

**REGLAMENTO DE EJECUCIÓN (UE) N° 1249/2012 DE LA COMISIÓN**  
**de 19 de diciembre de 2012**

**por el que se establecen normas técnicas de ejecución relativas al formato de la información que deben conservar las entidades de contrapartida central, de conformidad con el Reglamento (UE) n° 648/2012 del Parlamento Europeo y del Consejo, relativo a los derivados extrabursátiles, las entidades de contrapartida central y los registros de operaciones**

(Texto pertinente a efectos del EEE)

LA COMISIÓN EUROPEA,

Visto el Tratado de Funcionamiento de la Unión Europea,

Visto el dictamen del Banco Central Europeo <sup>(1)</sup>,

Visto el Reglamento (UE) n° 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 <sup>(2)</sup>, y, en particular, su artículo 29, apartado 5,

Considerando lo siguiente:

- (1) Con arreglo al artículo 29, apartado 4, del Reglamento (UE) n° 648/2012 y los artículos 13, 14 y 15 del acto delegado sobre las normas técnicas de regulación por las que se especifican los pormenores de la información y documentación que deben conservar las entidades de contrapartida central (ECC), adoptado en virtud del artículo 29, apartado 4, del Reglamento (UE) n° 648/2012, es preciso igualmente establecer normas que especifiquen el formato de la información y documentación conservada conforme a dichos artículos.
- (2) Para desempeñar sus funciones eficaz y uniformemente, las autoridades pertinentes deben recibir datos comparables de las ECC. La utilización de formatos comunes facilita asimismo la conciliación de datos entre ECC.
- (3) A efectos de conservación de la información, resulta oportuno exigir a las ECC que mantengan los datos en un formato compatible con el que utilicen los registros de operaciones para conservar sus datos, teniendo en cuenta que, en ciertas circunstancias, las ECC y los registros de operaciones están obligados a mantener o notificar la misma información. El uso de un formato común en diferentes infraestructuras de los mercados financieros favorece la difusión de esos formatos entre una gran diversidad de participantes en el mercado, promoviendo así la normalización.
- (4) A fin de facilitar un procesamiento directo y reducir los costes de los participantes en el mercado, es importante recurrir, en la medida de lo posible, a procedimientos y formatos de datos normalizados para todas las ECC.

- (5) Si bien resulta oportuno identificar el subyacente mediante un identificador único, no existe en la actualidad un código normalizado válido en todo el mercado para identificar los subyacentes integrados en una cesta. Procede, por tanto, que las ECC indiquen al menos que el subyacente es una cesta y utilicen los códigos internacionales de identificación de valores (ISIN) en lo que respecta a los índices normalizados, cuando sea posible.
- (6) El presente Reglamento se basa en los proyectos de normas técnicas de ejecución presentados por la Autoridad Europea de Valores y Mercados (AEVM) a la Comisión.
- (7) De acuerdo con lo dispuesto en el artículo 15 del Reglamento (UE) n° 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) <sup>(3)</sup>, la AEVM ha sometido los proyectos de normas técnicas de ejecución en que se basa el presente Reglamento a una consulta pública abierta antes de presentarlos, ha analizado los correspondientes costes y beneficios potenciales y ha solicitado el dictamen del Grupo de Partes Interesadas del Sector de Valores y Mercados, creado de conformidad con el artículo 37 del Reglamento (UE) n° 1095/2010.

HA ADOPTADO EL PRESENTE REGLAMENTO:

*Artículo 1*

**Formato de la información**

1. En relación con cada contrato procesado, las ECC conservarán la información especificada en el artículo 20 del acto delegado sobre las normas técnicas de regulación por las que se especifican los pormenores de la información y documentación que deben conservar las entidades de contrapartida central (ECC), adoptado en virtud del artículo 29, apartado 4, del Reglamento (UE) n° 648/2012, en el formato que se establece en el cuadro 1 del anexo.
2. En relación con cada posición, las ECC conservarán la información especificada en el artículo 21 del acto delegado sobre las normas técnicas de regulación por las que se especifican los pormenores de la información y documentación que deben conservar las entidades de contrapartida central (ECC), adoptado en virtud del artículo 29, apartado 4, del Reglamento (UE) n° 648/2012, en el formato que se establece en el cuadro 2 del anexo.

<sup>(1)</sup> No publicada aún en el Diario Oficial.

<sup>(2)</sup> DO L 201 de 27.7.2012, p. 1.

<sup>(3)</sup> DO L 331 de 15.12.2010, p. 84.

3. En relación con las actividades vinculadas a su organización interna y corporativa, las ECC conservarán la información especificada en el artículo 22 del acto delegado sobre las normas técnicas de regulación por las que se especifican los pormenores de la información y documentación que deben conservar las entidades de contrapartida central (ECC), adoptado en virtud del artículo 29, apartado 4, del Reglamento (UE) n° 648/2012, en el formato que se establece en el cuadro 3 del anexo.

4. Las ECC facilitarán a la autoridad competente la información y documentación a que se refieren los apartados 1, 2 y 3

en un formato que haga posible un flujo de datos directo en tiempo real entre la ECC y la autoridad competente. Las ECC establecerán dichos flujos de datos en tiempo real en el plazo de seis meses a contar desde la solicitud de la autoridad competente.

#### *Artículo 2*

#### **Entrada en vigor**

El presente Reglamento entrará en vigor el vigésimo día siguiente al de su publicación en el *Diario Oficial de la Unión Europea*.

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

Hecho en Bruselas, el 19 de diciembre de 2012.

*Por la Comisión*

*El Presidente*

José Manuel BARROSO

---

## ANEXO

## Cuadros de los campos de datos que deberán conservarse con arreglo al artículo 1

## Cuadro 1

## Registros de las operaciones procesadas

	Campo	Formato	Descripción
1	Marca de tiempo de la notificación	<i>Formato de fecha según la norma ISO 8601 / hora UTC.</i>	Fecha y hora de la notificación
2	Precio / tipo	<i>Hasta 20 dígitos, según el formato xxxx.yyyyy.</i>	Precio por valor o contrato de derivados, excluidas las comisiones y, en su caso, los intereses devengados. Cuando se trate de un instrumento de deuda, el precio podrá expresarse en términos monetarios o en porcentaje.
2a	Notación del precio	<i>P.ej., código de la moneda según la norma ISO 4217, 3 letras, porcentaje.</i>	Manera en la que se expresa el precio.
3	Moneda nocional	<i>Código de la moneda según la norma ISO 4217, 3 letras.</i>	Moneda en la que se expresa el precio. Si, en el caso de un bono u otra forma de deuda titulizada, el precio se expresa en porcentaje, se indicará ese porcentaje.
3a	Moneda entregable	<i>Código de la moneda según la norma ISO 4217, 3 letras.</i>	La moneda que deberá entregarse
4	Cantidad	<i>Hasta 10 dígitos.</i>	Número de unidades de los instrumentos financieros, valor nominal de los bonos, o número de contratos de derivados comprendidos en la operación.
5	Notación de la cantidad	<i>Hasta 10 dígitos.</i>	Se indicará si la cantidad corresponde al número de unidades de instrumentos financieros, al valor nominal de los bonos o al número de contratos de derivados.
6	Lado de la ECC	<i>B= comprador / S= vendedor.</i>	
7	Identificación del producto	<i>Taxonomía provisional conforme a la información del artículo 4 del Reglamento (UE) xx/2012 [proyectos de NTE sobre el formato y la frecuencia de las notificaciones de operaciones a los registros de operaciones], ISIN o identificador único de producto (UPI).</i>	El contrato se identificará mediante un identificador de producto, cuando se disponga de él.
8	Identificación del miembro compensador	<i>Identificador de entidades jurídicas (LEI) (20 caracteres alfanuméricos), identificador de entidades provisional (20 caracteres alfanuméricos), código BIC (11 caracteres alfanuméricos) o código de cliente (50 caracteres alfanuméricos).</i>	En caso de que la contraparte informante no sea un miembro compensador, el miembro compensador de la misma estará identificado en este campo por un código único. Cuando se trate de una persona física, se utilizará un código de cliente asignado por la ECC.

	Campo	Formato	Descripción
9	Identificación del beneficiario	<i>Identificador de entidades jurídicas (LEI) (20 caracteres alfanuméricos), identificador de entidades provisional (20 caracteres alfanuméricos), código BIC (11 caracteres alfanuméricos) o código de cliente (50 caracteres alfanuméricos).</i>	Si el beneficiario del contrato no es una contraparte del citado contrato, deberá identificarse mediante un código único o, cuando se trate de personas físicas, mediante un código de cliente asignado por la persona jurídica a la que recurra la persona física.
10	Parte que ha transferido el contrato (en caso de cesión)	<i>Identificador de entidades jurídicas (LEI) (20 caracteres alfanuméricos), identificador de entidades provisional (20 caracteres alfanuméricos), código BIC (11 caracteres alfanuméricos) o código de cliente (50 caracteres alfanuméricos).</i>	
11	Plataforma de ejecución	<i>Código de identificación del mercado (MIC) según la norma ISO 10383, en su caso, XOFF para los derivados cotizados que se negocien fuera de la bolsa o XXXX para los derivados extrabursátiles.</i>	Identificación de la plataforma en que se haya ejecutado la operación. Cuando se trate de contratos no celebrados en mercados regulados, deberá indicarse si el instrumento considerado es objeto de negociación extrabursátil aunque se admita su negociación en bolsa, o si tampoco está admitido a negociación en bolsa.
12	Fecha de intermediación	<i>Formato de fecha según la norma ISO 8601.</i>	Fecha en la que haya tenido lugar la intermediación de la ECC en el contrato.
13	Hora de intermediación	<i>Hora UTC.</i>	Hora en la que haya tenido lugar la intermediación de la ECC en el contrato, en hora local de la autoridad competente a la que se notificará la operación, y huso horario en que se declara la operación, expresado en Hora Universal Coordinada (UTC) +/- horas.
14	Fecha de terminación del contrato	<i>Formato de fecha según la norma ISO 8601.</i>	Fecha en la que haya terminado el contrato.
15	Hora de terminación del contrato	<i>Hora UTC.</i>	Hora en la que haya terminado el contrato, en hora local de la autoridad competente a la que se notificará la operación, y huso horario en que se declara la operación, expresado en Hora Universal Coordinada (UTC) +/- horas.
16	Tipo de entrega	<i>C = efectivo, P = física, O = opcional para la contraparte.</i>	Indicación de si el contrato se liquida mediante entrega física o en efectivo.
17	Fecha de liquidación	<i>Formato de fecha según la norma ISO 8601.</i>	Fecha en la que haya tenido lugar la liquidación o recompra del contrato. Si hay más de una, podrán añadirse otros campos.
18	Hora de liquidación o recompra del contrato	<i>Hora UTC.</i>	Hora en la que haya tenido lugar la liquidación o recompra del contrato, en hora local de la autoridad competente a la que se notificará la operación, y huso horario en que se declara la operación, expresado en Hora Universal Coordinada (UTC) +/- horas.

	Campo	Formato	Descripción
Datos sobre las condiciones iniciales de los contratos compensados, que se facilitarán en la medida en que resulten pertinentes			
19	Fecha	<i>Formato de fecha según la norma ISO 8601.</i>	Fecha en que se celebró inicialmente el contrato.
20	Hora	<i>Hora UTC.</i>	Hora en la que se celebró el contrato inicial, en hora local de la autoridad competente a la que se notificará la operación, y huso horario en que se declara la operación, expresado en Hora Universal Coordinada (UTC) +/- horas.
21	Identificación del producto	<i>Taxonomía provisional conforme a la información del artículo 4 del Reglamento (UE) xx/2012 [proyectos de NTE sobre el formato y la frecuencia de las notificaciones de operaciones a los registros de operaciones], ISIN o identificador único de producto (UPI).</i>	El contrato se identificará mediante un identificador único de producto, cuando se disponga de él.
22	Subyacente	<i>Identificador único de producto, ISIN (12 caracteres alfanuméricos) y CFI (6 caracteres alfanuméricos). Identificador de entidades jurídicas (LEI) (20 caracteres alfanuméricos), identificador de entidades provisional (20 caracteres alfanuméricos), B= cesta o I= índice.</i>	Identificación del instrumento correspondiente al valor que constituye el activo subyacente en un contrato de derivados, así como un valor negociable de los contemplados en el artículo 4.1.18)c) de la Directiva 2004/39/CE.
23	Tipo de derivado (en caso de contrato de derivados)	La descripción armonizada del tipo de derivado debe realizarse con arreglo a una de las categorías de nivel superior previstas en una norma uniforme internacionalmente aceptada para la clasificación de instrumentos financieros.	
24	Inclusión del instrumento en el registro de la AEVM de contratos sujetos a la obligación de compensación (en caso de contrato de derivados)	<i>Y= sí / N= no.</i>	
Otros datos que deberán facilitarse en la medida en que sean pertinentes			
25	Identificación de la ECC interoperable que compensa un componente de la operación	<i>Identificador de entidades jurídicas (LEI) (20 caracteres alfanuméricos), identificador de entidades provisional (20 caracteres alfanuméricos), código BIC (11 caracteres alfanuméricos) o código de cliente (50 caracteres alfanuméricos).</i>	

Cuadro 2

**Registros de las posiciones**

	Campo	Formato
1	Identificación del miembro compensador	Identificador de entidades jurídicas (LEI), identificador de entidades provisional o código BIC
2	Identificación del beneficiario	Identificador de entidades jurídicas (LEI), identificador de entidades provisional, código BIC o código de cliente
3	ECC interoperable que mantiene la posición	Identificador de entidades jurídicas (LEI), identificador de entidades provisional, código BIC o código de cliente
4	Signo de la posición	B= comprador / S= vendedor.
5	Valor de la posición	Hasta 10 dígitos (xxxx,yy).
6	Precio al que se valoran los contratos	Hasta 10 dígitos (xxxx,yy).
7	Moneda	Código ISO de la moneda.
8	Otra información pertinente	Texto libre
9	Importe de los márgenes solicitados por la ECC	Hasta 10 dígitos (xxxx,yy).
10	Importe de las contribuciones al fondo de garantía frente a incumplimientos solicitadas por la ECC	Hasta 10 dígitos (xxxx,yy).
11	Importe de otros recursos financieros solicitados por la ECC	Hasta 10 dígitos (xxxx,yy).
12A	Importe de los márgenes aportados por el miembro compensador con referencia a la cuenta cliente A	Hasta 10 dígitos (xxxx,yy).
13A	Importe de las contribuciones al fondo de garantía frente a incumplimientos aportadas por el miembro compensador con referencia a la cuenta cliente A	Hasta 10 dígitos (xxxx,yy).
14A	Importe de otros recursos financieros aportados por el miembro compensador con referencia a la cuenta cliente A	Hasta 10 dígitos (xxxx,yy).
15B	Importe de los márgenes aportados por el miembro compensador con referencia a la cuenta cliente B	Hasta 10 dígitos (xxxx,yy).
16B	Importe de las contribuciones al fondo de garantía frente a incumplimientos aportadas por el miembro compensador con referencia a la cuenta cliente B	Hasta 10 dígitos (xxxx,yy).
17B	Importe de otros recursos financieros aportados por el miembro compensador con referencia a la cuenta cliente B	Hasta 10 dígitos (xxxx,yy).

Cuadro 3

**Registros corporativos**

	Campo	Formato	Descripción
1	Organigramas	<i>Texto libre</i>	Consejo y comités pertinentes, unidad de compensación, unidad de gestión de riesgos y todas las demás unidades o divisiones pertinentes.

Accionistas o socios con participaciones cualificadas (campos que deberán añadirse por cada uno de los accionistas o socios pertinentes)

2	Tipo	<i>S= accionista / M= socio.</i>	
3	Tipo de participación cualificada	<i>D= directa / I =indirecta.</i>	
4	Tipo de entidad	<i>N= persona física / L= persona jurídica.</i>	
5	Importe de la participación	<i>Hasta 10 dígitos (xxxx,yyyyy).</i>	

Otros documentos

6	Políticas, procedimientos y procesos impuestos por requisitos organizativos	<i>Documentos</i>	
7	Actas de las reuniones del consejo, de los subcomités (en su caso) y de los comités de la alta dirección (en su caso)	<i>Documentos</i>	
8	Actas de las reuniones del comité de riesgos	<i>Documentos</i>	
9	Actas del grupo de consulta con los miembros compensadores y clientes (en su caso)	<i>Documentos</i>	
10	Informes de auditorías internas y externas, gestión de riesgos, cumplimiento y consultoría	<i>Documentos</i>	
11	Política de continuidad de la actividad y plan de recuperación en caso de catástrofe	<i>Documentos</i>	
12	Plan de liquidez e informes diarios de liquidez	<i>Documentos</i>	
13	Documentos que reflejen todos los activos y pasivos y las cuentas de capital	<i>Documentos</i>	

	Campo	Formato	Descripción
14	Reclamaciones recibidas	<i>Texto libre</i>	Por cada reclamación: nombre, dirección y número de cuenta del reclamante; fecha de recepción de la reclamación; nombre de todas las personas indicadas en ella; descripción de la naturaleza de la reclamación; curso de la misma; fecha en que se haya resuelto.
15	Información sobre interrupciones de los servicios o disfunciones	<i>Texto libre</i>	Información sobre cualquier interrupción de servicios o disfunción, junto con un informe detallado del momento en que se hayan producido, los efectos y las medidas correctoras.
16	Resultados de las pruebas retrospectivas y de resistencia efectuadas	<i>Texto libre</i>	
17	Comunicaciones escritas con las autoridades competentes, la AEVM y los miembros pertinentes del SEBC	<i>Documentos</i>	
18	Dictámenes jurídicos recibidos de conformidad con los requisitos organizativos	<i>Documentos</i>	
19	Acuerdos de interoperabilidad con otras ECC (en su caso)	<i>Documentos</i>	
20	Lista de todos los miembros compensadores (artículo 17 del Reglamento (UE) XXX/2012)	<i>Texto libre / documento</i>	Lista contemplada en el artículo 17 del Reglamento (UE) XXX/2012.
21	Información exigida por el artículo 17 del Reglamento (UE) XXX/2012.	<i>Texto libre / documentos</i>	Disposiciones legales y reglamentarias por las que se rijan: i) el acceso a la ECC; ii) los contratos celebrados por la ECC con miembros compensadores y, cuando sea posible, con clientes; iii) los contratos que la ECC acceda a compensar; iv) cualquier acuerdo de interoperabilidad; v) el uso de las garantías y las contribuciones al fondo de garantía frente a incumplimientos, incluida la liquidación de posiciones y garantías y el nivel de inembargabilidad de las garantías por terceros acreedores (nivel de segregación).
22	Procesos de desarrollo de nuevas iniciativas	<i>Texto libre</i>	En caso de prestación de nuevos servicios.