

REGLAMENTO DELEGADO (UE) 2022/1858 DE LA COMISIÓN**de 10 de junio de 2022**

por el que se completa el Reglamento (UE) n.º 648/2012 del Parlamento Europeo y del Consejo en lo que respecta a las normas técnicas de regulación que especifican los procedimientos para la conciliación de datos entre los registros de operaciones y los procedimientos que debe aplicar el registro de operaciones para verificar el cumplimiento de los requisitos de notificación por la contraparte notificante o la entidad remitente y para verificar que los datos notificados sean completos y correctos

(Texto pertinente a efectos del EEE)

LA COMISIÓN EUROPEA,

Visto el Tratado de Funcionamiento de la Unión Europea,

Visto el Reglamento (UE) n.º 648/2012 del Parlamento Europeo y del Consejo, de 4 de julio de 2012, relativo a los derivados extrabursátiles, las entidades de contrapartida central y los registros de operaciones ⁽¹⁾, y en particular su artículo 78, apartado 10,

Considerando lo siguiente:

- (1) Para garantizar una calidad elevada de los datos relativos a los derivados notificados a los registros de operaciones, estos deben verificar la identidad de las entidades que remiten las notificaciones, la integridad lógica de la secuencia de comunicación de los datos de los derivados y que dichos datos sean completos y correctos.
- (2) Por la misma razón, los registros de operaciones deben conciliar los datos de cada notificación de derivados recibida cuando ambas contrapartes tengan una obligación de notificación. Conviene especificar un proceso normalizado que permita a los registros de operaciones proceder a la conciliación de manera coherente y que reduzca el riesgo de que los datos de los derivados no se concilien. No obstante, algunos datos de los derivados podrían no ser idénticos debido a las especificidades de los sistemas tecnológicos utilizados por las entidades que remiten las notificaciones. Es preciso, por tanto, aplicar ciertos límites de tolerancia, de manera que las diferencias de poca importancia existentes en los datos de los derivados notificados no impidan a las autoridades analizar estos datos con un nivel adecuado de confianza.
- (3) Además, y sin perjuicio de otras obligaciones relativas a los datos de los derivados recogidos y registrados al llevar a cabo el proceso de conciliación, los registros de operaciones deben garantizar la confidencialidad de los datos intercambiados entre ellos y puestos a disposición de las contrapartes notificantes, las entidades responsables de la notificación y las entidades que remiten la notificación.
- (4) Cuando un acto de reestructuración empresarial tiene como resultado la modificación del identificador de entidad jurídica («LEI») de una contraparte, es preciso actualizar los datos de las entidades identificadas en la notificación del derivado. Para garantizar la integridad de esa información, esencial para el seguimiento de los riesgos sistémicos que pueden afectar a la estabilidad financiera, es necesario que la actualicen de forma centralizada los registros de operaciones. Por esta razón, debe establecerse un procedimiento que garantice que los registros de operaciones puedan actualizar de manera centralizada el identificador de la entidad, lo que asegurará la eficiencia, la solidez y la oportunidad del proceso.
- (5) Las entidades que remiten las notificaciones deben disponer de tiempo suficiente para adaptarse a los requisitos de notificación, en particular para impedir que se acumulen operaciones no conciliadas inmediatamente después de que se empiece a aplicar la obligación de notificación. Conviene, por consiguiente, que, en una primera fase, solo deba conciliarse un conjunto reducido de campos.

⁽¹⁾ DO L 201 de 27.7.2012, p. 1.

- (6) Las entidades que remiten las notificaciones y las entidades responsables de la notificación, en su caso, deben poder realizar un seguimiento del cumplimiento de sus obligaciones de notificación con arreglo al Reglamento (UE) n.º 648/2012. Así pues, deben poder acceder diariamente a determinada información en relación con dichas notificaciones, en particular los resultados de la verificación de estas, también cuando se haya generado una advertencia, así como la situación de la conciliación de los datos notificados. Resulta necesario, por tanto, especificar la información que los registros de operaciones deben poner a disposición de esas entidades al final de cada día hábil.
- (7) 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.
- (8) La Autoridad Europea de Valores y Mercados ha consultado a los miembros del Sistema Europeo de Bancos Centrales, 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 asesoramiento del Grupo de partes interesadas del sector de los valores y mercados, establecido de conformidad con el artículo 37 del Reglamento (UE) n.º 1095/2010 del Parlamento Europeo y del Consejo ^(?).
- (9) Para que las contrapartes y los registros de operaciones puedan adoptar todas las medidas necesarias para adaptarse a los nuevos requisitos, la fecha de aplicación del presente Reglamento debe aplazarse dieciocho meses.

HA ADOPTADO EL PRESENTE REGLAMENTO:

Artículo 1

Verificación de los derivados por los registros de operaciones

1. Los registros de operaciones verificarán todos los aspectos siguientes de las notificaciones de derivados recibidas:
 - a) la identidad de la entidad que remite la notificación a la que se refieren el campo 2 del cuadro 1 y el campo 2 del cuadro 3 del anexo del Reglamento de Ejecución (UE) 2022/1860 de la Comisión ^(?);
 - b) que la plantilla XML utilizada para la notificación de un derivado cumple la metodología de la norma ISO 20022 de conformidad con el artículo 1 del Reglamento de Ejecución (UE) 2022/1860;
 - c) que la entidad que remite la notificación, si es diferente de la entidad responsable de la notificación a que se refieren el campo 3 del cuadro 1 y el campo 3 del cuadro 3 del anexo del Reglamento de Ejecución (UE) 2022/1860, está debidamente autorizada para notificar en nombre de la contraparte 1 o de la entidad responsable de la notificación, si es diferente de la contraparte 1, según se indica en el campo 4 del cuadro 1 y en el campo 4 del cuadro 3 del anexo del Reglamento de Ejecución (UE) 2022/1860;
 - d) que no se ha presentado anteriormente la misma notificación de derivado;
 - e) que una notificación de derivado con un tipo de acción «Modificación», «Actualización del margen», «Valoración», «Corrección», «Error» o «Terminación» se refiere a una notificación de derivado presentada anteriormente;
 - f) que una notificación de derivado con un tipo de acción «Modificación» no se refiere a un derivado notificado como anulado con el tipo de acción «Error» que no se haya notificado posteriormente con el tipo de acción «Reactivación»;
 - g) que la notificación de derivado no indica el tipo de acción «Nueva» respecto de un derivado que se ha notificado anteriormente;

^(?) Reglamento (UE) n.º 1095/2010 del Parlamento Europeo y del Consejo, de 24 de noviembre de 2010, por el que se crea una Autoridad Europea de Supervisión (Autoridad Europea de Valores y Mercados), se modifica la Decisión n.º 716/2009/CE y se deroga la Decisión 2009/77/CE de la Comisión (DO L 331 de 15.12.2010, p. 84).

^(?) Reglamento de Ejecución (UE) 2022/1860 de la Comisión, de 10 de junio de 2022, por el que se establecen normas técnicas de ejecución para la aplicación del Reglamento (UE) n.º 648/2012 del Parlamento Europeo y del Consejo por lo que respecta a los estándares, los formatos, la frecuencia y los métodos y mecanismos de notificación (véase la página 68 del presente Diario Oficial).

- h) que la notificación de derivado no indica el tipo de acción «Componente de posición» respecto de un derivado que se ha notificado anteriormente;
- i) que la notificación de derivado no pretende modificar los datos de los campos «Contraparte 1» o «Contraparte 2» de un derivado notificado anteriormente;
- j) que la notificación de derivado no pretende modificar un derivado existente especificando una fecha efectiva posterior a la fecha de vencimiento notificada del derivado;
- k) que un derivado notificado con el tipo de acción «Reactivación» está relacionado con una notificación de derivado presentada anteriormente con un tipo de acción «Error» o «Terminación» o con un derivado que ha vencido;
- l) que la notificación de derivado es correcta y completa.

2. Los registros de operaciones rechazarán toda notificación de derivado que no cumpla alguno de los requisitos establecidos en el apartado 1 y le asignarán una de las categorías de rechazo que figuran en el cuadro 1 del anexo.

3. Los registros de operaciones facilitarán a las entidades que remitan las notificaciones información detallada sobre los resultados de la verificación de datos a que se refiere el apartado 1 en los sesenta minutos siguientes a su recepción de la notificación de derivado. Los registros de operaciones presentarán dichos resultados en formato XML y en una plantilla elaborada de conformidad con la metodología ISO 20022. En los resultados se especificarán los motivos para el rechazo de una notificación de derivado de conformidad con el cuadro 1 del anexo.

Artículo 2

Procedimiento para las actualizaciones de los identificadores de las entidades jurídicas (LEI)

1. Los registros de operaciones a los que se dirija una solicitud con arreglo al artículo 8 del Reglamento de Ejecución (UE) 2022/1860 identificarán los derivados pendientes a los que se refiere el artículo 2, apartado 2, del Reglamento de Ejecución (UE) 2022/1860 en el momento de producirse el acto de reestructuración empresarial, cuando la entidad esté notificada con el identificador utilizado antes del acto de reestructuración empresarial en el campo «Contraparte 1» o «Contraparte 2», según la información de la solicitud correspondiente. Sustituirán el antiguo identificador por el nuevo identificador de la entidad jurídica (LEI) en las notificaciones relativas a todos aquellos derivados que, en el momento de producirse el acto a que se refiere el artículo 8 del Reglamento de Ejecución (UE) 2022/1860, pertenezcan a esa contraparte. Los registros de operaciones llevarán a cabo el procedimiento de actualización del identificador a más tardar el día de la reestructuración o en un plazo de treinta días naturales a partir de la recepción de la solicitud si se notifica menos de treinta días naturales antes de la fecha del acto de reestructuración empresarial.

2. Los registros de operaciones identificarán los derivados pertinentes a que se refiere el artículo 2, apartado 2, del Reglamento de Ejecución (UE) 2022/1860 en el momento de producirse el acto de reestructuración empresarial, cuando la entidad esté identificada con el antiguo identificador en cualquiera de los campos, y sustituirán ese identificador por el nuevo LEI. Cuando un acto de reestructuración empresarial esté relacionado con una actualización del LEI para campos que no sean los de «Contraparte 1» o «Contraparte 2», el registro de operaciones llevará a cabo dicha actualización de los derivados pertinentes únicamente tras la oportuna confirmación de la contraparte 1 o de la entidad responsable de la notificación.

3. Los registros de operaciones llevarán a cabo las siguientes acciones:

- a) tras la recepción de la confirmación pertinente con arreglo al apartado 2, aplicar la actualización del LEI a partir de la fecha a que se refiere el apartado 1;
- b) comunicar la siguiente información lo antes posible, y a más tardar cinco días hábiles después de haber recibido la notificación completa, a todos los demás registros de operaciones y a las contrapartes notificantes, a las entidades que remitan la notificación, a las entidades responsables de la notificación vinculadas a los contratos de derivados afectados por la actualización del LEI y a los terceros a los que se haya concedido acceso a la información de conformidad con el artículo 78, apartado 7, del Reglamento (UE) n.º 648/2012, según proceda:
 - i) el(los) antiguo(s) identificador(es),
 - ii) el nuevo identificador,
 - iii) la fecha a partir de la cual será efectiva la actualización,
 - iv) en el caso de los actos societarios que afecten a un subconjunto de derivados pendientes en la fecha del acto, la lista de los identificadores únicos de operaciones (UTI) de los derivados a los que afecte la actualización del LEI;

- c) notificar, a más tardar el día hábil anterior a la fecha en que se aplique la actualización, a las entidades enumeradas en el artículo 81, apartado 3, del Reglamento (UE) n.º 648/2012 que tengan acceso a los datos relativos a los derivados que se hayan actualizado, mediante un fichero específico en formato legible electrónicamente:
- i) el(los) antiguo(s) identificador(es),
 - ii) el nuevo identificador,
 - iii) la fecha a partir de la cual será efectiva la actualización,
 - iv) en el caso de los actos societarios que afecten a un subconjunto de derivados pendientes en la fecha del acto, la lista de los identificadores únicos de operaciones (UTI) de los derivados a los que afecte la actualización del LEI;
- d) registrar la actualización del LEI en el libro de notificaciones.

4. Los registros de operaciones no actualizarán los LEI notificados para derivados que no sean aquellos a los que se refiere el artículo 2, apartado 2, del Reglamento de Ejecución (UE) 2022/1860 en el momento de producirse el acto societario.

Artículo 3

Conciliación de datos por los registros de operaciones

1. Los registros de operaciones procurarán conciliar los derivados notificados siguiendo los pasos contemplados en el apartado 3, siempre que se cumplan todas las condiciones siguientes:

- a) que el registro de operaciones haya realizado por completo las verificaciones previstas en el artículo 1, apartados 1 y 2;
- b) que ambas contrapartes del derivado notificado tengan una obligación de notificación de conformidad con el artículo 9 del Reglamento (UE) n.º 648/2012;
- c) que el registro de operaciones no haya recibido una notificación con el tipo de acción «Error» con respecto al derivado notificado, a menos que a dicha notificación haya seguido una notificación con el tipo de acción «Reactivación».

2. Los registros de operaciones dispondrán de mecanismos para garantizar la confidencialidad de los datos cuando intercambien información con otros registros de operaciones y cuando proporcionen información a las contrapartes notificantes, las entidades que remitan la notificación, las entidades responsables de la notificación, así como a los terceros a los que se haya concedido acceso a la información de conformidad con el artículo 78, apartado 7, del Reglamento (UE) n.º 648/2012, sobre los valores de todos los campos sujetos a conciliación.

3. Cuando se cumplan todas las condiciones del apartado 1, los registros de operaciones seguirán los pasos siguientes, utilizando el último valor notificado en cada uno de los campos del cuadro 2 del anexo en la fecha del día hábil anterior:

- a) el registro de operaciones que haya recibido una notificación de derivado verificará si ha recibido una notificación correspondiente de la otra contraparte o en nombre de esta;
- b) cuando el registro de operaciones no haya recibido la notificación de derivado correspondiente a que se refiere la letra a), tratará de identificar el registro de operaciones que la haya recibido, comunicando a todos los registros de operaciones inscritos los valores de los siguientes campos del derivado notificado: «Identificador único de operación», «Contraparte 1» y «Contraparte 2»;
- c) cuando el registro de operaciones determine que otro registro de operaciones ha recibido la notificación de derivado correspondiente a que se refiere la letra a), intercambiará con este los datos del derivado notificado en formato XML y en una plantilla elaborada de conformidad con la metodología ISO 20022;

- d) el registro de operaciones considerará conciliado un derivado notificado cuando los datos del derivado objeto de conciliación coincidan con los del derivado correspondiente a que se refiere la letra a) y de conformidad con los límites de tolerancia aplicables y las fechas de aplicación pertinentes establecidos en el cuadro 2 del anexo;
- e) el registro de operaciones asignará seguidamente valores a las categorías de conciliación respecto de cada operación con derivados notificada, tal como se establece en el cuadro 3 del anexo;
- f) el registro de operaciones llevará a cabo los pasos indicados en las letras a) a e) a la mayor brevedad y, a más tardar, a las 00:00 horas (UTC) de un determinado día hábil;
- g) cuando el registro de operaciones no pueda conciliar un derivado notificado, procurará casar los datos de dicho derivado el siguiente día hábil. El registro de operaciones dejará de intentar conciliar el derivado notificado treinta días naturales después de que el derivado haya dejado de estar pendiente.

4. Al final de cada día hábil, el registro de operaciones confirmará el número total de derivados casados y el número de derivados conciliados con cada registro de operaciones con el que haya procedido a la conciliación de derivados. El registro de operaciones dispondrá de procedimientos escritos para garantizar la resolución de todas las discrepancias detectadas en este proceso.

5. A más tardar sesenta minutos después de la conclusión del proceso de conciliación con arreglo al apartado 3, letra f), el registro de operaciones proporcionará a las entidades que remitieron la notificación los resultados del proceso de conciliación realizado respecto de los derivados notificados. El registro de operaciones facilitará dichos resultados en formato XML y en una plantilla elaborada de conformidad con la metodología ISO 20022, incluyendo información sobre los campos que no hayan sido conciliados.

Artículo 4

Mecanismos de respuesta al cierre

1. Con respecto a cada día hábil, los registros de operaciones pondrán a disposición de las contrapartes notificantes, las entidades que remitieron la notificación, las entidades responsables de la notificación y los terceros a los que se haya concedido acceso a la información de conformidad con el artículo 78, apartado 7, del Reglamento (UE) n.º 648/2012, según proceda, la siguiente información sobre los derivados de que se trate, en formato XML y en una plantilla elaborada de conformidad con la metodología ISO 20022:

- a) los derivados notificados durante ese día;
- b) el último estado de las operaciones de los derivados pendientes;
- c) las notificaciones de derivados que hayan sido rechazadas durante ese día;
- d) la situación de la conciliación de todos los derivados notificados sujetos a conciliación con arreglo al artículo 3, apartado 1;
- e) los derivados pendientes para los que no se haya notificado ninguna valoración, o para los que la fecha de la valoración notificada sea más de catorce días naturales anterior al día en el que se generó el informe;
- f) los derivados pendientes para los que no se haya notificado información sobre los márgenes, o para los que la fecha de la información sobre los márgenes notificada sea más de catorce días naturales anterior al día para el que se generó el informe;
- g) los derivados que se recibieron ese día con el tipo de acción «Nueva», «Componente de posición», «Modificación» o «Corrección» y cuyo importe nocional sea anormal para esa clase de derivados.

2. Los registros de operaciones facilitarán esa información a más tardar a las 06:00 horas (tiempo universal coordinado) del día hábil siguiente al día al que se refiera la información establecida en el apartado 1.

*Artículo 5***Entrada en vigor y aplicación**

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 29 de abril de 2024.

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

Hecho en Bruselas, el 10 de junio de 2022.

Por la Comisión
La Presidenta
Ursula VON DER LEYEN

ANEXO

Cuadro 1

Motivos de rechazo de una notificación de derivados

Categorías de rechazo	Motivo
Esquema	— el derivado ha sido rechazado por la no conformidad del esquema.
Permiso	— el derivado ha sido rechazado porque la entidad que remite la notificación no está autorizada a realizar la notificación en nombre de la contraparte notificante o de la entidad responsable de la notificación.
Lógica	— el derivado ha sido rechazado porque el tipo de acción correspondiente al derivado no es correcto desde el punto de vista lógico.
Actividad	— el derivado es rechazado porque no cumple una o varias validaciones de contenido.

Cuadro 2

	Sección	Campo	Tolerancia a la conciliación	Fecha de inicio de la conciliación
1	Partes en el derivado	Marca de tiempo de la notificación	No procede	No procede
2	Partes en el derivado	Identificación de la entidad que remite la notificación	No procede	No procede
3	Partes en el derivado	Entidad responsable de la notificación	No procede	No procede
4	Partes en el derivado	Contraparte 1 (contraparte notificante)	Igual que el campo 9 de este cuadro	Fecha de inicio de la obligación de notificación
5	Partes en el derivado	Naturaleza de la contraparte 1	No procede	No procede
6	Partes en el derivado	Sector empresarial de la contraparte 1	No procede	No procede
7	Partes en el derivado	Umbral de compensación de la contraparte 1	No procede	No procede
8	Partes en el derivado	Tipo de identificador de la contraparte 2	No procede	No procede
9	Partes en el derivado	Contraparte 2	Igual que el campo 4 de este cuadro	Fecha de inicio de la obligación de notificación
10	Partes en el derivado	País de la contraparte 2	No procede	No procede
11	Partes en el derivado	Naturaleza de la contraparte 2	No procede	No procede

	Sección	Campo	Tolerancia a la conciliación	Fecha de inicio de la conciliación
12	Partes en el derivado	Sector empresarial de la contraparte 2	No procede	No procede
13	Partes en el derivado	Umbral de compensación de la contraparte 2	No procede	No procede
14	Partes en el derivado	Obligación de notificación de la contraparte 2	No procede	No procede
15	Partes en el derivado	Identificación del agente intermediario	No procede	No procede
16	Partes en el derivado	Miembro compensador	No procede	No procede
17	Partes en el derivado	Dirección	A la inversa	Fecha de inicio de la obligación de notificación
18	Partes en el derivado	Dirección del componente 1	A la inversa	Fecha de inicio de la obligación de notificación
19	Partes en el derivado	Dirección del componente 2	A la inversa	Fecha de inicio de la obligación de notificación
20	Partes en el derivado	Vinculación directa con la actividad comercial o la financiación de tesorería	No procede	No procede
1	Sección 2a - Identificadores y enlaces	Identificador único de operación (UTI)	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
2	Sección 2a - Identificadores y enlaces	Número de seguimiento de la notificación	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
3	Sección 2a - Identificadores y enlaces	Identificador único de operación (UTI) previo (para relaciones uno a uno y uno a varios entre las operaciones)	No	Dos años después de la fecha de inicio de la obligación de notificación
4	Sección 2a - Identificadores y enlaces	Identificador único de operación de la posición posterior	No	Dos años después de la fecha de inicio de la obligación de notificación
5	Sección 2a - Identificadores y enlaces	Identificación de la reducción del riesgo posnegociación	No procede	No procede
6	Sección 2a - Identificadores y enlaces	Identificación del paquete	No procede	No procede
7	Sección 2b – Información sobre el contrato	Número internacional de identificación de valores mobiliarios (ISIN)	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
8	Sección 2b – Información sobre el contrato	Identificador único de producto (UPI)	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación

	Sección	Campo	Tolerancia a la conciliación	Fecha de inicio de la conciliación
9	Sección 2b – Información sobre el contrato	Clasificación del producto	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
10	Sección 2b – Información sobre el contrato	Tipo de contrato	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
11	Sección 2b – Información sobre el contrato	Clase de activo	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
12	Sección 2b – Información sobre el contrato	Derivado basado en criptoactivos	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
13	Sección 2b – Información sobre el contrato	Tipo de identificación del subyacente	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
14	Sección 2b – Información sobre el contrato	Identificación del subyacente	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
15	Sección 2b – Información sobre el contrato	Indicador del índice subyacente	Sí	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
16	Sección 2b – Información sobre el contrato	Nombre del índice subyacente	Sí	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
17	Sección 2b – Información sobre el contrato	Código de la cesta del cliente	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
18	Sección 2b – Información sobre el contrato	Identificador de los componentes de la cesta	Sí	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
19	Sección 2b – Información sobre el contrato	Moneda de liquidación 1	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
20	Sección 2b – Información sobre el contrato	Moneda de liquidación 2	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
21	Sección 2c – Valoración	Importe de la valoración	Sí	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
22	Sección 2c – Valoración	Moneda de la valoración	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
23	Sección 2c – Valoración	Marca de tiempo de la valoración	No procede	No procede

	Sección	Campo	Tolerancia a la conciliación	Fecha de inicio de la conciliación
24	Sección 2c – Valoración	Método de valoración	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
25	Sección 2c – Valoración	Delta	Sí	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
26	Sección 2d - Garantía real	Indicador de la cartera de garantías reales	No procede	No procede
27	Sección 2d - Garantía real	Código de la cartera de garantías reales	No procede	No procede
28	Sección 2e – Reducción del riesgo / Notificación	Marca de tiempo de la confirmación	Sí	Fecha de inicio de la obligación de notificación
29	Sección 2e – Reducción del riesgo / Notificación	Confirmado	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
30	Sección 2f - Compensación	Obligación de compensación	Sí	Fecha de inicio de la obligación de notificación
31	Sección 2f - Compensación	Compensado	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
32	Sección 2f - Compensación	Marca de tiempo de la compensación	Sí	Fecha de inicio de la obligación de notificación
33	Sección 2f - Compensación	Entidad de contrapartida central	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
34	Sección 2g - Detalles de la operación	Tipo de acuerdo marco	Sí	Fecha de inicio de la obligación de notificación
35	Sección 2g - Detalles de la operación	Otro tipo de acuerdo marco	No procede	No procede
36	Sección 2g - Detalles de la operación	Versión del acuerdo marco	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
37	Sección 2g - Detalles de la operación	Intragruppo	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
38	Sección 2g - Detalles de la operación	Reducción del riesgo posnegociación	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
39	Sección 2g - Detalles de la operación	Tipo de técnica de reducción del riesgo posnegociación	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación

	Sección	Campo	Tolerancia a la conciliación	Fecha de inicio de la conciliación
40	Sección 2g - Detalles de la operación	Proveedor de servicios de reducción del riesgo posnegociación	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
41	Sección 2g - Detalles de la operación	Centro de ejecución	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
42	Sección 2c - Detalles de la operación	Marca de tiempo de la ejecución	Sí	Fecha de inicio de la obligación de notificación
43	Sección 2c - Detalles de la operación	Fecha efectiva	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
44	Sección 2c - Detalles de la operación	Fecha de expiración	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
45	Sección 2c - Detalles de la operación	Fecha de terminación anticipada	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
46	Sección 2c - Detalles de la operación	Fecha límite de resolución contractual	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
47	Sección 2c - Detalles de la operación	Tipo de entrega	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
48	Sección 2g - Detalles de la operación	Precio	Sí	Fecha de inicio de la obligación de notificación
49	Sección 2g - Detalles de la operación	Moneda del precio	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
50	Sección 2g - Detalles de la operación	Fecha efectiva no ajustada del precio	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
51	Sección 2g - Detalles de la operación	Fecha final no ajustada del precio	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
52	Sección 2g - Detalles de la operación	Precio en vigor entre la fecha efectiva y la fecha final no ajustadas	Sí	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
53	Sección 2g - Detalles de la operación	Precio de la operación combinada	Sí	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
54	Sección 2g - Detalles de la operación	Moneda del precio de la operación combinada	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación

	Sección	Campo	Tolerancia a la conciliación	Fecha de inicio de la conciliación
55	Sección 2g - Detalles de la operación	Importe nacional del componente 1	Sí	Fecha de inicio de la obligación de notificación
56	Sección 2g - Detalles de la operación	Moneda nacional 1	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
57	Sección 2g - Detalles de la operación	Fecha efectiva del importe nacional del componente 1	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
58	Sección 2g - Detalles de la operación	Fecha final del importe nacional del componente 1	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
59	Sección 2g - Detalles de la operación	Importe nacional en vigor en la fecha efectiva asociada del componente 1	Sí	Fecha de inicio de la obligación de notificación
60	Sección 2g - Detalles de la operación	Cantidad nacional total del componente 1	Sí	Fecha de inicio de la obligación de notificación
61	Sección 2g - Detalles de la operación	Fecha efectiva de la cantidad nacional del componente 1	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
62	Sección 2g - Detalles de la operación	Fecha final de la cantidad nacional del componente 1	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
63	Sección 2g - Detalles de la operación	Cantidad nacional en vigor en la fecha efectiva asociada del componente 1	Sí	Fecha de inicio de la obligación de notificación
64	Sección 2g - Detalles de la operación	Importe nacional del componente 2	Sí	Fecha de inicio de la obligación de notificación
65	Sección 2g - Detalles de la operación	Moneda nacional 2	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
66	Sección 2g - Detalles de la operación	Fecha efectiva del importe nacional del componente 2	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
67	Sección 2g - Detalles de la operación	Fecha final del importe nacional del componente 2	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
68	Sección 2g - Detalles de la operación	Importe nacional en vigor en la fecha efectiva asociada del componente 2	Sí	Fecha de inicio de la obligación de notificación
69	Sección 2g - Detalles de la operación	Cantidad nacional total del componente 2	Sí	Fecha de inicio de la obligación de notificación
70	Sección 2g - Detalles de la operación	Fecha efectiva de la cantidad nacional del componente 2	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
71	Sección 2g - Detalles de la operación	Fecha final de la cantidad nacional del componente 2	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación

	Sección	Campo	Tolerancia a la conciliación	Fecha de inicio de la conciliación
72	Sección 2g - Detalles de la operación	Cantidad nominal en vigor en la fecha efectiva asociada del componente 2	Sí	Fecha de inicio de la obligación de notificación
73	Sección 2g - Detalles de la operación	Otros tipos de pagos	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
74	Sección 2g - Detalles de la operación	Importe de otros pagos	Sí	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
75	Sección 2g - Detalles de la operación	Moneda de otros pagos	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
76	Sección 2g - Detalles de la operación	Fecha de otros pagos	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
77	Sección 2g - Detalles de la operación	Pagador de otros pagos	Sí	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
78	Sección 2g - Detalles de la operación	Receptor de otros pagos	Sí	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
79	Sección 2h – Tipos de interés	Tipo fijo del componente 1 o cupón	Sí	Fecha de inicio de la obligación de notificación
80	Sección 2h – Tipos de interés	Convención sobre el cómputo de días del tipo fijo o el cupón del componente 1	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
81	Sección 2h – Tipos de interés	Período de la frecuencia de pago del tipo fijo o el cupón del componente 1	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
82	Sección 2h – Tipos de interés	Multiplicador del período de la frecuencia de pago del tipo fijo o el cupón del componente 1	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
83	Sección 2h – Tipos de interés	Identificador del tipo variable del componente 1	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
84	Sección 2h – Tipos de interés	Indicador del tipo variable del componente 1	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
85	Sección 2h – Tipos de interés	Nombre del tipo variable del componente 1	No procede	No procede
86	Sección 2h – Tipos de interés	Convención sobre el cómputo de días del tipo variable del componente 1	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación

	Sección	Campo	Tolerancia a la conciliación	Fecha de inicio de la conciliación
87	Sección 2h – Tipos de interés	Período de la frecuencia de pago del tipo variable del componente 1	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
88	Sección 2h – Tipos de interés	Multiplicador del período de la frecuencia de pago del tipo variable del componente 1	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
89	Sección 2h – Tipos de interés	Período de referencia del tipo variable del componente 1 – Período de tiempo	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
90	Sección 2h – Tipos de interés	Período de referencia del tipo variable del componente 1 – Multiplicador	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
91	Sección 2h – Tipos de interés	Período de la frecuencia de revisión del tipo variable del componente 1	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
92	Sección 2h – Tipos de interés	Multiplicador de la frecuencia de revisión del tipo variable del componente 1	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
93	Sección 2h – Tipos de interés	Diferencial del componente 1	Sí	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
94	Sección 2h - Tipos de interés	Moneda del diferencial del componente 1	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
95	Sección 2h - Tipos de interés	Tipo fijo del componente 2	Sí	Fecha de inicio de la obligación de notificación
96	Sección 2h - Tipos de interés	Convención de cómputo de días del tipo fijo del componente 2	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
97	Sección 2h - Tipos de interés	Período de la frecuencia de pago del tipo fijo del componente 2	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
98	Sección 2h - Tipos de interés	Multiplicador del período de la frecuencia de pago del tipo fijo del componente 2	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
99	Sección 2h - Tipos de interés	Identificador del tipo variable del componente 2	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
100	Sección 2h - Tipos de interés	Indicador del tipo variable del componente 2	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
101	Sección 2h - Tipos de interés	Nombre del tipo variable del componente 2	No procede	No procede
102	Sección 2h - Tipos de interés	Convención sobre el cómputo de días del tipo variable del componente 2	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
103	Sección 2h - Tipos de interés	Período de la frecuencia de pago del tipo variable del componente 2	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación

	Sección	Campo	Tolerancia a la conciliación	Fecha de inicio de la conciliación
104	Sección 2h - Tipos de interés	Multiplicador del período de la frecuencia de pago del tipo variable del componente 2	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
105	Sección 2h - Tipos de interés	Período de referencia del tipo variable del componente 2 – Período de tiempo	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
106	Sección 2h - Tipos de interés	Período de referencia del tipo variable del componente 2 – Multiplicador	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
107	Sección 2h - Tipos de interés	Período de la frecuencia de revisión del tipo variable del componente 2	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
108	Sección 2h - Tipos de interés	Multiplicador de la frecuencia de revisión del tipo variable del componente 2	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
109	Sección 2h - Tipos de interés	Diferencial del componente 2	Sí	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
110	Sección 2h - Tipos de interés	Moneda del diferencial del componente 2	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
111	Sección 2h - Tipos de interés	Diferencial de la operación combinada	Sí	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
112	Sección 2h - Tipos de interés	Moneda del diferencial de la operación combinada	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
113	Sección 2i – Divisas	Tipo de cambio 1	Sí	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
114	Sección 2i – Divisas	Tipo de cambio a plazo	Sí	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
115	Sección 2i – Divisas	Base del tipo de cambio	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
116	Sección 2j - Materias primas y derechos de emisión (General)	Producto base	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
117	Sección 2j - Materias primas y derechos de emisión (General)	Subproducto	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación

	Sección	Campo	Tolerancia a la conciliación	Fecha de inicio de la conciliación
118	Sección 2j - Materias primas y derechos de emisión (General)	Otros subproductos	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
119	Sección 2k - Materias primas y derechos de emisión (Energía)	Punto o zona de entrega	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
120	Sección 2k - Materias primas y derechos de emisión (Energía)	Punto de interconexión	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
121	Sección 2k - Materias primas y derechos de emisión (Energía)	Tipo de carga	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
122	Sección 2k - Materias primas y derechos de emisión (Energía)	Tiempo de inicio del intervalo de entrega	Sí	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
123	Sección 2k - Materias primas y derechos de emisión (Energía)	Tiempo de finalización del intervalo de entrega	Sí	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
124	Sección 2k - Materias primas y derechos de emisión (Energía)	Fecha de inicio de la entrega	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
125	Sección 2k - Materias primas y derechos de emisión (Energía)	Fecha de finalización de la entrega	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
126	Sección 2k - Materias primas y derechos de emisión (Energía)	Duración	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
127	Sección 2k - Materias primas y derechos de emisión (Energía)	Días de la semana	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
128	Sección 2k - Materias primas y derechos de emisión (Energía)	Capacidad de entrega	Sí	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación

	Sección	Campo	Tolerancia a la conciliación	Fecha de inicio de la conciliación
129	Sección 2k - Materias primas y derechos de emisión (Energía)	Unidad de cantidad	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
130	Sección 2k - Materias primas y derechos de emisión (Energía)	Precio/cantidad de intervalo de tiempo	Sí	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
131	Sección 2k - Materias primas y derechos de emisión (Energía)	Moneda del precio/cantidad de intervalo de tiempo	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
132	Sección 2l - Opciones	Tipo de opción	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
133	Sección 2l - Opciones	Estilo de opción	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
134	Sección 2l - Opciones	Precio de ejercicio	Sí	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
135	Sección 2l - Opciones	Fecha efectiva del precio de ejercicio	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
136	Sección 2l - Opciones	Fecha final del precio de ejercicio	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
137	Sección 2l - Opciones	Precio de ejercicio en vigor en la fecha efectiva asociada	Sí	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
138	Sección 2l - Opciones	Moneda/par de divisas del precio de ejercicio	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
139	Sección 2l - Opciones	Importe de la prima de la opción	Sí	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
140	Sección 2l - Opciones	Moneda de la prima de la opción	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
141	Sección 2l - Opciones	Fecha de pago de la prima de la opción	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación

	Sección	Campo	Tolerancia a la conciliación	Fecha de inicio de la conciliación
142	Sección 2i - Opciones	Fecha de vencimiento del subyacente	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
143	Sección 2m – Derivados de crédito	Orden de prelación	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
144	Sección 2m – Derivados de crédito	Entidad de referencia	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
145	Sección 2m – Derivados de crédito	Serie	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
146	Sección 2m – Derivados de crédito	Versión	No	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
147	Sección 2m – Derivados de crédito	Factor de índice	Sí	Fecha de inicio de la obligación de notificación
148	Sección 2m – Derivados de crédito	Tramo	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación
149	Sección 2m – Derivados de crédito	Punto de conexión (<i>attachment point</i>) del índice de permutas de cobertura por impago («índice CDS»)	Sí	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
150	Sección 2m – Derivados de crédito	Punto de desconexión (<i>detachment point</i>) del índice de permutas de cobertura por impago («índice CDS»)	Sí	Dos años a partir de la fecha de inicio de la obligación de notificación
151	Sección 2n - Modificaciones del derivado	Tipo de acción	No procede	No procede
152	Sección 2n - Modificaciones del derivado	Tipo de suceso	No procede	No procede
153	Sección 2n - Modificaciones del derivado	Fecha del suceso	No procede	No procede
154	Sección 2n - Modificaciones del derivado	Nivel	No	Fecha de inicio de la obligación de notificación

Cuadro 3

Categorías de conciliación	Valores admisibles
Requisito de notificación aplicable a ambas contrapartes	Sí/No
Tipo de notificación	Unilateral/bilateral
Correspondencia	Casado/No casado
Conciliación	Conciliado/No conciliado
Conciliación de la valoración	Conciliada/No conciliada
Reactivado	Sí/No
Otras modificaciones	Sí/No