

AUTORITÉ DE CONTRÔLE PRUDENTIEL ET DE RÉOLUTION

Instruction n° 2017-I-05

relative aux formulaires de demande d'exemption à l'échange obligatoire de garanties applicable aux transactions intragroupe portant sur des contrats dérivés de gré à gré

L'Autorité de contrôle prudentiel et de résolution,

Vu le règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du Conseil du 4 juillet 2012 sur les produits dérivés de gré à gré, les contreparties centrales et les référentiels centraux (« EMIR »), notamment son article 11 paragraphes 3, 6, 8 et 10 ;

Vu le Code monétaire et financier, notamment ses articles L. 612-24 et L. 612-1 II 1° ;

Vu l'avis de la Commission consultative Affaires prudentielles en date du 6 mars 2017 ;

DÉCIDE

Article 1^{er}

Sont dénommées ci-après :

- « entités assujetties » les contreparties financières, au sens du 8 de l'article 2 du règlement EMIR, qui sont soumises au contrôle de l'Autorité de contrôle prudentiel et de résolution ;
- « entités déclarantes » celles des entités assujetties qui effectuent la déclaration au moyen du formulaire qui figure en annexe de la présente instruction.

Article 2

Les entités assujetties qui souhaitent bénéficier des exemptions à l'échange obligatoire de garanties prévues aux paragraphes 6, 8 et 10 de l'article 11 du règlement EMIR, dans le cadre de transactions intragroupe portant sur des contrats dérivés de gré à gré, au sens de l'article 3 du même règlement, sollicitent l'autorisation de l'Autorité de contrôle prudentiel et de résolution.

À cette fin, les entités déclarantes complètent le « formulaire de demande » qui figure en annexe de la présente instruction et le transmettent par courrier, ainsi que par voie électronique en format xls.

Conformément à l'article 32, paragraphes 3 et 8 du Règlement délégué (UE) n° 2016/2251 de la Commission du 4 octobre 2016, le délai de traitement des demandes débute à la date de réception de l'ensemble des éléments d'information visés par le formulaire mentionné à l'alinéa précédent.

Article 3

La présente instruction entre en vigueur dès sa publication.

Fait à Paris, le 6 mars 2017

Le Président
de l'Autorité de contrôle prudentiel
et de résolution,

[François VILLEROY de GALHAU]

Annexe Formulaire de demande d'exemption d'échange obligatoire de garanties (collatéral) prévue à l'article 11 du règlement EMIR et son annexe.