



European Securities and
Markets Authority

Orientations

sur les informations périodiques et la notification de toute modification substantielle que les référentiels centraux doivent transmettre à l'ESMA



Table des matières

1. Références législatives, acronymes et définitions	5
2. Note de synthèse	9
3. Champ d'application.....	11
4. Objet.....	11
5. Cahier des charges de la déclaration.....	13
5.1. Aspects généraux	13
5.2. Canaux de déclaration	14
5.3. Convention de dénomination des fichiers	14
5.4. Validations des modèles	14
5.5. Programme, fréquence et date limite de la déclaration	15
6. Déclaration d'informations périodiques	20
6.1. Module: déclaration relative à la gouvernance et aux activités.....	20
6.2. Module: déclaration d'informations financières.....	23
6.3. Module: déclaration d'informations relatives au contrôle interne	24
6.4. Module: déclaration d'informations relatives aux technologies de l'information et à la sécurité de l'information	26
6.5. Module: déclaration des données	27
6.6. Module: déclaration relative au calcul des redevances de surveillance prudentielle	28
7. Déclaration d'informations ponctuelles	29
7.1. Notification de toute modification substantielle des conditions d'enregistrement initiales et des informations pertinentes relatives à la surveillance	29
7.2. Autres notifications.....	32
7.3. Plan de liquidation – Principaux documents à transmettre à l'ESMA	33

1. Références législatives, acronymes et définitions

Références législatives

<i>EMIR</i>	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 Texte présentant de l'intérêt pour l'EEE
<i>Règlement instituant l'ESMA</i>	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 ¹
<i>NTR modifiée sur l'enregistrement (EMIR)</i>	Règlement délégué (UE) n° 2019/362 de la Commission du 13 décembre 2018 modifiant le règlement délégué (UE) n° 150/2013 en ce qui concerne les normes techniques de réglementation précisant les détails de la demande d'enregistrement en tant que référentiel central
<i>NTR sur l'enregistrement (EMIR)</i>	Règlement délégué (UE) n° 150/2013 de la Commission complétant le règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du Conseil sur les produits dérivés de gré à gré, les contreparties centrales et les référentiels centraux en ce qui concerne les normes techniques de réglementation précisant les détails de la demande d'enregistrement en tant que référentiel central
<i>NTR sur l'enregistrement (SFTR)</i>	Règlement délégué (UE) 2019/359 de la Commission du 13 décembre 2018 complétant le règlement (UE) 2015/2365 du Parlement européen et du Conseil par des normes techniques de réglementation précisant les détails de la demande d'enregistrement en tant que référentiel central ou d'extension de cet enregistrement
<i>NTR sur l'accès aux données (EMIR)</i>	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

¹ JO L 331 du 15.12.2010, p. 84.

les normes opérationnelles à respecter pour l'agrégation, la comparaison et l'accessibilité des données

<i>NTR sur l'accès aux données (SFTR)</i>	Règlement délégué (UE) 2019/357 de la Commission du 13 décembre 2018 complétant le règlement (UE) 2015/2365 du Parlement européen et du Conseil par des normes techniques de réglementation concernant l'accès aux éléments relatifs aux titres
<i>Règlement délégué de la Commission sur les frais (EMIR)</i>	Règlement délégué (UE) n° 1003/2013 de la Commission du 12 juillet 2013 complétant le règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du Conseil en ce qui concerne les frais à payer par les référentiels centraux à l'Autorité européenne des marchés financiers
<i>Règlement délégué de la Commission sur les frais (SFTR)</i>	Règlement délégué (UE) 2019/360 de la Commission du 13 décembre 2018 complétant le règlement (UE) 2015/2365 du Parlement européen et du Conseil en ce qui concerne les frais à payer par les référentiels centraux à l'Autorité européenne des marchés financiers
<i>SFTR</i>	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

Acronymes

<i>ACN</i>	Autorité compétente nationale
<i>AI</i>	Audit interne
<i>ANC</i>	Agence de notation de crédit
<i>ANS</i>	Accord de niveau de service
<i>CC</i>	Contrôle de la conformité
<i>CCP</i>	Chambre de compensation à contrepartie centrale
<i>CEO</i>	Chief Executive Officer: président directeur général
<i>CISO</i>	Chief Information Security Officer: responsable en chef de la sécurité de l'information
<i>COO</i>	Chief Operations Officer: directeur des opérations

<i>CRO</i>	Chief Risk Officer: directeur des risques
<i>CTO</i>	Chief Technology Officer: directeur des techniques informatiques
<i>DC</i>	Document de consultation
<i>ESMA</i>	European Securities and Markets Authority (AEMF – Autorité européenne des marchés financiers)
<i>ETP</i>	Employé à temps plein
<i>IT</i>	Technologies de l'information
<i>LDT</i>	Livre de travail
<i>CCO</i>	Chief Compliance Officer: responsable de la conformité
<i>NTR</i>	Normes techniques de réglementation
<i>PCA</i>	Plan de continuité des activités
<i>RC</i>	Référentiel central
<i>SFTP</i>	Protocole «SSH File Transfer»
<i>SI</i>	Sécurité de l'information
<i>TRACE</i>	Système d'accès unique aux données des référentiels centraux
<i>UE</i>	Union européenne

Notions de base

<i>Informations périodiques</i>	Données de supervision communiquées par les référentiels centraux à l'ESMA à une fréquence prédéterminée.
<i>Informations ponctuelles</i>	Données de supervision communiquées par les référentiels centraux à l'ESMA à la suite d'une modification substantielle de données déjà communiquées à l'ESMA.
<i>Dès que possible</i>	Les données de supervision doivent être communiquées par le référentiel central sans retard injustifié.

Format machine lisible par

a) il s'agit d'un format électronique conçu pour être directement et automatiquement lu par un ordinateur. Le format électronique doit être précisé par des normes libres, non propriétaires et ouvertes. Le format électronique doit inclure le type de fichiers ou de messages, les règles permettant de les identifier, ainsi que le nom et le type de données des champs qu'ils contiennent;

b) il est stocké dans une architecture informatique permettant un accès automatique;

c) il est suffisamment robuste pour garantir la continuité et la régularité des services fournis et est accessible suffisamment rapidement;

d) il est accessible, lisible, utilisable et copiable par des logiciels informatiques publiquement disponibles et gratuits.

Entité participant au système des référentiels centraux

Toute entité liée à au moins un référentiel central enregistré ou reconnu par un accord contractuel aux fins de la déclaration des contrats dérivés en vertu de l'article 9 d'EMIR ou des opérations de financement sur titres en vertu de l'article 4 de SFTR. L'entité participant au système des référentiels centraux peut être une entité qui soumet la déclaration, une entité responsable de la déclaration, une contrepartie déclarante ou une chambre de compensation à contrepartie centrale, ou encore une entité disposant uniquement d'un accès en consultation au référentiel central.

Entité associée

Toute entité qui contrôle directement ou indirectement le référentiel central, ou qui est contrôlée directement ou indirectement par le référentiel central, ou qui est sous contrôle commun avec le référentiel central.

2. Note de synthèse

Motifs de la publication

Les présentes orientations définissent les informations qui doivent être transmises par les référentiels centraux afin de faciliter la surveillance permanente des référentiels centraux par l'ESMA sur une base cohérente. Le principal objectif des présentes orientations est donc de rationaliser l'aspect périodique de ce processus de collecte d'informations, veillant ainsi à ce qu'il soit entièrement aligné sur la surveillance de l'ESMA et sur ses processus d'évaluation des risques.

Les orientations précisent le format et la fréquence des différentes catégories d'informations que l'ESMA s'attend à recevoir en sa qualité de superviseur des référentiels centraux enregistrés en vertu d'EMIR et/ou de SFTR et, en conséquence, précisent les obligations respectives des référentiels centraux en vertu de l'article 55, paragraphe 4, d'EMIR et de l'article 5, paragraphe 4, de SFTR.

L'ESMA s'attend à ce que l'application des présentes orientations confère les avantages suivants:

- a. réduire les efforts à fournir pour demander ces informations de façon sporadique et veiller à ce qu'aucune information ne soit omise;
- b. réduire le temps de traitement des informations reçues;
- c. assurer des conditions équitables s'agissant des informations à fournir par tous les référentiels centraux, en établissant des modèles de déclaration harmonisés;
- d. renforcer la prévisibilité des informations requises et rationaliser les processus au sein des référentiels centraux;
- e. renforcer la transparence des référentiels centraux surveillés;
- f. assurer l'exhaustivité des informations requises par l'ESMA aux fins d'une surveillance fondée sur les risques;
- g. améliorer la planification interne des équipes de surveillance de l'ESMA, s'agissant de l'examen des informations, et faciliter le traitement;
- h. standardiser les pratiques déjà mises en œuvre par les référentiels centraux au titre d'une obligation de moyens;
- i. réaliser des économies d'échelle grâce à une bonne cohérence avec le cahier des charges pertinent pour les agences de notation de crédit surveillées par l'ESMA (voir le rapport final sur les orientations sur la transmission d'informations périodiques à l'ESMA par les agences de notation de crédit, deuxième édition², ESMA33-9-295);

² Rapport final sur les orientations https://www.esma.europa.eu/system/files_force/library/esma33-9-295_guidelines_on_the_submission_of_periodic_information_final_fr.pdf?download=1

- j. veiller à ce que les informations utilisées pour calculer les redevances de surveillance prudentielle soient exactes.

Contenu

La section 3 du document définit le champ d'application des orientations. La section 4 présente l'objet de la définition d'orientations sur la déclaration des informations périodiques et des modifications substantielles. La section 5 détaille le cahier des charges de la déclaration s'agissant des éléments à déclarer, des canaux de déclaration, des modèles, des conventions de dénomination des fichiers, des validations des modèles, des programmes de déclaration et des calendriers y afférents. La section 6 inclut des explications détaillées pour chaque élément des informations périodiques requises. La section 7 inclut des explications détaillées pour chaque élément des informations ponctuelles requises, ainsi que le modèle à utiliser pour notifier un plan de liquidation en cas de retrait de l'enregistrement.

Étapes suivantes

Les orientations seront publiées sur le site web de l'ESMA. Elles s'appliquent à partir du 30 juin 2021.

3. Champ d'application

Qui?

1. Les présentes orientations s'appliquent aux référentiels centraux, tels que définis à l'article 2, paragraphe 2, d'EMIR et à l'article 3, paragraphe 1, de SFTR, qui sont enregistrés en vertu des titres VI et VII d'EMIR et du chapitre III de SFTR.

Quoi?

2. Les présentes orientations s'appliquent en rapport avec l'article 55, paragraphe 4, d'EMIR et avec l'article 5, paragraphe 4, de SFTR. Elles ne s'appliquent pas aux référentiels centraux de pays tiers reconnus conformément à EMIR ou à SFTR. Les orientations incluent tous les modèles et les calendriers de déclaration pertinents. De plus, dans le but d'améliorer leur visibilité et leur intégration dans les processus internes des référentiels centraux, l'ESMA publiera également le calendrier de déclaration et les versions Excel des modèles en tant qu'éléments indépendants pouvant être téléchargés à partir du site web de l'ESMA.

Quand?

3. Les présentes orientations s'appliquent à compter du 30 juin 2021. Tous les éléments des informations périodiques dont la fréquence est annuelle et dont la date limite de déclaration est fixée au 31 janvier, conformément aux présentes orientations, doivent être communiqués pour la première année au plus tard le 30 juin 2021.

4. Objet

4. L'ESMA a été chargée de l'enregistrement et de la surveillance des référentiels centraux en vertu des titres VI et VII d'EMIR et du chapitre III de SFTR.
5. La NTR sur l'enregistrement (EMIR), la NTR modifiée sur l'enregistrement (EMIR) et la NTR sur l'enregistrement (SFTR) précisent les informations devant être transmises par les référentiels centraux afin que l'ESMA puisse évaluer leur conformité aux conditions d'enregistrement en vertu d'EMIR et du SFTR.
6. À cet égard, l'article 55, paragraphe 4, d'EMIR et l'article 5, paragraphe 4, de SFTR exigent des référentiels centraux qu'ils «se conforment en permanence aux conditions d'enregistrement» et qu'ils informent l'ESMA, «sans retard injustifié, de toute modification importante des conditions de l'enregistrement».
7. Dans cette optique, les présentes orientations visent à préciser le format et la fréquence des différentes catégories d'informations que l'ESMA s'attend à recevoir en sa qualité de superviseur des référentiels centraux enregistrés en vertu d'EMIR et/ou de SFTR et, en conséquence, visent à préciser leurs obligations respectives en vertu de l'article 55, paragraphe 4, d'EMIR et de l'article 5, paragraphe 4, de SFTR.
8. Ainsi, les orientations visent à assurer une surveillance permanente des référentiels centraux, par l'ESMA, qui soit cohérente, continue, efficiente et fondée sur les risques.

Plus précisément, les orientations proposées visent à renforcer la cohérence et la facilité d'utilisation des informations transmises par les référentiels centraux. Cela consiste notamment à fournir des instructions de déclaration spécifiques pour chaque aspect de la déclaration, ainsi que, dans la mesure du possible, des modèles de déclaration standardisés. Les orientations proposées précisent également certaines informations afin de mieux appuyer les processus de surveillance de l'ESMA, de façon efficiente et efficace.

9. Afin d'assurer une traduction adéquate des documents transmis par les référentiels centraux dans des langues autres que l'anglais, les orientations proposées précisent que tout document rédigé dans une langue autre que l'anglais doit toujours être transmis dans un format lisible par machine, tandis que les documents rédigés en anglais doivent être transmis dans un format lisible par machine, lorsque cela est possible.
10. L'approche appliquée par l'ESMA pour évaluer les risques inhérents aux référentiels centraux est dynamique. Elle tient compte des risques à la fois au niveau de l'entité et au niveau du secteur. Cette évaluation dépend des informations dont l'ESMA dispose. Ces informations peuvent provenir de sources variées, telles que les informations (périodiques) déclarées par les entités surveillées, les informations communiquées à l'ESMA par les autorités compétentes nationales, les activités de surveillance ou les demandes de renseignements (régies par les articles 61 et 62 d'EMIR et qui s'appliquent également aux référentiels centraux enregistrés en vertu de SFTR au titre de son article 9), les informations tirées des acteurs des marchés et des régulateurs de pays tiers et enfin les informations obtenues par l'ESMA dans le cadre de sa propre veille de marché.
11. Les référentiels centraux transmettent actuellement certaines informations à l'ESMA sur une base périodique ou ponctuelle, comme les procès-verbaux des réunions du conseil d'administration, les rapports de vérification de la conformité ou des statistiques concernant la qualité des données. Toutefois, ces déclarations ne se font pas dans le même format et selon la même date limite, ce qui nuit à l'exhaustivité et à la comparabilité des informations relatives à la surveillance.
12. De plus, sur la base des processus de surveillance permanente, l'ESMA appréhende suffisamment la fréquence à laquelle elle doit recevoir les informations pertinentes de la part des référentiels centraux, ainsi que la façon dont les informations actuellement transmises peuvent être standardisées grâce à l'introduction de modèles spécifiques. Cela permettra à l'ESMA d'adopter une approche plus systématique pour la surveillance des référentiels centraux.
13. Les présentes orientations s'appuient sur les informations requises en vertu des NTR sur l'enregistrement. En outre, l'ESMA tire parti de l'expérience acquise dans le cadre de la surveillance des référentiels centraux en vertu d'EMIR et précise également le format et la fréquence des informations périodiques et ponctuelles devant être transmises par les référentiels centraux enregistrés en vertu de SFTR.
14. Certaines informations, à savoir celles spécifiques aux entreprises telles que les procès-verbaux des réunions du conseil d'administration, sont les mêmes pour les référentiels centraux enregistrés en vertu d'EMIR que pour ceux enregistrés en vertu de SFTR et ne doivent donc pas être dupliquées si un référentiel central est enregistré en vertu des deux régimes et si les informations sont requises en vertu des deux régimes. Les présentes orientations indiquent clairement si les modèles s'appliquent également aux référentiels centraux enregistrés en vertu de SFTR.

15. Les présentes orientations définissent les informations qui doivent être périodiquement transmises par les référentiels centraux à l'ESMA, afin de faciliter la surveillance permanente des référentiels centraux sur une base cohérente. Le principal objectif des présentes orientations est donc de rationaliser l'aspect périodique de ce processus de génération et de collecte d'informations, veillant ainsi à ce qu'il soit entièrement aligné sur la surveillance de l'ESMA et sur ses processus d'évaluation des risques.
16. L'objectif secondaire des orientations est de renforcer la transparence et de définir un cadre harmonisé pour les interactions de l'ESMA avec les référentiels centraux en manière de surveillance. À cet égard, il est prévu que les orientations proposées, en renforçant la qualité et la facilité d'utilisation des informations transmises par les référentiels centraux à l'ESMA sur une base périodique, réduisent le besoin pour l'ESMA de demander des informations aux référentiels centraux sur une base bilatérale par le biais de demandes de renseignements.
17. Les orientations proposées regroupent le cahier des charges de la déclaration en deux catégories globales: «périodique» et «ponctuelle». Au sein de ces deux catégories, les éléments individuels à déclarer sont ensuite regroupés en fonction de différents modules. Cela permet ainsi que les cahiers des charges similaires soient traités côte à côte, ce qui renforce la transparence quant aux informations requises par l'ESMA.
18. Celle-ci suggère une utilisation accrue des modèles communs de déclaration pour les informations quantitatives et qualitatives devant être collectées dans un format standardisé, y compris la liste des entités participant au système des référentiels centraux, les revenus et coûts, les incidents liés aux technologies de l'information, le nombre des employés à temps plein, les rapports concernant la performance en matière de traitement des données, la qualité des données, etc. Cela permettrait au personnel de l'ESMA et à ses instruments de surveillance de traiter efficacement les informations qu'elle doit recevoir.
19. Toutefois, les orientations prévoient également que les modèles puissent être modifiés. Un fichier modèle sera mis à disposition sur le site web de l'ESMA. Les référentiels centraux doivent être avertis si des modifications sont apportées au modèle et doivent toujours utiliser la dernière version en date pour transmettre leurs informations à l'ESMA. Les informations transmises à l'aide de modèles antérieurs seront refusées.
20. Toutes les considérations susmentionnées permettent également de veiller à ce que la conformité aux orientations devienne plus proportionnée.

5. Cahier des charges de la déclaration

5.1. Aspects généraux

Orientation 1. Pour chaque élément à déclarer, les référentiels centraux doivent suivre le cahier des charges relatif au contenu, au format, aux dates limites de déclaration et, le cas échéant, aux modèles. Les référentiels centraux doivent procéder de la sorte pour chaque règlement en vertu duquel ils sont enregistrés.

Orientation 2. Les référentiels centraux doivent transmettre les documents rédigés en anglais dans un format lisible par machine, dans la mesure du possible. Si les documents sont rédigés dans une langue autre que l'anglais, les référentiels centraux doivent les transmettre dans un format lisible par machine, afin qu'ils puissent être automatiquement traduits par les instruments de surveillance de l'ESMA. Pour faciliter ce processus de traduction, les référentiels centraux doivent soumettre ces documents au format .pdf ou, si cela n'est pas le cas, dans un format lisible par machine non verrouillé.

5.2. Canaux de déclaration

Orientation 3. Les référentiels centraux doivent transmettre à l'ESMA les informations requises dans les présentes orientations au moyen des canaux de déclaration communiqués par l'ESMA à l'avance.

5.3. Convention de dénomination des fichiers

Orientation 4. Les référentiels centraux doivent déclarer les informations requises en vertu de chaque élément à déclarer conformément à la convention de dénomination suivante: TRAAA_REGU_TY_ST_PD_ITEMXX_AAAAMMJJ.zip. Dès lors qu'un modèle de déclaration est utilisé, cela doit se faire au format .csv pour les modèles relatifs aux données et au format .xls pour les autres modèles. Au sein d'un même fichier d'archive, s'il est nécessaire d'utiliser un modèle de déclaration, le référentiel central doit suivre la convention de dénomination susmentionnée et utiliser un fichier .csv pour les éléments liés aux données et un fichier .xls pour les autres éléments. Les fichiers différents des modèles fournis dans les fichiers d'archives peuvent être transmis avec le fichier d'origine «nom/type».

5.4. Validations des modèles

Orientation 5. Les référentiels centraux doivent remplir les modèles conformément aux validations de modèle applicables et ne doivent pas modifier le format du modèle, notamment ne pas ajouter ou retirer de champ. Les référentiels centraux doivent toujours utiliser la dernière version disponible, car les versions antérieures seront refusées par l'ESMA. Les référentiels centraux devront à nouveau transmettre les informations concernées en utilisant la dernière version disponible.

5.5. Programme, fréquence et date limite de la déclaration

Les référentiels centraux doivent transmettre les informations périodiques conformément à la fréquence et à la date limite de déclaration pour chaque règlement en vertu duquel ils sont enregistrés, comme indiqué dans le

Orientation 6. Tableau 1: CALENDRIER DE LA DÉCLARATION D'INFORMATIONS PÉRIODIQUES. Les informations incluses doivent couvrir la période de déclaration concernée, telle que déterminée par la fréquence des informations transmises.

Orientation 7. Les référentiels centraux doivent déclarer «dès que possible» toute modification substantielle des conditions initiales d'enregistrement, ainsi que plusieurs autres événements spécifiques que l'ESMA juge pertinents dans le cadre de ses responsabilités de surveillance, qui sont indiqués dans le Tableau 2: DÉCLARATION D'INFORMATIONS PONCTUELLES **Error! Reference source not found..**

Si un référentiel central est enregistré en vertu à la fois d'EMIR et de SFTR, il devrait suivre les indications fournies dans le

Orientation 8. Tableau 1: CALENDRIER DE LA DÉCLARATION D'INFORMATIONS PÉRIODIQUES et le Tableau 2: DÉCLARATION D'INFORMATIONS PONCTUELLES, afin de déterminer si l'élément à déclarer concerné doit être transmis séparément ou conjointement. S'il est indiqué que l'élément s'applique séparément à la fois à EMIR et à SFTR, cela signifie que le référentiel central devra clairement indiquer dans le modèle pour lequel des deux règlements il déclare les informations requises. S'il est indiqué que l'élément s'applique conjointement à la fois aux données EMIR et aux données SFTR, cela signifie que les données doivent être identiques pour les deux règlements et que, pour cette raison, le référentiel central ne doit transmettre cet élément qu'une seule fois pour les deux règlements.

TABLEAU 1: CALENDRIER DE LA DÉCLARATION D'INFORMATIONS PÉRIODIQUES

Déclaration d'informations périodiques pour les référentiels centraux					
Élément	Élément à déclarer	Applicable à	Fréquence de déclaration	Date limite de déclaration	Modèle disponible?
Gouvernance et activités					
1	Documents du conseil d'administration	EMIR et SFTR conjointement	Semestrielle	31 janvier et 31 juillet	Non
2	Calendrier, endroit et ordre du jour des réunions du conseil d'administration	EMIR et SFTR conjointement	Annuelle	31 janvier	Non
3	Structure de propriété ou une attestation	EMIR et SFTR conjointement	Annuelle	31 janvier	Non
4	Organigrammes	EMIR et SFTR conjointement	Annuelle	31 janvier	Non
5	Personnel et employés à temps plein	EMIR et SFTR séparément	Annuelle	31 janvier	Modèle pour l'élément 5
6	Inventaire des services auxiliaires fournis par le référentiel central ou le groupe	EMIR et SFTR séparément	Annuelle	31 janvier	Modèle pour l'élément 6
7	Inventaire des autres services fournis par le référentiel central	EMIR et SFTR conjointement	Annuelle	31 janvier	Modèle pour l'élément 7
8	Utilisation commerciale des données des référentiels centraux	EMIR et SFTR séparément	Annuelle	31 janvier	Modèle pour l'élément 8
9	Inventaire des accords d'externalisation et liste des services externalisés	EMIR et SFTR séparément	Annuelle	31 janvier	Modèle pour l'élément 9
10	Politiques et procédures internes	EMIR et SFTR conjointement	Annuelle	31 janvier	Modèle pour l'élément 10
11	Liste des principaux contacts au sein du référentiel central	EMIR et SFTR séparément	Annuelle	31 janvier	Modèle pour l'élément 11
Déclaration d'informations financières					
12	Ventilation des revenus et coûts des services du référentiel central	EMIR et SFTR séparément	Annuelle	31 juillet	Modèle pour l'élément 12
13	Comptes financiers intermédiaires	EMIR et SFTR conjointement	Semestrielle	31 janvier et 31 juillet	Non
14	États financiers audités	EMIR et SFTR conjointement	Annuelle	30 juin	Non
15	Ressources financières	EMIR et SFTR conjointement	Annuelle	31 juillet	Modèle pour l'élément 15
16	Évaluations de la politique de détermination des prix	EMIR et SFTR séparément	Annuelle	31 juillet	Non
Contrôle interne					
17	Programme de travail en matière de conformité	EMIR et SFTR séparément	Annuelle	31 janvier	Non
18	Rapports d'évaluation de la conformité	EMIR et SFTR séparément	Semestrielle	31 janvier et 31 juillet	Non

Déclaration d'informations périodiques pour les référentiels centraux					
Élément	Élément à déclarer	Applicable à	Fréquence de déclaration	Date limite de déclaration	Modèle disponible?
19	Plan d'audit interne	EMIR et SFTR séparément	Annuelle	31 janvier	Non
20	Rapports d'audit interne	EMIR et SFTR séparément	Semestrielle	31 janvier et 31 juillet	Non
21	Rapports sur les risques	EMIR et SFTR séparément	Annuelle	31 janvier	Non
22	Tableau de bord des risques	EMIR et SFTR séparément	Annuelle	31 janvier	Non
23	Vue d'ensemble du contrôle de la conformité et de l'audit interne	EMIR et SFTR séparément	Semestrielle	31 janvier et 31 juillet	Modèle pour l'élément 23
24	Liste des cas potentiels et avérés de non-conformité	EMIR et SFTR séparément	Annuelle	31 janvier	Modèle pour l'élément 24
Déclaration d'informations relatives aux technologies de l'information et à la sécurité de l'information					
25	Stratégie informatique	EMIR et SFTR conjointement	Annuelle	31 janvier	Non
26	Livre de travail	EMIR et SFTR séparément	Trimestrielle	31 janvier, 30 avril, 31 juillet et 31 octobre	Modèle pour l'élément 26
27	Résumé des technologies ou attestation	EMIR et SFTR séparément	Annuelle	31 janvier	Modèle pour l'élément 27
28	Rapports de test du plan de continuité des activités	EMIR et SFTR séparément	Annuelle	31 janvier	Non
29	Attestation relative aux tests de la sécurité de l'information	EMIR et SFTR séparément	Annuelle	31 janvier	Non
30	Mesures relatives à la cybersécurité	EMIR et SFTR séparément	Semestrielle	31 janvier et 31 juillet	Modèle pour l'élément 30
Déclaration des données					
31	Vue d'ensemble des entités participant au système des référentiels centraux	EMIR et SFTR séparément	Semestrielle	31 janvier et 31 juillet	Modèle pour l'élément 31
32	Statut d'accès des régulateurs	EMIR et SFTR séparément	Trimestrielle	31 janvier, 30 avril, 31 juillet et 31 octobre	Modèle pour l'élément 32
33	Volume de données	EMIR et SFTR séparément	Trimestrielle	31 janvier, 30 avril, 31 juillet et 31 octobre	Modèle pour l'élément 33
34	Vue d'ensemble du statut des demandes de portabilité	EMIR et SFTR séparément	Annuelle	31 janvier	Modèle pour l'élément 34
35	Mesures de la performance et des capacités en matière de déclaration des données	EMIR et SFTR séparément	Mensuelle	Au plus tard le 15 du mois suivant	Modèle pour l'élément 35

Déclaration d'informations périodiques pour les référentiels centraux					
Élément	Élément à déclarer	Applicable à	Fréquence de déclaration	Date limite de déclaration	Modèle disponible?
36	Statistiques de rapprochement	EMIR et SFTR séparément	Mensuelle	Au plus tard le 15 du mois suivant	Modèle pour l'élément 36
Déclaration relative au calcul des redevances de surveillance prudentielle					
37	Informations relatives au calcul des redevances de surveillance prudentielle	EMIR et SFTR séparément	Annuelle	30 juin	Modèle pour l'élément 37

Tableau 2: DÉCLARATION D'INFORMATIONS PONCTUELLES

Exigences de déclaration ponctuelle applicables aux référentiels centraux				
Élément	Élément à déclarer	Déclaration ponctuelle applicable à	Calendrier de déclaration	Modèle disponible?
Notification de toute modification substantielle des conditions d'enregistrement				
38	Détails relatifs aux membres du conseil d'administration	EMIR et SFTR conjointement	Première liste à transmettre dès l'application des orientations. Par la suite, une nouvelle notification doit être fournie dès que les informations initialement transmises changent.	Modèle pour l'élément 38
39	Membres clés du personnel	EMIR et SFTR séparément	Première liste à transmettre dès l'application des orientations. Par la suite, une nouvelle notification doit être fournie dès que les informations initialement transmises changent.	Modèle pour l'élément 39
40	Modification de la structure de propriété	EMIR et SFTR conjointement	Une première liste des personnes ou entités détenant directement ou indirectement au moins 5 % du capital doit être fournie dans un modèle dès l'application des orientations. Par la suite, une nouvelle notification doit être fournie dès que les informations initialement transmises changent.	Modèle pour l'élément 40
41	Lancement de nouveaux services (y compris des services auxiliaires ou tout autre service)	EMIR et SFTR séparément	Dès que possible	Modèle pour l'élément 41
42	Modification de la structure tarifaire/politique de détermination des prix	EMIR et SFTR séparément	Dès que possible	Non
43	Établissement de filiales et de succursales, remaniement ou restructuration des activités du référentiel central ou changement du nom, de l'adresse, de la documentation réglementaire ou du statut juridique	EMIR et SFTR conjointement	Dès que possible	Non
44	Nouveau contentieux/procédure pouvant avoir potentiellement un	EMIR et SFTR conjointement	Dès que possible	Non

Exigences de déclaration ponctuelle applicables aux référentiels centraux				
Élément	Élément à déclarer	Déclaration ponctuelle applicable à	Calendrier de déclaration	Modèle disponible?
	impact important pour le référentiel central			
45	Copies des modèles de contrat utilisés pour les régulateurs	EMIR et SFTR séparément	Dès qu'une modification intervient	Non
46	Copies des modèles de contrat utilisés pour les entités participant au système des référentiels centraux	EMIR et SFTR séparément	Dès qu'une modification intervient	Non
47	Cas potentiels et avérés de non-conformité au(x) règlement(s) en vertu duquel/desquels le référentiel central est enregistré, y compris la détection de toute violation substantielle des politiques et procédures du référentiel central ou de toute activité frauduleuse/irrégularité	EMIR et SFTR séparément	Dès qu'un tel cas est identifié	Modèle pour l'élément 47
48	Modification de la charte et de la méthodologie d'audit interne	EMIR et SFTR séparément	Dès que possible	Non
49	Assurance de la qualité de l'audit interne	EMIR et SFTR conjointement	Dès qu'elle est disponible	Non
50	Modification substantielle du plan de continuité des activités et de toute caractéristique de ce plan	EMIR et SFTR séparément	Dès que possible	Non
51	Modification substantielle ou mise à niveau des systèmes et de l'infrastructure du référentiel central	EMIR et SFTR séparément	Dès qu'une modification substantielle intervient	Modèle pour l'élément 51
52	Notification de toute externalisation vers des fournisseurs de services d'informatique en nuage	EMIR et SFTR séparément	Notification à fournir dès que possible quant à toute externalisation prévue de fonctions critiques ou importantes vers des fournisseurs de services d'informatique en nuage ou toute modification des accords existants d'externalisation vers de tels fournisseurs	Modèle pour l'élément 52
53	Modification des accords d'externalisation	EMIR et SFTR séparément	Dès que possible	Non
54	Toute autre modification substantielle des conditions d'enregistrement	EMIR et SFTR séparément	Dès que possible	Non
Autres				
55	Incidents liés aux technologies de l'information et à la sécurité de l'information	EMIR et SFTR séparément	Notification de l'incident au plus tard à la fin du jour ouvrable durant lequel il est détecté, avec les informations disponibles à ce moment. Notification ultérieure relative à cet incident,	Modèle pour l'élément 55

Exigences de déclaration ponctuelle applicables aux référentiels centraux				
Élément	Élément à déclarer	Déclaration ponctuelle applicable à	Calendrier de déclaration	Modèle disponible?
			avec des informations exhaustives et une analyse des causes profondes, au bout de 30 jours civils.	
56	Notification d'une demande de portabilité	EMIR et SFTR séparément	Dès que possible	Modèle pour l'élément 56
Plan de liquidation				
57	Cessation des activités	EMIR et SFTR séparément	Dès que possible	Modèle pour l'élément 57

6. Déclaration d'informations périodiques

6.1. Module: déclaration relative à la gouvernance et aux activités

Élément 1 – Documents du conseil d'administration

Orientation 9. Les référentiels centraux doivent envoyer à l'ESMA les documents du conseil d'administration suivants, concernant les réunions de celui-ci qui se sont déroulées pendant la période: i) procès-verbaux des réunions du conseil d'administration, ii) copies des documents envoyés aux membres du conseil d'administration au sujet des réunions concernées, iii) tout document supplémentaire couvert pendant la réunion. Si le procès-verbal n'est disponible que dans sa version provisoire, laquelle doit être approuvée lors de la réunion suivante, la version provisoire doit être transmise à l'ESMA. Si un référentiel central a créé des comités au sein de son conseil d'administration, il doit également envoyer les procès-verbaux et les documents des réunions de ces comités.

Élément 2 – Calendrier, endroit et ordre du jour des réunions du conseil d'administration

Orientation 10. Les référentiels centraux doivent envoyer à l'ESMA la liste des réunions programmées pour le conseil d'administration, les endroits prévus à cet effet et l'ordre du jour de ces réunions, si ces informations sont disponibles, pour l'exercice en cours. En cas de modification survenant après que la notification a été envoyée à l'ESMA, les référentiels centraux doivent avertir l'ESMA et envoyer les informations mises à jour dès que la modification est confirmée.

Élément 3 – La structure de propriété

Orientation 11. Les référentiels centraux doivent envoyer à l'ESMA le dernier graphique des relations de propriété montrant les liens de propriété entre l'entreprise mère, les filiales et toute autre entité ou succursale associée, identifiées par leur nom complet, leur statut juridique et leur adresse légale. Les informations doivent inclure toutes les modifications transmises à l'ESMA durant l'exercice précédent à la suite de la modification substantielle des conditions d'enregistrement. Si aucune modification n'est intervenue depuis la dernière déclaration annuelle, le référentiel central doit envoyer une attestation indiquant que la notification précédente est toujours exacte.

Élément 4 – Organigrammes

Orientation 12. Les référentiels centraux doivent envoyer leurs organigrammes internes à l'ESMA. Ces organigrammes doivent inclure les fonctions de gestion, de contrôle, les fonctions commerciales et de soutien, en indiquant clairement les lignes hiérarchiques, les implantations géographiques et le nombre/la réserve de ressources assignées à chaque fonction ou pouvant être mises à la disposition de chaque fonction. Les informations doivent inclure toutes les modifications substantielles communiquées à l'ESMA durant l'exercice précédent.

Élément 5 – Personnel et employés à temps plein

Orientation 13. Les référentiels centraux doivent fournir à l'ESMA le nombre exact d'employés directement employés ou dédiés au niveau de l'entité et une estimation du nombre d'employés auxquels on peut accéder au niveau du groupe, par exemple la réserve de ressources, avec une ventilation des employés à temps plein dans les domaines de la conformité, des technologies de l'information, de la sécurité de l'information, de la gestion des risques et de l'audit interne, conformément au modèle désigné.

Élément 6 – Inventaire des services auxiliaires fournis par le référentiel central ou le groupe

Orientation 14. Les référentiels centraux doivent envoyer à l'ESMA une liste des services auxiliaires offerts par le référentiel concerné ou une entreprise au sein du même groupe, conformément à la définition des «services auxiliaires» stipulée à l'article 17 de la NTR sur l'enregistrement (EMIR) et à l'article 17 de la NTR sur l'enregistrement (SFTR). La liste doit indiquer combien d'entités participant au système des référentiels centraux utilisent ces services, conformément au modèle désigné. La liste doit inclure une description des services auxiliaires fournis par le

référentiel central ou l'entreprise au sein de son groupe, ainsi qu'une description de tout accord que le référentiel a éventuellement conclu avec des entreprises offrant ces services auxiliaires. Des copies de ces accords doivent être transmises avec le modèle.

Élément 7 – Inventaire des autres services fournis par le référentiel central

Orientation 15. Les référentiels centraux doivent envoyer à l'ESMA une liste des services que le référentiel concerné, en tant qu'entité juridique, fournit en plus des services stratégiques et auxiliaires fournis au titre du règlement en vertu duquel le référentiel est enregistré, indiquant combien d'entités participant au système des référentiels centraux utilisent ces services, conformément au modèle désigné.

Élément 8 – Utilisation commerciale des données des référentiels centraux

Orientation 16. Les référentiels centraux doivent envoyer à l'ESMA une liste de tous les cas d'utilisation commerciale des données déclarées aux référentiels centraux en vertu d'EMIR ou de SFTR recensés durant l'exercice précédent, s'il y a une telle utilisation a eu lieu, conformément au modèle désigné.

Élément 9 – Inventaire des accords d'externalisation et liste des services externalisés

Orientation 17. Les référentiels centraux doivent fournir à l'ESMA un inventaire des accords d'externalisation, y compris des accords de niveau de service, conformément au modèle désigné. L'inventaire doit contenir à la fois les services externalisés par le référentiel central et les services externalisés auprès du référentiel central. Les informations doivent inclure une définition détaillée des services qui seront fournis, y compris l'étendue mesurable de ces services, la granularité des activités ainsi que les conditions dans lesquelles ces activités seront exercées, et leur calendrier, conformément à l'article 16, point d), de la NTR sur l'enregistrement (EMIR) et à l'article 16, point d), de la NTR sur l'enregistrement (SFTR). L'inventaire devrait inclure les informations relatives à toutes les notifications pertinentes transmises durant l'exercice précédent.

Élément 10 – Politiques et procédures internes

Orientation 18. Les référentiels centraux doivent envoyer à l'ESMA une vue d'ensemble de toutes les politiques et procédures internes actives, conformément au modèle désigné. Ces politiques incluent, sans s'y limiter, celles relatives aux conflits d'intérêts, à la protection de la confidentialité des données, à l'accès aux données par des fournisseurs tiers, au processus de filtrage de l'accès, aux

dispositions contractuelles applicables entre le référentiel central et les entités déclarantes, aux canaux de déclaration, à la conservation des informations et à la rémunération/compensation. En cas de modification des politiques et procédures existantes, le référentiel central est tenu de signaler cette modification, de la justifier et de joindre la version révisée du document contenant les changements, en activant le mode de suivi des changements.

Élément 11 – Liste des principaux contacts au sein du référentiel central

Orientation 19. Les référentiels centraux doivent mettre à jour la liste des contacts que l'ESMA doit utiliser pour communiquer avec l'entité sur certains aspects. La liste doit être agencée en fonction des domaines de responsabilité (par exemple contacts au sein du service de la conformité, de l'équipe de direction, de TRACE, du service des finances, etc.).

6.2. Module: déclaration d'informations financières

Élément 12 – Ventilation des revenus et coûts des services du référentiel central

Orientation 20. Les référentiels centraux doivent transmettre à l'ESMA une ventilation des revenus et coûts des services de référentiel central, déterminés conformément aux principes comptables utilisés pour préparer les états financiers audités du référentiel concerné et à toute autre méthode de comptabilité interne (par exemple la comptabilité de gestion), le cas échéant.

Élément 13 – Comptes financiers intermédiaires

Orientation 21. Les référentiels centraux doivent transmettre à l'ESMA leurs comptes financiers intermédiaires préparés conformément aux principes comptables utilisés pour préparer les états financiers audités du référentiel concerné.

Élément 14 – États financiers audités

Orientation 22. Les référentiels centraux doivent transmettre à l'ESMA leurs états financiers audités. Si l'exercice financier ne correspond pas à l'année civile, les référentiels centraux doivent transmettre une ventilation des revenus et des dépenses certifiée par un auditeur indépendant, avant la date limite.

Élément 15 – Ressources financières

Orientation 23. Les référentiels centraux doivent informer l'ESMA des ressources financières dont ils disposent pour couvrir au moins six mois de coûts

opérationnels, en vertu de l'article 21, point b), de la NTR modifiée sur l'enregistrement (EMIR) et/ou de l'article 21, point b), de la NTR sur l'enregistrement (SFTR), conformément au modèle désigné.

Élément 16 – Évaluations de la politique de détermination des prix

Orientation 24. Les référentiels centraux doivent envoyer à l'ESMA des copies des évaluations menées durant l'exercice précédent s'agissant des frais, des coûts et de la stratégie de détermination des prix.

6.3. Module: déclaration d'informations relatives au contrôle interne

Élément 17 – Programme de travail en matière de conformité

Orientation 25. Les référentiels centraux doivent transmettre à l'ESMA une copie de leur programme de travail en matière de conformité. En cas de changement des priorités en matière de conformité lors de la transmission, un programme de travail mis à jour devrait être transmis dès que possible.

Élément 18 – Rapports d'évaluation de la conformité

Orientation 26. Les référentiels centraux doivent transmettre à l'ESMA une copie de tout rapport de vérification de la conformité, y compris toute évaluation de la conformité et tout rapport de test portant sur les activités, les systèmes, les processus et les opérations du référentiel central menée ou préparé par la fonction de conformité (y compris au niveau du groupe).

Élément 19 – Plan d'audit interne

Orientation 27. Qu'un référentiel central ait ou non mis en place une fonction d'audit interne ou commandé des audits internes auprès d'un prestataire extérieur, il doit transmettre une copie de son plan de travail annuel en matière d'audit interne.

Élément 20 – Rapports d'audit interne

Orientation 28. Qu'un référentiel central ait ou non mis en place une fonction d'audit interne ou commandé des audits internes auprès d'un prestataire extérieur, l'ESMA s'attend à recevoir une copie des rapports d'audit interne qui ont été préparés et qui portent sur les activités, les systèmes, les processus et les opérations du référentiel central.

Élément 21 – Rapport sur les risques

Orientation 29. Les référentiels centraux doivent transmettre une copie de toute évaluation des risques menée par la fonction de gestion des risques pendant la période de déclaration qui porte sur les activités, les systèmes, les processus et les opérations du référentiel central. Ce rapport sur les risques doit inclure ou mentionner le cadre de gestion des risques pertinent, ainsi que la méthodologie appliquée pour mener l'évaluation.

Élément 22 – Tableau de bord des risques

Orientation 30. Les référentiels centraux doivent soumettre leur tableau de bord des risques, qui devrait inclure les risques les plus importants identifiés dans le contexte de leur processus de gestion des risques. Cet élément complète l'élément précédent en fournissant une vue plus détaillée des risques identifiés dans le cadre de certains des aspects critiques du fonctionnement du référentiel central concerné. Si les référentiels centraux ont des tableaux de bord séparés pour les risques liés aux technologies de l'information et à la sécurité de l'information, ils doivent également fournir ces documents.

Élément 23 – Vue d'ensemble du contrôle de la conformité et de l'audit interne

Orientation 31. Les référentiels centraux doivent transmettre une vue d'ensemble de toutes les conclusions et mesures de suivi découlant des évaluations menées dans le cadre du contrôle de la conformité et de l'audit interne, conformément au modèle désigné.

Élément 24 – Liste des cas potentiels et avérés de non-conformité

Orientation 32. Les référentiels centraux doivent transmettre une liste annuelle des cas potentiels et avérés de non-conformité, conformément au modèle désigné. Cet élément à déclarer porte sur les cas potentiels et avérés de non-conformité qui tombent dans le champ d'application d'EMIR et de SFTR mais qui ne sont pas à déclarer à l'ESMA en tant qu'incident lié aux technologies de l'information ou à la sécurité de l'information en vertu des présentes orientations. Les cas à déclarer sont les violations des procédures internes du référentiel central conçues pour assurer la conformité aux règlements respectifs, les réclamations internes reçues par la fonction de conformité, les potentiels conflits d'intérêts identifiés, les activités frauduleuses/irrégularités détectées et toute autre situation pouvant engendrer la non-conformité à EMIR et/ou à SFTR. Les référentiels centraux sont tenus de

remplir un modèle contenant une liste des cas potentiels et avérés de non-conformité, y compris:

- a) Tous les cas en cours détectés durant la période;
- b) Tous les cas en cours détectés durant une période antérieure mais qui n'ont pas été clôturés durant la période;
- c) Tous les cas clôturés durant la période.

6.4. Module: déclaration d'informations relatives aux technologies de l'information et à la sécurité de l'information

Élément 25 – Stratégie informatique

Orientation 33. Les référentiels centraux doivent soumettre à l'ESMA leur stratégie informatique en vigueur pour les principales décisions prises quant à leurs systèmes informatiques, concernant notamment l'externalisation, l'informatique en nuage, etc.

Élément 26 – Livre de travail

Orientation 34. Les référentiels centraux doivent transmettre des informations relatives à leurs projets informatiques et les progrès réalisés en la matière, en remplissant le modèle désigné. Avec chaque livre de travail qu'ils soumettent, les référentiels centraux doivent déclarer les projets/réparations qui ont été clôturés depuis la soumission du précédent livre de travail. Le modèle doit contenir des informations sur les projets en cours, les projets prévus, les projets clôturés depuis le précédent livre de travail, les réparations en cours, les réparations prévues et les réparations mises en œuvre et clôturées depuis le précédent livre de travail.

Élément 27 – Résumé des technologies

Orientation 35. Les référentiels centraux doivent transmettre à l'ESMA un résumé des technologies, conformément au modèle désigné. Le résumé des technologies doit inclure une liste des applications utilisées par le référentiel concerné, des systèmes d'exploitation, des bases de données, etc., ainsi qu'une description de la façon dont le référentiel concerné cartographie ses processus stratégiques. Si aucune modification n'est intervenue depuis la dernière déclaration annuelle, le référentiel central doit envoyer une attestation indiquant que la notification précédente est toujours exacte.

Élément 28 – Rapports de test du plan de continuité des activités

Orientation 36. Les référentiels centraux doivent transmettre à l'ESMA tout test du plan de continuité des activités mené durant l'exercice précédent, ainsi que ses résultats et toute mesure de suivi. Le test du plan de continuité des activités doit indiquer au moins la date à laquelle il a été mené, son champ d'application et l'approche/la méthodologie/le scénario du test.

Éléments 29 et 30 – Rapports de test de la sécurité de l'information et des mesures relatives à la cybersécurité

Orientation 37. Les référentiels centraux doivent transmettre à l'ESMA une attestation indiquant qu'ils ont mené différents tests relatifs à la sécurité de l'information, accompagnée du modèle désigné.

6.5. Module: déclaration des données

Élément 31 – Vue d'ensemble de l'entité participant au système des référentiels centraux

Orientation 38. Les référentiels centraux doivent transmettre les statistiques et le profil des entités participant au système des référentiels centraux, conformément au modèle désigné. Les informations à transmettre au moyen du modèle incluent, sans s'y limiter, le règlement en vertu duquel la déclaration est faite, le type d'entité participante (par exemple établissement financier/non financier et des informations sur le secteur d'activité), le pays, le statut d'entité déclarante directe ou indirecte, leur part dans le capital, etc.

Élément 32 – Statut d'accès des régulateurs

Orientation 39. Les référentiels centraux doivent transmettre la liste des régulateurs qui ont demandé un accès au référentiel concerné et de ceux qui ont établi un accès à ce référentiel, y compris par le biais de TRACE, conformément au modèle désigné.

Élément 33 – Volume de données

Orientation 40. Les référentiels centraux doivent déclarer, entre autres, des statistiques relatives i) au nombre total d'opérations et de rapports reçus dès le début de la déclaration pour chaque règlement et ii) au nombre d'instruments dérivés et d'opérations de financement sur titres par juridiction, aux entités

participant à la déclaration et à la catégorie de qualité des données (pour EMIR), conformément au modèle désigné.

Élément 34 – Vue d’ensemble du statut des demandes de portabilité

Orientation 41. Les référentiels centraux doivent fournir à l’ESMA la liste des entités participant au système des référentiels centraux qui ont demandé la portabilité au cours des douze derniers mois, en incluant toute demande en cours reportée depuis des périodes antérieures, et fournir tous les détails conformément au modèle désigné.

Élément 35 – Mesures de la performance et des capacités en matière de déclaration des données

Orientation 42. Les référentiels centraux doivent fournir à l’ESMA des statistiques sur l’ingestion des données, la génération de rapports (c’est-à-dire pour les clients, entre différents référentiels centraux et pour les régulateurs), les capacités des systèmes (c’est-à-dire en termes de stockage et de calcul), conformément au modèle désigné.

Élément 36 – Statistiques de rapprochement

Orientation 43. Les référentiels centraux doivent fournir à l’ESMA des statistiques sur le rapprochement des instruments dérivés et des opérations de financement sur titres, conformément au modèle désigné.

6.6. Module: déclaration relative au calcul des redevances de surveillance prudentielle

Élément 37 – Informations relatives au calcul des redevances de surveillance prudentielle

Orientation 44. Les référentiels centraux doivent déclarer à l’ESMA les informations nécessaires pour déterminer le chiffre d’affaires applicable, en vertu du règlement délégué (UE) n° 1003/2013 de la Commission et/ou du règlement délégué (UE) 2019/360 de la Commission, conformément au modèle désigné. Ces informations doivent être certifiées par un auditeur indépendant.

7. Déclaration d'informations ponctuelles

7.1. Notification de toute modification substantielle des conditions d'enregistrement initiales et des informations pertinentes relatives à la surveillance

Élément 38 – Détails des membres du conseil d'administration

Orientation 45. Les référentiels centraux doivent fournir une première liste exhaustive des membres du conseil d'administration (y compris de l'organe de direction, du conseil de surveillance et des comités du conseil d'administration), ainsi que leurs profils. Dès qu'une modification survient, une nouvelle notification doit être soumise au moyen d'un modèle accompagné des documents justificatifs pertinents visés à l'article 9 de la NTR modifiée sur l'enregistrement (EMIR) et/ou à l'article 9 de la NTR sur l'enregistrement (SFTR), lesquels doivent être joints.

Élément 39 – Membres clés du personnel

Orientation 46. Les référentiels centraux doivent fournir une première liste exhaustive des membres clés de leur personnel (CEO, CCO, CTO, COO, CRO, CISO et tout autre membre clé du personnel), ainsi que leurs profils. Dès qu'une modification survient, une nouvelle notification doit être soumise au moyen d'un modèle. Pour les cadres dirigeants, les documents visés à l'article 9 de la NTR modifiée sur l'enregistrement (EMIR) et/ou à l'article 9 de la NTR sur l'enregistrement (SFTR) doivent être joints.

Élément 40 – Modification de la structure de propriété

Orientation 47. Les référentiels centraux doivent envoyer une notification décrivant le changement de propriété, laquelle doit couvrir l'acquisition ou la cession de participations supérieures à 5 % du capital-actions émis ou des droits de vote du référentiel concerné. Conformément au modèle de déclaration, les référentiels centraux doivent inclure une liste mise à jour recensant toutes les personnes ou entités qui détiennent directement ou indirectement au moins 5 % de leur capital ou de leurs droits de vote ou qui, de par les participations qu'elles détiennent, sont en mesure d'exercer une influence significative sur leur gestion.

Élément 41 – Lancement de nouveaux services (y compris des services auxiliaires ou tout autre service)

Orientation 48. Les référentiels centraux doivent avertir l'ESMA à l'avance de toute décision de lancer de nouveaux services et expliquer la séparation opérationnelle, la tarification, les conflits d'intérêts potentiels, l'impact sur les ressources, etc., conformément au modèle.

Élément 42 – Modification de la structure tarifaire/politique de détermination des prix

Orientation 49. Les référentiels centraux doivent envoyer à l'ESMA tous les documents pertinents sur la nouvelle structure tarifaire/politique de détermination des prix, en incluant les remises et ristournes existantes ou proposées et les conditions en vigueur pour pouvoir bénéficier de ces réductions.

Élément 43 – Établissement de filiales et de succursales, remaniement ou restructuration des activités de référentiel central ou changement du nom, de l'adresse, de la documentation réglementaire ou du statut juridique

Orientation 50. S'agissant de l'établissement de filiales et de succursales, du remaniement ou de la restructuration des activités de référentiel central ou du changement du nom, de l'adresse, de la documentation réglementaire ou du statut juridique, les référentiels centraux doivent envoyer à l'ESMA une description des modifications, de la nouvelle structure, de la nouvelle adresse et de toutes les informations justificatives pertinentes.

Élément 44 – Nouveau contentieux/procédure pouvant potentiellement avoir un impact important pour le référentiel central

Orientation 51. Les référentiels centraux doivent envoyer à l'ESMA une description de la nouvelle procédure contentieuse (judiciaire, administrative, d'arbitrage ou tout autre type de procédure contentieuse) pouvant avoir un impact important sur le référentiel concerné, s'agissant notamment de la fiscalité et de l'insolvabilité, ainsi qu'une évaluation des conséquences potentielles et de l'impact sur le référentiel concerné.

Élément 45 – Copies des modèles de contrat utilisés pour les régulateurs

Orientation 52. Les référentiels centraux doivent envoyer à l'ESMA des copies de tous les types de modèles de contrat/conditions d'utilisation utilisés pour accorder aux régulateurs un accès aux données déclarées conformément au règlement en vertu duquel le référentiel concerné est enregistré.

Élément 46 – Copies des modèles de contrat utilisés pour les entités participant au système des référentiels centraux

Orientation 53. Les référentiels centraux doivent envoyer à l'ESMA des copies de tous les types de modèles de contrat utilisés pour fournir des services de déclaration conformément au règlement en vertu duquel le référentiel concerné est enregistré.

Élément 47 – Cas potentiels et avérés de non-conformité au(x) règlement(s) en vertu duquel/desquels le référentiel central est enregistré, y compris la détection de toute

violation substantielle des politiques et procédures du référentiel central ou de toute activité frauduleuse/irrégularité

Orientation 54. Les référentiels centraux doivent fournir à l'ESMA des informations sur les cas potentiels et avérés pouvant engendrer ou ayant engendré la non-conformité au(x) règlement(s) en vertu duquel/desquels le référentiel concerné est enregistré, et ce dès que cette non-conformité est identifiée. Les informations doivent être fournies au moyen d'un modèle désigné et doivent porter sur un cas de non-conformité qui tombe dans le champ d'application d'EMIR et de SFTR, mais qui ne correspond pas à un cas à déclarer à l'ESMA en tant qu'incident lié aux technologies de l'information ou à la sécurité de l'information en vertu des présentes orientations (par exemple les violations des procédures internes du référentiel concerné conçues pour assurer la conformité aux règlements respectifs, les réclamations internes reçues par la fonction de conformité, les potentiels conflits d'intérêts identifiés, les activités frauduleuses/irrégularités détectées et toute autre situation pouvant engendrer la non-conformité à EMIR et/ou à SFTR). Ces informations doivent être fournies en parallèle avec les notifications périodiques de toute non-conformité.

Élément 48 – Charte et méthodologie d'audit interne

Orientation 55. Les référentiels centraux doivent transmettre leur charte d'audit interne et leur méthodologie d'audit interne, ainsi que toute modification y afférente.

Élément 49 – Assurance de la qualité de l'audit interne

Orientation 56. Si un référentiel central a obtenu une évaluation indépendante des travaux de la fonction d'audit interne durant la période, il doit envoyer une copie du rapport d'évaluation.

Élément 50 – Modification substantielle du plan de continuité des activités et de toute caractéristique de ce plan

Orientation 57. Les référentiels centraux doivent envoyer à l'ESMA une description de la modification, les raisons pour lesquelles le plan de continuité des activités a été modifié et les conséquences de ce changement, conformément au modèle.

Élément 51 – Résumé des technologies – Modification substantielle des systèmes et de l'infrastructure du référentiel central

Orientation 58. Les référentiels centraux doivent utiliser le modèle pour avertir l'ESMA de toute modification des applications et de l'infrastructure du système.

Élément 52 – Notification de toute externalisation vers des fournisseurs de services d'informatique en nuage

Orientation 59. Les référentiels centraux doivent déclarer à l'ESMA, dans les meilleurs délais, toute externalisation prévue des processus et données du référentiel concerné vers des fournisseurs de services d'informatique en nuage portant sur une fonction critique ou importante, conformément au modèle désigné. Le référentiel concerné devrait également déclarer, dans les meilleurs délais, à l'aide du même modèle, les accords d'externalisation vers des fournisseurs de services d'informatique en nuage portant sur une fonction qui était précédemment classée comme non critique ou non importante puis est devenue critique ou importante, ainsi que toute autre modification de ses accords existants d'externalisation auprès de fournisseurs de services d'informatique en nuage. Cette notification satisfait à l'exigence de notification qui incombe au référentiel central en vertu des orientations de l'ESMA sur l'informatique en nuage³,

Élément 53 – Modification des accords d'externalisation

Orientation 60. Dès qu'une modification substantielle survient dans les accords d'externalisation, les référentiels centraux doivent fournir à l'ESMA une notification indiquant cette modification substantielle, y compris les accords de niveau de service, conformément au modèle désigné. Les services externalisés par le référentiel et les services externalisés auprès du référentiel doivent être déclarés. Les informations doivent inclure une définition détaillée des services qui seront fournis, y compris l'étendue mesurable de ces services, la granularité des activités ainsi que les conditions dans lesquelles ces activités seront exercées, et leur calendrier. Les référentiels centraux doivent joindre une copie de tout document d'externalisation pertinent.

Élément 54 – Toute autre modification substantielle des conditions d'enregistrement

Orientation 61. Les référentiels centraux doivent fournir à l'ESMA une description de la modification.

7.2. Autres notifications

Élément 55 – Incidents liés aux technologies de l'information et à la sécurité de l'information

Orientation 62. Les référentiels centraux doivent envoyer à l'ESMA une notification initiale de l'incident dans un délai de 24 heures après en avoir pris connaissance, puis une notification de suivi dans un délai d'un mois. Les référentiels centraux doivent envoyer ces notifications dans un modèle désigné.

³ [Orientations relatives à la sous-traitance à des prestataires de services en nuage](#), publiées en décembre 2020.

Élément 56 – Notification d’une demande de portabilité

Orientation 63. Les référentiels centraux doivent notifier l’ESMA sur réception d’une demande de portabilité de la part d’une entité participant au système des référentiels centraux, conformément au modèle désigné.

7.3. Plan de liquidation – Principaux documents à transmettre à l’ESMA

Élément 57 – Cessation des activités

Orientation 64. Les référentiels centraux doivent fournir à l’ESMA un plan de liquidation, conformément à l’article 79, paragraphe 3, d’EMIR et à l’article 5, paragraphe 2, de SFTR dans le contexte d’un retrait de l’enregistrement prévu à l’article 71, paragraphe 1, d’EMIR ou à l’article 73, point d), d’EMIR ainsi qu’à l’article 9, paragraphe 1 ou à l’article 10, paragraphe 1, de SFTR, à l’aide du modèle désigné et conformément au calendrier pertinent indiqué dans le modèle.