

BASE DE DATOS DE Norma DEF.-

Referencia: NCL012203

REGLAMENTO DELEGADO (UE) 2018/1645, DE LA COMISIÓN, de 13 de julio, por el que se completa el Reglamento (UE) 2016/1011 del Parlamento Europeo y del Consejo en lo que respecta a las normas técnicas de regulación relativas a la forma y el contenido de la solicitud de reconocimiento ante la autoridad competente del Estado miembro de referencia y de la información presentada en la notificación a la Autoridad Europea de Valores y Mercados (AEVM).

(DOUE L 274, de 5 de noviembre de 2018)

[El presente Reglamento entrará en vigor 25 de noviembre de 2018. Será de aplicación a partir del 25 de enero de 2019.]*

LA COMISIÓN EUROPEA,

Visto el Tratado de Funcionamiento de la Unión Europea,

Visto el Reglamento (UE) 2016/1011 del Parlamento Europeo y del Consejo, de 8 de junio de 2016, sobre los índices utilizados como referencia en los instrumentos financieros y en los contratos financieros o para medir la rentabilidad de los fondos de inversión, y por el que se modifican las Directivas 2008/48/CE y 2014/17/UE y el Reglamento (UE) n.º 596/2014, y en particular su artículo 32, apartado 9,

Considerando lo siguiente:

(1) Un administrador de índices de referencia radicado en un tercer país puede solicitar su reconocimiento en la Unión. En la solicitud de reconocimiento, el administrador debe indicar exhaustivamente los sistemas, las políticas y los procedimientos que ha instaurado a fin de cumplir los requisitos establecidos en el Reglamento (UE) 2016/1011 que le son de aplicación. El presente Reglamento tiene por objeto asegurar que las autoridades competentes de toda la Unión reciban información uniforme y coherente de los administradores de índices de referencia de terceros países que soliciten su reconocimiento.

(2) La solicitud de reconocimiento debe incluir información sobre la elección del Estado miembro de referencia, de conformidad con el artículo 32, apartado 4, del Reglamento (UE) 2016/1011, y sobre el representante legal en el Estado miembro de referencia. Esa información debe permitir a la autoridad competente del Estado miembro de referencia comprobar que este Estado ha sido correctamente determinado y que el administrador de un tercer país cuenta con un representante legal que está establecido en dicho Estado miembro y que está capacitado para actuar conforme a lo exigido por el Reglamento (UE) 2016/1011.

(3) Para que la autoridad competente pueda evaluar si existen conflictos de intereses derivados de los intereses comerciales de los propietarios del solicitante que puedan afectar a la independencia de este último y, por tanto, menoscabar la exactitud e integridad de sus índices de referencia, conviene que el solicitante facilite información sobre las actividades de sus propietarios y sobre la propiedad de sus empresas matrices.

(4) Resulta oportuno que el solicitante facilite información sobre la composición, el funcionamiento y el grado de independencia de sus órganos directivos, con objeto de que la autoridad competente pueda evaluar si la estructura de gobernanza empresarial garantiza la independencia del administrador en el cálculo del índice de referencia, así como la prevención de los conflictos de intereses.

(5) Con objeto de evaluar la manera en que se eliminan, o se gestionan y comunican, los conflictos de intereses, el solicitante debe facilitar a la autoridad competente una explicación sobre la forma en que los conflictos de intereses que puedan surgir se detectan, registran, gestionan, mitigan, previenen y solucionan.

(6) A fin de permitir a la autoridad competente evaluar la pertinencia y solidez de la estructura de control interno, la vigilancia y el sistema de rendición de cuentas, el proveedor solicitante debe notificar a dicha autoridad las políticas y procedimientos para controlar las actividades de elaboración de un índice de referencia o una familia de índices de referencia.



(7) La solicitud de reconocimiento debe incluir información que demuestre que los controles sobre los datos de cálculo, a partir de los cuales se calculan los índices de referencia del solicitante, son adecuados para garantizar la representatividad, exactitud e integridad de tales datos.

(8) Con objeto de que la autoridad competente pueda evaluar si los índices de referencia elaborados por el solicitante son aptos para su utilización actual o prospectiva en la Unión, con el propósito último de incluirlos en el registro del artículo 36 del Reglamento (UE) 2016/1011, debe facilitarse en la solicitud de reconocimiento una lista de todos los índices de referencia elaborados por el solicitante que ya se utilicen o estén destinados a ser utilizados en el futuro en la Unión, junto con una descripción de los mismos.

(9) La información sobre la naturaleza y las características de los índices de referencia elaborados por el solicitante es pertinente para mostrar a la autoridad competente si la evaluación del cumplimiento de los requisitos aplicables del Reglamento (UE) 2016/1011 ha de llevarse a cabo con referencia a alguno de los regímenes especiales aplicables, a los índices de referencia de datos regulados o a los índices de referencia de materias primas que no se basen en aportaciones de contribuidores que sean en su mayor parte entidades supervisadas, con arreglo a lo establecido en el Reglamento (UE) 2016/1011.

(10) Si el solicitante considera que uno o varios de sus índices de referencia son significativos o no significativos, debe incluir en la solicitud de reconocimiento información sobre el grado de utilización de dichos índices en la Unión, de modo que la autoridad competente pueda evaluar si la clasificación como significativos o no significativos es correcta. Los índices de referencia elaborados por el solicitante que aún no se utilicen en la Unión y que figuren en la solicitud de reconocimiento atendiendo a su utilización prospectiva en la Unión se consideran, de conformidad con el artículo 3, apartado 1, punto 27, del Reglamento (UE) 2016/1011 índices de referencia no significativos.

(11) El presente Reglamento se basa en los proyectos de normas técnicas de regulación que la Autoridad Europea de Valores y Mercados (AEVM) ha presentado a la Comisión.

(12) La AEVM ha llevado a cabo consultas públicas abiertas sobre los proyectos de normas técnicas de regulación en que se basa el presente Reglamento, ha analizado los costes y beneficios potenciales correspondientes y ha recabado el dictamen del Grupo de Partes Interesadas del Sector de Valores y Mercados, establecido de conformidad con el artículo 37 del Reglamento (UE) n.º 1095/2010 del Parlamento Europeo y del Consejo.

(13) Resulta oportuno conceder a los administradores tiempo suficiente para preparar las solicitudes y garantizar el cumplimiento de los requisitos del presente Reglamento y las normas técnicas de regulación contempladas en el anexo. Por consiguiente, el presente Reglamento debe comenzar a aplicarse dos meses después de su entrada en vigor.

HA ADOPTADO EL PRESENTE REGLAMENTO:

Artículo 1. *Requisitos generales.*

1. Cuando soliciten su reconocimiento en virtud del artículo 32 del Reglamento (UE) 2016/1011, los administradores radicados en terceros países facilitarán la información enumerada en el anexo.

2. En el supuesto de que el solicitante omita facilitar parte de la información requerida, la solicitud incluirá una explicación de los motivos por los que no se ha facilitado.

Artículo 2. *Formato de la solicitud.*

1. La solicitud de reconocimiento se presentará en la lengua oficial o en una de las lenguas oficiales del Estado miembro de referencia, salvo que se indique lo contrario en el anexo. Los documentos a que se refiere el



punto 8 del anexo se presentarán en una lengua habitual en el campo de las finanzas internacionales o en la lengua oficial o una de las lenguas oficiales del Estado miembro de referencia.

2. La solicitud de reconocimiento se presentará por medios electrónicos o, si la autoridad competente pertinente lo admite, en soporte papel. Esos medios electrónicos deberán garantizar que la completitud, integridad y confidencialidad de la información se mantenga durante su transmisión. El solicitante se asegurará de que cada documento presentado indica claramente a qué requisito específico del presente Reglamento responde.

Artículo 3. Información específica relativa a las políticas y procedimientos.

1. Las políticas y procedimientos establecidos para cumplir con los requisitos del Reglamento (UE) 2016/1011 y descritos en una solicitud deberán contener o ir acompañados de lo siguiente:

- a) la indicación de la identidad de la persona o personas responsables de la aprobación y el mantenimiento de las políticas y procedimientos;
- b) una descripción de la manera en que se controla el cumplimiento de las políticas y procedimientos y la identidad de la persona o personas responsables de dicho control;
- c) una descripción de las medidas que se adoptarán en caso de incumplimiento de las políticas y procedimientos.

2. Cuando el solicitante sea una empresa que forme parte de un grupo, podrá cumplir lo dispuesto en el apartado 1 presentando las políticas y procedimientos de su grupo, en la medida en que se refieran a la elaboración de índices de referencia.

Artículo 4. Entrada en vigor.

El presente Reglamento entrará en vigor a los veinte días de su publicación en el *Diario Oficial de la Unión Europea*. Será aplicable a partir del 25 de enero de 2019.

El presente Reglamento será obligatorio en todos sus elementos y directamente aplicable en cada Estado miembro.

Hecho en Bruselas, el 13 de julio de 2018.

Por la Comisión
El Presidente
Jean-Claude JUNCKER

ANEXO

Información que deberá facilitarse en la solicitud de reconocimiento con arreglo al artículo 32 del Reglamento (UE) 2016/1011

SECCIÓN A - INFORMACIÓN SOBRE LA PERSONA QUE ELABORA EL ÍNDICE Y SU REPRESENTANTE LEGAL EN LA UNIÓN

1. INFORMACIÓN GENERAL

- a) Nombre completo e identificador de entidad jurídica (LEI) del solicitante.
- b) Dirección de la sede en el país de radicación.
- c) Forma jurídica.
- d) Sitio web, en su caso.
- e) En caso de que el solicitante sea objeto de supervisión en el tercer país en el que esté radicado, información sobre su autorización actual, incluidas las actividades que está autorizado a realizar, el nombre y la

dirección de la autoridad competente del tercer país y el enlace con el registro de esta autoridad, en su caso; si varias autoridades son responsables de la supervisión, se especificarán las respectivas áreas de competencia.

f) Descripción de las actividades del solicitante en la UE y en terceros países, con independencia de que estén sujetas a regulación financiera de la UE o de fuera de la UE, que sean pertinentes para la actividad de elaboración de índices de referencia, junto con la indicación de dónde se llevan a cabo.

g) Si el solicitante forma parte de un grupo, su estructura de grupo junto con el diagrama de las relaciones de propiedad, en el que se muestren los vínculos entre las empresa matrices y filiales. Deberá identificarse a las empresas y filiales que aparezcan en el diagrama mediante su nombre completo, su forma jurídica y la dirección de su domicilio social y su administración central.

h) Declaración de honorabilidad del propio interesado, con información, en su caso, de lo siguiente:

i) procedimientos de carácter disciplinario, pasados y en curso, incoados contra el interesado (salvo que hayan sido archivados);

ii) denegación de autorización o inscripción registral por una autoridad financiera;

iii) revocación de la autorización o inscripción registral por una autoridad financiera.

2. REPRESENTANTE LEGAL EN EL ESTADO MIEMBRO DE REFERENCIA

a) Pruebas documentales en apoyo de la elección del Estado miembro de referencia, de conformidad con los criterios establecidos en el artículo 32, apartado 4, del Reglamento (UE) 2016/1011.

b) Con respecto al representante legal establecido en el Estado miembro de referencia, con arreglo a lo dispuesto en el artículo 32, apartado 3, del Reglamento (UE) 2016/1011, los siguientes datos:

i) nombre completo;

ii) cargo, si se trata de una persona física, o forma jurídica, si se trata de una persona jurídica;

iii) escritura de constitución, estatutos u otros documentos constitutivos, si se trata de una persona jurídica, e indicación de si es objeto de supervisión por una autoridad de supervisión;

iv) dirección;

v) dirección de correo electrónico;

vi) número de teléfono;

vii) confirmación por escrito de la autoridad del representante legal de que actúa en nombre del solicitante, de conformidad con el artículo 32, apartado 3, del Reglamento (UE) 2016/1011;

viii) datos sobre el desempeño de la función de vigilancia por el representante legal en relación con la elaboración de índices de referencia que pueden utilizarse en la Unión;

ix) nombre, cargo, dirección postal, dirección de correo electrónico y número de teléfono de una persona de contacto en el representante legal.

3. ESTRUCTURA ORGANIZATIVA Y GOBERNANZA

a) Estructura organizativa interna en relación con el consejo de administración, los comités de la alta dirección, la función de vigilancia y cualquier otro órgano interno que ejerza funciones de gestión importantes y que intervenga en la elaboración de un índice de referencia, con indicación de:

i) su mandato o un resumen del mismo; y

ii) la adhesión a cualesquiera códigos de gobernanza o disposiciones similares.

b) Procedimientos que garanticen que los empleados del administrador y cualesquiera otras personas físicas que estén a su servicio o bajo su control y que intervengan directamente en la elaboración de un índice de referencia posean las cualificaciones, los conocimientos y la experiencia necesarios para desempeñar los cometidos que se les asignen, y actúen de conformidad con lo dispuesto en el artículo 4, apartado 7, del Reglamento (UE) 2016/1011.

c) Número de empleados (permanentes y temporales) que participen en la elaboración de un índice de referencia.

4. CONFLICTOS DE INTERESES



a) Políticas y procedimientos relativos a lo siguiente:

i) la forma en que los conflictos de intereses actuales y potenciales están siendo o serán detectados, registrados, gestionados, mitigados, prevenidos o solucionados;

ii) circunstancias particulares que se aplican al solicitante o a cualquier índice de referencia específico elaborado por el solicitante y que pueda utilizarse en la Unión, y en relación con las cuales es muy probable que surjan conflictos de intereses, en particular cuando se realice una apreciación experta o se ejerza la discrecionalidad en el proceso de determinación del índice de referencia, cuando el solicitante pertenezca al mismo grupo que un usuario del índice de referencia, y cuando el proveedor participe en el mercado o la realidad económica que el índice de referencia está destinado a medir.

b) Respecto de un determinado índice de referencia o familia de índices de referencia, una lista de los conflictos de intereses importantes detectados, junto con las correspondientes medidas de mitigación.

c) Estructura de la política de remuneración, especificando los criterios utilizados para determinar la remuneración de las personas que participan directa o indirectamente en la actividad de elaboración de índices de referencia.

5. ESTRUCTURA DE CONTROL INTERNO, VIGILANCIA Y SISTEMA DE RENDICIÓN DE CUENTAS

a) Políticas y procedimientos orientados al seguimiento de las actividades de elaboración de un índice de referencia o una familia de índices de referencia, incluidos los relativos a:

i) los sistemas informáticos;

ii) la gestión de riesgos, junto con un catálogo de los riesgos que puedan surgir y que puedan afectar a la exactitud, integridad y representatividad de los índices de referencia elaborados o a la continuidad de la actividad de elaboración, acompañado de las correspondientes medidas de mitigación;

iii) la constitución, el cometido y el funcionamiento de la función de vigilancia, tal como se describe en el artículo 5 del Reglamento (UE) 2016/1011 y se especifica en las normas técnicas de regulación adoptadas de conformidad con el artículo 5, apartado 5, del Reglamento (UE) 2016/1011, o los correspondientes principios sobre los índices de referencia financieros acordados por la Organización Internacional de Comisiones de Valores (OICV) el 17 de julio de 2013 («los principios de la OICV sobre los índices de referencia financieros»), o los principios para las agencias de comunicación de precios del petróleo acordados por la OICV el 5 de octubre de 2012 («los principios de la OICV para las agencias de comunicación de precios del petróleo»), según proceda, incluidos los procedimientos para el nombramiento, la sustitución o el cese de los integrantes de la función de vigilancia;

iv) la constitución, el cometido y el funcionamiento del sistema de control, tal como se describe en el artículo 6 del Reglamento (UE) 2016/1011, o los correspondientes principios de la OICV sobre los índices de referencia financieros o para las agencias de comunicación de precios del petróleo, según proceda, incluidos los procedimientos para el nombramiento, la sustitución o el cese de los responsables de dicho sistema;

v) el sistema de rendición de cuentas, tal como se describe en el artículo 7 del Reglamento (UE) 2016/1011, o los correspondientes principios de la OICV sobre los índices de referencia financieros o para las agencias de comunicación de precios del petróleo, según proceda, incluidos los procedimientos para el nombramiento, la sustitución o el cese de los responsables de dicho sistema.

b) Planes de contingencia para determinar y publicar un índice de referencia de forma temporal.

c) Procedimientos para la comunicación interna de las infracciones del Reglamento (UE) 2016/1011 por parte de los directivos, los empleados o cualquier otra persona física que esté al servicio o bajo el control del proveedor.

6. EXTERNALIZACIÓN

Cuando se externalice cualquier actividad que forme parte del proceso de elaboración de un índice de referencia o una familia de índices de referencia:

- a) acuerdos de externalización, incluidos los acuerdos de nivel de servicio, que demuestren el cumplimiento de lo previsto en el artículo 10 del Reglamento (UE) 2016/1011 o los correspondientes principios de la OICV sobre los índices de referencia financieros o para las agencias de comunicación de precios del petróleo, según proceda;
- b) datos de las funciones externalizadas, salvo que esta información ya figure en los contratos pertinentes;
- c) políticas y procedimientos para la vigilancia de las actividades externalizadas, salvo que esta información ya figure en los contratos pertinentes.

7. CUMPLIMIENTO DE LOS PRINCIPIOS DE LA OICV

- a) En su caso, evaluación por un auditor externo independiente del cumplimiento de los principios sobre los índices de referencia financieros acordados por la Organización Internacional de Comisiones de Valores (OICV) el 17 de julio de 2013 o de los principios para las agencias de comunicación de precios del petróleo acordados por la OICV el 5 de octubre de 2012, según proceda.
- b) En su caso, cuando el solicitante esté sujeto a supervisión, certificación facilitada por la autoridad competente del tercer país donde el solicitante esté radicado, que dé fe del cumplimiento de los principios de la OICV a que se refiere la letra a).

8. OTRA INFORMACIÓN

- a) El solicitante podrá facilitar cuanta información adicional considere pertinente para su solicitud.
- b) El solicitante presentará esta información en la forma establecida por la autoridad competente.

SECCIÓN B INFORMACIÓN SOBRE LOS ÍNDICES DE REFERENCIA

9. DESCRIPCIÓN DE LOS ÍNDICES DE REFERENCIA O FAMILIAS DE ÍNDICES DE REFERENCIA, ACTUALES O FUTUROS, QUE PUEDAN UTILIZARSE EN LA UNIÓN

- a) Lista de todos los índices de referencia elaborados por el solicitante que ya se utilizan en la Unión, en su caso, con sus números internacionales de identificación de valores (ISIN).
- b) Descripción del índice de referencia o de la familia de índices de referencia elaborados y que ya se utilizan en la Unión, incluidas una descripción del mercado o la realidad económica subyacentes que el índice de referencia o la familia de índices de referencia están destinados a medir, indicando las fuentes utilizadas para facilitar estas descripciones, y una descripción de los contribuidores, si los hubiera, de este índice de referencia o familia de índices de referencia.
- c) Lista de todos los índices de referencia que está previsto comercializar para su uso en la Unión, en su caso, con sus códigos ISIN.
- d) Descripción del índice de referencia o de la familia de índices de referencia que está previsto comercializar para su uso en la Unión, incluidas una descripción del mercado o la realidad económica subyacentes que el índice de referencia o la familia de índices de referencia están destinados a medir, indicando las fuentes utilizadas para facilitar estas descripciones, y una descripción de los contribuidores, si los hubiera, de este índice de referencia o familia de índices de referencia.
- e) Cualquier prueba documental de que el índice de referencia o la familia de índices de referencia mencionados en las letras b) y d) pueden considerarse índices de referencia de datos regulados, de conformidad con la definición del artículo 3, apartado 1, punto 24, del Reglamento (UE) 2016/1011, y pueden, por tanto, acogerse a las exenciones enumeradas en el artículo 17, apartado 1, del mismo Reglamento.
- f) Cualquier prueba documental de que el índice de referencia o la familia de índices de referencia mencionados en las letras b) y d) pueden considerarse índices de referencia de materias primas, de conformidad con la definición del artículo 3, apartado 1, punto 23, del Reglamento (UE) 2016/1011, y de que no se basan en aportaciones de contribuidores que son en su mayor parte entidades supervisadas, junto con las posibles pruebas de la aplicación de los requisitos del régimen especial establecidos en el artículo 19 y el anexo II del Reglamento o de los correspondientes principios de la OICV para las agencias de comunicación de precios del petróleo.
- g) Cualquier prueba documental de que el índice de referencia o la familia de índices de referencia mencionados en las letras b) y d) pueden considerarse índices de referencia de tipos de interés, de conformidad con la definición del artículo 3, apartado 1, punto 22, del Reglamento (UE) 2016/1011, junto con las posibles

pruebas de la aplicación de los requisitos del régimen especial establecidos en el artículo 18 y el anexo I del Reglamento.

h) Cualquier prueba documental de que el índice de referencia o la familia de índices de referencia mencionados en la letra b) presentan un grado de utilización en el territorio de la Unión tal que el índice de referencia o todos los índices de referencia incluidos en la familia pueden considerarse índices de referencia significativos, de conformidad con la definición del artículo 3, apartado 1, punto 26, del Reglamento (UE) 2016/1011, o índices de referencia no significativos, de conformidad con la definición del artículo 3, apartado 1, punto 27, del Reglamento (UE) 2016/1011. La información que deberá facilitarse se determinará, en la medida de lo posible, sobre la base de las disposiciones del Reglamento Delegado (UE) 2018/66 de la Comisión para la evaluación del importe nominal de los instrumentos financieros distintos de los derivados, el importe notional de los derivados y el valor neto de los activos de los fondos de inversión que hagan referencia a índices de referencia de terceros países, dentro de la Unión, incluso en el caso de referencia indirecta a cualquiera de tales índices dentro de una combinación de índices de referencia.

i) Justificación en la que se basa la aplicación por el administrador al índice de referencia de alguna de las exenciones enumeradas en el artículo 25, apartado 1, para los índices de referencia significativos, y en el artículo 26, apartado 1, del Reglamento (UE) 2016/1011, para los índices de referencia no significativos; la información se presentará, en la medida de lo posible, con arreglo al formato establecido por las normas técnicas de ejecución adoptadas de conformidad con el artículo 25, apartado 8, y el artículo 26, apartado 5, del Reglamento (UE) 2016/1011.

j) Información sobre las medidas relativas a las correcciones de la determinación o publicación de un índice de referencia.

k) Información sobre el procedimiento que debe llevar a cabo el proveedor en caso de modificación o de cesación de un índice de referencia, de conformidad con el artículo 28, apartado 1, del Reglamento (UE) 2016/1011 o los correspondiente principios de la OICV sobre los índices de referencia financieros o para las agencias de comunicación de precios del petróleo, según proceda.

10. DATOS DE CÁLCULO Y METODOLOGÍA

a) Por cada índice de referencia o familia de índices de referencia, las políticas y procedimientos con respecto a los datos de cálculo, incluidos los relativos a lo siguiente:

i) el tipo de datos de cálculo utilizados, su prioridad de uso y el ejercicio de la discrecionalidad o la realización de una apreciación experta;

ii) los procesos para garantizar que los datos de cálculo sean suficientes, adecuados y verificables;

iii) los criterios que determinen quién podrá aportar datos de cálculo al administrador y el proceso de selección de los contribuidores;

iv) la evaluación de los datos de cálculo del contribuidor y el proceso de validación de los datos de cálculo.

b) Por cada índice de referencia o familia de índices de referencia, y en lo que respecta a la metodología:

i) una descripción de la metodología, destacando sus elementos fundamentales con arreglo al artículo 13 del Reglamento (UE) 2016/1011 y a lo especificado en las normas técnicas de regulación adoptadas en virtud del artículo 13, apartado 3, del Reglamento (UE) 2016/1011;

ii) las políticas y procedimientos, incluidos los relativos a lo siguiente:

- las medidas adoptadas a efectos de la validación y la revisión de la metodología, incluidas las pruebas, retrospectivas o de otro tipo, realizadas;

- el proceso de consulta sobre cualquier cambio sustancial que se prevea introducir en la metodología.

© Unión Europea, <http://eur-lex.europa.eu/>

Únicamente se consideran auténticos los textos legislativos de la Unión Europea publicados en la edición impresa del Diario Oficial de la Unión Europea.