Este texto es exclusivamente un instrumento de documentación y no surte efecto jurídico. Las instituciones de la UE no asumen responsabilidad alguna por su contenido. Las versiones auténticas de los actos pertinentes, incluidos sus preámbulos, son las publicadas en el Diario Oficial de la Unión Europea, que pueden consultarse a través de EUR-Lex. Los textos oficiales son accesibles directamente mediante los enlaces integrados en este documento

►**B**

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

(Texto pertinente a efectos del EEE)

(DO L 262 de 7.10.2022, p. 68)

Rectificado por:

►**C1** Rectificación, DO L 304 de 24.11.2022, p. 102 (2022/1860)
►**C2** Rectificación, DO L 125 de 11.5.2023, p. 59 (2022/1860)
►**C3** Rectificación, DO L 90272 de 29.4.2024, p. 1 (2022/1860)

▼B

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

(Texto pertinente a efectos del EEE)

Artículo 1

Estándares de datos y formatos de las notificaciones sobre derivados

Los datos de un contrato de derivados que deben notificarse con arreglo al artículo 9 del Reglamento (UE) n.º 648/2012 se facilitarán de conformidad con los estándares y formatos establecidos en los cuadros 1, 2 y 3 del anexo del presente Reglamento y en formato electrónico común y apto para lectura automatizada y en una plantilla XML común que se ajuste a la metodología ISO 20022.

Artículo 2

Frecuencia de las notificaciones

1. Todas las notificaciones de los datos de un derivado especificadas en el artículo 1 del Reglamento Delegado (UE) 2022/1855 de la Comisión ([1]) se presentarán en el orden cronológico en el que se hayan producido los sucesos relacionados con la información que debe notificarse.

2. Las ECC, las contrapartes financieras o las contrapartes no financieras a que se refiere el artículo 10 del Reglamento (UE) n.º 648/2012 que sean contrapartes de un derivado, o la entidad responsable de la notificación, notificarán cualquier modificación de los elementos relativos a las garantías reales en los campos 1 a 29 del cuadro 3 del anexo del Reglamento Delegado (UE) 2022/1855 con el tipo de acción «Actualización del margen», tal y como se encuentren al final de cada día, para ese derivado cuando:

a) el derivado no haya vencido ni haya sido objeto de una notificación con el tipo de acción «Finalización», «Error» o «Componente de posición», tal como se indica en el campo 151 del cuadro 2 del anexo, o

b) el derivado haya sido objeto de una notificación con el tipo de acción «Reactivación», no seguida de otra notificación con el tipo de acción «Finalización» o «Error» a que se refiere el campo 151 del cuadro 2 del anexo.

([1]) Reglamento Delegado (UE) 2022/1855 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 elementos mínimos de los datos que deben notificarse a los registros de operaciones y el tipo de notificaciones que deben utilizarse (véase la página 1 del presente Diario Oficial).

▼B

3. Una contraparte de un derivado contemplado en el apartado 2, letras a) y b), que sea una ECC, una contraparte financiera o una contraparte no financiera a que se refiere el artículo 10 del Reglamento (UE) n.º 648/2012, o la entidad responsable de la notificación, informará sobre la valoración del contrato al cierre a precios de mercado o según modelo en los campos 21 a 25 del cuadro 2 del anexo del Reglamento Delegado (UE) 2022/1855 con el tipo de acción «Actualización de la valoración», tal y como se encuentre al final de cada día.

Artículo 3

Identificación de las contrapartes y otras entidades

1. El informe utilizará un código de identificación de entidad jurídica (LEI) según la norma ISO 17442 para identificar:

a) una entidad de intermediación;

b) una ECC;

c) un miembro compensador;

d) una contraparte que sea una entidad jurídica;

e) una entidad que remite la notificación;

f) una entidad responsable de la notificación;

g) un proveedor de servicios de reducción de riesgos posnegociación.

2. Una contraparte 1 de un derivado a que se refiere el campo 4 del cuadro 1 del anexo del Reglamento Delegado (UE) 2022/1855 y la entidad responsable de la notificación velarán por que los datos de referencia relacionados con su código LEI basado en la norma ISO 17442 se renueven de conformidad con las condiciones de cualquiera de las unidades operativas locales acreditadas del sistema mundial de LEI al notificar la celebración o la modificación de un contrato con arreglo al artículo 9 del Reglamento (UE) n.º 648/2012.

Artículo 4

Dirección del derivado

1. El lado de la contraparte del contrato de derivados a que se refiere el cuadro 1, campos 17 a 19, del anexo se determinará en el momento de la celebración del derivado ►C1 conforme a los apartados 2 a 13 ◄.

2. En el caso de las opciones y las opciones sobre permutas financieras, la contraparte que ostente el derecho a ejercitar la opción se identificará como el comprador y la contraparte que venda la opción y reciba una prima se identificará como el vendedor.

3. En el caso de los contratos a plazo relacionados con divisas, la contraparte 1 se identificará como el pagador o el receptor para el componente 1, y a la inversa para el componente 2. La contraparte 2 cumplimentará los campos 18 y 19 del cuadro 1 con los valores opuestos a los de la contraparte 1.

▼B

4. En el caso de las permutas financieras relacionadas con divisas en las que se producen múltiples intercambios de divisas, cada contraparte de ambos componentes de la operación se identificará como el pagador o el receptor del componente sobre la base del intercambio de divisas que tenga lugar más cerca de la fecha de expiración.

5. En el caso de los contratos a plazo distintos de los contratos a plazo sobre divisas y en el caso de los futuros, la contraparte que compre el instrumento se identificará como el comprador y la contraparte que venda el instrumento se identificará como el vendedor.

6. En el caso de los contratos financieros por diferencias y de las apuestas por diferencias, la contraparte que vaya en corto en el contrato se identificará como el vendedor y la contraparte que vaya en largo se identificará como el comprador.

7. En el caso de las permutas relacionadas con dividendos, la contraparte que reciba el equivalente de los pagos del importe del dividendo se identificará como el comprador y la contraparte que pague el equivalente del pago del importe del dividendo se identificará como el vendedor.

8. En el caso de permutas financieras relacionadas con valores distintos de dividendos, la contraparte 1 se identificará como el pagador o el receptor para el componente 1, y lo contrario para el componente 2. La contraparte 2 cumplimentará los campos 18 y 19 del cuadro 1 con los valores opuestos a los de la contraparte 1.

9. En el caso de las permutas financieras relacionadas con tipos de interés o índices de inflación, incluidas las permutas de divisas, la contraparte 1 se identificará como el pagador o el receptor para el componente 1, y lo contrario para el componente 2. La contraparte 2 cumplimentará los campos 18 y 19 del cuadro 1 con los valores opuestos a los de la contraparte 1.

10. En el caso de los instrumentos derivados destinados a la transferencia del riesgo de crédito, exceptuadas las opciones y las opciones sobre permutas financieras, la contraparte que compre la protección se identificará como el comprador y la contraparte que venda la protección se identificará como el vendedor.

11. En el caso de las permutas financieras relacionadas con materias primas, la contraparte 1 se identificará como el pagador o el receptor para el componente 1, y lo contrario para el componente 2. La contraparte 2 cumplimentará los campos 18 y 19 del cuadro 1 con los valores opuestos a los de la contraparte 1.

12. En el caso de los contratos a plazo sobre tipos de interés, la contraparte 1 se identificará como el pagador o el receptor para el componente 1, y lo contrario para el componente 2. La contraparte 2 cumplimentará los campos 18 y 19 del cuadro 1 con los valores opuestos a los de la contraparte 1.

13. En el caso de los derivados relacionados con la varianza, la volatilidad y la correlación, la contraparte que se beneficie de un aumento del precio del subyacente se identificará como el comprador y la contraparte que se beneficie de una disminución del precio del subyacente se identificará como el vendedor.

▼B

Artículo 5

Cobertura mediante garantías reales

La contraparte notificante identificará el tipo de garantía real del contrato de derivados o de una cartera de derivados a que se refiere el campo 11 del cuadro 3 del anexo como sigue:

a) «sin garantía real», cuando no exista un acuerdo de garantía real entre las contrapartes o el acuerdo de garantía real entre ellas estipule que las contrapartes no aportan ni margen inicial ni margen de variación con respecto al contrato de derivados o a una cartera de derivados;

b) «con garantía real parcial: solo la contraparte 1», cuando el acuerdo de garantía real entre las contrapartes estipule que la contraparte notificante solo aporta regularmente márgenes de variación y que la otra contraparte no aporta ningún margen con respecto al derivado o a una cartera de derivados;

c) «con garantía real parcial: solo la contraparte 2», cuando el acuerdo de garantía real entre las contrapartes estipule que la otra contraparte solo aporta regularmente un margen de variación y que la contraparte notificante no aporta ningún margen con respecto al derivado o a una cartera de derivados;

d) «con garantía real parcial», cuando el acuerdo de garantía real entre las contrapartes estipule que ambas contrapartes solo aportan regularmente un margen de variación con respecto al derivado o a una cartera de derivados;

e) «con garantía real unilateral: solo la contraparte 1», cuando el acuerdo de garantía real entre las contrapartes estipule que la contraparte notificante aporta el margen inicial y regularmente aporta márgenes de variación y que la otra contraparte no aporta ningún margen con respecto al derivado o a una cartera de derivados;

f) «con garantía real unilateral: solo la contraparte 2», cuando el acuerdo de garantía real entre las contrapartes estipule que la otra contraparte aporta el margen inicial y regularmente aporta márgenes de variación y que la contraparte notificante no aporta ningún margen con respecto al derivado o a una cartera de derivados;

g) «con garantía real unilateral/parcial: contraparte 1», cuando el acuerdo de garantía real entre las contrapartes estipule que la contraparte notificante aporta el margen inicial y regularmente aporta el margen de variación y que la otra contraparte aporta regularmente solo el margen de variación con respecto al derivado o a una cartera de derivados;

h) «con garantía real unilateral/parcial: contraparte 2», cuando el acuerdo de garantía real entre las contrapartes estipule que la otra contraparte aporta el margen inicial y regularmente aporta el margen de variación y que la contraparte notificante regularmente aporta solo el margen de variación con respecto al derivado o a una cartera de derivados;

▼B

i) «con garantía real íntegra», cuando el acuerdo de garantía real entre las contrapartes estipule que ambas contrapartes aportan margen inicial y regularmente aportan márgenes de variación con respecto al derivado o a una cartera de derivados.

Artículo 6

Especificación, identificación y clasificación de los derivados

1. En las notificaciones, todo derivado se especificará basándose en el tipo de contrato y la categoría de activo conforme a los campos 10 y 11 del cuadro 2 del anexo.

La notificación especificará la categoría de activos más parecida al derivado cuando los derivados no pertenezcan a ninguna de las categorías de derivados mencionadas en el campo 11 del cuadro 2 del anexo. Ambas contrapartes indicarán la misma categoría de activos.

2. Los derivados se identificarán en el campo 7 del cuadro 2 del anexo utilizando un código del número internacional de identificación de valores mobiliarios (ISIN) según la norma ISO 6166 en cualquiera de los casos siguientes:

a) cuando esté admitido a negociación o se negocie en un centro de negociación;

b) cuando se negocie en un internalizador sistemático y su subyacente se admita a negociación o se negocie en un centro de negociación o sea un índice o una cesta compuesta por instrumentos negociados en un centro de negociación.

3. Los derivados distintos del derivado a que se refiere el apartado 2 se identificarán en el campo 8 del cuadro 2 del anexo utilizando un código de identificador único de producto (UPI) según la norma ISO 4914.

4. La contraparte notificante clasificará el derivado en el campo 9 del cuadro 2 del anexo utilizando un código de clasificación de instrumento financiero (CFI) según la norma ISO 10962.

Artículo 7

Identificador único de operación

1. Las contrapartes notificarán los derivados utilizando el UTI generado de conformidad con los apartados 2, 3 y 5.

2. Un derivado, notificado por operaciones o por posiciones, se identificará utilizando un identificador único de operación (UTI) según la norma ISO 23897 en el campo 1 del cuadro 2 del anexo. El UTI estará compuesto por el LEI de la entidad que lo haya generado, seguido de un código de hasta 32 caracteres que sea único a nivel de la entidad generadora.

3. Las contrapartes determinarán la entidad responsable de generar el UTI de conformidad con lo siguiente:

▼B

a) en el caso de los derivados compensados distintos de los derivados entre dos ECC, el UTI se generará en el momento de la compensación por la ECC para el miembro compensador. El miembro compensador generará un UTI diferente para su contraparte en una operación en la que la ECC no sea contraparte;

b) en el caso de los derivados con ejecución centralizada y compensación no centralizada, el UTI lo generará el centro en que tenga lugar la ejecución para su miembro;

c) en el caso de los derivados distintos de los contemplados en las letras a) y b), cuando cualquiera de las contrapartes esté sujeta a los requisitos de notificación en un tercer país, el UTI se generará con arreglo a las normas de la jurisdicción de la contraparte que deba cumplir primero dichos requisitos de notificación.

Cuando la contraparte sujeta a notificación con arreglo al artículo 9 del Reglamento (UE) n.º 648/2012 deba cumplir primero los requisitos de notificación, la entidad responsable de generar el UTI será la siguiente:

i) para los derivados con confirmación centralizada por medios electrónicos, la plataforma de confirmación de operaciones en el momento de la confirmación,

ii) para todos los demás derivados, las contrapartes acordarán la entidad responsable de generar el UTI. Cuando las contrapartes no lleguen a un acuerdo, será responsable de la generación la contraparte cuyo LEI se base en primer lugar en la clasificación de los identificadores de las contrapartes con los caracteres del identificador invertidos.

Cuando la legislación aplicable del tercer país pertinente prevea el mismo plazo de notificación que el aplicable a la contraparte sujeta a notificación de conformidad con el artículo 9 del Reglamento (UE) n.º 648/2012 con arreglo al artículo 9, apartado 1, párrafo primero, de dicho Reglamento, las contrapartes acordarán la entidad responsable de generar el UTI.

Cuando las contrapartes no lleguen a un acuerdo y se trate de un derivado con confirmación centralizada por medios electrónicos, el UTI será generado por la plataforma de confirmación de operaciones en el momento de la confirmación.

Si la plataforma de confirmación de operaciones no puede generar el UTI en el momento de la confirmación y los datos del derivado deben notificarse a un único registro de operaciones, dicho registro de operaciones será responsable de generar el UTI.

Si el registro de operaciones al que se han notificado los datos del derivado no puede generar el UTI, la contraparte cuyo LEI se encuentre en primer lugar al clasificar los identificadores de las contrapartes con los caracteres invertidos será responsable de la generación;

▼B

d) para los derivados distintos de los mencionados en las letras a), b) y c) que fueran confirmados de manera centralizada por medios electrónicos, el UTI será generado por la plataforma de confirmación de operaciones en el momento de la confirmación;

e) para todos los derivados distintos de los contemplados en las letras a) a d), será de aplicación lo siguiente:

i) cuando contrapartes financieras celebren un contrato de derivados con contrapartes no financieras, el UTI lo generarán dichas contrapartes financieras,

ii) cuando contrapartes no financieras que sobrepasen el umbral de compensación celebren un contrato de derivados con contrapartes no financieras que se sitúen por debajo del umbral de compensación, las contrapartes no financieras que sobrepasen el umbral de compensación generarán el UTI,

iii) para todos los derivados distintos de los contemplados en los incisos i) y ii), las contrapartes acordarán la entidad responsable de generar el UTI. Cuando las contrapartes no lleguen a un acuerdo, será responsable de la generación la contraparte cuyo LEI se base en primer lugar en la clasificación de los identificadores de las contrapartes con los caracteres del identificador invertidos.

4. La contraparte que genere el UTI deberá comunicarlo a la otra contraparte de manera oportuna y a más tardar a las 10:00 a.m. (tiempo universal coordinado) del día hábil siguiente a la fecha de celebración del derivado.

5. No obstante lo dispuesto en el apartado 3, la generación del UTI podrá delegarse en una entidad distinta de la determinada de conformidad con el apartado 3. La entidad que genere el UTI deberá cumplir los requisitos establecidos en los apartados 2 y 4.

Artículo 8

Notificación de cambios del LEI y actualización de su código de identificación

1. Cuando la contraparte identificada con arreglo al artículo 3 en una notificación de derivados sea objeto de un acto de reestructuración empresarial que provoque un cambio en su LEI, dicha contraparte o la contraparte a la que pertenezca el nuevo LEI, o la entidad responsable de la notificación en nombre de cualquiera de esas contrapartes con arreglo al artículo 9, apartados 1 *bis* a 1 *quinquies*, del Reglamento (UE) n.º 648/2012, o la entidad en la que alguna de las contrapartes haya delegado la notificación de conformidad con el artículo 9, apartado 1 *septies*, del Reglamento (UE) n.º 648/2012, informará del cambio al registro de operaciones al que la contraparte objeto del acto de reestructuración empresarial notificó sus derivados y solicitará una actualización del LEI en los derivados afectados a que se refiere el artículo 2, apartado 2, letras a) y b), en la fecha del acto de reestructuración que provoque un cambio del LEI o en los contratos notificados tras esa fecha.

▼B

2. Cuando sea posible, la solicitud de actualización del identificador de los derivados a que se refiere el artículo 2, apartado 2, letras a) y b), se presentará al menos treinta días naturales antes del acto de reestructuración empresarial que provoque un cambio del LEI. Si la entidad a que se refiere el apartado 1 no puede facilitar esta información al registro de operaciones treinta días naturales antes del acto de reestructuración empresarial que provoque un cambio del LEI, lo notificará al registro de operaciones lo antes posible.

3. La solicitud a la que se refiere el apartado 1 incluirá al menos los siguientes elementos:

a) el LEI de cada una de las contrapartes que participan en el acto de reestructuración empresarial;

b) el LEI de la nueva contraparte;

c) la fecha en que se produce o se haya producido el cambio del LEI;

d) los UTI de los derivados afectados en caso de que el acto de reestructuración empresarial afecte únicamente a un subconjunto de derivados contemplados en el artículo 2, apartado 2, letras a) y b);

e) las pruebas de que el acto de reestructuración empresarial se ha producido o se va a producir, sin perjuicio de las disposiciones relativas a la divulgación pública de información privilegiada conforme al artículo 17 del Reglamento (UE) n.º 596/2014.

4. Cuando una contraparte notifique por error un cambio en su LEI a un registro de operaciones, seguirá el procedimiento establecido en los apartados 1, 2 y 3 para solicitar la actualización de su LEI.

5. Cuando una contraparte previamente identificada con un identificador distinto del LEI obtenga un LEI, se aplicarán los procedimientos previstos en los apartados 1, 2 y 3.

6. Cuando un cambio en el LEI afecte a una contraparte establecida en un tercer país, su contraparte notificante establecida en la Unión o la entidad responsable de la notificación con arreglo al artículo 9, apartados 1 *bis* a 1 *quinquies*, del Reglamento (UE) n.º 648/2012, o la entidad en la que la contraparte notificante establecida en la Unión haya delegado la notificación, iniciará el procedimiento previsto en los apartados 1, 2 y 3.

7. Cuando una contraparte establecida en un tercer país previamente identificada con un identificador distinto del LEI obtenga un LEI, cada contraparte notificante establecida en la Unión afectada por este cambio o la entidad responsable de la notificación con arreglo al artículo 9, apartados 1 *bis* a 1 *quinquies*, del Reglamento (UE) n.º 648/2012, o la entidad en la que la contraparte notificante establecida en la Unión haya delegado la notificación, solicitará la actualización del identificador de la contraparte establecida en un tercer país a su respectivo registro de operaciones.

▼B

8. Cuando el cambio en el LEI afecte a una entidad contemplada en el artículo 3, apartado 1, letras a), b), c), e) o g), que no sea una contraparte del derivado, la contraparte 1 o la entidad responsable de la notificación confirmará al registro de operaciones los UTI de los derivados afectados a que se refiere el artículo 2, apartado 2, letras a) y b). Cuando la contraparte 1 y la entidad responsable de la notificación no confirmen al registro de operaciones los UTI de los derivados a que se refiere el artículo 2, apartado 2, letras a) y b), afectados por el cambio en el LEI, la contraparte 1 o la entidad responsable de la notificación actualizarán el LEI de la entidad de que se trate en todas las notificaciones relativas a los derivados afectados a que se refiere el artículo 2, apartado 2, letras a) y b), mediante el envío de una notificación con el tipo de acción «Modificación».

Artículo 9

Métodos y mecanismos de notificación

1. La entidad responsable de la notificación informará a su autoridad competente y, si fuera diferente, a la autoridad competente de la contraparte notificante, en cualquiera de los casos siguientes:

a) cualquier notificación incorrecta causada por deficiencias en los sistemas de notificación que afecten a un número significativo de notificaciones;

b) cualquier obstáculo que impida a la entidad que remite la notificación enviar notificaciones a un registro de operaciones en el plazo a que se refiere el artículo 9, apartado 1, del Reglamento (UE) n.º 648/2012;

c) cualquier problema significativo que dé lugar a errores de notificación que no provoquen el rechazo por parte de un registro de operaciones de conformidad con Reglamento Delegado (UE) 2022/1858 de la Comisión ([2]).

La entidad responsable de la notificación informará sin demora sobre cualquiera de estos casos tan pronto como tenga conocimiento de ellos.

La notificación indicará al menos el tipo de error u omisión, la fecha en que se produjo, el alcance de las notificaciones afectadas, los motivos de los errores u omisiones, las medidas adoptadas para resolver el problema y el calendario previsto para su resolución y las correcciones correspondientes.

2. Cuando una contraparte financiera tenga la responsabilidad exclusiva, incluida la legal, de la notificación de los datos de los contratos de derivados extrabursátiles en nombre de una contraparte no financiera con arreglo al artículo 9, apartado 1 *bis*, del Reglamento (UE) n.º 648/2012, establecerá los siguientes mecanismos:

([2]) 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 (véase la página 46 del presente Diario Oficial).

▼B

a) mecanismos para que la contraparte no financiera facilite oportunamente los siguientes datos de los contratos de derivados extrabursátiles de los que no quepa esperar razonablemente que la contraparte financiera disponga, y cuando dicha contraparte financiera los desconozca:

i) la identificación del agente intermediario, tal como se indica en el campo 15 del cuadro 1 del anexo,

ii) el miembro compensador, tal como se indica en el campo 16 del cuadro 1 del anexo,

iii) los datos directamente relacionados con la actividad comercial o la financiación de tesorería, tal como se indica en el campo 20 del cuadro 1 del anexo;

b) mecanismos para que la contraparte no financiera informe oportunamente a la contraparte financiera de cualquier cambio en sus obligaciones de conformidad con el artículo 10, apartado 1, del Reglamento (UE) n.º 648/2012;

c) mecanismos para la debida renovación por la contraparte no financiera de su LEI de conformidad con las condiciones de cualquiera de las unidades operativas locales acreditadas del sistema mundial de LEI;

d) mecanismos para que la contraparte no financiera notifique oportunamente a la contraparte financiera su decisión de iniciar la notificación de los datos de los contratos de derivados extrabursátiles celebrados con la contraparte financiera o dejar de notificarlos. Dichos mecanismos garantizarán, como mínimo, que la notificación se efectúe por escrito o por otros medios electrónicos equivalentes al menos diez días hábiles antes de la fecha en que la contraparte no financiera desee iniciar o interrumpir la notificación.

3. Las contrapartes, las entidades responsables de la notificación y las entidades que remiten la notificación, según proceda, dispondrán de mecanismos que garanticen que se tiene en cuenta la información sobre los fallos en la conciliación facilitada de conformidad con el artículo 3 del Reglamento Delegado (UE) 2022/1858.

▼C2

Artículo 10

Fecha límite en que se deberán notificar los contratos de derivados

Una contraparte de un derivado que el 29 de abril de 2024 cumpla las condiciones establecidas en el artículo 2, apartado 2, letras a) o b), o la entidad responsable de la notificación, notificará todos los datos de ese derivado requeridos de conformidad con el anexo remitiendo una notificación con el tipo de evento «Actualización» en un plazo de ciento ochenta días naturales a partir del 29 de abril de 2024, a menos que haya presentado una notificación con el tipo de acción «Modificación» o «Corrección» de dicho derivado dentro de ese período.

▼B

Artículo 11

Derogación

Queda derogado el Reglamento de Ejecución (UE) n.º 1247/2012.

Las referencias al Reglamento derogado se entenderán hechas al presente Reglamento.

Artículo 12

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 abril 2024.

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

▼B

ANEXO

Cuadro 1

	Sección	Campo	Formato
1	Partes en el derivado	Marca de tiempo de la notificación	Fecha ISO 8601 en el formato del tiempo universal coordinado (UTC) AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ
2	Partes en el derivado	Identificación de la entidad que remite la notificación	Identificador de entidad jurídica (LEI) según la norma ISO 17442, código de 20 caracteres alfanuméricos que se incluye en los datos del LEI publicados por la Fundación del Sistema Mundial de Identificación de Entidad Jurídica.
3	Partes en el derivado	Entidad responsable de la notificación	Identificador de entidad jurídica (LEI) según la norma ISO 17442, código de 20 caracteres alfanuméricos que se incluye en los datos del LEI publicados por la Fundación del Sistema Mundial de Identificación de Entidad Jurídica. El LEI deberá renovarse debidamente de conformidad con las condiciones de cualquiera de las unidades operativas locales acreditadas del sistema mundial de identificación de entidad jurídica.
4	Partes en el derivado	Contraparte 1 (contraparte notificante)	Identificador de entidad jurídica (LEI) según la norma ISO 17442, código de 20 caracteres alfanuméricos que se incluye en los datos del LEI publicados por la Fundación del Sistema Mundial de Identificación de Entidad Jurídica. El LEI deberá renovarse debidamente de conformidad con las condiciones de cualquiera de las unidades operativas locales acreditadas del sistema mundial de identificación de entidad jurídica.
5	Partes en el derivado	Naturaleza de la contraparte 1	F = Contraparte financiera N = Contraparte no financiera C = Entidad de contrapartida central O = Otro
6	Partes en el derivado	Sector empresarial de la contraparte 1	Taxonomía de las contrapartes financieras: «INVF» = Empresa de servicios de inversión autorizada de conformidad con la Directiva 2014/65/UE del Parlamento Europeo y del Consejo ([1]); «CDTI» = Entidad de crédito autorizada de conformidad con la Directiva 2013/36/UE del Parlamento Europeo y del Consejo ([2]); «INUN» = Empresa de seguros o de reaseguros autorizada de conformidad con la Directiva 2009/138/CE del Parlamento Europeo y del Consejo ([3]); «UCIT» = Organismo de inversión colectiva en valores mobiliarios (OICVM) y, si ha lugar, su sociedad de gestión, autorizados de conformidad con la Directiva 2009/65/CE del Parlamento Europeo y del Consejo ([4]), salvo si el OCIVM se ha establecido exclusivamente a efectos de dar servicio a uno o más planes de adquisición de acciones para empleados; «ORPI» = Fondo de pensiones de empleo (FPE) con arreglo a la definición del artículo 6, punto 1, de la Directiva (UE) 2016/2341 del Parlamento Europeo y del Consejo ([5]);

▼B

	Sección	Campo	Formato
			«AIFD» = Fondo de inversión alternativo (FIA), tal como se define en el artículo 4, apartado 1, letra a), de la Directiva 2011/61/UE del Parlamento Europeo y del Consejo ([6]), con sede en la Unión o gestionado por un gestor de fondos de inversión alternativos (GFIA) autorizado o registrado de conformidad con dicha Directiva, salvo si el FIA se ha establecido exclusivamente con el fin de dar servicio a uno o más planes de adquisición de acciones para empleados, salvo que ese FIA sea un vehículo de finalidad especial de titulización a efectos de lo dispuesto en el artículo 2, apartado 3, letra g), de la Directiva 2011/61/UE y, cuando proceda, su GFIA establecido en la Unión; «CSDS» = Depositario central de valores autorizado de conformidad con el Reglamento (UE) n.º 909/2014 del Parlamento Europeo y del Consejo ([7]); Taxonomía de las contrapartes no financieras. Las siguientes categorías corresponden a las principales secciones de la NACE tal como se definen en el Reglamento (CE) n.º 1893/2006 del Parlamento Europeo y del Consejo ([8]): «A» = Agricultura, silvicultura y pesca; «B» = Industrias extractivas; «C» = Industria manufacturera; «D» = Suministro de energía eléctrica, gas, vapor y aire acondicionado; «E» = Suministro de agua, actividades de saneamiento, gestión de residuos y descontaminación; «F» = Construcción; «G» = Comercio al por mayor y al por menor; reparación de vehículos de motor y motocicletas; «H» = Transporte y almacenamiento; «I» = Hostelería; «J» = Información y comunicaciones; «K» = Actividades financieras y de seguros; «L» = Actividades inmobiliarias; «M» = Actividades profesionales, científicas y técnicas; «N» = Actividades administrativas y servicios auxiliares; «O» = Administración Pública y defensa; seguridad social obligatoria; «P» = Educación; «Q» = Actividades sanitarias y servicios sociales; «R» = Actividades artísticas, recreativas y de entretenimiento; «S» = Otros servicios;

▼B

	Sección	Campo	Formato
			«T» = Actividades de los hogares como empleadores de personal doméstico; actividades de los hogares como productores de bienes y servicios para uso propio; «U» = Actividades de organizaciones y organismos extraterritoriales. Cuando se notifique más de una actividad, los códigos se enumerarán siguiendo el orden de importancia relativa de las actividades correspondientes. Se dejará en blanco en el caso de las ECC y otro tipo de contrapartes conforme al artículo 1, apartado 5, del Reglamento (UE) n.º 648/2012 (9).
7	Partes en el derivado	Umbral de compensación de la contraparte 1	Valor booleano: ►C3 TRUE ◄ = por encima del umbral ►C3 FALSE ◄ = por debajo del umbral
8	Partes en el derivado	Tipo de identificador de la contraparte 2	Valor booleano: — ►C3 TRUE ◄ — ►C3 FALSE ◄, para las personas físicas que actúan como particulares que no pueden optar a un LEI según la declaración del Comité de Vigilancia Reglamentaria sobre las personas que actúan en capacidad empresarial, a partir del 20 de septiembre de 2015 (en lo sucesivo, «declaración del CVR»).
9	Partes en el derivado	Contraparte 2	— Identificador de entidad jurídica (LEI) según la norma ISO 17442, código de 20 caracteres alfanuméricos que se incluye en los datos del LEI publicados por la Fundación del Sistema Mundial de Identificación de Entidad Jurídica o código de hasta 72 caracteres alfanuméricos para las personas físicas que actúan como particulares y que no pueden optar a un LEI según la declaración del CVR. El código de identificación de una persona física estará compuesto por el LEI de la contraparte 1, seguido de un identificador único asignado y mantenido de forma coherente por la contraparte 1 para esa persona o personas físicas a efectos de información reglamentaria.
10	Partes en el derivado	País de la contraparte 2	Código de país ISO 3166 - código de país de 2 caracteres
11	Partes en el derivado	Naturaleza de la contraparte 2	F = Contraparte financiera N = Contraparte no financiera C = Entidad de contrapartida central O = Otro

▼B

	Sección	Campo	Formato
12	Partes en el derivado	Sector empresarial de la contraparte 2	Taxonomía de las contrapartes financieras: «INVF» = Empresa de servicios de inversión autorizada de conformidad con la Directiva 2014/65/UE; «CDTI» = Entidad de crédito autorizada de conformidad con la Directiva 2013/36/UE; «INUN» = Empresa de seguros o de reaseguros autorizada de conformidad con la Directiva 2009/138/CE; «UCIT» = Organismo de inversión colectiva en valores mobiliarios (OICVM) y, si ha lugar, su sociedad de gestión, autorizados de conformidad con la Directiva 2009/65/CE, salvo si el OCIVM se ha establecido exclusivamente a efectos de dar servicio a uno o más planes de adquisición de acciones para empleados; «ORPI» = Fondo de pensiones de empleo (FPE) con arreglo a la definición del artículo 6, punto 1, de la Directiva (UE) 2016/2341; «AIFD» = Fondo de inversión alternativo (FIA), tal como se define en el artículo 4, apartado 1, letra a), de la Directiva 2011/61/UE, con sede en la Unión o gestionado por un gestor de fondos de inversión alternativos (GFIA) autorizado o registrado de conformidad con dicha Directiva, salvo si el FIA se ha establecido exclusivamente con el fin de dar servicio a uno o más planes de adquisición de acciones para empleados, salvo que ese FIA sea un vehículo de finalidad especial de titulización a efectos de lo dispuesto en el artículo 2, apartado 3, letra g), de la Directiva 2011/61/UE y, cuando proceda, su GFIA establecido en la Unión; «CSDS» = Depositario central de valores autorizado de conformidad con el Reglamento (UE) n.º 909/2014; Taxonomía de las contrapartes no financieras. Las siguientes categorías corresponden a las principales secciones de la NACE tal como se definen en el Reglamento (CE) n.º 1893/2006: «A» = Agricultura, silvicultura y pesca; «B» = Industrias extractivas; «C» = Industria manufacturera; «D» = Suministro de energía eléctrica, gas, vapor y aire acondicionado; «E» = Suministro de agua, actividades de saneamiento, gestión de residuos y descontaminación; «F» = Construcción; «G» = Comercio al por mayor y al por menor; reparación de vehículos de motor y motocicletas; «H» = Transporte y almacenamiento; «I» = Hostelería; «J» = Información y comunicaciones; «K» = Actividades financieras y de seguros;

▼B

	Sección	Campo	Formato
			«L» = Actividades inmobiliarias; «M» = Actividades profesionales, científicas y técnicas; «N» = Actividades administrativas y servicios auxiliares; «O» = Administración Pública y defensa; seguridad social obligatoria; «P» = Educación; «Q» = Actividades sanitarias y servicios sociales; «R» = Actividades artísticas, recreativas y de entretenimiento; «S» = Otros servicios; «T» = Actividades de los hogares como empleadores de personal doméstico; actividades de los hogares como productores de bienes y servicios para uso propio; «U» = Actividades de organizaciones y organismos extraterritoriales. Cuando se notifique más de una actividad, los códigos se enumerarán siguiendo el orden de importancia relativa de las actividades correspondientes. Se dejará en blanco en el caso de las ECC y otro tipo de contrapartes conforme al artículo 1, apartado 5, del Reglamento (UE) n.º 648/2012.
13	Partes en el derivado	Umbral de compensación de la contraparte 2	Valor booleano: ►C3 TRUE ◄ = por encima del umbral ►C3 FALSE ◄ = por debajo del umbral
14	Partes en el derivado	Obligación de notificación de la contraparte 2	Valor booleano: — ►C3 TRUE ◄, si la contraparte 2 tiene la obligación de notificación — ►C3 FALSE ◄, si la contraparte 2 no tiene la obligación de notificación
15	Partes en el derivado	Identificación del agente intermediario	Identificador de entidad jurídica (LEI) ISO 17442, código de 20 caracteres alfanuméricos que se incluye en los datos del LEI publicados por la Fundación del Sistema Mundial de Identificación de Entidad Jurídica.
16	Partes en el derivado	Miembro compensador	Identificador de entidad jurídica (LEI) ISO 17442, código de 20 caracteres alfanuméricos que se incluye en los datos del LEI publicados por la Fundación del Sistema Mundial de Identificación de Entidad Jurídica (GLEIF, por sus siglas en inglés).
17	Partes en el derivado	Dirección	4 caracteres alfabéticos: BYER = comprador SLLR = vendedor Cumplimentada de conformidad con el artículo 4 del presente Reglamento

▼B

	Sección	Campo	Formato
18	Partes en el derivado	Dirección del componente 1	4 caracteres alfabéticos: MAKE = pagador TAKE = receptor Cumplimentada de conformidad con el artículo 4 del presente Reglamento
19	Partes en el derivado	Dirección del componente 2	4 caracteres alfabéticos: MAKE = pagador TAKE = receptor Cumplimentada de conformidad con el artículo 4 del presente Reglamento
20	Partes en el derivado	Vinculación directa con actividad comercial o financiación de tesorería	Valor booleano: ►C3 TRUE ◄ = Sí ►C3 FALSE ◄ = No

([1]) Directiva 2014/65/UE del Parlamento Europeo y del Consejo, de 15 de mayo de 2014, relativa a los mercados de instrumentos financieros y por la que se modifican la Directiva 2002/92/CE y la Directiva 2011/61/UE (DO L 173 de 12.6.2014, p. 349).
([2]) Directiva 2013/36/UE del Parlamento Europeo y del Consejo, de 26 de junio de 2013, relativa al acceso a la actividad de las entidades de crédito y a la supervisión prudencial de las entidades de crédito y las empresas de inversión, por la que se modifica la Directiva 2002/87/CE y se derogan las Directivas 2006/48/CE y 2006/49/CE (DO L 176 de 27.6.2013, p. 338).
([3]) Directiva 2009/138/CE del Parlamento Europeo y del Consejo, de 25 de noviembre de 2009, sobre el acceso a la actividad de seguro y de reaseguro y su ejercicio (Solvencia II) (DO L 335 de 17.12.2009, p. 1).
([4]) Directiva 2009/65/CE del Parlamento Europeo y del Consejo, de 13 de julio de 2009, por la que se coordinan las disposiciones legales, reglamentarias y administrativas sobre determinados organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios (OICVM) (DO L 302 de 17.11.2009, p. 32).
([5]) Directiva (UE) 2016/2341 del Parlamento Europeo y del Consejo, de 14 de diciembre de 2016, relativa a las actividades y la supervisión de los fondos de pensiones de empleo (FPE) (DO L 354 de 23.12.2016, p. 37).
([6]) Directiva 2011/61/UE del Parlamento Europeo y del Consejo, de 8 de junio de 2011, relativa a los gestores de fondos de inversión alternativos y por la que se modifican las Directivas 2003/41/CE y 2009/65/CE y los Reglamentos (CE) n.º 1060/2009 y (UE) n.º 1095/2010 (DO L 174 de 1.7.2011, p. 1).
([7]) Reglamento (UE) n.º 909/2014 del Parlamento Europeo y del Consejo, de 23 de julio de 2014, sobre la mejora de la liquidación de valores en la Unión Europea y los depositarios centrales de valores y por el que se modifican las Directivas 98/26/CE y 2014/65/UE y el Reglamento (UE) n.º 236/2012 (DO L 257 de 28.8.2014, p. 1).
([8]) Reglamento (CE) n.º 1893/2006 del Parlamento Europeo y del Consejo, de 20 de diciembre de 2006, por el que se establece la nomenclatura estadística de actividades económicas NACE Revisión 2 y por el que se modifica el Reglamento (CEE) n.º 3037/90 del Consejo y determinados Reglamentos de la CE sobre aspectos estadísticos específicos (DO L 393 de 30.12.2006, p. 1).
([9]) 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).

Cuadro 2

	Sección	Campo	Formato
1	Sección 2a — Identificadores y vínculos	UTI	UTI según la norma ISO 23897. Hasta 52 caracteres alfanuméricos, solo se permiten los caracteres alfabéticos en mayúscula A-Z y los dígitos 0-9.
2	Sección 2a — Identificadores y vínculos	Número de seguimiento de la notificación	Campo alfanumérico de un máximo de 52 caracteres
3	Sección 2a — Identificadores y vínculos	UTI anterior (para relaciones uno a uno y uno a varios entre transacciones)	Hasta 52 caracteres alfanuméricos, solo se permiten los caracteres alfabéticos en mayúscula A-Z y los dígitos 0-9.

▼B

	Sección	Campo	Formato
4	Sección 2a — Identificadores y vínculos	UTI de la posición posterior	Hasta 52 caracteres alfanuméricos, solo se permiten los caracteres alfabéticos en mayúscula A-Z y los dígitos 0-9.
5	Sección 2a — Identificadores y vínculos	Identificación de la reducción del riesgo posnegociación	Hasta 52 caracteres alfanuméricos, solo se permiten los caracteres alfabéticos en mayúscula A-Z y los dígitos 0-9. Los primeros 20 caracteres representan el LEI del proveedor de compresión
6	Sección 2a — Identificadores y vínculos	Identificador del paquete	Máximo de 35 caracteres alfanuméricos
7	Sección 2b – Información sobre los contratos	Número internacional de identificación de valores mobiliarios (ISIN)	Código ISIN de 12 caracteres alfanuméricos según la norma ISO 6166
8	Sección 2b – Información sobre los contratos	Identificador único del producto (UPI)	Código UPI de 12 caracteres alfanuméricos según la norma ISO 4914
9	Sección 2b – Información sobre los contratos	Clasificación del producto	Código CFI de 6 caracteres alfabéticos según la norma ISO 10962
10	Sección 2b – Información sobre los contratos	Tipo de contrato	CFDS = Contratos financieros por diferencias FRAS = Contratos a plazo sobre tipos de interés FUTR = Futuros FORW = Contratos a plazo OPTN = Opciones SPDB = Apuestas por diferencias SWAP = Permutas financieras SWPT = Opciones sobre permutas financieras OTHR = Otros
11	Sección 2b – Información sobre los contratos	Clase de activo	COMM = Materias primas y derechos de emisión CRDT = Crédito CURR = Divisas EQUI = Acciones INTR = Tipos de interés
12	Sección 2b – Información sobre los contratos	Derivados basados en criptoactivos	Valor booleano: — ►C3 TRUE ◄ — para los derivados basados en criptoactivos — ►C3 FALSE ◄ — para otros derivados
13	Sección 2b – Información sobre los contratos	Tipo de identificación del subyacente	1 carácter alfabético I = ISIN B = Cesta X = Índice

▼B

	Sección	Campo	Formato
14	Sección 2b – Información sobre los contratos	Identificación del subyacente	En el caso de identificación del subyacente de tipo I: Código ISIN de 12 caracteres alfanuméricos según la norma ISO 6166 En el caso de identificación del subyacente de tipo X: Código ISIN de 12 caracteres alfanuméricos según la norma ISO 6166, si se dispone de él
15	Sección 2b – Información sobre los contratos	Indicación del índice subyacente	Indicación del índice del tipo variable 4 caracteres alfabéticos: ESTR = €STR SONA = SONIA SOFR = SOFR EONA = EONIA EONS = EONIA SWAP EURI = EURIBOR EUUS = EURODOLLAR EUCH = EuroSwiss GCFR = GCF REPO ISDA = ISDAFIX LIBI = LIBID LIBO = LIBOR MAAA = Muni AAA PFAN = Pfandbriefe TIBO = TIBOR STBO = STIBOR BBSW = BBSW JIBA = JIBAR BUBO = BUBOR CDOR = CDOR CIBO = CIBOR MOSP = MOSPRIM NIBO = NIBOR PRBO = PRIBOR TLBO = TELBOR WIBO = WIBOR TREA = Tesoro SWAP = Permuta financiera FUSW = Permuta financiera a plazo EFFR = Tipo efectivo de los fondos federales OBFR = Tipo de financiación bancaria a un día CZNA = CZEONIA
16	Sección 2b – Información sobre los contratos	Nombre del índice subyacente	Máximo de 50 caracteres alfanuméricos Se permiten caracteres especiales si forman parte del nombre completo del índice.

▼B

	Sección	Campo	Formato
17	Sección 2b – Información sobre los contratos	Código de cesta personalizada	Hasta 72 caracteres alfanuméricos compuestos por el LEI del estructurador de la cesta, seguidos de un máximo de 52 caracteres alfanuméricos.
18	Sección 2b – Información sobre los contratos	Identificador de los componentes de la cesta	En el caso de identificación del subyacente de tipo B: Todos los componentes individuales identificados mediante el código ISIN según la norma ISO 6166
19	Sección 2b – Información sobre los contratos	Moneda de liquidación 1	Código de moneda ISO 4217 de 3 caracteres alfabéticos
20	Sección 2b – Información sobre los contratos	Moneda de liquidación 2	Código de moneda ISO 4217 de 3 caracteres alfabéticos
21	Sección 2c – Valoración	Importe de valoración	Valor positivo y negativo de hasta 25 caracteres numéricos, incluido hasta 5 decimales. Si el valor tiene más de 5 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto. El signo menos, de figurar, no contará como dígito
22	Sección 2c – Valoración	Moneda de valoración	Código de moneda ISO 4217 de 3 caracteres alfabéticos
23	Sección 2c – Valoración	Marca de tiempo de la valoración	Fecha ISO 8601 en el formato de hora UTC AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ
24	Sección 2c – valoración	Método de valoración	4 caracteres alfabéticos: MTMA = A precios de mercado MTMO = Según modelo CCPV = Valoración de la ECC
25	Sección 2c – Valoración	Delta	Hasta 25 caracteres numéricos incluidos hasta 5 decimales. Si el valor tiene más de 5 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto. Se permite cualquier valor entre -1 y 1 (incluidos -1 y 1).
26	Sección 2d - Garantías reales	Indicador de la cartera de garantías reales	Valor booleano: ►C3 TRUE ◄ = con garantías reales por cartera ►C3 FALSE ◄ = no forma parte de una cartera
27	Sección 2d - Garantías reales	Código de la cartera de garantías reales	Hasta 52 caracteres alfanuméricos No se permiten caracteres especiales
28	Sección 2e – Reducción del riesgo / Notificación	Marca de tiempo de la confirmación	Fecha ISO 8601 en el formato de hora UTC AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ

▼B

	Sección	Campo	Formato
29	Sección 2e – Reducción del riesgo / Notificación	Confirmado	4 caracteres alfabéticos: — no confirmado = NCNF — electrónico = ECNF — no electrónico = YCNF
30	Sección 2f – Compensación	Obligación de compensación	►C3 TRUE ◄ = el contrato pertenece a una categoría de derivados extrabursátiles que ha sido declarada sujeta a la obligación de compensación y ambas contrapartes del contrato están sujetas a la obligación de compensación ►C3 FALSE ◄ = el contrato pertenece a una categoría de derivados extrabursátiles que ha sido declarada sujeta a la obligación de compensación, pero una o ambas contrapartes del contrato no están sujetas a la obligación de compensación o valor «UKWN»: el contrato no pertenece a una categoría de derivados extrabursátiles que haya sido declarada sujeta a la obligación de compensación
31	Sección 2f – Compensación	Compensado	1 carácter alfabético Y = sí, compensado centralmente, para las transacciones beta y gamma. N = no, no compensado de forma centralizada.
32	Sección 2f – Compensación	Marca de tiempo de la compensación	Fecha ISO 8601 en el formato de hora UTC AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ
33	Sección 2f – Compensación	Entidades de contrapartida central	Identificador de entidad jurídica (LEI) según la norma ISO 17442, código de 20 caracteres alfanuméricos que se incluye en los datos del LEI publicados por la Fundación del Sistema Mundial de Identificación de Entidad Jurídica.
34	Sección 2g – Detalles de la operación	Tipo de acuerdo marco	4 caracteres alfabéticos: «ISDA» = ISDA «CDEA» = Acuerdo de ejecución de derivados compensados FIA-ISDA «EUMA» = Acuerdo Marco Europeo «FPCA» = Acuerdo profesional FOA con el cliente «FMAT» = Acuerdo Marco FBF relativo a las operaciones con instrumentos financieros a plazo «DERV» = Deutscher Rahmenvertrag für Finanztermingeschäfte (DRV) «CMOP» = Contrato Marco de Operaciones Financieras «CHMA» = Acuerdo Marco Suizo «IDMA» = Acuerdo Marco Derivativo Islámico «EFMA» = Acuerdo Marco EFET

▼B

	Sección	Campo	Formato
			«GMRA» = GMRA «GMSL» = GMSLA «BIAG» = acuerdo bilateral O «OTHR» si el tipo de acuerdo marco no está incluido en esta lista anterior
35	Sección 2g – Detalles de la operación	Otro tipo de acuerdo marco	Máximo de 50 caracteres alfanuméricos
36	Sección 2g – Detalles de la operación	Versión del acuerdo marco	Fecha ISO 8601 en el formato AAAA
37	Sección 2g – Detalles de la operación	Intragrupo	Valor booleano: ►C3 TRUE ◄ = contrato celebrado como operación intragrupo ►C3 FALSE ◄ = contrato no celebrado como operación intragrupo
38	Sección 2g – Detalles de la operación	RRPN	Valor booleano: ►C3 TRUE ◄ = el contrato es el resultado de un incidente RRPN ►C3 FALSE ◄ = el contrato no es el resultado de un incidente RRPN
39	Sección 2g – Detalles de la operación	Tipo de técnica RRPN	4 caracteres alfabéticos: «PWOS» = Compresión de cartera sin un proveedor de servicios tercero «PWAS» = Compresión de cartera con un proveedor tercero de servicios o ECC «PRBM» = Reequilibrado de la cartera/gestión del margen OTHR = Otro
40	Sección 2g – Detalles de la operación	Proveedor de servicios de RRPN	Identificador de entidad jurídica (LEI) ISO 17442, código de 20 caracteres alfanuméricos que se incluye en los datos del LEI publicados por la Fundación del Sistema Mundial de Identificación de Entidad Jurídica.
41	Sección 2g – Detalles de la operación	Centro de ejecución	Código de identificación del mercado (MIC) según la norma ISO 10383, 4 caracteres alfanuméricos
42	Sección 2c – Detalles de la operación	Marca de tiempo de la ejecución	Fecha ISO 8601 en el formato de hora UTC AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ
43	Sección 2c – Detalles de la operación	Fecha efectiva	Fecha ISO 8601 en el formato UTC AAAA-MM-DD.
44	Sección 2c – Detalles de la operación	Fecha de expiración	Fecha ISO 8601 en el formato UTC AAAA-MM-DD.

▼B

	Sección	Campo	Formato
45	Sección 2c – Detalles de la operación	Fecha de terminación anticipada	Fecha ISO 8601 en el formato UTC AAAA-MM-DD.
46	Sección 2c – Detalles de la operación	Fecha límite de liquidación contractual	Fecha ISO 8601 en el formato UTC AAAA-MM-DD.
47	Sección 2c – Detalles de la operación	Tipo de entrega	4 caracteres alfabéticos: CASH = Efectivo PHYS = Física OPTL = Opcional para la contraparte o determinada por un tercero
48	Sección 2g – Detalles de la operación	Precio	— Si el precio se expresa como valor monetario, cualquier valor de hasta 18 caracteres numéricos, incluidos hasta 13 decimales. Si el valor tiene más de 13 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. — Si el precio se expresa como porcentaje, cualquier valor de hasta 11 caracteres numéricos, incluidos hasta 10 decimales, expresado como porcentaje (por ejemplo, 2,57 en lugar del 2,57 %). Si el valor tiene más de 10 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto. El signo menos, de figurar, no contará como dígito
49	Sección 2g – Detalles de la operación	Moneda del precio	Código de moneda ISO 4217 de 3 caracteres alfabéticos
	Los campos 50-52 son repetibles y deberán cumplimentarse en el caso de los derivados que incluyan tablas de precios		
50	Sección 2g – Detalles de la operación	Fecha efectiva del precio no ajustada	Fecha ISO 8601 en el formato UTC AAAA-MM-DD.
51	Sección 2g – Detalles de la operación	Fecha de vencimiento del precio no ajustada	Fecha ISO 8601 en el formato UTC AAAA-MM-DD.
52	Sección 2g – Detalles de la operación	Precio en vigor entre la fecha efectiva no ajustada y la fecha de vencimiento	— Si el precio se expresa como valor monetario, cualquier valor de hasta 18 caracteres numéricos, incluidos hasta 13 decimales. Si el valor tiene más de 13 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba.

▼B

	Sección	Campo	Formato
			— Si el precio se expresa como porcentaje, cualquier valor de hasta 11 caracteres numéricos, incluido hasta 10 decimales, expresado como porcentaje (por ejemplo, 2,57 en lugar del 2,57 %). Si el valor tiene más de 10 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto. El signo menos, de figurar, no contará como dígito
53	Sección 2g – Detalles de la operación	Precio de las operaciones combinadas	— Si el precio de una operación combinada se expresa como valor monetario, cualquier valor de hasta 18 caracteres numéricos, incluidos hasta 13 decimales. Si el valor tiene más de 13 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. — Si el precio de una operación combinada se expresa como porcentaje, cualquier valor de hasta 11 caracteres numéricos, incluido hasta 10 decimales, expresado como porcentaje (por ejemplo, 2,57 en lugar del 2,57 %). Si el valor tiene más de 10 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto. El signo menos, de figurar, no contará como dígito
54	Sección 2g – Detalles de la operación	Moneda del precio de las operaciones combinadas	Código de moneda ISO 4217 de 3 caracteres alfabéticos
55	Sección 2g – Detalles de la operación	Importe nocional del componente 1	Cualquier valor superior o igual a cero hasta 25 caracteres numéricos, incluido hasta 5 decimales. Si el valor tiene más de 5 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto.
56	Sección 2g – Detalles de la operación	Moneda nocional 1	Código de moneda ISO 4217 de 3 caracteres alfabéticos
	Los campos 57-59 son repetibles y deberán cumplimentarse en el caso de los derivados que incluyan tablas de importes nocionales		

▼B

	Sección	Campo	Formato
57	Sección 2g – Detalles de la operación	Fecha efectiva del importe nocional del componente 1	Fecha ISO 8601 en el formato UTC AAAA-MM-DD.
58	Sección 2g – Detalles de la operación	Fecha de vencimiento del importe nocional del componente 1	Fecha ISO 8601 en el formato UTC AAAA-MM-DD.
59	Sección 2g – Detalles de la operación	Importe nocional en vigor en la fecha de entrada efectiva asociada del componente 1	Cualquier valor superior o igual a cero hasta 25 caracteres numéricos, incluidos hasta 5 decimales. Si el valor tiene más de 5 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto.
60	Sección 2g – Detalles de la operación	Cantidad nocional total del componente 1	Cualquier valor superior o igual a cero hasta 25 caracteres numéricos, incluido hasta 5 decimales. Si el valor tiene más de 5 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto.
	Los campos 61-63 son repetibles y deberán cumplimentarse en el caso de los derivados que incluyan tablas de cantidades nocionales		
61	Sección 2g – Detalles de la operación	Fecha efectiva de la cantidad nocional del componente 1	Fecha ISO 8601 en el formato UTC AAAA-MM-DD.
62	Sección 2g – Detalles de la operación	Fecha de vencimiento de la cantidad nocional del componente 1	Fecha ISO 8601 en el formato UTC AAAA-MM-DD.
63	Sección 2g – Detalles de la operación	Cantidad nocional en vigor en la fecha de entrada efectiva asociada del componente 1	Cualquier valor superior o igual a cero hasta 25 caracteres numéricos, incluidos hasta 5 decimales. Si el valor tiene más de 5 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto.

▼B

	Sección	Campo	Formato
64	Sección 2g – Detalles de la operación	Importe nocional del componente 2	Cualquier valor superior o igual a cero hasta 25 caracteres numéricos, incluidos hasta 5 decimales. Si el valor tiene más de 5 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto.
65	Sección 2g – Detalles de la operación	Moneda nocional 2	Código de moneda ISO 4217 de 3 caracteres alfabéticos
	Los campos 66-68 son repetibles y deberán cumplimentarse en el caso de los derivados que incluyan tablas de importes nocionales		
66	Sección 2g – Detalles de la operación	Fecha efectiva del importe nocional del componente 2	Fecha ISO 8601 en el formato UTC AAAA-MM-DD.
67	Sección 2g – Detalles de la operación	Fecha de vencimiento del importe nocional del componente 2	Fecha ISO 8601 en el formato UTC AAAA-MM-DD.
68	Sección 2g – Detalles de la operación	Importe nocional en vigor en la fecha de entrada efectiva asociada del componente 2	Cualquier valor superior o igual a cero hasta 25 caracteres numéricos, incluidos hasta 5 decimales. Si el valor tiene más de 5 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto.
69	Sección 2g – Detalles de la operación	Cantidad nocional total del componente 2	Cualquier valor superior o igual a cero hasta 25 caracteres numéricos, incluidos hasta 5 decimales. Si el valor tiene más de 5 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto.
	Los campos 70-72 son repetibles y deberán cumplimentarse en el caso de los derivados que incluyan tablas de cantidades nocionales		

▼B

	Sección	Campo	Formato
70	Sección 2g – Detalles de la operación	Fecha efectiva de la cantidad nocional del componente 2	Fecha ISO 8601 en el formato UTC AAAA-MM-DD.
71	Sección 2g – Detalles de la operación	Fecha de vencimiento de la cantidad nocional del componente 2	Fecha ISO 8601 en el formato UTC AAAA-MM-DD.
72	Sección 2g – Detalles de la operación	Cantidad nocional en vigor en la fecha de entrada efectiva asociada del componente 2	Cualquier valor superior o igual a cero hasta 25 caracteres numéricos, incluidos hasta 5 decimales. Si el valor tiene más de 5 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto.
	La sección de los campos 73 a 78 es repetible		
73	Sección 2g – Detalles de la operación	Otro tipo de pago	4 caracteres alfabéticos: UFRO = Pago inicial, es decir, el pago efectuado por una de las contrapartes para que una operación se realice al valor razonable o por cualquier otra razón que pueda ser la causa de una operación fuera de mercado UWIN = Liquidación o terminación total, es decir, el pago de la liquidación final efectuado en caso de liquidación de una operación antes de su fecha de vencimiento; Pagos que pueden resultar de la terminación total de una o varias operaciones con derivados PEXH = Intercambio de principal, es decir, intercambio de valores nocionales para permutas entre divisas
74	Sección 2g – Detalles de la operación	Importe de otros pagos	Hasta 25 caracteres numéricos incluidos hasta 5 decimales. Si el valor tiene más de 5 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto. Se permite cualquier valor superior o igual a cero.
75	Sección 2g – Detalles de la operación	Otra moneda de pago	Código de moneda ISO 4217 de 3 caracteres alfabéticos
76	Sección 2g – Detalles de la operación	Otra fecha de pago	Fecha ISO 8601 en el formato UTC AAAA-MM-DD.

▼B

	Sección	Campo	Formato
77	Sección 2g – Detalles de la operación	Pagador de otros pagos	— Identificador de entidad jurídica (LEI) según la norma ISO 17442, código de 20 caracteres alfanuméricos que se incluye en los datos del LEI publicados por la Fundación del Sistema Mundial de Identificación de Entidad Jurídica o código de hasta 72 caracteres alfanuméricos para las personas físicas que actúan como particulares y que no pueden optar a un LEI según la declaración del CVR. El código de identificación de una persona física estará compuesto por el LEI de la contraparte 1, seguido de un identificador único asignado y mantenido de forma coherente por la contraparte 1 para esa persona o personas físicas a efectos de información reglamentaria.
78	Sección 2g – Detalles de la operación	Receptor de otros pagos	— Identificador de entidad jurídica (LEI) ISO 17442, código de 20 caracteres alfanuméricos que se incluye en los datos del LEI publicados por la Fundación del Sistema Mundial de Identificación de Entidad Jurídica o código de hasta 72 caracteres alfanuméricos para las personas físicas que actúan como particulares y que no pueden optar a un LEI según la declaración del CVR. El código de identificación de una persona física estará compuesto por el LEI de la contraparte 1, seguido de un identificador único asignado y mantenido de forma coherente por la contraparte 1 para esa persona o personas físicas a efectos de información reglamentaria.
79	Sección 2h – Tipos de interés	Tipo fijo del componente 1 o cupón	• Valores positivos y negativos, de hasta 11 caracteres numéricos, incluidos hasta 10 decimales, expresados como porcentaje (por ejemplo, 2,57 en lugar del 2,57 %). La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto. El signo menos, de figurar, no contará como dígito
80	Sección 2h – Tipos de interés	Convención sobre el cómputo de días del tipo fijo o cupón del componente 1	4 caracteres alfanuméricos: A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA A009 = Actual365LorActuActubasisRule A010 = ActualActualAFB A011 = IC30360ICMAor30360basicrule

▼B

	Sección	Campo	Formato
			A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 A014 = Actual365NL A015 = ActualActualUltimo A016 = IC30EPlus360 A017 = Actual364 A018 = Business252 A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = Narrativa
81	Sección 2h – Tipos de interés	Periodo de la frecuencia de pago del tipo fijo o cupón del componente 1	4 caracteres alfabéticos: DAIL = diario WEEK = semanal MNTH = mensual YEAR = anual ADHO = *ad hoc* que se aplica cuando los pagos son irregulares EXPI = pago al plazo
82	Sección 2h – Tipos de interés	Multiplicador del periodo de la frecuencia de pago del tipo fijo o cupón del componente 1	Cualquier valor íntegro superior o igual a cero, de hasta 3 caracteres numéricos.
83	Sección 2h – Tipos de interés	Identificador del tipo variable del componente 1	Si el tipo variable tiene un código ISIN, el código ISIN de dicho tipo.
84	Sección 2h – Tipos de interés	Indicador del tipo variable del componente 1	Indicación del índice del tipo variable 4 caracteres alfabéticos: ESTR = €STR SONA = SONIA SOFR = SOFR EONA = EONIA EONS = EONIA SWAP EURI = EURIBOR EUUS = EURODOLLAR EUCH = EuroSwiss GCFR = GCF REPO ISDA = ISDAFIX LIBI = LIBID LIBO = LIBOR MAAA = Muni AAA PFAN = Pfandbriefe

▼B

	Sección	Campo	Formato
			TIBO = TIBOR STBO = STIBOR BBSW = BBSW JIBA = JIBAR BUBO = BUBOR CDOR = CDOR CIBO = CIBOR MOSP = MOSPRIM NIBO = NIBOR PRBO = PRIBOR TLBO = TELBOR WIBO = WIBOR TREA = Tesoro SWAP = Permuta financiera FUSW = Permuta financiera a plazo EFFR = Tipo efectivo de los fondos federales OBFR = Tipo de financiación bancaria a un día CZNA = CZEONIA
85	Sección 2h – Tipos de interés	Nombre del tipo variable del componente 1	Máximo de 50 caracteres alfanuméricos Se permiten caracteres especiales si forman parte del nombre completo del índice.
86	Sección 2h – Tipos de interés	Convención sobre el cómputo de días del tipo variable del componente 1	4 caracteres alfanuméricos: A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA A009 = Actual365LorActuActubasisRule A010 = ActualActualAFB A011 = IC30360ICMAor30360basicrule A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 A014 = Actual365NL A015 = ActualActualUltimo A016 = IC30EPlus360 A017 = Actual364

▼B

	Sección	Campo	Formato
			A018 = Business252 A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = Narrativa
87	Sección 2h – Tipos de interés	Periodo de la frecuencia de pago del tipo variable del componente 1	4 caracteres alfabéticos: DAIL = diario WEEK = semanal MNTH = mensual YEAR = anual ADHO = *ad hoc* que se aplica cuando los pagos son irregulares EXPI = pago al plazo
88	Sección 2h – Tipos de interés	Multiplicador del periodo de la frecuencia de pago del tipo variable del componente 1	Cualquier valor entero superior o igual a cero, de hasta 3 caracteres numéricos.
89	Sección 2h – Tipos de interés	Periodo de referencia del tipo variable del componente 1 — Período de tiempo	4 caracteres alfabéticos: DAIL = diario WEEK = semanal MNTH = mensual YEAR = anual ADHO = *ad hoc* que se aplica cuando los pagos son irregulares EXPI = pago al plazo
90	Sección 2h – Tipos de interés	Periodo de referencia del tipo variable en el componente 1 – Multiplicador	Cualquier valor entero superior o igual a cero, de hasta 3 caracteres numéricos.
91	Sección 2h – Tipos de interés	Periodo de la frecuencia de revisión del tipo variable del componente 1	4 caracteres alfabéticos: DAIL = diario WEEK = semanal MNTH = mensual YEAR = anual ADHO = *ad hoc* que se aplica cuando los pagos son irregulares EXPI = pago al plazo
92	Sección 2h – Tipos de interés	Multiplicador de la frecuencia de revisión del tipo variable del componente 1	Cualquier valor entero superior o igual a cero, de hasta 3 caracteres numéricos.

▼B

	Sección	Campo	Formato
93	Sección 2h – Tipos de interés	Diferencial del componente 1	— Si el diferencial se expresa como importe monetario, cualquier valor de hasta 18 caracteres numéricos, incluidos hasta 13 decimales. — Si el diferencial se expresa como porcentaje, cualquier valor de hasta 11 caracteres numéricos, incluidos hasta 10 decimales, expresado como porcentaje (por ejemplo, 2,57 en lugar del 2,57 %). — Si el diferencial se expresa como puntos básicos, cualquier valor entero de hasta 5 caracteres numéricos expresado en puntos básicos (por ejemplo, 257 en lugar del 2,57 %).
94	Sección 2h – Tipos de interés	Moneda del diferencial del componente 1	Código de moneda ISO 4217 de 3 caracteres alfabéticos
95	Sección 2h – Tipos de interés	Tipo fijo del componente 2	• Valores positivos y negativos, de hasta 11 caracteres numéricos, incluido hasta 10 decimales, expresado como porcentaje (por ejemplo, 2,57 en lugar del 2,57 %). La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto. El signo menos, de figurar, no contará como dígito
96	Sección 2h – Tipos de interés	Convención sobre el cómputo de días del tipo fijo del componente 2	4 caracteres alfanuméricos: A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA A009 = Actual365LorActuActubasisRule A010 = ActualActualAFB A011 = IC30360ICMAor30360basicrule A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 A014 = Actual365NL A015 = ActualActualUltimo A016 = IC30EPlus360 A017 = Actual364 A018 = Business252 A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = Narrativa

▼B

	Sección	Campo	Formato
97	Sección 2h – Tipos de interés	Periodo de la frecuencia de pago del tipo fijo del componente 2	4 caracteres alfabéticos: DAIL = diario WEEK = semanal MNTH = mensual YEAR = anual ADHO = *ad hoc* que se aplica cuando los pagos son irregulares EXPI = pago al plazo
98	Sección 2h – Tipos de interés	Multiplicador del periodo de la frecuencia de pago del tipo fijo del componente 2	Cualquier valor entero superior o igual a cero, de hasta 3 caracteres numéricos.
99	Sección 2h – Tipos de interés	Identificador del tipo variable del componente 2	Si el tipo variable tiene un código ISIN, el código ISIN de dicho tipo.
100	Sección 2h – Tipos de interés	Indicador del tipo variable del componente 2	Indicación del índice del tipo variable 4 caracteres alfabéticos: ESTR = €STR SONA = SONIA SOFR = SOFR EONA = EONIA EONS = EONIA SWAP EURI = EURIBOR EUUS = EURODOLLAR EUCH = EuroSwiss GCFR = GCF REPO ISDA = ISDAFIX LIBI = LIBID LIBO = LIBOR MAAA = Muni AAA PFAN = Pfandbriefe TIBO = TIBOR STBO = STIBOR BBSW = BBSW JIBA = JIBAR BUBO = BUBOR CDOR = CDOR CIBO = CIBOR MOSP = MOSPRIM NIBO = NIBOR PRBO = PRIBOR TLBO = TELBOR

▼B

	Sección	Campo	Formato
			WIBO = WIBOR TREA = Tesoro SWAP = Permuta financiera FUSW = Permuta financiera a plazo EFFR = Tipo efectivo de los fondos federales OBFR = Tipo de financiación bancaria a un día CZNA = CZEONIA
101	Sección 2h – Tipos de interés	Nombre del tipo variable del componente 2	Máximo de 50 caracteres alfanuméricos Se permiten caracteres especiales si forman parte del nombre completo del índice.
102	Sección 2h – Tipos de interés	Convención sobre el cómputo de días del tipo variable del componente 2	4 caracteres alfanuméricos: A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA A009 = Actual365LorActuActubasisRule A010 = ActualActualAFB A011 = IC30360ICMAor30360basicrule A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 A014 = Actual365NL A015 = ActualActualUltimo A016 = IC30EPlus360 A017 = Actual364 A018 = Business252 A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = Narrativa
103	Sección 2h – Tipos de interés	Periodo de la frecuencia de pago del tipo variable del componente 2	4 caracteres alfabéticos: DAIL = diario WEEK = semanal MNTH = mensual YEAR = anual ADHO = *ad hoc* que se aplica cuando los pagos son irregulares EXPI = pago al plazo

▼B

	Sección	Campo	Formato
104	Sección 2h – Tipos de interés	Multiplicador del periodo de la frecuencia de pago del tipo variable del componente 2	Cualquier valor entero superior o igual a cero, de hasta 3 caracteres numéricos.
105	Sección 2h – Tipos de interés	Periodo de referencia del tipo variable del componente 2 — Período de tiempo	4 caracteres alfabéticos: DAIL = diario WEEK = semanal MNTH = mensual YEAR = anual ADHO = *ad hoc* que se aplica cuando los pagos son irregulares EXPI = pago al plazo
106	Sección 2h – Tipos de interés	Periodo de referencia del tipo variable en el componente 2 – Multiplicador	Cualquier valor entero superior o igual a cero, de hasta 3 caracteres numéricos.
107	Sección 2h – Tipos de interés	Periodo de la frecuencia de revisión del tipo variable del componente 2	4 caracteres alfabéticos: DAIL = diario WEEK = semanal MNTH = mensual YEAR = anual ADHO = *ad hoc* que se aplica cuando los pagos son irregulares EXPI = pago al plazo
108	Sección 2h – Tipos de interés	Multiplicador de la frecuencia de revisión del tipo variable del componente 2	Cualquier valor entero superior o igual a cero, de hasta 3 caracteres numéricos.
109	Sección 2h – Tipos de interés	Diferencial del componente 2	— Si el diferencial se expresa como importe monetario, cualquier valor de hasta 18 caracteres numéricos, incluidos hasta 13 decimales. — Si el diferencial se expresa como porcentaje, cualquier valor de hasta 11 caracteres numéricos, incluidos hasta 10 decimales, expresado como porcentaje (por ejemplo, 2,57 en lugar del 2,57 %). — Si el diferencial se expresa como puntos básicos, cualquier valor entero de hasta 5 caracteres numéricos expresado en puntos básicos (por ejemplo, 257 en lugar del 2,57 %).
110	Sección 2h – Tipos de interés	Moneda del diferencial del componente 2	Código de moneda ISO 4217 de 3 caracteres alfabéticos

▼B

	Sección	Campo	Formato
111	Sección 2h – Tipos de interés	Diferencial de operaciones combinadas	— Si el diferencial de una operación combinada se expresa como importe monetario, valor positivo y negativo de hasta 18 caracteres numéricos, incluidos hasta 13 decimales. Si el valor tiene más de 13 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. — Si el diferencial de una operación combinada se expresa como porcentaje, valor positivo y negativo de hasta 11 caracteres numéricos, incluidos hasta 10 decimales, expresado como porcentaje (por ejemplo, 2,57 en lugar del 2,57 %). Si el valor tiene más de 10 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. — Si el diferencial de una operación combinada se expresa como puntos básicos, cualquier valor entero de hasta 5 caracteres numéricos expresado en puntos básicos (por ejemplo, 257 en lugar del 2,57 %). La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto. El signo menos, de figurar, no contará como dígito
112	Sección 2h – Tipos de interés	Moneda del diferencial de operaciones combinadas	Código de moneda ISO 4217 de 3 caracteres alfabéticos
113	Sección 2i – Divisas	Tipo de cambio 1	Cualquier valor superior a cero hasta 18 dígitos numéricos, incluidos hasta 13 decimales. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto.
114	Sección 2i – Divisas	Tipo de cambio a plazo	Cualquier valor superior a cero hasta dieciocho dígitos numéricos, incluidos hasta trece decimales. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto.
115	Sección 2i – Divisas	Base del tipo de cambio	7 caracteres que representan 2 códigos de moneda ISO 4217 separados por «/» sin restringir la compra del par de divisas. El primer código de moneda indicará la unidad monetaria y el segundo código indicará la moneda de cotización.
116	Sección 2j – Materias primas y derechos de emisión (general)	Producto base	Indíquense solo valores que figuren en la columna «Producto base» del cuadro relativo a la clasificación de los derivados sobre materias primas.
117	Sección 2j – Materias primas y derechos de emisión (general)	Subproducto	Indíquense solo valores que figuren en la columna «Subproducto» del cuadro relativo a la clasificación de los derivados sobre materias primas.

▼B

	Sección	Campo	Formato
118	Sección 2j – Materias primas y derechos de emisión (general)	Subproducto ulterior	Indíquense solo valores que figuren en la columna «Subproducto» del cuadro relativo a la clasificación de los derivados sobre materias primas.
119	Sección 2k – Materias primas y derechos de emisión (energía)	Punto o zona de entrega	Código EIC, dieciséis caracteres alfanuméricos Campo repetible.
120	Sección 2k – Materias primas y derechos de emisión (energía)	Punto de interconexión	Código EIC, dieciséis caracteres alfanuméricos
121	Sección 2k – Materias primas y derechos de emisión (energía)	Tipo de carga	BSLD = Carga base PKLD = Carga de punta OFFP = Fuera de punta HABH = Hora/bloque horario SHPD = Shaped GASD = Día de gas OTHR = Otros
	La sección de los campos 122 a 131 es repetible		
122	Sección 2k – Materias primas y derechos de emisión (energía)	Hora de inicio del intervalo de entrega	hh:mm:ssZ
123	Sección 2k – Materias primas y derechos de emisión (energía)	Hora de finalización del intervalo de entrega	hh:mm:ssZ
124	Sección 2k – Materias primas y derechos de emisión (energía)	Fecha de inicio de la entrega	Fecha ISO 8601 en el formato AAAA-MM-DD
125	Sección 2k – Materias primas y derechos de emisión (energía)	Fecha de vencimiento de la entrega	Fecha ISO 8601 en el formato AAAA-MM-DD
126	Sección 2k – Materias primas y derechos de emisión (energía)	Duración	MNUT = Minutos HOUR = Hora DASD = Día WEEK = Semana MNTH = Mes QURT = Trimestre SEAS = Temporada YEAR = Anual OTHR = Otro

▼B

	Sección	Campo	Formato
127	Sección 2k – Materias primas y derechos de emisión (energía)	Días de la semana	WDAY = Días hábiles WEND = Fin de semana MOND = Lunes TUED = Martes WEDD = Miércoles THUD = Jueves FRID = Viernes SATD = Sábado SUND = Domingo XBHL = Excluidos los días festivos IBHL = Incluidos los días festivos Se admiten varios valores
128	Sección 2k – Materias primas y derechos de emisión (energía)	Capacidad de entrega	Máximo de 20 caracteres numéricos, incluidos decimales. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto. El signo menos, de figurar, no contará como dígito
129	Sección 2k – Materias primas y derechos de emisión (energía)	Unidad de cantidad	KWAT = KW KWHH = KWh/h KWHD = KWh/d MWAT = MW MWHH = MWh/h MWHD = MWh/d GWAT = GW GWhh = GWh/h GWHD = GWh/d THMD = Therm/d KTMD = Ktherm/d MTMD = Mtherm/d CMPD = cm/d MCMD = mcm/d BTUD = Btu/d MBTD = MMBtu/d MJDD = MJ/d HMJD = 100MJ/d MMJD = MMJ/d GJDD = GJ/d
130	Sección 2k – Materias primas y derechos de emisión (energía)	Precio/cantidad de intervalo de tiempo	Máximo de 20 caracteres numéricos, incluidos decimales. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto. El signo menos, de figurar, no contará como dígito

▼B

	Sección	Campo	Formato
131	Sección 2k – Materias primas y derechos de emisión (energía)	Moneda del precio/ cantidad de intervalo de tiempo	Código de moneda ISO 4217 de 3 caracteres alfabéticos.
132	Sección 2l - Opciones	Tipo de opción	4 carácter alfabético PUTO = Venta CALL = Compra OTHR = Si no puede determinarse si se trata de una opción de compra o de una opción de venta.
133	Sección 2l - Opciones	Tipo de opción	4 caracteres alfabéticos: AMER = Americano BERM = «Bermudas» EURO = Europeo
134	Sección 2l - Opciones	Precio de ejercicio	— Si el precio de ejercicio se expresa como importe monetario: cualquier valor de hasta 18 caracteres numéricos, incluidos hasta 13 decimales (por ejemplo, 6,39 USD, expresado como 6,39), para opciones sobre acciones, opciones sobre materias primas, opciones sobre divisas y productos similares. Si el valor tiene más de 13 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. — Si el precio de ejercicio se expresa como porcentaje: cualquier valor de hasta 11 caracteres numéricos, incluido hasta 10 decimales, expresado como porcentaje (por ejemplo, 2,1 en lugar del 2,1 %), para las opciones sobre tipos de interés, las opciones sobre permutas financieras de tipos de interés y de crédito cotizadas en el diferencial, y productos similares. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto. El signo menos, de figurar, no contará como dígito
	Los campos 135-137 son repetibles y deberán cumplimentarse en el caso de los derivados que incluyan tablas de precios de ejercicio		
135	Sección 2l - Opciones	Fecha efectiva del precio de ejercicio	Fecha ISO 8601 en el formato UTC AAAA-MM-DD.
136	Sección 2l - Opciones	Fecha de vencimiento del precio de ejercicio	Fecha ISO 8601 en el formato UTC AAAA-MM-DD.

▼B

	Sección	Campo	Formato
137	Sección 2l - Opciones	Precio del ejercicio en vigor en la fecha efectiva asociada	— Si el precio de ejercicio se expresa como importe monetario: cualquier valor de hasta 18 caracteres numéricos, incluidos hasta 13 decimales (por ejemplo, 6,39 USD, expresado como 6,39), para opciones sobre acciones, opciones sobre materias primas, opciones sobre divisas y productos similares. Si el valor tiene más de 13 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. — Si el precio de ejercicio se expresa como porcentaje: cualquier valor de hasta 11 caracteres numéricos, incluidos hasta 10 decimales, expresado como porcentaje (por ejemplo, 2,1 en lugar del 2,1 %), para las opciones sobre tipos de interés, las opciones sobre permutas financieras de tipos de interés y de crédito cotizadas en el diferencial, y productos similares. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto. El signo menos, de figurar, no contará como dígito
138	Sección 2l - Opciones	Moneda/par de divisas del precio de ejercicio	Código de moneda ISO 4217 de 3 caracteres alfabéticos o para las opciones sobre divisas: 7 caracteres que representan 2 códigos de moneda ISO 4217 separados por «/» sin restringir la compra del par de divisas. El primer código de moneda indicará la moneda de base y el segundo código indicará la moneda de cotización.
139	Sección 2l - Opciones	Importe de la prima de la opción	Cualquier valor superior o igual a cero hasta 25 caracteres numéricos, incluidos hasta 5 decimales. Si el valor tiene más de 5 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto.
140	Sección 2l - Opciones	Moneda de la prima de la opción	Código de moneda ISO 4217 de 3 caracteres alfabéticos
141	Sección 2l - Opciones	Fecha de pago de la prima de opción	Fecha ISO 8601 en el formato UTC AAAA-MM-DD.
142	Sección 2i - Opciones	Fecha de vencimiento del subyacente	Fecha ISO 8601 en el formato UTC AAAA-MM-DD.

▼B

	Sección	Campo	Formato
143	Sección 2m — Derivados de crédito	Orden de prelación	4 caracteres alfabéticos: SNDB = senior, tal como la deuda senior no garantizada (empresas/entidades financieras), la deuda soberana en moneda extranjera (administración pública), SBOD = subordinada, tal como la deuda subordinada o de nivel 2 inferior (bancos), la deuda subordinada junior o de nivel 2 superior (bancos), OTHR = otros, tales como las acciones preferentes o el capital de nivel 1 (bancos) u otros derivados de crédito
144	Sección 2m – Derivados de crédito	Entidad de referencia	Código de país ISO 3166 - código de país de 2 caracteres o Código de país ISO 3166-2 de 2 caracteres seguido por un guion «-» y un código de subdivisión de país de un máximo de 3 caracteres alfanuméricos o Identificador de entidad jurídica (LEI) según la norma ISO 17442, código de 20 caracteres alfanuméricos.
145	Sección 2m – Derivados de crédito	Serie	Campo de números enteros de un máximo de 5 caracteres.
146	Sección 2m – Derivados de crédito	Versión	Campo de números enteros de un máximo de 5 caracteres.
147	Sección 2m – Derivados de crédito	Factor de índice	• Cualquier valor de hasta 11 caracteres numéricos, incluidos hasta 10 decimales, expresado como fracción decimal (por ejemplo, 0,05 en lugar del 5 %) entre cero y uno (incluido 0 y 1). La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto.
148	Sección 2m – Derivados de crédito	Tramo	Valor booleano: ►C3 TRUE ◄ = Por tramos ►C3 FALSE ◄ = Sin tramos
149	Sección 2m – Derivados de crédito	Punto de conexión (*attachment point*) del índice de permutas de cobertura por impago («índice CDS»)	• Cualquier valor de hasta 11 caracteres numéricos, incluidos hasta 10 decimales, expresado como fracción decimal (por ejemplo, 0,05 en lugar del 5 %) entre cero y uno (incluido 0 y 1). La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto.
150	Sección 2m – Derivados de crédito	Punto de desconexión (*detachment point*) del índice de permutas de cobertura por impago («índice CDS»)	• Cualquier valor de hasta once caracteres numéricos, incluidos hasta diez decimales, expresado como fracción decimal (por ejemplo, 0,05 en lugar del 5 %) entre cero y uno (incluido 0 y 1). La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto.

▼B

	Sección	Campo	Formato
151	Sección 2n - Modificaciones del derivado	Tipo de acción	4 caracteres alfabéticos: NEWT = Nueva MODI = Modificación CORR = Corrección TERM = Terminación EROR = Error REVI = Reactivación VALU = Valoración PSOC = Componente de posición
152	Sección 2n - Modificaciones del derivado	Tipo de suceso	4 caracteres alfabéticos: TRAD = Operación NOVA = Entrada (*step-in*) COMP = RRPN ETRM = Terminación anticipada CLRG = Compensación EXER = Ejercicio ALOC = Asignación CREV = Suceso de crédito CORP = Acto societario INCP = Inclusión en la posición UPDT = Actualización
153	Sección 2n - Modificaciones del derivado	Fecha del suceso	Fecha ISO 8601 en el formato UTC AAAA-MM-DD.
154	Sección 2n - Modificaciones del derivado	Nivel	4 caracteres alfabéticos: TCTN = Operación PSTN = Posición

Cuadro 3

	Sección	Campo	Formato
1	Partes en el derivado	Marca de tiempo de la notificación	Fecha ISO 8601 en el formato del tiempo universal coordinado (UTC) AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ
2	Partes en el derivado	Identificación de la entidad que remite la notificación	Identificador de entidad jurídica (LEI) según la norma ISO 17442, código de 20 caracteres alfanuméricos que se incluye en los datos del LEI publicados por la Fundación del Sistema Mundial de Identificación de Entidad Jurídica.
3	Partes en el derivado	Entidad responsable de la notificación	Identificador de entidad jurídica (LEI) según la norma ISO 17442, código de 20 caracteres alfanuméricos que se incluye en los datos del LEI publicados por la Fundación del Sistema Mundial de Identificación de Entidad Jurídica. El LEI deberá renovarse debidamente de conformidad con las condiciones de cualquiera de las unidades operativas locales acreditadas del sistema mundial de identificación de entidad jurídica.

▼B

	Sección	Campo	Formato
4	Partes en el derivado	Contraparte 1 (contraparte notificante)	Identificador de entidad jurídica (LEI) según la norma ISO 17442, código de 20 caracteres alfanuméricos que se incluye en los datos del LEI publicados por la Fundación del Sistema Mundial de Identificación de Entidad Jurídica. El LEI deberá renovarse debidamente de conformidad con las condiciones de cualquiera de las unidades operativas locales acreditadas del sistema mundial de identificación de entidad jurídica.
5	Partes en el derivado	Tipo de identificador de la contraparte 2	Valor booleano: — ►C3 TRUE ◄ — ►C3 FALSE ◄, para las personas físicas que actúan como particulares y que no pueden optar a un LEI según la declaración del CVR.
6	Partes en el derivado	Contraparte 2	— Identificador de entidad jurídica (LEI) ISO 17442, código de 20 caracteres alfanuméricos que se incluye en los datos del LEI publicados por la Fundación del Sistema Mundial de Identificación de Entidad Jurídica o código de hasta 72 caracteres alfanuméricos para las personas físicas que actúan como particulares y que no pueden optar a un LEI según la declaración del CVR. El código de identificación de una persona física estará compuesto por el LEI de la contraparte 1, seguido de un identificador único asignado y mantenido de forma coherente por la contraparte 1 para esa persona o personas físicas a efectos de información reglamentaria.
7	Garantías reales	Marca de tiempo de las garantías reales	Fecha ISO 8601 en el formato de hora UTC AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ
8	Garantías reales	Indicador de la cartera de garantías reales	Valor booleano: ►C3 TRUE ◄ = con garantías reales por cartera ►C3 FALSE ◄ = no forma parte de una cartera
9	Garantías reales	Código de la cartera de garantías reales	Hasta 52 caracteres alfanuméricos No se permiten caracteres especiales
10	Garantías reales	UTI	Hasta 52 caracteres alfanuméricos, solo se permiten los caracteres alfabéticos en mayúscula A-Z y los dígitos 0-9.
11	Garantías reales	Categoría de cobertura mediante garantías reales	4 caracteres alfabéticos: UNCL = sin garantía real PRC1 = con garantía real parcial: solo la contraparte 1 PRC2 = con garantía real parcial: solo la contraparte 2 PRCL = con garantía real parcial OWC1 = con garantía real unilateral: solo la contraparte 1

▼B

	Sección	Campo	Formato
			OWC2 = con garantía real unilateral: solo la contraparte 2 OWP1 = con garantía real unilateral/parcial: contraparte 1 OWP2 = con garantía real unilateral/parcial: contraparte 2 FLCL = con garantía real íntegra Cumplimentada de conformidad con el artículo 5 del presente Reglamento
12	Garantías reales	Margen inicial aportado por la contraparte 1 (antes del recorte)	Cualquier valor superior o igual a cero hasta 25 caracteres numéricos, incluido hasta 5 decimales. Si el valor tiene más de 5 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto.
13	Garantías reales	Margen inicial aportado por la contraparte 1 (después del recorte)	Cualquier valor superior o igual a cero hasta 25 caracteres numéricos, incluidos hasta 5 decimales. Si el valor tiene más de 5 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto.
14	Garantías reales	Moneda del margen inicial aportado	Código de moneda ISO 4217 de 3 caracteres alfabéticos
15	Garantías reales	Margen de variación aportado por la contraparte 1 (antes del recorte)	Cualquier valor superior o igual a cero hasta 25 caracteres numéricos, incluidos hasta 5 decimales. Si el valor tiene más de 5 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto.
16	Garantías reales	Margen de variación aportado por la contraparte 1 (después del recorte)	Cualquier valor superior o igual a cero hasta 25 caracteres numéricos, incluidos hasta 5 decimales. Si el valor tiene más de 5 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto.
17	Garantías reales	Moneda de los márgenes de variación aportados	Código de moneda ISO 4217 de 3 caracteres alfabéticos

▼B

	Sección	Campo	Formato
18	Garantías reales	Garantías reales excedentarias aportadas por la contraparte 1	Cualquier valor superior o igual a cero hasta 25 caracteres numéricos, incluidos hasta 5 decimales. Si el valor tiene más de 5 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto.
19	Garantías reales	Moneda de las garantías reales excedentarias aportadas	Código de moneda ISO 4217 de 3 caracteres alfabéticos
20	Garantías reales	Margen inicial recibido por la contraparte 1 (antes del recorte)	Cualquier valor superior o igual a cero hasta 25 caracteres numéricos, incluidos hasta 5 decimales. Si el valor tiene más de 5 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto.
21	Garantías reales	Margen inicial recibido por la contraparte 1 (después del recorte)	Cualquier valor superior o igual a cero hasta 25 caracteres numéricos, incluidos hasta 5 decimales. Si el valor tiene más de 5 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto.
22	Garantías reales	Moneda del margen inicial recibido	Código de moneda ISO 4217 de 3 caracteres alfabéticos
23	Garantías reales	Margen de variación recibido por la contraparte 1 (antes del recorte)	Cualquier valor superior o igual a cero hasta 25 caracteres numéricos, incluidos hasta 5 decimales. Si el valor tiene más de 5 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto.
24	Garantías reales	Margen de variación recibido por la contraparte 1 (después del recorte)	Cualquier valor superior o igual a cero hasta 25 caracteres numéricos, incluidos hasta 5 decimales. Si el valor tiene más de 5 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto.

▼B

	Sección	Campo	Formato
25	Garantías reales	Moneda del margen de variación recibido	Código de moneda ISO 4217 de 3 caracteres alfabéticos
26	Garantías reales	Garantías reales excedentarias recibidas por la contraparte 1	Cualquier valor superior o igual a cero hasta 25 caracteres numéricos, incluidos hasta 5 decimales. Si el valor tiene más de 5 dígitos después del decimal, las contrapartes notificantes redondearán hacia arriba. La marca de decimal no cuenta como carácter numérico. Si figura dicho signo, se representará con un punto.
27	Garantías reales	Moneda de las garantías reales excedentarias recibidas	Código de moneda ISO 4217 de 3 caracteres alfabéticos
28	Garantías reales	Tipo de acción	«MARU» = Actualización del margen CORR = Corrección
29	Garantías reales	Fecha del suceso	Fecha ISO 8601 en el formato UTC AAAA-MM-DD.

Cuadro 4

Clasificación de materias primas

Producto base	Subproducto	Otros subproductos
«AGRI» = Agrícolas	«GROS» = Granos de cereales y semillas oleaginosas	«FWHT» = Trigo forrajero «SOYB» = Semillas de soja «CORN» = Maíz «RPSD» = Colza «RICE» = Arroz «OTHR» = Otros
	«SOFT» = Productos perecederos	«CCOA» = Cacao «ROBU» = Café robusta «WHSG» = Azúcar blanco «BRWN» = Azúcar en bruto «OTHR» = Otros
	«POTA» = Patatas	
	«OOLI» = Aceite de oliva	«LAMP» = Aceite de oliva lampante «OTHR» = Otros
	«DIRY» = Productos lácteos	
	«FRST» = Productos forestales	

▼B

Producto base	Subproducto	Otros subproductos
	«SEAF» = Productos del mar	
	«LSTK» = Ganado	
	«GRIN» = Cereales	«MWHT» = Trigo de molienda «OTHR» = Otros
	«OTHR» = Otros	
«NRGY» = Energía	«ELEC» = Electricidad	«BSLD» = Carga base «FITR» = Derechos financieros de transporte «PKLD» = Pico de carga «OFFP» = Fuera de punta «OTHR» = Otros
	«NGAS» = Gas natural	«GASP» = GASPOOL «LNGG» = GNL «NBPG» - NPB «NCGG» = NCG «TTFG» = TTF «OTHR» = Otros
	«OILP» = Petróleo	«BAKK» = Bakken «BDSL» = Biodiésel «BRNT» = Brent «BRNX» = Brent NX «CNDA» = Canadiense «COND» = Condensado «DSEL» = Diésel «DUBA» = Dubái «ESPO» = ESPO «ETHA» = Etanol «FUEL» = Fuel «FOIL» = Fuelóleo «GOIL» = Gasóleo «GSLN» = Gasolina «HEAT» = Gasóleo de calefacción «JTFL» = Carburorreactor «KERO» = Queroseno «LLSO» = Light Luisiana Sweet (LLS) «MARS» = Mars «NAPH» = Nafta «NGLO» = LGN «TAPI» = Tapis «URAL» = Urales «WTIO» = WTI «OTHR» = Otros

▼B

Producto base	Subproducto	Otros subproductos
	«COAL» = Carbón «INRG» = Inter[-]energía «RNNG» = Energías renovables «LGHT» = Productos finales ligeros «DIST» = Destilados «OTHR» = Otros	
«ENVR» = Medio ambiente	«EMIS» = Emisiones	«CERE» = RCE «ERUE» = URE «EUAE» = EUA «EUAA» = EUAA «OTHR» = Otros
	«WTHR» = Meteorología «CRBR» = Relacionados con el carbono «OTHR» = Otros	
«FRGT» = Carga	«WETF» = Carga líquida	«TNKR» = Buques cisterna «OTHR» = Otros
	«DRYF» = Carga seca	«DBCR» = Graneleros de carga seca «OTHR» = Otros
	«CSHP» = Buques portacontenedores	
	«OTHR» = Otros	
«FRTL» = Fertilizantes	«AMMO» = Amoníaco «DAPH» = DAP (fosfato diamónico) «PTSH» = Potasio «SLPH» = Azufre «UREA» = Urea «UAAN» = UAN (urea y nitrato de amonio) «OTHR» = Otros	
«INDP» = Productos industriales	«CSTR» = Construcción «MFTG» = Fabricación	
«METL» = Metales	«NPRM» = No preciosos	«ALUM» = Aluminio «ALUA» = Aleación de aluminio «CBLT» = Cobalto «COPR» = Cobre «IRON» = Mineral de hierro

▼B

Producto base	Subproducto	Otros subproductos
		«LEAD» = Plomo «MOLY» = Molibdeno «NASC» = NASAAC «NICK» = Níquel «STEL» = Acero «TINN» = Estaño «ZINC» = Zinc «OTHR» = Otros
	«PRME» = Preciosos	«GOLD» = Oro «SLVR» = Plata «PTNM» = Platino «PLDM» = Paladio «OTHR» = Otros
«MCEX» = Multimaterias primas exóticas (Multi Commodity Exotic)		
«PAPR» = Papel	«CBRD» = Cartón ondulado «NSPT» = Papel-prensa «PULP» = Pasta «RCVP» = Papel reciclado «OTHR» = Otros	
«POLY» = Polipropileno	«PLST» = Plásticos «OTHR» = Otros	
«INFL» = Inflación		
«OEST» = Estadísticas económicas oficiales		
«OTHC» = «Otros derivados C10» tal como se definen en el cuadro 10.1, del anexo III del Reglamento Delegado (UE) 2017/583 de la Comisión ([1])		
«OTHR» = Otros		

([1]) Reglamento Delegado (UE) 2017/583 de la Comisión, de 14 de julio de 2016, por el que se completa el Reglamento (UE) n.º 600/2014 del Parlamento Europeo y del Consejo, relativo a los mercados de instrumentos financieros, en lo que respecta a las normas técnicas de regulación sobre los requisitos de transparencia aplicables a los centros de negociación y las empresas de servicios de inversión con relación a los bonos, los productos de financiación estructurada, los derechos de emisión y los derivados (DO L 87 de 31.3.2017, p. 229).