

AUTORITÉ DE CONTRÔLE PRUDENTIEL ET DE RÉOLUTION

DÉCISION DU COLLÈGE DE SUPERVISION

Décision n° 2021-C-25

du 7 juillet 2021

Mise en œuvre du règlement UE n° 2019/2033 du Parlement européen et du Conseil du 27 novembre 2019 concernant les exigences prudentielles applicables aux entreprises d'investissement et modifiant les règlements (UE) n° 1093/2010, (UE) n° 575/2013, (UE) n° 600/2014 et (UE) n° 806/2014

LE SOUS-COLLÈGE SECTORIEL DE LA BANQUE

Vu le Code monétaire et financier ;

Vu le règlement UE n° 2019/2033 du Parlement européen et du Conseil du 27 novembre 2019 concernant les exigences prudentielles applicables aux entreprises d'investissement et modifiant les règlements (UE) n° 1093/2010, (UE) n° 575/2013, (UE) n° 600/2014 et (UE) n° 806/2014 ;

Vu l'avis de la Commission consultative Affaires prudentielles du 23 juin 2021 ;

DÉCIDE

Article 1^{er} : Pour ce qui concerne les exigences prudentielles applicables aux entreprises d'investissement, le paragraphe 2 de l'article 41 du règlement UE n° 2019/2033 du Parlement européen et du Conseil du 27 novembre 2019 concernant les exigences prudentielles applicables aux entreprises d'investissement et modifiant les règlements (UE) n° 1093/2010, (UE) n° 575/2013, (UE) n° 600/2014 et (UE) n° 806/2014 est mis en œuvre sur le territoire de la République française conformément aux dispositions de l'article 2.

Article 2 : Pour le calcul de la valeur exposée au risque mentionnée au paragraphe 1 de l'article 37 du règlement (UE) n° 2019/2033, les expositions suivantes sont exemptées :

a) à hauteur de 100 % moins les pondérations applicables conformément aux paragraphes 4 et 5 de l'article 129 du règlement (UE) n° 575/2013 du Parlement européen et du Conseil du 26 juin 2013 pour les obligations garanties ;

b) en totalité pour les expositions encourues par une entreprise d'investissement sur son entreprise mère, sur les autres filiales de cette entreprise mère ou sur ses propres filiales, pour autant que ces entreprises soient supervisées sur base consolidée, conformément à l'article 7 du règlement (UE) n° 2019/2033 ou au règlement (UE) n° 575/2013, qu'elles fassent l'objet d'une surveillance du respect du test de la

capitalisation du groupe, conformément à l'article 8 du règlement (UE) n° 2019/2033, ou qu'elles soient supervisées conformément aux normes équivalentes en vigueur dans un pays tiers, et pour autant que les conditions suivantes soient remplies :

- i) il n'existe, en droit ou en fait, aucun obstacle significatif, actuel ou prévu, au transfert rapide de fonds propres ou au remboursement rapide de passifs par l'entreprise mère ; et
- ii) les procédures d'évaluation, de mesure et de contrôle des risques de l'entreprise mère incluent l'entité du secteur financier.

Article 3 : La présente décision sera publiée au registre officiel de l'Autorité de contrôle prudentiel et de résolution.

Le Président désigné,

[Denis BEAU]