

BASE DE DATOS DE Norma DEF.-

Referencia: NCL013047

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

(DOUE L 262, de 7 de octubre de 2022)

[* El presente Reglamento entrará en vigor el 27 de octubre de 2022. Será aplicable a partir del 29 de abril de 2024.]

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, 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.

(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;

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 notional 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

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

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