

Bruxelles, le 13.12.2018  
C(2018) 8332 final

**RÈGLEMENT DÉLÉGUÉ (UE) .../... DE LA COMMISSION**

**du 13.12.2018**

**complétant le règlement (UE) 2015/2365 du Parlement européen et du Conseil par des normes techniques de réglementation concernant la collecte, la vérification, l'agrégation, la comparaison et la publication de données sur les opérations de financement sur titres (OFT) par les référentiels centraux**

(Texte présentant de l'intérêt pour l'EEE)

## **EXPOSÉ DES MOTIFS**

### **1. CONTEXTE DE L'ACTE DÉLÉGUÉ**

Le règlement (UE) 2015/2365 (ci-après le «règlement»)<sup>1</sup> impose aux référentiels centraux de collecter et de conserver les éléments des opérations de financement sur titres (OFT) qui leur sont déclarés, d'assurer l'accès des autorités compétentes aux éléments collectés et de publier régulièrement des positions agrégées par type d'OFT. À cet effet, l'article 12, paragraphe 3, et l'article 5, paragraphe 7, point a), du règlement habilitent la Commission à adopter, après soumission de projets de normes techniques de réglementation par l'Autorité européenne des marchés financiers (AEMF) et conformément aux articles 10 à 14 du règlement (UE) n° 1095/2010<sup>2</sup> instituant l'AEMF, un règlement délégué définissant des normes opérationnelles pour la collecte, l'agrégation et la comparaison des données par les référentiels centraux, précisant la fréquence et les éléments des positions agrégées qu'ils doivent publier et les procédures qu'ils doivent appliquer pour vérifier le caractère exhaustif et l'exactitude des éléments d'OFT qui leur sont déclarés.

Conformément à l'article 10, paragraphe 1, du règlement (UE) n° 1095/2010, la Commission statue sur l'approbation d'un projet de norme technique de réglementation dans les trois mois suivant sa réception. Elle peut n'approuver le projet de norme technique que partiellement ou moyennant des modifications lorsque les intérêts de l'Union l'imposent, conformément à la procédure spécifique établie dans cet article.

### **2. CONSULTATION AVANT L'ADOPTION DE L'ACTE**

Conformément à l'article 10, paragraphe 1, troisième alinéa, du règlement (UE) n° 1095/2010, l'AEMF a procédé à deux consultations publiques; la première s'est appuyée sur un premier document de réflexion (mars/avril 2016) et la seconde sur un document de consultation présentant des projets de normes techniques de réglementation établis conformément à l'article 12, paragraphe 3, du règlement. Ce document de consultation a été publié le 30 septembre 2016, et la consultation s'est achevée le 30 novembre 2016.

Le groupe des parties intéressées au secteur financier de l'AEMF, constitué conformément à l'article 37 du règlement (UE) n° 1095/2010, a également été consulté sur ces projets de normes techniques.

En outre, l'AEMF a impliqué les membres du Système européen de banques centrales (SEBC) dans l'élaboration des projets de normes techniques de réglementation, comme l'exige l'article 12, paragraphe 3, du règlement.

L'AEMF a joint à ces projets de normes techniques de réglementation un rapport expliquant comment le résultat de ces consultations avait été pris en compte dans l'élaboration de la version finale des projets soumis à la Commission.

Outre l'élaboration de ces projets de normes techniques de réglementation, et conformément à l'article 10, paragraphe 1, troisième alinéa, du règlement (UE) n° 1095/2010, l'AEMF a

---

<sup>1</sup> 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).

<sup>2</sup> 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).

également commandé une analyse des coûts et avantages des projets soumis à la Commission conformément à l'article 12, paragraphe 3, du règlement. Cette analyse figure à l'annexe XII du rapport final sur les projets de normes techniques prévus par le règlement, qui peut être consulté à l'adresse suivante:

[https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/esma70-708036281-82\\_2017\\_sftr\\_final\\_report\\_and\\_cba.pdf](https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/esma70-708036281-82_2017_sftr_final_report_and_cba.pdf).

### **3. ÉLÉMENTS JURIDIQUES DE L'ACTE DÉLÉGUÉ**

L'article 12, paragraphe 3, du règlement dispose que l'AEMF élabore des projets de normes techniques de réglementation précisant les normes opérationnelles à respecter pour la collecte, l'agrégation et la comparaison de données par les référentiels centraux et précisant la fréquence et les éléments des positions agrégées qu'ils doivent publier. En outre, l'article 5, paragraphe 7, point a), dispose que l'AEMF peut élaborer des projets de normes de réglementation précisant les procédures à appliquer par les référentiels centraux pour vérifier l'exhaustivité et l'exactitude des éléments d'OFT qui leur sont déclarés. Le pouvoir d'adopter des règlements délégués dans ces domaines est conféré à la Commission par l'article 5, paragraphe 7, et par l'article 12, paragraphe 3, du règlement. Afin de garantir la cohérence des dispositions susmentionnées et de permettre aux référentiels centraux d'en avoir une vision globale, il est souhaitable de regrouper ces normes techniques de réglementation dans un règlement unique.

#### **3.1. Article 1<sup>er</sup>**

Le règlement délégué précise les étapes de vérification nécessaires à la validation des données collectées par le référentiel central, notamment en ce qui concerne la vérification des informations fournies sur les sûretés. Le règlement délégué dispose également que les déclarations d'OFT qui s'avèrent non conformes à l'issue de la procédure de vérification sont rejetées et que des informations détaillées sur le résultat des validations de données sont fournies sous format XML aux contreparties et entités déclarantes, au plus tard soixante minutes après réception de la déclaration.

#### **3.2. Article 2**

Le règlement délégué définit le processus détaillé de rapprochement, par le référentiel central, des données transmises par l'une des contreparties à l'opération de financement sur titres avec celles transmises par l'autre contrepartie, y compris en cas de déclaration à un autre référentiel central. En outre, à la fin de chaque jour ouvrable, le référentiel central doit vérifier, avec chaque référentiel central avec lequel il a procédé au rapprochement d'OFT déclarées, le nombre total d'OFT déclarées qui ont été rapprochées. Enfin, les référentiels centraux sont tenus de fournir à la contrepartie et aux entités déclarantes les résultats du processus de rapprochement sous format XML au plus tard soixante minutes après la conclusion du processus.

#### **3.3. Article 3**

Le règlement délégué précise les informations que les référentiels centraux doivent soumettre à la contrepartie et aux entités déclarantes, à la fin de chaque jour ouvrable, sur les OFT pertinentes pour la contrepartie.

#### **3.4. Article 4**

Le règlement délégué impose aux référentiels centraux de veiller à ce que les autorités visées à son article 12, paragraphe 2, aient accès aux éléments des OFT et il précise sous quel format cet accès doit être fourni.

### **3.5. Article 5**

Le règlement délégué précise à quelles données au niveau des positions les autorités compétentes doivent avoir accès concernant les expositions entre contreparties déclarantes, et sous quel format cet accès doit leur être fourni. Il dispose que les autorités doivent avoir accès à ces données le plus rapidement possible, et au plus tard le jour ouvrable suivant la réception de la déclaration de l'opération de financement sur titres correspondante. Les référentiels centraux doivent également veiller à ce que les autorités aient accès à des données au niveau agrégé, calculées suivant des normes et processus communément admis de collecte et d'agrégation de ces données au niveau international.

### **3.6. Article 6**

Le règlement délégué définit les différents critères d'agrégation sur la base desquels doivent être calculés i) le montant du principal de l'opération de financement sur titres, ii) le nombre d'opérations et iii) la valeur de marché des sûretés.

### **3.7. Article 7**

Le règlement délégué dispose que les référentiels centraux doivent publier des données de positions agrégées à un rythme hebdomadaire, et au plus tard le mardi midi pour les OFT déclarées jusqu'à la fin du vendredi précédent. Le règlement délégué prévoit que les positions agrégées doivent être publiées en euros et sous la forme d'un tableau définie à l'annexe du règlement délégué. Les données relatives aux positions agrégées doivent être conservées sur le site web du référentiel central pendant au moins 104 semaines.

### **3.8. Article 8**

Le présent règlement entre en vigueur le vingtième jour suivant celui de sa publication au *Journal officiel de l'Union européenne*.

### **3.9. Annexe I**

Dans sa première annexe, le règlement délégué précise dans trois tableaux i) les champs de données devant faire l'objet d'un rapprochement pour les OFT, y compris, le cas échéant, leurs niveaux de tolérance, ii) les différentes catégories de motifs de rejet d'une déclaration d'OFT, et iii) les différentes catégories de rapprochement, ainsi que les valeurs qui peuvent leur être affectées.

### **3.10. Annexe II:**

La deuxième annexe du règlement délégué contient le tableau à l'aide duquel les référentiels centraux doivent publier les données de position agrégées.

# RÈGLEMENT DÉLÉGUÉ (UE) .../... DE LA COMMISSION

du 13.12.2018

**complétant le règlement (UE) 2015/2365 du Parlement européen et du Conseil par des normes techniques de réglementation concernant la collecte, la vérification, l'agrégation, la comparaison et la publication de données sur les opérations de financement sur titres (OFT) 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) 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<sup>1</sup>, et notamment son article 5, paragraphe 7, point a), et son article 12, paragraphe 3, points a) et b),

considérant ce qui suit:

- (1) Afin d'assurer la haute qualité des éléments d'opérations de financement sur titres (OFT) déclarés aux référentiels centraux, ceux-ci devraient vérifier l'identité des entités qui soumettent les déclarations, la cohérence logique de l'ordre dans lequel ces éléments sont déclarés ainsi que leur exhaustivité et leur exactitude.
- (2) Pour la même raison, les référentiels centraux devraient procéder au rapprochement des éléments de chaque déclaration d'OFT qu'ils reçoivent. Il conviendrait de définir une procédure normalisée pour permettre aux référentiels centraux d'effectuer ce rapprochement de manière cohérente et réduire les risques de non-concordance de certains éléments. Il est vrai que certains éléments d'OFT peuvent ne pas être identiques en raison des spécificités des technologies utilisées par les entités qui soumettent les déclarations. Il est donc nécessaire de prévoir certaines marges de tolérance afin que de légères différences entre les éléments d'OFT déclarés n'empêchent pas les autorités d'analyser les données avec un degré de confiance suffisant.
- (3) L'on peut s'attendre à une amélioration progressive de la part des entités qui soumettent les déclarations, tant en termes de réduction du nombre de déclarations rejetées qu'en termes de déclarations concordantes. Ces entités devraient néanmoins disposer d'un délai suffisant pour s'adapter aux exigences en matière de déclaration, notamment pour empêcher une accumulation de transactions non rapprochées dès l'entrée en application de l'obligation de déclaration. Il convient, dans un premier temps, de limiter le rapprochement à un nombre de champs réduit.
- (4) Les entités qui soumettent les déclarations et les entités responsables des déclarations, le cas échéant, devraient pouvoir s'assurer qu'elles respectent leurs obligations déclaratives au titre du règlement (UE) 2015/2365. Elles devraient donc pouvoir

---

<sup>1</sup> JO L 337 du 23.12.2015, p. 1.

accéder quotidiennement à certaines informations sur ces déclarations, notamment sur le résultat de la vérification de ces dernières et sur l'état d'avancement du rapprochement des données déclarées. Il est par conséquent nécessaire de préciser les informations qu'un référentiel central devrait mettre à la disposition de ces entités à la fin de chaque jour ouvrable.

- (5) Pour contribuer à l'intégrité des éléments d'OFT, l'accès direct et immédiat prévu à l'article 12, paragraphe 2, du règlement (UE) 2015/2365 devrait être fourni de manière harmonisée et cohérente. Pour harmoniser les déclarations, minimiser les coûts pour le secteur financier et garantir la comparabilité et l'agrégation cohérente des données d'un référentiel central à l'autre, il convient que toutes les déclarations produites et tous les échanges soient effectués au format XML et selon une méthodologie largement utilisée dans le secteur.
- (6) L'accès aux données au niveau des positions sur les expositions entre deux contreparties est essentiel pour permettre aux entités visées à l'article 12, paragraphe 2, du règlement (UE) 2015/2365 de déterminer les sources potentielles de risques, systémiques ou non, pour la stabilité financière.
- (7) Afin d'assurer au public un niveau adéquat de transparence des OFT, les critères utilisés pour l'agrégation des positions devraient permettre au grand public de comprendre le fonctionnement des marchés des OFT, sans pour autant compromettre la confidentialité des données déclarées aux référentiels centraux. La fréquence et les éléments de la publication par un référentiel central, conformément à l'article 12, paragraphe 1, du règlement (UE) 2015/2365, de positions agrégées devraient être définis sur la base du cadre correspondant prévu par le règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du Conseil<sup>2</sup> pour les contrats dérivés.
- (8) 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), conformément à la procédure prévue à l'article 10 du règlement (UE) n° 1095/2010 du Parlement européen et du Conseil<sup>3</sup>.
- (9) Les dispositions du présent règlement portent sur des normes opérationnelles pour la collecte, l'agrégation et la comparaison de données par les référentiels centraux et sur les procédures que ces derniers doivent appliquer pour vérifier l'exhaustivité et l'exactitude des éléments qui leur sont déclarés concernant des OFT. Afin de garantir la cohérence de ces dispositions et de permettre aux référentiels centraux d'en avoir une vision globale, il est souhaitable de regrouper les normes techniques de réglementation concernées dans un règlement unique.
- (10) L'AEMF a mené des consultations publiques ouvertes sur ces projets de normes techniques de réglementation, analysé les coûts et avantages potentiels qu'elles impliquent et demandé l'avis du groupe des parties intéressées au secteur financier institué en application de l'article 37 du règlement (UE) n° 1095/2010,

---

<sup>2</sup> 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 (JO L 201 du 27.7.2012, p. 1).

<sup>3</sup> 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*

#### ***Vérification par les référentiels centraux des déclarations d'OFT***

1. Les référentiels centraux vérifient tout ce qui suit dans chaque déclaration d'OFT qu'ils reçoivent:
  - (a) l'identité de l'entité qui soumet la déclaration, indiquée dans le champ 2 du tableau 1 de l'annexe I du [OP: insérer la référence pour C(2018)7658];
  - (b) que le modèle XML utilisé pour déclarer une OFT respecte la méthodologie ISO 20022, conformément au [OP: insérer la référence pour C(2018)7658];
  - (c) que l'entité qui soumet la déclaration, si elle est différente de la contrepartie déclarante indiquée dans le champ 3 du tableau 1 de l'annexe I du [OP: insérer la référence pour C(2018)7658], est dûment autorisée à effectuer la déclaration pour le compte de la contrepartie déclarante, sauf dans le cas prévu à l'article 4, paragraphe 3, du règlement (UE) 2015/2365;
  - (d) que la déclaration d'OFT n'a pas déjà été soumise antérieurement;
  - (e) que la déclaration d'OFT, si elle mentionne le type d'action «Modification», concerne bien une déclaration d'OFT soumise antérieurement;
  - (f) que la déclaration d'OFT, si elle mentionne le type d'action «Modification», ne concerne pas une OFT déclarée comme annulée;
  - (g) que la déclaration d'OFT ne mentionne pas le type d'action «Nouveau» concernant une OFT qui a déjà été déclarée;
  - (h) que la déclaration d'OFT ne mentionne pas le type d'action «Composante de la position» concernant une OFT qui a déjà été déclarée;
  - (i) que la déclaration d'OFT ne vise pas à modifier les éléments relatifs à l'entité qui soumet la déclaration, à la contrepartie déclarante ou à l'autre contrepartie d'une OFT déclarée antérieurement;
  - (j) que la déclaration d'OFT ne vise pas à modifier une déclaration d'OFT existante en indiquant une date de valeur postérieure à la date déclarée d'échéance de l'OFT;
  - (k) l'exactitude et l'exhaustivité de la déclaration d'OFT.
2. Les référentiels centraux vérifient si des informations sur les sûretés figurent bien dans les champs 73 à 96 du tableau 2 de l'annexe I du [OP: insérer la référence pour C(2018)7658] pour les OFT pour lesquelles le champ 72 «Code signalétique Prêt de titres non garanti» de ce même tableau est déclaré comme «faux». Les référentiels centraux notifient, conformément à l'article 3 du présent règlement, le résultat de la vérification à l'entité qui soumet la déclaration, à la contrepartie déclarante et à l'entité responsable de la déclaration, le cas échéant.
3. Les référentiels centraux rejettent toute déclaration d'OFT qui ne respecte pas l'une des exigences énoncées au paragraphe 1 et lui attribuent l'une des catégories du tableau 2 de l'annexe I du présent règlement.
4. Dans les soixante minutes suivant la réception d'une déclaration d'OFT, les référentiels centraux fournissent à l'entité qui soumet la déclaration et à la contrepartie déclarante, ainsi que, le cas échéant, à l'entité responsable de la

déclaration, des informations détaillées sur les résultats de la vérification des données prévue au paragraphe 1. Les référentiels centraux fournissent ces résultats sous un format XML et selon un modèle élaborés selon la méthodologie ISO 20022. Ces résultats indiquent, le cas échéant, les motifs précis du rejet, en vertu du paragraphe 3, d'une déclaration d'OFT.

## *Article 2*

### ***Rapprochement des données par les référentiels centraux***

1. Le référentiel central procède au rapprochement d'une OFT déclarée en prenant les mesures décrites au paragraphe 2, pour autant que toutes les conditions suivantes soient remplies:
  - (a) le référentiel central a achevé les vérifications prévues à l'article 1, paragraphes 1 et 2;
  - (b) les contreparties à l'OFT déclarée sont toutes deux soumises à une obligation de déclaration;
  - (c) le référentiel central n'a pas reçu, pour l'OFT déclarée, de déclaration ultérieure mentionnant le type d'action «Erreur».
2. Si toutes les conditions posées au paragraphe 1 sont remplies, le référentiel central prend les mesures suivantes, en utilisant la valeur déclarée en dernier lieu pour chaque champ du tableau 1 de l'annexe I du présent règlement:
  - (a) un référentiel central qui reçoit une déclaration d'OFT vérifie s'il a reçu une déclaration d'OFT correspondante de l'autre contrepartie ou pour le compte de celle-ci;
  - (b) s'il n'a pas reçu la déclaration d'OFT correspondante visée au point a), le référentiel central s'efforce d'identifier le référentiel central qui a reçu cette déclaration d'OFT correspondante, en communiquant à tous les référentiels centraux enregistrés les valeurs des champs suivants, pour l'OFT déclarée: «Identifiant de transaction unique», «Contrepartie déclarante», «Autre contrepartie» et «Type d'accord-cadre»;
  - (c) un référentiel central qui constate qu'un autre référentiel central a reçu la déclaration d'OFT correspondante visée au point a) échange avec celui-ci les éléments de l'OFT déclarée, sous un format XML et selon un modèle élaborés selon la méthodologie ISO 20022;
  - (d) sous réserve du point e), le référentiel central traite comme rapprochée une SFT déclarée lorsque les éléments de cette OFT recoupent ceux de la déclaration d'OFT correspondante visée au point a) du présent paragraphe;
  - (e) le référentiel central s'efforce de faire concorder séparément les champs relatifs aux données sur les prêts et les champs relatifs aux données sur les sûretés de l'OFT déclarée, en respectant les limites de tolérance et les dates d'application indiquées dans le tableau 1 de l'annexe I du présent règlement;
  - (f) pour chaque OFT déclarée, le référentiel central attribue ensuite des valeurs aux catégories de rapprochement, comme prévu au tableau 3 de l'annexe I du présent règlement;
  - (g) le référentiel central prend dès que possible les mesures visées aux points a) à f) du présent paragraphe et ne prend plus de telles mesures après 18h00, en temps universel coordonné, d'un jour ouvrable donné;



- (h) si le référentiel central ne parvient pas à effectuer le rapprochement d'une OFT déclarée, il s'efforce d'en faire concorder les éléments le jour ouvrable suivant. Il cesse d'essayer de procéder au rapprochement de cette OFT trente jours calendaires après l'échéance déclarée de l'OFT ou lorsqu'il reçoit une déclaration la concernant mentionnant le type d'action «Cessation» ou «Composante de position».
3. À la fin de chaque jour ouvrable, le référentiel central vérifie avec chaque référentiel central avec lequel il a procédé au rapprochement d'OFT déclarées le nombre total d'OFT déclarées qui ont été rapprochées.
4. Au plus tard dans les soixante minutes qui suivent la conclusion, conformément au paragraphe 2, point g), du processus de réconciliation, le référentiel central fournit à l'entité qui soumet la déclaration et à la contrepartie déclarante, ainsi qu'à l'entité responsable de la déclaration, le cas échéant, les résultats du rapprochement qu'il a effectué concernant les OFT déclarées. Le référentiel central fournit ces résultats, y compris des informations sur les champs qui n'ont pas pu être rapprochés, sous un format XML et selon un modèle élaborés selon la méthodologie ISO 20022.

### *Article 3*

#### ***Mécanismes de réponse en fin de journée***

À la fin de chaque jour ouvrable, le référentiel central met les informations suivantes sur les OFT concernées à la disposition de l'entité qui soumet la déclaration et de la contrepartie déclarante, ainsi que, le cas échéant, de l'entité responsable de la déclaration, sous un format XML et selon un modèle élaborés conformément à la méthodologie ISO 20022:

- (a) les OFT déclarées ce jour-là;
- (b) les valeurs les plus récentes des OFT qui ne sont pas arrivées à échéance ou qui n'ont pas fait l'objet d'une déclaration mentionnant l'un des types d'action «Erreur», «Cessation» ou «Composante de position»;
- (c) les identifiants de transaction uniques (UTI) des OFT pour lesquelles il est déclaré «faux» dans le champ 72 du tableau 2 de l'annexe I du [OP: insérer la référence pour C(2018)7658] et pour lesquelles il n'a pas encore été transmis d'informations sur les sûretés dans les champs 73 à 96 du même tableau;
- (d) les déclarations d'OFT rejetées ce jour-là;
- (e) l'état de rapprochement de toutes les OFT déclarées, à l'exception de celles qui sont arrivées à expiration ou pour lesquelles des déclarations mentionnant le type d'action «Cessation» ou «Composante de position» ont été reçues plus d'un mois avant ce jour-là.

### *Article 4*

#### ***Accès aux éléments des OFT***

Les référentiels centraux assurent aux entités visées à l'article 12, paragraphe 2, du règlement (UE) 2015/2365 un accès direct et immédiat aux éléments des OFT sous une forme électronique lisible par machine, y compris en cas de délégation en vertu de l'article 28 du règlement (UE) n° 1095/2010, conformément au [OP: insérer la référence pour C(2018)8330].

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

## Article 5

### *Calcul des données au niveau des positions et accès à celles-ci*

1. Les référentiels centraux calculent les données au niveau des positions sur les expositions entre contreparties en termes de prêts et de sûretés. Le calcul des données au niveau des positions se fonde sur les critères suivants:
  - (a) les valeurs des catégories de rapprochement du tableau 3 de l'annexe I du présent règlement;
  - (b) le type d'OFT,
  - (c) le secteur des contreparties;
  - (d) le statut en termes de compensation;
  - (e) la conclusion ou non sur une plate-forme de négociation;
  - (f) le type de sûreté;
  - (g) la monnaie de la même espèce;
  - (h) la tranche de maturité;
  - (i) la tranche de décote;
  - (j) les référentiels centraux auxquels l'autre contrepartie a déclaré les éléments d'OFT.
2. Les référentiels centraux veillent à ce que les entités visées à l'article 12, paragraphe 2, du règlement (UE) 2015/2365 aient accès aux données au niveau des positions conformément aux modalités d'accès aux données définies dans le [OP: insérer la référence pour C(2018)8330].
3. Les données au niveau des positions visées au paragraphe 1 sont fournies sous une forme électronique lisible par machine, sous un format XML et selon un modèle élaborés conformément à la méthodologie ISO 20022.
4. L'accès prévu au paragraphe 2 est fourni dès que possible et au plus tard le jour ouvrable suivant la réception d'une déclaration d'OFT conformément à l'article 4, paragraphe 1, du règlement (UE) 2015/2365.
5. Les référentiels centraux fournissent aux entités visées à l'article 12, paragraphe 2, du règlement (UE) 2015/2365 un accès à des données au niveau agrégé, conformément aux modalités d'accès aux données définies dans le [OP: insérer la référence à la NTR sur les niveaux d'accès prévue par l'article 12, paragraphe 3, points c) et d), du règlement sur les OFT], calculées suivant des normes et processus communément admis de collecte et d'agrégation au niveau international des données relatives aux OFT.

## Article 6

### *Calcul de données de position agrégées pour publication*

1. Les référentiels centraux calculent, conformément aux critères définis aux paragraphes 2 et 3, des données de position agrégées pour les valeurs suivantes:
  - (a) le montant en principal des contrats de mise en pension, des opérations d'achat-revente ou de vente-rachat, le volume total de titres ou de matières premières prêtés ou empruntés et le montant des prêts sur marge;
  - (b) le nombre d'UTI correspondant aux OFT pertinentes;

- (c) la valeur de marché des sûretés.
2. Les référentiels centraux calculent des données de position agrégées pour toutes les OFT déclarées avec la mention du type d'action «Nouveau» entre le samedi 00h00mn00s (TUC) et le vendredi 23h59mn59s (TUC) sur la base des critères suivants et des valeurs correspondantes du tableau 1 de l'annexe II du présent règlement:
- (a) la localisation de la contrepartie déclarante ou, le cas échéant, de la succursale concernée;
  - (b) la localisation de l'autre contrepartie ou, le cas échéant, de la succursale concernée;
  - (c) le type d'OFT,
  - (d) le statut de l'OFT en termes de rapprochement, comme indiqué au tableau 3 de l'annexe I du présent règlement;
  - (e) le type de plate-forme sur laquelle l'OFT a été conclue;
  - (f) le fait qu'il y ait eu ou non compensation de l'OFT;
  - (g) la méthode de transfert de la sûreté;
  - (h) chaque indice utilisé comme référence lors d'une OFT négociée sur une plate-forme d'exécution autre que «XXXX», dès lors que le montant nominal agrégé déclaré au référentiel central pour l'indice est supérieur à cinq milliards d'EUR et qu'au moins six contreparties différentes ont déclaré les OFT concernées au référentiel central.
3. Au plus tard le vendredi 23h59mn59s (TUC), les référentiels centraux calculent des données de position agrégées pour toutes les OFT qui ne sont pas arrivées à échéance ou qui n'ont pas fait l'objet d'une déclaration mentionnant l'un des types d'action «Erreur», «Cessation» ou «Composante de position», en se basant sur les critères suivants et sur les valeurs correspondantes du tableau 1 de l'annexe II du présent règlement:
- (a) la localisation de la contrepartie déclarante ou, le cas échéant, de la succursale concernée;
  - (b) la localisation de l'autre contrepartie ou, le cas échéant, de la succursale concernée;
  - (c) le type d'OFT,
  - (d) le statut de l'OFT en termes de rapprochement, comme indiqué au tableau 3 de l'annexe I du présent règlement;
  - (e) le type de plate-forme sur laquelle l'OFT a été conclue;
  - (f) le fait qu'il y ait eu ou non compensation de l'OFT;
  - (g) la méthode de transfert de la sûreté;
  - (h) chaque indice utilisé comme référence lors d'une OFT négociée sur une plate-forme d'exécution autre que «XXXX», dès lors que le montant nominal agrégé déclaré au référentiel central pour l'indice est supérieur à 5 milliards d'EUR et qu'au moins six contreparties différentes ont déclaré les OFT concernées au référentiel central.
4. Les référentiels centraux ont une procédure permettant d'identifier les valeurs extraordinaires parmi les données de position agrégées.
5. Les référentiels centraux ont une procédure permettant d'effectuer et de notifier les corrections à apporter aux données de position agrégées, notamment celles découlant

de déclarations mentionnant le type d'action «Erreur», et de publier les données agrégées originales et corrigées.

#### *Article 7*

##### ***Publication de données de position agrégées***

1. Les référentiels centraux publient sur leur site web des données de position agrégées, calculées conformément à l'article 6, à un rythme hebdomadaire et au plus tard le mardi midi, pour les OFT déclarées au plus tard à 23h59min59s (TUC) le vendredi précédent.
2. Les référentiels centraux publient toutes les données de position agrégées en euros et appliquent les taux de change publiés sur le site web de la BCE le vendredi précédant la publication de ces données.
3. Les référentiels centraux veillent à ce que les données de position agrégées soient publiées sous le format d'un tableau conforme à l'annexe II du présent règlement et qui permette le téléchargement des données.
4. Les données de position agrégées qu'un référentiel central a publiées sur son site web restent sur ce site pendant au moins 104 semaines.

#### *Article 8*

##### ***Entrée en vigueur***

Le présent règlement entre en vigueur le vingtième jour suivant celui de sa publication au *Journal officiel de l'Union européenne*.

Il est obligatoire dans tous ses éléments et directement applicable dans tout État membre.

Fait à Bruxelles, le 13.12.2018

*Par la Commission*  
*Le président,*  
*Jean-Claude JUNCKER*