

BASE DE DATOS DE Norma DEF.-

Referencia: NCL012206

REGLAMENTO DELEGADO (UE) 2018/1646, 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 sobre la información que se ha de facilitar en la solicitud de autorización y en la solicitud de inscripción registral.

(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 34, apartado 8,

Considerando lo siguiente:

(1) El presente Reglamento establece la información que la autoridad competente debe recibir junto con la solicitud de autorización o de inscripción registral de un administrador de índices de referencia, en función de las características del solicitante o de los índices de referencia elaborados y destinados a ser utilizados en la Unión. Esa especificación de la información que debe facilitarse en la solicitud de autorización y en la solicitud de inscripción registral favorece un proceso común y coherente en toda la Unión.

(2) Es importante que la autoridad competente reciba la información establecida en el presente Reglamento para poder evaluar si las medidas adoptadas por el solicitante de la autorización o de la inscripción registral cumplen los requisitos establecidos en el Reglamento (UE) 2016/1011.

(3) Para que la autoridad competente pueda evaluar si existen conflictos de intereses derivados de las actividades relacionadas con los índices y de los intereses comerciales de los propietarios del solicitante que puedan afectar a la independencia de este último a la hora de calcular el índice de referencia y, por tanto, menoscabar la exactitud e integridad del índice, el solicitante debe estar obligado a presentar 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 y el funcionamiento de sus órganos directivos y la independencia de estos en el cálculo del índice de referencia, con objeto de que la autoridad competente pueda evaluar si la estructura de gobernanza empresarial garantiza la independencia del solicitante en el cálculo del índice de referencia, así como la prevención y la gestión de los conflictos de intereses.

(5) Procede que el solicitante facilite información sobre sus políticas y procedimientos con respecto a la detección, gestión, mitigación y comunicación de los conflictos de intereses en relación con su actividad de elaboración de índices de referencia o familias de índices de referencia. Cuando se trate de índices de referencia cruciales, habida cuenta de su mayor importancia sistémica, conviene que el solicitante facilite a la autoridad competente un inventario actualizado de los conflictos de intereses existentes, junto con una explicación de cómo se gestionan.

(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 solicitante debe notificar las políticas y procedimientos para controlar las actividades de elaboración de un índice de referencia o una familia de índices de referencia. Esta información es necesaria para que la autoridad competente evalúe si dichas políticas y procedimientos cumplen los requisitos del Reglamento (UE) 2016/1011.



(7) La información debe también incluirse en la solicitud con el objeto de demostrar a la autoridad competente que los controles a los que se someten los datos de cálculo utilizados para determinar los índices de referencia elaborados por el solicitante son adecuados para garantizar la representatividad, la exactitud y la integridad de esos datos, y que la metodología empleada para calcular dichos índices reúne todas las características requeridas por el Reglamento (UE) 2016/1011.

(8) A fin de permitir a la autoridad competente evaluar si el índice de referencia es representativo de la realidad económica que está destinado a medir, el solicitante debe facilitarle una descripción del índice de referencia o de la familia de índices de referencia que elabore o vaya a elaborar y del tipo de índice de referencia al que pertenecen, de conformidad con las disposiciones del Reglamento (UE) 2016/1011. El tipo al que pertenece el índice debe evaluarse según el leal saber y entender del solicitante e indicarse junto con las fuentes de los datos utilizados, de modo que la autoridad competente pueda conocer la fiabilidad y exhaustividad de la información subyacente.

(9) El contenido de la solicitud de autorización o inscripción registral correspondiente a una persona física debe establecerse de forma específica, dado que la estructura organizativa del administrador será muy distinta de la de una persona jurídica.

(10) El presente Reglamento se basa en los proyectos de normas técnicas de regulación presentados por la Autoridad Europea de Valores y Mercados a la Comisión.

(11) La Autoridad Europea de Valores y Mercados 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 conexos 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.

(12) 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. Las solicitudes presentadas con arreglo al artículo 34 del Reglamento (UE) 2016/1011 comprenderán, según proceda, la siguiente información:

a) los elementos enumerados en el anexo I, cuando el solicitante sea una persona jurídica que solicite autorización;

b) los elementos enumerados en el anexo II, cuando el solicitante sea una persona jurídica que solicite su inscripción registral;

c) los elementos enumerados en el anexo I, a excepción de la información contemplada en el punto 1, letras c), f), h) e i), del anexo I, cuando el solicitante sea una persona física que solicite autorización;

d) los elementos enumerados en el anexo II, a excepción de la información contemplada en el punto 1, letras c), f), h) e i), del anexo II, cuando el solicitante sea una persona física que solicite su inscripción registral.

2. La solicitud podrá contener información correspondiente a una familia de índices de referencia únicamente cuando ninguno de los índices que integren la familia esté incluido en la lista de índices de referencia cruciales establecida de conformidad con el artículo 20, apartado 1, del Reglamento (UE) 2016/1011.

3. 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.



4. El solicitante no estará obligado a facilitar la información enumerada en el punto 1, letras f) a j), del anexo I o del anexo II, según proceda, en la medida en que ya sea supervisado en el Estado miembro por la misma autoridad competente en relación con actividades distintas de la elaboración de índices de referencia.

Artículo 2. *Información exigida en relación con los tipos de índices de referencia.*

1. El solicitante podrá presentar, respecto de cualquier índice de referencia no significativo que elabore, la información exigida en el punto 6 del anexo I o en el punto 6 del anexo II, según proceda, en forma de resumen.

2. Las entidades no supervisadas que elaboren índices de referencia cruciales y significativos presentarán la información enumerada en el anexo I.

3. Las entidades supervisadas que elaboren únicamente índices de referencia no cruciales presentarán la información enumerada en la primera columna del anexo II.

4. Los solicitantes que elaboren únicamente índices de referencia no significativos presentarán la información enumerada en la segunda columna del anexo II.

5. Sin perjuicio de lo dispuesto en los apartados 1 a 4, los solicitantes que elaboren únicamente índices de referencia de datos regulados no presentarán la información enumerada en el punto 5, letra c), y en el punto 6, letra a), incisos iii) y iv), del anexo I y del anexo II.

6. Los solicitantes que elaboren únicamente índices de referencia de tipos de interés presentarán la información enumerada en los anexos del presente Reglamento y precisarán de qué modo se satisfacen los requisitos específicos establecidos en el anexo I del Reglamento (UE) 2016/1011, cuando las disposiciones de dicho anexo se apliquen de manera adicional a los requisitos del título II del Reglamento (UE) 2016/1011, o en sustitución de estos requisitos, de conformidad con el artículo 18 de dicho Reglamento.

7. Los solicitantes que elaboren únicamente índices de referencia de materias primas facilitarán la información enumerada en el anexo I del presente Reglamento, si se trata de entidades no supervisadas o si elaboran un índice de referencia crucial. Si se trata de una entidad supervisada y ninguno de los índices de referencia que elabora es un índice de referencia crucial, facilitará la información enumerada en la primera columna del anexo II. El solicitante especificará de qué modo se satisfacen los requisitos establecidos en el anexo II del Reglamento (UE) 2016/1011 en relación con cualquier índice de referencia de materias primas que esté sujeto a lo previsto en el anexo II en lugar de lo previsto en el título II del Reglamento (UE) 2016/1011, de conformidad con el artículo 19 de dicho Reglamento.

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

1. Las políticas y procedimientos que figuren en una solicitud deberán contener o ir acompañados de:

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 las 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 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 I

Información que deberá facilitarse en la solicitud de autorización con arreglo al artículo 34 del Reglamento (UE) 2016/1011

1. INFORMACIÓN GENERAL

- a) Nombre completo e identificador de entidad jurídica (LEI) del solicitante.
- b) Dirección de la sede en la Unión Europea.
- c) Forma jurídica.
- d) Sitio web, en su caso.
- e) Con respecto a la persona de contacto a efectos de la solicitud:

- i) nombre,
- ii) cargo,
- iii) dirección,
- iv) dirección de correo electrónico,
- v) número de teléfono.

f) Si el solicitante es una entidad supervisada, información sobre su autorización actual, incluidas las actividades que está autorizada a realizar y su autoridad competente en su Estado miembro de origen.

g) Descripción de las actividades del solicitante en la Unión Europea, con independencia de que estén o no sujetas a regulación financiera, que sean pertinentes para la actividad de elaboración de índices de referencia, junto con la indicación de dónde se llevan a cabo.

h) En su caso, escritura de constitución, estatutos u otros documentos constitutivos.

i) 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.

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

- i) procedimientos de carácter disciplinario 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.

k) Número de índices de referencia elaborados.

2. 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 relacionadas con 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 participan en la elaboración de un índice de referencia.

3. 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 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 solicitante 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. Respecto de cada índice de referencia crucial, un inventario actualizado de los conflictos de intereses reales y potenciales, 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.

4. 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 del índice de referencia elaborado 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 de la Comisión, 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, 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, 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, incluidos planes de continuidad de la actividad y de recuperación en caso de catástrofe.



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 solicitante.

5. DESCRIPCIÓN DE LOS ÍNDICES DE REFERENCIA O FAMILIAS DE ÍNDICES DE REFERENCIA ELABORADOS

a) Descripción de un índice de referencia o una familia de índices de referencia que el solicitante elabore o se proponga elaborar y del tipo al que el índice pertenezca, según el leal saber y entender del solicitante y teniendo en cuenta las disposiciones del Reglamento (UE) 2016/1011, junto con la indicación de las fuentes utilizadas para determinar el tipo de índice de referencia.

b) Descripción del mercado o la realidad económica subyacentes que el índice de referencia o la familia de índices de referencia estén destinados a medir, junto con la indicación de las fuentes utilizadas para proporcionar esta descripción.

c) Descripción de los contribuidores a un índice de referencia o una familia de índices de referencia, así como del código de conducta a que se refiere el artículo 15 del Reglamento (UE) 2016/1011 y, cuando se trate de índices de referencia cruciales, indicación del nombre y la radicación de los contribuidores.

d) Información sobre las medidas relativas a las correcciones de la determinación o publicación de un índice de referencia o una familia de índices de referencia.

e) Información sobre el procedimiento que debe llevar a cabo el administrador en caso de modificación o de cesación de un índice de referencia o una familia de índices de referencia, de conformidad con el artículo 28, apartado 1, del Reglamento (UE) 2016/1011.

6. 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 de la Comisión,

ii) las políticas y procedimientos, incluidas las relativas a lo siguiente:

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

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

7. 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) los acuerdos de externalización pertinentes, incluidos los acuerdos de nivel de servicio, que demuestren el cumplimiento de lo previsto en el artículo 10 del Reglamento (UE) 2016/1011;

b) los datos de las funciones externalizadas, salvo que esta información ya figure en los contratos pertinentes;

c) las políticas y procedimientos para la vigilancia de las actividades externalizadas.



8. OTRA INFORMACIÓN

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

ANEXO II

Información que deberá facilitarse en la solicitud de inscripción registral con arreglo al artículo 34 del Reglamento (UE) 2016/1011

«A» significa «aplicable»

«N/A» significa «no aplicable»

Elemento del anexo I		Entidades supervisadas que elaboran únicamente índices de referencia no cruciales	Entidades que elaboran únicamente índices de referencia no significativos
1) Información general			
1.a)	Nombre completo	A	A
1.b)	Dirección	A	A
1.c)	Forma jurídica	A	A
1.d)	Sitio web	A	A
1.e)	Persona de contacto	A	A
1.f)	Autorización actual	A ⁽¹⁾	A ⁽¹⁾ para las entidades supervisadas N/A para las entidades no supervisadas
1.g)	Actividades realizadas	A ⁽¹⁾	A ⁽¹⁾
1.h)	Documentos constitutivos	A ⁽¹⁾	A ⁽¹⁾
1.i)	Estructura del grupo	A ⁽¹⁾	A ⁽¹⁾
1.j)	Declaración de honorabilidad del interesado	A ⁽¹⁾	A ⁽¹⁾
1.k)	Número de índices de referencia	A	A
2) Estructura organizativa y gobernanza			
2.a)	Estructura organizativa interna	A	A
2.b)	Empleados	A	A
2.c)	Recursos humanos	A	N/A
3) Conflictos de intereses			



3.a)	Políticas y procedimientos	A ⁽²⁾	A ⁽²⁾ en forma de resumen
3.b)	Conflictos de intereses importantes	A	N/A
3.c)	Estructura de remuneración	A	A
4) Estructura de control interno, vigilancia y sistema de rendición de cuentas			
4.a)	Políticas y procedimientos para el seguimiento de las actividades de elaboración de un índice de referencia	A	A ⁽³⁾ en forma de resumen
4.b)	Disposiciones internas para la determinación y publicación de un índice de referencia	A	A en forma de resumen
4.c)	Comunicación interna de las infracciones	A	A en forma de resumen
5) Descripción de los índices de referencia elaborados			
5.a)	Descripción	A ⁽⁴⁾	A en forma de resumen
5.b)	Mercado subyacente	A ⁽⁴⁾	A en forma de resumen
5.c)	Contribuidores	A ⁽⁴⁾	A en forma de resumen
5.d)	Correcciones	A ⁽⁴⁾	A en forma de resumen
5.e)	Modificación y cesación	A ⁽⁴⁾	A en forma de resumen
6) Datos de cálculo y metodología			
6.a).i)	Descripción de los datos de cálculo utilizados	A ⁽⁴⁾	A en forma de resumen
6.a).ii)	Datos de cálculo suficientes, adecuados y verificables	A ⁽⁴⁾	A (5) en forma de resumen
6.a).iii)	Contribuidores	A ⁽⁴⁾	A en forma de resumen
6.a).iv)	Evaluación y validación de los datos de cálculo del contribuidor	A ⁽⁶⁾	N/A
6.b).i)	Descripción de la metodología	A ⁽⁴⁾	A en forma de resumen
6.b).ii).1)	Validación/revisión	A ⁽⁴⁾	A en forma de resumen



6.b).ii).2)	Cambios sustanciales	A ⁽⁶⁾	N/A
7) Externalización			
7.a)	Contratos	A ⁽⁶⁾	N/A
7.b)	Funciones externalizadas	A ⁽⁶⁾	A en forma de resumen
7.c)	Control	A ⁽⁶⁾	A en forma de resumen
8) Otros			
8.a)	Información adicional	A	A
8.b)	Forma	A	A

(1) Salvo que ya sean supervisadas por la misma autoridad competente en relación con actividades distintas de la elaboración de índices de referencia.

(2) El solicitante podrá optar por no facilitar la información a que se refiere el punto 3, letra a), inciso iii), del anexo I, en relación con un índice de referencia, significativo o no significativo, que elabore.

(3) El solicitante podrá omitir, respecto de un índice de referencia no significativo que elabore, la información a que se refiere el punto 4, letra a), del anexo I en su inciso iii) -salvo la información sobre el establecimiento y el mantenimiento de una función de vigilancia permanente-, su inciso iv) y su inciso v) -en relación con parte de la información que debe facilitarse sobre el sistema de control y de rendición de cuentas-.

(4) Cuando una entidad supervisada elabore índices de referencia tanto significativos como no significativos, podrá facilitar esta información en forma de resumen en lo que respecta a sus índices de referencia no significativos.

(5) El solicitante podrá optar por no facilitar información acerca del carácter verificable de los datos de cálculo en relación con un índice de referencia no significativo que elabore.

(6) Cuando una entidad supervisada elabore índices de referencia tanto significativos como no significativos, podrá facilitar esta información únicamente en lo que respecta a sus índices de referencia significativos.

© 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.