





**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)

*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:

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.

**▼B**

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.

**▼M3***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) n° 648/2012, y compris lorsque des accords de délégation existent en vertu de l'article 28 du règlement (UE) n° 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) n° 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 <sup>(1)</sup>, 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 <sup>(2)</sup>;
- 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 <sup>(3)</sup>;

<sup>(1)</sup> Règlement délégué (UE) 2022/1855 de la Commission du 10 juin 2022 complétant le règlement (UE) n° 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).

<sup>(2)</sup> 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) n° 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).

<sup>(3)</sup> Règlement délégué (UE) 2022/1858 de la Commission du 10 juin 2022 complétant le règlement (UE) n° 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).

**▼M3**

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. 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.

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) 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.

**▼M3**

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) n° 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) 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

**▼M3**

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) n° 1024/2013 du Conseil <sup>(1)</sup>, 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) n° 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) 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.

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) n° 806/2014 du Parlement européen et du Conseil <sup>(2)</sup>.

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.

**▼B***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.

<sup>(1)</sup> 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).

<sup>(2)</sup> 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 (OJ L 225 du 30.7.2014, p. 1)

**▼B**

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.

**▼M3**

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) n° 648/2012, d'accéder aux données, en tenant compte du mandat et des responsabilités de ces autorités.

*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) n° 648/2012;
  - b) publient sur leur site web les instructions que les entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) n° 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) n° 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) n° 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) n° 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) n° 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) n° 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:

**▼ M3**

- 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.

**▼ B***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.

**▼ M1**

3. 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) n° 648/2012 de se connecter à l'aide d'une interface sécurisée de machine à machine pour demander et recevoir des données.

Les référentiels centraux utilisent le protocole *SSH File Transfer Protocol* aux fins du premier alinéa. Ils utilisent des messages XML standardisés élaborés conformément à la méthodologie ISO 20022 pour communiquer par l'intermédiaire de cette interface. Ils peuvent en sus, en accord avec l'entité concernée, établir une connexion utilisant un autre protocole défini en commun.

**▼ M3**

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) n° 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

6. Les référentiels centraux fournissent aux entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) n° 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;

**▼ M3**

- u) contrepartie centrale;
- v) membre compensateur;
- w) niveau;
- x) type d'action;
- y) type d'événement

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) n° 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) n° 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.

**▼ M1**

8. Les référentiels centraux accusent réception de toute demande d'accès à des données présentée par des entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) n° 648/2012 et en vérifient l'exactitude et l'exhaustivité. Ils notifient à ces entités le résultat de cette vérification au plus tard soixante minutes après la présentation de la demande.

9. Les référentiels centraux utilisent des protocoles de signature électronique et de cryptage des données pour assurer la confidentialité, l'intégrité et la protection des données mises à la disposition des entités visées à l'article 81, paragraphe 3, du règlement (UE) n° 648/2012.

**▼B**

*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.