

Ordonnance relative à la loi fédérale sur la Banque nationale suisse (Ordonnance de la Banque nationale, OBN)

Modification du 26 novembre 2015

La Banque nationale suisse
arrête:

I

L'ordonnance du 18 mars 2004 de la Banque nationale¹ est modifiée comme suit:

Art. 1, let. c

La présente ordonnance règle:

- c. la surveillance des infrastructures des marchés financiers d'importance systémique.

Art. 2, al. 1, let. h à n et q

¹ Au sens de la présente ordonnance, on entend par:

- h. *infrastructure des marchés financiers d'importance systémique*: un système de paiement, un dépositaire central ou une contrepartie centrale au sens de l'art. 22, al. 1, de la loi du 19 juin 2015 sur l'infrastructure des marchés financiers (LIMF)²;
- i. *système de paiement*: une organisation au sens de l'art. 81 LIMF;
- j. *Abrogée*
- k. *dépositaire central*: un exploitant au sens de l'art. 61, al. 1, LIMF;
- l. *contrepartie centrale*: une organisation au sens de l'art. 48 LIMF;
- m. *exploitant*: un dépositaire central ainsi que toute personne ou société qui exploite un système de paiement ou une contrepartie centrale;
- n. *participant indirect*: toute personne au sens de l'art. 2, let. e, LIMF;
- q. *fonds propres*: fonds propres de base durs au sens des art. 21 à 26 de l'ordonnance du 1^{er} juin 2012 sur les fonds propres³;

¹ RS 951.131

² RS 958.1

³ RS 952.03

Art. 3, let. b

La Banque nationale collecte les données statistiques nécessaires:

- b. à l'accomplissement de ses tâches dans le domaine de la surveillance des infrastructures des marchés financiers d'importance systémique;

Titre précédant l'art. 18

Chapitre 4 Surveillance des infrastructures des marchés financiers d'importance systémique

Section 1

Détermination des infrastructures des marchés financiers et des processus opérationnels d'importance systémique

Art. 18 Obligation d'informer

¹ L'obligation d'informer au sens de l'art. 20, al. 1, LBN s'applique:

- a. aux systèmes de paiement par lesquels des paiements d'un montant (brut) supérieur à 25 milliards de francs sont effectués au cours d'un exercice;
- b. aux dépositaires centraux;
- c. aux contreparties centrales.

² L'obligation d'informer s'applique avant même que le système de paiement, le dépositaire central ou la contrepartie centrale n'entre en activité; toutefois, les systèmes de paiement sont soumis à cette exigence uniquement s'il est probable que le montant prévu à l'al. 1, let. a, sera atteint dans la première année qui suit le commencement de l'activité.

Art. 19 Procédure

¹ La Banque nationale détermine par voie de décision les infrastructures des marchés financiers et leurs processus opérationnels qui sont d'importance systémique au sens de l'art. 22 LIMF⁴.

² Elle demande à l'exploitant de lui fournir les informations et documents nécessaires dans un délai donné et fixe la forme sous laquelle ils doivent être remis.

³ Avant de déterminer qu'une infrastructure des marchés financiers est d'importance systémique et quels sont ses processus opérationnels d'importance systémique, elle donne à l'exploitant la possibilité de prendre position. S'il s'agit d'une infrastructure des marchés financiers soumise à autorisation au sens de l'art. 4 LIMF, elle consulte la FINMA.

⁴ RS 958.1

Art. 20 Critères définissant les infrastructures des marchés financiers d'importance systémique

Pour déterminer si un système de paiement, un dépositaire central ou une contrepartie centrale est d'importance systémique au sens de l'art. 22, al. 1, LIMF⁵, la Banque nationale tient compte en particulier:

- a. des opérations qui sont compensées ou réglées par l'infrastructure; à cet effet, elle examine notamment s'il s'agit d'opérations de change, si elles sont passées sur le marché monétaire ou sur le marché des capitaux, si elles portent sur des produits dérivés ou si elles facilitent la mise en œuvre de la politique monétaire;
- b. du nombre et du montant des opérations qui sont compensées ou réglées par l'infrastructure;
- c. des monnaies dans lesquelles les opérations sont compensées ou réglées par l'infrastructure;
- d. du nombre, de la valeur nominale et de la monnaie d'émission des instruments financiers conservés ou gérés de façon centralisée par l'infrastructure;
- e. des participants;
- f. des liens existant avec d'autres infrastructures des marchés financiers;
- g. de la possibilité, pour les participants, de recourir à court terme à une autre infrastructure des marchés financiers ou à d'autres processus de compensation et de règlement pour leurs opérations, et des risques qui en découlent;
- h. des risques de crédit et de liquidité liés à l'exploitation de l'infrastructure.

Art. 20a et 21

Abrogés

Titre précédant l'art. 21a

Section 2

Exigences spéciales applicables aux infrastructures des marchés financiers d'importance systémique

Art. 21a Applicabilité des exigences spéciales

¹ Les infrastructures des marchés financiers d'importance systémique qui ne sont pas soumises à l'autorisation ni à la surveillance de la FINMA au sens de l'art. 4 LIMF⁶ sont assujetties à l'ensemble des exigences spéciales ci-après.

² Les infrastructures des marchés financiers d'importance systémique soumises à l'autorisation et à la surveillance de la FINMA au sens de l'art. 4 LIMF sont assujetties uniquement aux exigences prévues aux art. 23, 24, al. 4 à 6, 24a, 25c, 27, al. 1 et

⁵ RS 958.1

⁶ RS 958.1

2, 28, 28a à 28d, 29, 30, al. 1 et 3, 32 à 32c et 34, ainsi qu'aux obligations prévues à la section 3 à l'exception de l'art. 36, al. 1, let. h.

Art. 22, al. 3 et 4

Abrogés

Art. 22a, al. 5

Abrogé

Art. 22b, al. 2 et 3

Abrogés

Art. 23a, al. 1, let. f et h

Abrogées

Art. 24b

Abrogé

Art. 25a, al. 1, let. a et b

¹ Les règles de l'infrastructure des marchés financiers fixent le moment à partir duquel:

- a. l'ordre de paiement d'un participant ne peut plus être modifié ou révoqué;
- b. un paiement est réglé.

Art. 25b Règlement d'engagements liés

L'exploitant d'une infrastructure des marchés financiers permet aux participants d'éviter les risques de règlement; à cette fin, il garantit qu'en cas d'engagements liés entre eux, l'un n'est réglé que si le règlement de l'autre est assuré.

Art. 25c Dépositaires centraux

¹ Les dépositaires centraux établissent des règles, des procédures et des mécanismes de contrôle permettant de limiter le plus possible les risques découlant de la conservation et du transfert de titres.

² *Ne concerne que les textes allemand et italien.*

Art. 27, al. 1

¹ L'exploitant établit une méthode d'identification, de mesure, de gestion et de surveillance intégrées des principaux risques, et particulièrement des risques juri-

diques, des risques commerciaux, des risques opérationnels, des risques de crédit et des risques de liquidité.

Art. 28a, al. 3

³ Il évite toute concentration de risques liés aux garanties. Il fixe des limites de concentration afin de favoriser la diversification des garanties et vérifie que ces limites sont respectées. Il s'assure que les participants ne fournissent pas de garanties susceptibles de subir de fortes pertes de valeur s'ils sont défaillants.

Art. 28c, al. 1 et 2

¹ Les dépôts de garantie initiaux d'un participant couvrent les risques de crédit auxquels serait exposée la contrepartie centrale concernée en cas de défaillance du participant, en raison des variations de prix de marché attendues sur une durée appropriée, avec un niveau de confiance d'au moins 99 %. Le niveau de confiance est d'au moins 99,5 % pour les produits dérivés négociés hors bourse, sauf s'ils présentent les mêmes caractéristiques de risque que les produits dérivés négociés en bourse.

² La durée appropriée visée à l'al. 1 correspond à la durée écoulée entre le dernier versement de marge de variation et la date attendue pour la liquidation ou la couverture des créances et engagements en cas de défaillance d'un participant. Elle est d'au moins deux jours ouvrables. Elle est d'au moins cinq jours ouvrables pour les produits dérivés négociés hors bourse, sauf s'ils présentent les mêmes caractéristiques de risque que les produits dérivés négociés en bourse.

Art. 29, al. 4 et 5

⁴ Sont considérés comme liquidités au sens de l'al. 2 dans une monnaie dite de référence les avoirs en espèces, les lignes de crédit et les garanties visés aux art. 50, al. 1, et 58, al. 1, de l'ordonnance du 25 novembre 2015 sur l'infrastructure des marchés financiers, (OIMF)⁷.

⁵ L'exploitant diversifie ses fournisseurs de liquidités et évite la concentration de risques pour les garanties et les actifs au sens des art. 50, al. 1, let. d et e, et 58, al. 1, let. d et e, OIMF.

Art. 31, al. 3

³ Les garanties et autres ressources financières spécialement affectées qui sont utilisées pour couvrir les pertes résultant de la défaillance de participants ou d'autres risques de crédit et de liquidité conformément aux art. 28 et 29 ne sont pas prises en compte pour satisfaire à l'exigence définie à l'al. 2.

⁷ RS 958.11

Art. 32a, al. 3, let. j

³ Il prend des mesures organisationnelles et techniques afin d'atteindre les objectifs de sécurité de l'information, et ce tant en période normale d'exploitation que lors de travaux de développement et de maintenance ou si le nombre des transactions est provisoirement plus élevé. Il prend notamment les dispositions nécessaires pour:

- j. enregistrer, évaluer et corriger rapidement et de manière standardisée les erreurs de traitement et les perturbations affectant le système de traitement de l'information, et éviter qu'elles ne se reproduisent.

Art. 32d Externalisation

¹ Si l'exploitant externalise des prestations essentielles, il sélectionne les prestataires avec soin et les instruit.

² Il tient compte des prestations externalisées dans son système de contrôle interne et surveille en permanence les prestations qui lui sont fournies.

³ Il garde la responsabilité, pour les prestations externalisées, du respect des exigences spéciales prévues dans le présent chapitre.

⁴ Le contrat d'externalisation comprend notamment:

- a. une liste des prestations à fournir;
- b. une disposition donnant à la Banque nationale, à l'exploitant ou à un organe extérieur mandaté la possibilité d'examiner intégralement et sans restriction les prestations externalisées.

Art. 34, al. 2

² Si un dépositaire central établit des liens avec un autre dépositaire central:

- a. il couvre par des mesures de couverture appropriées et avec un niveau de confiance élevé les risques de crédit découlant de tout crédit qu'il lui accorde;
- b. il n'autorise l'utilisation des titres qu'il reçoit provisoirement de l'autre dépositaire central que si le transfert initial ne peut plus être modifié ou révoqué;
- c. il identifie, mesure, gère et surveille, si les liens sont indirects, les risques découlant de l'intervention d'intermédiaires financiers;
- d. il procède quotidiennement à un rapprochement comptable entre les titres qu'il détient indirectement et ceux qu'il détient auprès d'autres dépositaires centraux et auprès d'autres dépositaires;
- e. il s'efforce de permettre le règlement de transactions par livraison contre paiement entre ses participants et ceux de l'autre dépositaire central.

Titre précédant l'art. 35

Section 3 Evaluation du respect des exigences spéciales

Art. 35 Obligation de renseigner

L'exploitant fournit à la Banque nationale ou à tout tiers désigné par elle tous les renseignements et documents dont elle a besoin pour déterminer s'il respecte les exigences spéciales définies dans le présent chapitre.

Art. 36, al. 1, let. n, et 3, let. b

¹ L'exploitant fournit à la Banque nationale les documents et informations suivants:

- n. un rapport sur le respect des exigences spéciales définies dans le présent chapitre.

³ L'exploitant informe immédiatement la Banque nationale:

- b. de tout événement pouvant entraver notablement la réalisation des objectifs de sécurité de l'information au sens de l'art. 32a et des objectifs de continuité de l'activité au sens de l'art. 32b;

Art. 37, al. 1

¹ Afin d'évaluer le respect des exigences spéciales définies dans le présent chapitre, la Banque nationale peut procéder à des vérifications dans les locaux de l'infrastructure des marchés financiers, ou charger un tiers de le faire.

Art. 38 Procédure en cas de non-respect des exigences spéciales

¹ Si une infrastructure des marchés financiers ne satisfait pas aux exigences spéciales définies dans le présent chapitre, la Banque nationale adresse une recommandation à l'exploitant.

² Si l'exploitant ne suit pas une recommandation à lui adressée conformément à l'al. 1, la Banque nationale rend une décision.

³ Avant d'adresser une recommandation à l'exploitant au sens de l'al. 1 ou de rendre une décision au sens de l'al. 2, la Banque nationale donne à l'exploitant la possibilité de prendre position. Si l'infrastructure des marchés financiers concernée est soumise à l'autorisation et à la surveillance de la FINMA au sens de l'art. 4 LIMF⁸, la Banque nationale consulte au préalable la FINMA.

Art. 39

Abrogé

Art. 40

¹ Les sociétés d'audit vérifient que l'obligation de fournir des données à des fins statistiques et l'obligation de détenir des réserves minimales sont respectées.

² La vérification a lieu en règle générale lors de l'audit prévu par l'art. 24 de la loi du 22 juin 2007 sur la surveillance des marchés financiers⁹. Il convient d'éviter autant que possible les vérifications redondantes. Le rapport de vérification doit être communiqué à la Banque nationale dans les six mois qui suivent la clôture des comptes annuels.

Art. 41 Dispositions transitoires

¹ Pour les infrastructures des marchés financiers d'importance systémique soumises à l'autorisation et à la surveillance de la FINMA, les exigences spéciales définies aux art. 21a à 34 et les obligations énoncées à l'art. 36 s'appliquent à compter de l'entrée en vigueur de la décision d'autorisation au sens de l'art. 25 LIMF¹⁰. Jusqu'à cette date, le droit actuel continue de s'appliquer.

² Pour les infrastructures des marchés financiers d'importance systémique non soumises à l'autorisation et à la surveillance de la FINMA, les exigences spéciales définies aux art. 22 à 34 et les obligations énoncées à l'art. 36 s'appliquent à compter de l'entrée en vigueur de la modification du 26 novembre 2015 de la présente ordonnance.

II

L'annexe est modifiée conformément au texte ci-joint.

III

La présente ordonnance entre en vigueur le 1^{er} janvier 2016.

26 novembre 2015

Au nom de la Banque nationale suisse:

Le président de la Direction générale, Thomas Jordan

Un membre de la Direction générale, Fritz Zurbrugg

⁹ RS 956.1

¹⁰ RS 958.1

Enquêtes

Désignation de l'enquête:	Stocks de titres
Objet de l'enquête:	stocks de titres dans les dépôts ouverts de la clientèle; ventilation des titres selon la catégorie (en particulier papiers monétaires, obligations de caisse, obligations, actions, parts de placements collectifs de capitaux, produits structurés), selon l'origine de l'émetteur (Suisse ou étranger) et selon la monnaie; ventilation des titulaires de dépôts selon leur secteur économique et selon leur siège ou leur domicile (Suisse ou étranger); stocks de titres prêtés
Type d'enquête:	enquête partielle; enquête exhaustive
Etablissements tenus de renseigner:	banques, dépositaires centraux et contreparties centrales dont les stocks de titres dépassent 4,3 milliards de francs pour l'enquête mensuelle; l'ensemble des autres banques, dépositaires centraux et contreparties centrales pour l'enquête annuelle
Périmètre de consolidation:	comptoir
Fréquence:	mensuelle; annuelle
Délai de remise des données à compter de la date de référence de l'enquête:	enquête mensuelle: 25 jours enquête annuelle: 3 mois
Dispositions particulières:	–

Désignation de l'enquête:	Mouvements dans les dépôts de titres
Objet de l'enquête:	mouvements dus à des achats et ventes dans les dépôts ouverts de titres de la clientèle; ventilation des titulaires de dépôts selon le siège ou le domicile (Suisse ou étranger); ventilation des mouvements selon la catégorie de titres (en particulier papiers monétaires, obligations de caisse, obligations, actions, parts de placements collectifs de capitaux, produits structurés), selon l'origine de l'émetteur (Suisse ou étranger) et selon la monnaie
Type d'enquête:	enquête partielle
Etablissements tenus de renseigner:	banques, dépositaires centraux et contreparties centrales tenus de participer à l'enquête mensuelle sur les stocks de titres
Périmètre de consolidation:	comptoir
Fréquence:	trimestrielle
Délai de remise des données à compter de la date de référence de l'enquête:	25 jours
Dispositions particulières:	–

Désignation de l'enquête:	Répartition par pays des stocks de titres d'émetteurs étrangers dans les dépôts de la clientèle (IMF Coordinated Portfolio Investment Survey)
Objet de l'enquête:	recensement des titres d'émetteurs étrangers dans les dépôts ouverts de la clientèle suisse; ventilation selon la catégorie de titres (papiers monétaires, obligations, actions, parts de placements collectifs de capitaux, produits structurés et autres titres) et selon le pays d'origine des émetteurs
Type d'enquête:	enquête partielle
Etablissements tenus de renseigner:	banques, dépositaires centraux et contreparties centrales dont les dépôts de titres concernés dépassent 1,8 milliard de francs
Périmètre de consolidation:	comptoir
Fréquence:	trimestrielle
Délai de remise des données à compter de la date de référence de l'enquête:	25 jours
Dispositions particulières:	–

