prise d'effet;

r) horodatage de la valorisation;

s) date d'expiration;

t) date de résiliation anticipée;

u) contrepartie centrale;

v) membre compensateur;

w) niveau;

x) type d'action;

y) type d'événement»;

d) le paragraphe 7 est remplacé par le texte suivant:

«7. Les référentiels centraux mettent en place et tiennent à jour les capacités techniques nécessaires pour fournir aux entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) nº 648/2012 un accès direct et immédiat aux éléments des contrats dérivés dont elles ont besoin pour exercer leurs responsabilités et leurs mandats. Cet accès est fourni comme suit:

a) lorsqu'une entité visée à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) nº 648/2012 demande à accéder aux éléments de contrats dérivés en cours ou de contrats dérivés qui soit sont arrivés à échéance, soit ont fait l'objet de déclarations mentionnant les types d'action «Erreur», «Résiliation» ou «Composante de position» du champ 151 du tableau 2 de l'annexe du règlement d'exécution (UE) 2022/1860 ou ont fait l'objet d'une déclaration mentionnant le type d'action «Réactivation» non suivie d'une déclaration mentionnant les types d'action «Erreur» ou «Résiliation» pas plus d'un an avant la date de la demande d'accès, le référentiel central donne suite à cette demande au plus tard à 12 h 00, en temps universel coordonné, le premier jour calendaire suivant le jour où elle lui a été présentée;

b) lorsqu'une entité visée à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) n° 648/2012 demande à accéder aux éléments de contrats dérivés qui soit sont arrivés à échéance, soit ont fait l'objet de déclarations mentionnant les types d'action «erreur», «Résiliation» ou «composante de position» du champ 151 du tableau 2 de l'annexe du règlement d'exécution (UE) 2022/1860 ou ont fait l'objet d'une déclaration mentionnant le type d'action «Réactivation» non suivie d'une déclaration mentionnant les types d'action «Erreur» ou «Résiliation» plus d'un an avant la date de la demande d'accès, le référentiel central donne suite à cette demande au plus tard le troisième jour ouvré suivant la présentation de la demande;

c) lorsqu'une demande d'accès à des données présentée par une entité visée à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) n° 648/2012 concerne des contrats dérivés relevant à la fois du point a) et du point b) du présent paragraphe, le référentiel central fournit les éléments de ces contrats dérivés au plus tard le troisième jour ouvré suivant la présentation de la demande.».

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*.

L'article 1er, paragraphe 4, points c) et d), est applicable à partir du 29 avril 2024.

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

Fait à Bruxelles, le 10 juin 2022.

Par la Commission
La présidente
Ursula VON DER LEYEN