

REGLAMENTO DELEGADO (UE) 2019/358 DE LA COMISIÓN**de 13 de diciembre de 2018****por el que se completa el Reglamento (UE) 2015/2365 del Parlamento Europeo y del Consejo en lo que respecta a las normas técnicas de regulación relativas a la recopilación, verificación, agregación, comparación y publicación de datos sobre las operaciones de financiación de valores (OFV) por parte de los registros de operaciones****(Texto pertinente a efectos del EEE)**

LA COMISIÓN EUROPEA,

Visto el Tratado de Funcionamiento de la Unión Europea,

Visto el Reglamento (UE) 2015/2365 del Parlamento Europeo y del Consejo, de 25 de noviembre de 2015, sobre transparencia de las operaciones de financiación de valores y de reutilización y por el que se modifica el Reglamento (UE) n.º 648/2012 ⁽¹⁾, y en particular su artículo 5, apartado 7, letra a), y su artículo 12, apartado 3, letras a) y b),

Considerando lo siguiente:

- (1) Para garantizar una calidad elevada de los datos relativos a las OFV notificadas a los registros de operaciones, estos deben verificar la identidad de las entidades que remiten la notificación, la integridad lógica de la secuencia de comunicación de los datos de las OFV y la integridad y exactitud de dichos datos.
- (2) Por la misma razón, los registros de operaciones deben conciliar los datos de cada notificación de OFV que reciban. 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 las OFV no se concilien. No obstante, algunos datos de las OFV 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 las OFV notificadas no impidan a las autoridades analizar estos datos con un nivel adecuado de confianza.
- (3) Cabe esperar que las entidades que remiten las notificaciones mejoren este proceso con el tiempo, tanto en términos de reducción del número de notificaciones rechazadas como en términos de notificaciones conciliadas. Sin embargo, 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.
- (4) 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) 2015/2365. Así pues, deben poder acceder diariamente a determinada información en relación con dichas notificaciones, en particular los resultados de la verificación de estas, 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.
- (5) Para favorecer la integridad de los datos de las OFV, el acceso directo e inmediato a que se hace referencia en el artículo 12, apartado 2, del Reglamento (UE) 2015/2365 debe facilitarse de manera armonizada y coherente. A fin de normalizar el proceso de notificación, minimizar los costes para el sector y asegurar la comparabilidad y la agregación coherente de los datos entre registros de operaciones, conviene que todas las notificaciones e intercambios se realicen en plantillas de formato XML y sigan una metodología que se utilice ampliamente en el sector financiero.
- (6) El acceso a los datos a nivel de posiciones sobre las exposiciones entre dos contrapartes determinadas es fundamental para permitir a las entidades a que se refiere el artículo 12, apartado 2, del Reglamento (UE) 2015/2365 determinar las posibles fuentes de riesgos sistémicos o no sistémicos para la estabilidad financiera.
- (7) A fin de proporcionar al público un nivel adecuado de transparencia en las OFV, los criterios utilizados para la agregación de las posiciones deben permitir al público en general entender el funcionamiento de los mercados de

⁽¹⁾ DOL 337 de 23.12.2015, p. 1.

OFV, sin comprometer la confidencialidad de los datos comunicados a los registros de operaciones. La frecuencia y los pormenores de la publicación de las posiciones agregadas por los registros de operaciones con arreglo al artículo 12, apartado 1, del Reglamento (UE) 2015/2365 deben especificarse sobre la base del marco conexo previsto en el Reglamento (UE) n.º 648/2012 del Parlamento Europeo y del Consejo ⁽²⁾ para los contratos de derivados.

- (8) El presente Reglamento se basa en los proyectos de normas técnicas de regulación presentados por la Autoridad Europea de Valores y Mercados (AEVM) a la Comisión con arreglo al procedimiento establecido en el artículo 10 del Reglamento (UE) n.º 1095/2010 del Parlamento Europeo y del Consejo ⁽³⁾.
- (9) Las disposiciones del presente Reglamento se refieren a las normas operativas para la recopilación, la agregación y la comparación de datos por los registros de operaciones, así como a los procedimientos que deben aplicar estos a fin de verificar la integridad y exactitud de los datos de las OFV que se les notifiquen. A fin de garantizar la coherencia entre esas disposiciones y de facilitar una visión global a los registros de operaciones, es conveniente incluir las correspondientes normas técnicas de regulación en un solo reglamento.
- (10) La AEVM ha llevado a cabo una consulta pública abierta sobre estos proyectos de normas técnicas de regulación, 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.

HA ADOPTADO EL PRESENTE REGLAMENTO:

Artículo 1

Verificación de las notificaciones de OFV por los registros de operaciones

1. Los registros de operaciones verificarán todos los aspectos siguientes de las notificaciones de OFV recibidas:
 - a) la identidad de la entidad que remite la notificación indicada en el campo 2 del cuadro 1 del anexo I del Reglamento de Ejecución (UE) 2019/363 de la Comisión ⁽⁴⁾;
 - b) que la plantilla XML utilizada para notificar una OFV respeta la metodología ISO 20022, de conformidad con el Reglamento de Ejecución (UE) 2019/363;
 - c) que, en caso de que sea diferente de la contraparte notificante indicada en el campo 3 del cuadro 1 del anexo I del Reglamento de Ejecución (UE) 2019/363, la entidad que remite la notificación esté debidamente autorizada para hacerlo en nombre de la contraparte notificante, salvo en el caso contemplado en el artículo 4, apartado 3, del Reglamento (UE) 2015/2365;
 - d) que no se ha presentado anteriormente la misma notificación de OFV;
 - e) que la notificación de OFV con un tipo de acción «Modificación» se refiere a una notificación de OFV presentada anteriormente;
 - f) que la notificación de OFV con un tipo de acción «Modificación» no se refiere a una OFV que se ha notificado como anulada;
 - g) que la notificación de OFV no indica el tipo de acción «Nueva» respecto de una OFV que ya se ha notificado;
 - h) que la notificación de OFV no indica el tipo de acción «Componente de posición» respecto de una OFV que ya se ha notificado;

⁽²⁾ 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 (DO L 201 de 27.7.2012, p. 1).

⁽³⁾ 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).

⁽⁴⁾ Reglamento de Ejecución (UE) 2019/363 de la Comisión, de 13 de diciembre de 2018, por el que se establecen normas técnicas de ejecución relativas al formato y la frecuencia de las notificaciones de los datos de las operaciones de financiación de valores a los registros de operaciones, de conformidad con el Reglamento (UE) 2015/2365 del Parlamento Europeo y del Consejo, y por el que se modifica el Reglamento de Ejecución (UE) n.º 1247/2012 en lo que respecta a la utilización de códigos de notificación en la notificación de los contratos de derivados (véase la página 85 del presente Diario Oficial).

- i) que la notificación de OFV no pretende modificar los datos de la entidad que remite la notificación, de la contraparte notificante o de la otra contraparte de una OFV notificada anteriormente;
 - j) que la notificación de OFV no pretende modificar una notificación de OFV existente especificando una fecha de valor posterior a la fecha de vencimiento notificada de la OFV;
 - k) la exactitud e integridad de la notificación de OFV.
2. Los registros de operaciones verificarán si se ha comunicado información sobre las garantías reales en los campos 73 a 96 del cuadro 2 del anexo I del Reglamento de Ejecución (UE) 2019/363 en el caso de las OFV en las que se indique «falso» en el campo 72 «Indicador de préstamo de valores sin garantía real» de ese mismo cuadro. De conformidad con el artículo 3 del presente Reglamento, los registros de operaciones comunicarán el resultado de la verificación a la entidad que remite la notificación y a la contraparte notificante, así como a la entidad responsable de la notificación, en su caso.
3. Los registros de operaciones rechazarán toda notificación de OFV 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 2 del anexo I del presente Reglamento.
4. Los registros de operaciones facilitarán a la entidad que remite la notificación y a la contraparte notificante, así como a la entidad responsable de la notificación, en su caso, información detallada sobre los resultados de la verificación de datos a que se refiere el apartado 1 en los sesenta minutos siguientes a la recepción de una notificación de OFV. Los registros de operaciones presentarán dichos resultados en formato XML y en una plantilla elaborada de conformidad con la metodología ISO 20022. Los resultados indicarán, en su caso, los motivos concretos del rechazo de una notificación de OFV, de conformidad con el apartado 3.

Artículo 2

Conciliación de datos por los registros de operaciones

1. Los registros de operaciones procurarán conciliar las OFV notificadas siguiendo los pasos contemplados en el apartado 2, 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 de la OFV notificada tengan una obligación de notificación;
 - c) que el registro de operaciones no haya recibido una notificación posterior con el tipo de acción «Error» respecto de la OFV notificada.
2. 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 1 del anexo I del presente Reglamento:
 - a) el registro de operaciones que haya recibido una notificación de OFV verificará si ha recibido una notificación de OFV correspondiente de la otra contraparte o en nombre de la otra contraparte;
 - b) cuando el registro de operaciones no haya recibido la notificación de OFV 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 de la OFV notificada: «Identificador único de operación», «Contraparte notificante», «Otra contraparte» y «Tipo de acuerdo marco»;
 - c) cuando el registro de operaciones determine que otro registro de operaciones ha recibido la notificación de OFV correspondiente a que se refiere la letra a), intercambiará con este los datos de la OFV notificada en formato XML y en una plantilla elaborada de conformidad con la metodología ISO 20022;
 - d) sin perjuicio de lo dispuesto en la letra e), el registro de operaciones considerará conciliada una OFV notificada cuando los datos de esta OFV coincidan con los de la notificación de OFV correspondiente a que se refiere la letra a) del presente apartado;
 - e) el registro de operaciones procurará casar por separado los campos relativos a los datos sobre préstamos y los relativos a los datos sobre garantías reales de una OFV notificada, de conformidad con los límites de tolerancia y las fechas de aplicación pertinentes que se establecen en el cuadro 1 del anexo I del presente Reglamento;

- f) el registro de operaciones asignará seguidamente valores a las categorías de conciliación respecto de cada OFV notificada, tal como se establece en el cuadro 3 del anexo I del presente Reglamento;
 - g) el registro de operaciones llevará a cabo los pasos indicados en las letras a) a f) del presente apartado a la mayor brevedad y, a más tardar, a las 18:00 horas (UTC) de un determinado día hábil;
 - h) cuando el registro de operaciones no pueda conciliar una OFV notificada, procurará casar los datos de dicha OFV el siguiente día hábil. El registro de operaciones dejará de intentar conciliar la OFV notificada 30 días naturales después de la fecha de vencimiento notificada de la OFV o después de recibir una notificación relativa a la OFV con el tipo de acción «Finalización» o «Componente de posición».
3. Al final de cada día hábil, el registro de operaciones confirmará el número total de OFV notificadas conciliadas con cada registro de operaciones con el que haya procedido a la conciliación de las OFV notificadas.
4. A más tardar sesenta minutos después de la conclusión del proceso de conciliación con arreglo al apartado 2, letra g), el registro de operaciones proporcionará a la entidad que remitió la notificación y a la contraparte notificante, así como a la entidad responsable de la notificación, en su caso, los resultados del proceso de conciliación realizado respecto de las OFV notificadas. 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 3

Mecanismos de respuesta al cierre

Al final de cada día hábil, los registros de operaciones pondrán la siguiente información sobre las OFV pertinentes a disposición de la entidad que remitió la notificación y de la contraparte notificante, así como de la entidad responsable de la notificación, en su caso, en formato XML y en una plantilla elaborada de conformidad con la metodología ISO 20022:

- a) las OFV notificadas durante ese día;
- b) la situación más reciente de las OFV que no hayan vencido o respecto de las cuales no se hayan realizado notificaciones con los tipos de acción «Error», «Finalización» o «Componente de posición»;
- c) los identificadores únicos de operación de las OFV respecto de las cuales se indique «falso» en el campo 72 del cuadro 2 del anexo I del Reglamento de Ejecución (UE) 2019/363 y aún no se haya notificado la información sobre las garantías reales de los campos 73 a 96 de ese mismo cuadro;
- d) las notificaciones de OFV que hayan sido rechazadas durante ese día;
- e) la situación en cuanto a conciliación de todas las OFV notificadas, a excepción de aquellas que hayan expirado o respecto de las cuales se hayan recibido notificaciones con el tipo de acción «Finalización» o «Componente de posición» más de un mes antes de dicho día hábil.

Artículo 4

Acceso a los datos de las OFV

Los registros de operaciones ofrecerán a las entidades enumeradas en el artículo 12, apartado 2, del Reglamento (UE) 2015/2365 acceso directo e inmediato, incluso en caso de delegación en virtud del artículo 28 del Reglamento (UE) n.º 1095/2010, a los datos de las OFV, en formato electrónico y apto para lectura automatizada de conformidad con el Reglamento Delegado (UE) 2019/357 de la Comisión ⁽⁵⁾;

A efectos del párrafo primero, los registros de operaciones utilizarán un formato XML y una plantilla elaborada de conformidad con la metodología ISO 20022.

⁽⁵⁾ Reglamento Delegado (UE) 2019/357 de la Comisión, de 13 de diciembre de 2018, por el que se completa el Reglamento (UE) 2015/2365 del Parlamento Europeo y del Consejo en lo que respecta a las normas técnicas de regulación sobre el acceso a los datos de las operaciones de financiación de valores (OFV) conservados en los registros de operaciones (véase la página 22 del presente Diario Oficial).

*Artículo 5***Cálculo de los datos a nivel de posiciones y acceso a estos datos**

1. Los registros de operaciones calcularán los datos a nivel de posiciones sobre las exposiciones entre contrapartes en términos de préstamos y de garantías reales. El cálculo de los datos a nivel de posiciones se basará en los siguientes criterios:

- a) los valores de las categorías de conciliación, según el cuadro 3 del anexo I del presente Reglamento;
- b) el tipo de OFV;
- c) el sector de las contrapartes;
- d) la situación en cuanto a compensación;
- e) la realización dentro o fuera de un centro de negociación;
- f) el tipo de garantía real;
- g) la moneda de la rama de efectivo;
- h) el intervalo de vencimiento;
- i) el intervalo de descuentos;
- j) los registros de operaciones a los que la otra contraparte haya notificado los datos de la OFV.

2. Los registros de operaciones velarán por que las entidades enumeradas en el artículo 12, apartado 2, del Reglamento (UE) 2015/2365 tengan acceso a los datos a nivel de posiciones de conformidad con el acceso a los datos que se especifica en el Reglamento Delegado (UE) 2019/357.

3. Los datos a nivel de posiciones a que se refiere el apartado 1 se facilitarán en formato electrónico y apto para lectura automatizada, en formato XML y en una plantilla elaborada de conformidad con la metodología ISO 20022.

4. El acceso contemplado en el apartado 2 se facilitará a la mayor brevedad y, a más tardar, el día hábil siguiente a la recepción de una notificación de OFV con arreglo al artículo 4, apartado 1, del Reglamento (UE) 2015/2365.

5. Los registros de operaciones ofrecerán a las entidades enumeradas en el artículo 12, apartado 2, del Reglamento (UE) 2015/2365 acceso a datos agregados, conforme al acceso a los datos que se especifica en el Reglamento Delegado (UE) 2019/357, y calculados según normas y procesos comúnmente admitidos para la recopilación y agregación de los datos de OFV a nivel mundial.

*Artículo 6***Cálculo de los datos agregados de las posiciones para su publicación**

1. Los registros de operaciones agregarán los datos de las posiciones con arreglo a los criterios contemplados en los apartados 2 y 3 respecto de los siguientes valores:

- a) el importe del principal de los pactos de recompra, operaciones simultáneas de compra-retroventa o de venta-recompra, la cantidad agregada de materias primas o valores prestados o tomados en préstamo y el importe de los préstamos de margen;
- b) el número de identificadores únicos de operación correspondientes a las OFV pertinentes;
- c) el valor de mercado de la garantía real.

2. Los registros de operaciones agregarán los datos de las posiciones correspondientes a todas las OFV notificadas con el tipo de acción «Nueva» entre el sábado a las 00:00:00 horas (UTC) y el viernes a las 23:59:59 horas (UTC) sobre la base de los criterios siguientes y los valores conexos que figuran en el cuadro 1 del anexo II del presente Reglamento:

- a) la ubicación de la contraparte notificante o, en su caso, de la sucursal pertinente;
- b) la ubicación de la otra contraparte o, en su caso, de la sucursal pertinente;
- c) el tipo de OFV;
- d) la situación de la OFV en cuanto a conciliación, según el cuadro 3 del anexo I del presente Reglamento;

- e) el tipo de centro en el que se realizó la OFV;
 - f) si la OFV se ha compensado o no;
 - g) el método mediante el cual se ha transferido la garantía real;
 - h) cada índice utilizado como referencia en una OFV negociada en un centro de ejecución distinto de «XXXX», cuando el importe nominal agregado comunicado al registro de operaciones en el índice sea superior a 5 000 millones EUR y cuando al menos seis contrapartes diferentes hayan notificado las OFV pertinentes al registro de operaciones.
3. A más tardar el viernes a las 23:59:59 horas (UTC), los registros de operaciones agregarán los datos de las posiciones correspondientes a todas las OFV que no hayan vencido o respecto de las cuales no se hayan recibido notificaciones con los tipos de acción «Error», «Finalización» o «Componente de posición», sobre la base de los criterios siguientes y los valores conexos que figuran en el cuadro 1 del anexo II del presente Reglamento:
- a) la ubicación de la contraparte notificante o, en su caso, de la sucursal pertinente;
 - b) la ubicación de la otra contraparte o, en su caso, de la sucursal pertinente;
 - c) el tipo de OFV;
 - d) la situación de la OFV en cuanto a conciliación, según el cuadro 3 del anexo I del presente Reglamento;
 - e) el tipo de centro en el que se realizó la OFV;
 - f) si la OFV se ha compensado o no;
 - g) el método mediante el cual se ha transferido la garantía real;
 - h) cada índice utilizado como referencia en una OFV, negociado en un centro de ejecución distinto de «XXXX», cuando el importe nominal agregado comunicado al registro de operaciones en el índice sea superior a 5 000 millones EUR y al menos seis contrapartes diferentes hayan notificado las OFV pertinentes al registro de operaciones.
4. Los registros de operaciones dispondrán de un procedimiento para identificar valores extraordinarios entre los datos agregados de las posiciones.
5. Los registros de operaciones dispondrán de un procedimiento para llevar a cabo y notificar las correcciones de los datos agregados de las posiciones, incluidas las derivadas de las notificaciones con el tipo de acción «Error», y para publicar los datos agregados originales y corregidos.

Artículo 7

Publicación de los datos agregados de las posiciones

1. Los registros de operaciones publicarán en su sitio web los datos agregados de las posiciones, calculados de conformidad con el artículo 6, con una periodicidad semanal y, a más tardar, el martes a mediodía, en el caso de las OFV notificadas, a más tardar, a las 23:59:59 horas (UTC) del viernes anterior.
2. Los registros de operaciones publicarán todos los datos agregados de las posiciones en euros y utilizarán los tipos de cambio publicados en el sitio web del BCE el viernes anterior a la publicación de dichos datos.
3. Los registros de operaciones velarán por que los datos agregados de las posiciones se publiquen en forma de cuadro, según lo establecido en el anexo II del presente Reglamento, que permita la descarga de los datos.
4. Los datos agregados de las posiciones que los registros de operaciones hayan publicado en su sitio web se mantendrán en él durante al menos 104 semanas.

Artículo 8

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 obligatorio en todos sus elementos y directamente aplicable en cada Estado miembro.

Hecho en Bruselas, el 13 de diciembre de 2018.

Por la Comisión
El Presidente
Jean-Claude JUNCKER

ANEXO I

Cuadro 1

Campos de conciliación, niveles de tolerancia y fecha de inicio de la fase de conciliación

Cuadro	Sección	Campo	Tolerancia	Fecha de inicio mencionada en:
Datos de la contraparte	No procede	Contraparte notificante	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la contraparte	No procede	Lado de la contraparte	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la contraparte	No procede	Otras contrapartes	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Identificador único de operación (UTI)	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Tipo de OFV	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Compensada	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Marca de tiempo de la compensación	Una hora	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Préstamo	ECC	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Centro de negociación	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Tipo de acuerdo marco	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Marca de tiempo de la ejecución	Una hora	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Fecha de valor (Fecha de inicio)	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Fecha de vencimiento (Fecha final)	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Fecha de finalización	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Período mínimo de preaviso	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Préstamo	Primera fecha de solicitud de devolución	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Préstamo	Indicador de garantías reales genéricas	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses

Cuadro	Sección	Campo	Tolerancia	Fecha de inicio mencionada en:
Datos de la operación	Préstamo	Indicador de entrega por valor («DBV»)	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Préstamo	Método utilizado para aportar garantías reales	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Plazo abierto	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Opciones de finalización	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Préstamo	Tipo fijo	Hasta tres decimales	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Convención sobre el cómputo de días	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Tipo variable	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Período de referencia del tipo variable – Período de tiempo	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Período de referencia del tipo variable – Multiplicador	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Préstamo	Frecuencia de pago del tipo variable – Período de tiempo	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Préstamo	Frecuencia de pago del tipo variable – Multiplicador	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Préstamo	Frecuencia de revisión del tipo variable – Período de tiempo	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Frecuencia de revisión del tipo variable – Multiplicador	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Diferencial	Hasta tres decimales	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Importe en la moneda del préstamo con reposición del margen	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Moneda del préstamo con reposición del margen	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365

Cuadro	Sección	Campo	Tolerancia	Fecha de inicio mencionada en:
Datos de la operación	Préstamo	Tipo ajustado	Hasta tres decimales	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Préstamo	Fecha del tipo	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Préstamo	Importe del principal en la fecha de valor	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Importe del principal en la fecha de vencimiento	0,0005 %	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Moneda del importe del principal	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Tipo de activo	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Identificador del valor	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Clasificación de un valor	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Categoría de producto	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Préstamo	Subcategoría de producto	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Préstamo	Ulterior subcategoría de producto	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Préstamo	Cantidad o importe nominal	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Unidad de medida	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Préstamo	Moneda del importe nominal	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Precio del valor o materia prima	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Préstamo	Moneda del precio	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Préstamo	Calidad del valor	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Vencimiento del valor	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365

Cuadro	Sección	Campo	Tolerancia	Fecha de inicio mencionada en:
Datos de la operación	Préstamo	Jurisdicción del emisor	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Identificador de persona jurídica (LEI) del emisor	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Tipo de valor	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Valor del préstamo	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Préstamo	Valor de mercado	0,0005 %	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Préstamo	Interés de descuento fijo	Hasta tres decimales	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Interés de descuento variable	Hasta tres decimales	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Período de referencia del interés de descuento variable – Período de tiempo	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Préstamo	Período de referencia del interés de descuento variable – Multiplicador	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Préstamo	Frecuencia de pago del interés de descuento variable – Período de tiempo	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Préstamo	Frecuencia de pago del interés de descuento variable – Multiplicador	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Préstamo	Frecuencia de revisión del interés de descuento variable – Período de tiempo	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Préstamo	Frecuencia de revisión del interés de descuento variable – Multiplicador	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Préstamo	Diferencial del interés de descuento	Hasta tres decimales	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Préstamo	Comisión del préstamo	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365

Cuadro	Sección	Campo	Tolerancia	Fecha de inicio mencionada en:
Datos de la operación	Préstamo	Acuerdos exclusivos	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Préstamo	Préstamo pendiente con reposición del margen	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Moneda de base del préstamo pendiente con reposición del margen	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Valor de mercado de las posiciones cortas	0,0005 %	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Garantías reales	Indicador de préstamo de valores («SL») sin garantía real	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Garantías reales	Cobertura de la exposición neta mediante garantías reales	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Garantías reales	Fecha de valor de las garantías reales	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Garantías reales	Tipo de componente de las garantías reales	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Garantías reales	Importe de las garantías reales en efectivo	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Garantías reales	Moneda de las garantías reales en efectivo	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Garantías reales	Identificación de un valor utilizado como garantía real	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Garantías reales	Clasificación de un valor utilizado como garantía real	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Garantías reales	Categoría de producto	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Garantías reales	Subcategoría de producto	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Garantías reales	Ulterior subcategoría de producto	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso iv), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Garantías reales	Cantidad o importe nominal de las garantías reales	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Garantías reales	Unidad de medida de las garantías reales	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses

Cuadro	Sección	Campo	Tolerancia	Fecha de inicio mencionada en:
Datos de la operación	Garantías reales	Moneda del importe nominal de las garantías reales	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Garantías reales	Moneda del precio	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Garantías reales	Precio unitario	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Garantías reales	Valor de mercado de las garantías reales	0,0005 %	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Datos de la operación	Garantías reales	Recorte o margen	Hasta tres decimales	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Garantías reales	Calidad de las garantías reales	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Garantías reales	Fecha de vencimiento del valor	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Garantías reales	Jurisdicción del emisor	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Garantías reales	Identificador de persona jurídica (LEI) del emisor	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Garantías reales	Tipo de garantía real	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Garantías reales	Posibilidad de reutilización de garantías reales	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Garantías reales	Identificador de la cesta de garantías reales	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365
Datos de la operación	Préstamo	Nivel	No	Artículo 33, apartado 2, letra a), inciso i), del Reglamento (UE) 2015/2365

Cuadro 2

Motivos de rechazo de una notificación de OFV

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

Cuadro 3

Resultados del proceso de conciliación

Categorías de conciliación	Valores de conciliación
Tipo de notificación	Unilateral/bilateral
Requisito de notificación aplicable a ambas contrapartes	Sí/No
Situación en cuanto a casamiento	Casado/No casado
Situación en cuanto a conciliación de préstamos	Conciliado/No conciliado
Situación en cuanto a conciliación de garantías reales	Conciliada/No conciliada
Otras modificaciones	Sí/No

ANEXO II

Cuadro 1

Datos públicos

Cuadro A. Agregación

Fecha	Notificación de operación (TR)	Tipo de agregación	Tipo de centro	Ubicación de la contraparte notificante	Ubicación de la otra contraparte	Conciliación	Tipo de OFV	Compensada	Método de transferencia de garantías reales	Índice utilizado como referencia ⁽¹⁾	Importe agregado prestado	Número agregado de operaciones	Valor agregado de las garantías reales
20161007	TR UE	Notificada	XXXX	EEE	EEE	Bilateral, préstamo conciliado, garantías reales no conciliadas	Repo	Sí	Acuerdo de garantía financiera con cambio de titularidad	
...	...	Pendiente	XOFF	No EEE	No EEE	Bilateral, préstamo conciliado, garantías reales conciliadas	Operación simultánea de compra-retroventa/operación simultánea de venta-recompra	No	Acuerdo de garantía financiera prendaria (SICA)	
...	MIC EEE	Unilateral EEE, préstamo conciliado, garantías reales conciliadas	Préstamo de valores o materias primas y toma de valores o materias primas en préstamo	...	Acuerdo de garantía financiera con derecho de uso (SIUR)	
...	MIC no EEE	Préstamo con reposición del margen
...

⁽¹⁾ A cumplimentar con los índices pertinentes incluidos en el campo 25 del cuadro 2 «Datos de los préstamos y las garantías reales» del anexo I del Reglamento de Ejecución (UE) 2019/363.