

REGLAMENTO DELEGADO (UE) 2017/585 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 en lo que respecta a las normas técnicas de regulación relativas a las normas y los formatos aplicables a los datos de referencia de los instrumentos financieros y las medidas técnicas en relación con las disposiciones que han de tomar la Autoridad Europea de Valores y Mercados y las autoridades competentes****(Texto pertinente a efectos del EEE)**

LA COMISIÓN EUROPEA,

Visto el Tratado de Funcionamiento de la Unión Europea,

Visto el Reglamento (UE) n.º 600/2014 del Parlamento Europeo y del Consejo, de 15 de mayo de 2014, relativo a los mercados de instrumentos financieros y por el que se modifica el Reglamento (UE) n.º 648/2012 ⁽¹⁾, y en particular su artículo 27, apartado 3, párrafo tercero,

Considerando lo siguiente:

- (1) Con vistas a un seguimiento eficaz de los mercados por parte de las autoridades competentes, los datos de referencia de los instrumentos financieros han de comunicarse en un formato coherente y con arreglo a normas uniformes.
- (2) La comunicación y publicación de los datos de referencia en formato electrónico, de lectura mecánica y descargable facilita la utilización eficiente y el intercambio de dichos datos.
- (3) La pronta recepción de los datos de referencia de todos los instrumentos financieros que sean admitidos a negociación o que se negocien en un centro de negociación o a través de un internalizador sistemático permite a las autoridades competentes y la Autoridad Europea de Valores y Mercados (AEVM) garantizar la calidad de los datos y un seguimiento eficaz de los mercados, contribuyendo así a la integridad de estos.
- (4) A fin de garantizar que los centros de negociación y los internalizadores sistemáticos presenten datos de referencia completos y exactos y que las autoridades competentes puedan recibir de forma efectiva y utilizar oportunamente tales datos, es preciso establecer plazos de presentación apropiados. Conviene conceder un plazo adecuado para poder detectar inexactitudes u omisiones antes de su publicación. Con objeto de asegurar que los datos de referencia presentados sean coherentes con la información correspondiente comunicada de conformidad con el artículo 26 del Reglamento (UE) n.º 600/2014, las autoridades competentes deben utilizar los datos de referencia relativos a un determinado día para validar y remitir las comunicaciones de las operaciones ejecutadas ese mismo día.
- (5) De conformidad con el artículo 27, apartado 2, del Reglamento (UE) n.º 600/2014, los remitentes y los destinatarios de los datos de referencia deben velar por la recepción efectiva y el intercambio eficiente de los datos, y su calidad y coherencia con las correspondientes comunicaciones de operaciones previstas en el artículo 26 de dicho Reglamento. Los centros de negociación y los internalizadores sistemáticos deben, por tanto, facilitar datos de referencia completos y exactos e informar inmediatamente a las autoridades competentes de cualquier omisión o inexactitud que detecten en los datos ya proporcionados. Asimismo, deben mantener sistemas y controles adecuados con vistas a suministrar en el momento oportuno datos de referencia exactos y completos.
- (6) A efectos de una utilización y una transmisión eficientes de los datos de referencia, y con el fin de velar por que estos sean coherentes con los datos correspondientes facilitados en las comunicaciones de operaciones, los centros de negociación y los internalizadores sistemáticos deben basarse en normas uniformes aceptadas para la identificación de los instrumentos financieros y las entidades jurídicas que se incluyan en los datos de referencia. En particular, para asegurar que los datos de referencia coincidan con las correspondientes comunicaciones de operaciones, los centros de negociación y los internalizadores sistemáticos deben velar por la obtención e inclusión en los datos comunicados del número internacional de identificación de valores, conforme a la norma ISO 6166, asignado a los instrumentos financieros objeto de la comunicación.
- (7) En aras de la coherencia y a efectos de garantizar el correcto funcionamiento de los mercados financieros, es necesario que las disposiciones que establece el presente Reglamento y las contenidas en el Reglamento (UE) n.º 600/2014 se apliquen a partir de una misma fecha.

⁽¹⁾ DOL 173 de 12.6.2014, p. 84.

- (8) El presente Reglamento se basa en los proyectos de normas técnicas de regulación presentados por la AEVM a la Comisión.
- (9) La AEVM ha llevado a cabo consultas públicas abiertas sobre los proyectos de normas técnicas de regulación en que se basa el presente Reglamento, ha analizado los costes y beneficios potenciales correspondientes y ha recabado el dictamen del Grupo de Partes Interesadas del Sector de Valores y Mercados, establecido de conformidad con el artículo 37 del Reglamento (UE) n.º 1095/2010 del Parlamento Europeo y del Consejo ⁽¹⁾.

HA ADOPTADO EL PRESENTE REGLAMENTO:

Artículo 1

Contenido, normas y formato de los datos de referencia

Los centros de negociación y los internalizadores sistemáticos facilitarán a las autoridades competentes todos los datos que conforman los datos de referencia de los instrumentos financieros («datos de referencia») previstos en el cuadro 3 del anexo y que correspondan al instrumento financiero considerado. Todos los datos se presentarán conforme a las normas y formatos que se especifican en el cuadro 3 del anexo, en formato electrónico y apto para lectura mecánica y en una plantilla XML común de conformidad con la metodología ISO 20022.

Artículo 2

Momento de suministro de los datos de referencia a las autoridades competentes

1. Cada día en que estén abiertos para negociación, a más tardar a las 21:00 horas CET, los centros de negociación y los internalizadores sistemáticos facilitarán a su autoridad competente los datos de referencia de todos los instrumentos financieros que sean admitidos a negociación o que se negocien, incluso en el caso de que las órdenes o cotizaciones se presenten a través de su sistema, antes de las 18:00 horas CET de ese día.
2. Cuando un instrumento financiero sea admitido a negociación o se negocie, incluso en el caso de que se presente por primera vez una orden o una cotización, después de las 18:00 horas CET de un día en que el centro de negociación o internalizador sistemático está abierto para negociación, los datos de referencia del correspondiente instrumento financiero se proporcionarán a más tardar a las 21:00 horas CET del siguiente día en que el centro de negociación o el internalizador sistemático en cuestión esté abierto para negociación.

Artículo 3

Identificación de los instrumentos financieros y entidades jurídicas

1. Antes de que un instrumento financiero empiece a negociarse en un centro de negociación o internalizador sistemático, estos deberán obtener el número internacional de identificación de valores conforme a la norma ISO 6166 («código ISIN») que corresponda al instrumento financiero.
2. Los centros de negociación y los internalizadores sistemáticos se asegurarán de que los códigos de identificación de entidades jurídicas incluidos en los datos de referencia facilitados se atengan a la norma ISO 17442:2012, correspondan al emisor de que se trate, y figuren en la base de datos de códigos internacionales de identificación de entidades jurídicas mantenida por la Central Operating Unit designada por el Legal Entity Identifier Regulatory Oversight Committee (Comité de Vigilancia Reglamentaria para el Sistema Mundial de Identificación de Entidad Jurídica).

Artículo 4

Disposiciones para garantizar la recepción efectiva de los datos de referencia

1. Las autoridades competentes controlarán y evaluarán si los datos de referencia que reciben de un centro de negociación o un internalizador sistemático están completos y se atienen a las normas y formatos especificados en el cuadro 3 del anexo.

⁽¹⁾ Reglamento (UE) n.º 1095/2010 del Parlamento Europeo y del Consejo, de 24 de noviembre de 2010, por el que se crea una Autoridad Europea de Supervisión (Autoridad Europea de Valores y Mercados), se modifica la Decisión n.º 716/2009/CE y se deroga la Decisión 2009/77/CE de la Comisión (DO L 331 de 15.12.2010, p. 84).

2. Tras recibir los datos de referencia correspondientes a cada día en que los centros de negociación e internalizadores sistemáticos estén abiertos para negociación, las autoridades competentes notificarán a dichos centros e internalizadores cualquier omisión constatada en los datos y toda falta de suministro de los datos de referencia dentro de los plazos establecidos en el artículo 2.
3. La AEVM controlará y evaluará si los datos de referencia que recibe de las autoridades competentes están completos y se atienen a las normas y formatos especificados en el cuadro 3 del anexo.
4. Tras recibir los datos de referencia de las autoridades competentes, la AEVM notificará a estas cualquier omisión constatada en los datos y toda falta de suministro de los datos de referencia dentro de los plazos establecidos en el artículo 7, apartado 1.

Artículo 5

Disposiciones para garantizar la calidad de los datos de referencia

Las autoridades competentes llevarán a cabo evaluaciones de calidad relativas al contenido y la exactitud de los datos de referencia recibidos, con arreglo al artículo 27, apartado 1, del Reglamento (UE) n.º 600/2014, como mínimo trimestralmente.

Artículo 6

Métodos y disposiciones para suministrar los datos de referencia

1. Los centros de negociación y los internalizadores sistemáticos velarán por suministrar datos de referencia completos y exactos a sus autoridades competentes con arreglo a los artículos 1 y 3.
2. Los centros de negociación y los internalizadores sistemáticos implantarán métodos y mecanismos que les permitan detectar los datos de referencia incompletos o inexactos presentados anteriormente. Cualquier centro de negociación o internalizador sistemático que descubra que los datos de referencia presentados están incompletos o son inexactos lo notificará de inmediato a su autoridad competente y le transmitirá sin demora injustificada los datos de referencia pertinentes completos y correctos.

Artículo 7

Disposiciones para un intercambio eficiente de los datos de referencia y su publicación

1. Cada día, a más tardar a las 23:59 horas CET, las autoridades competentes transmitirán los datos de referencia completos y exactos a la AEVM, utilizando el canal de comunicación electrónica segura establecido a tal efecto entre las autoridades competentes y la AEVM.
2. El día siguiente a la recepción de los datos de referencia de conformidad con el apartado 1, la AEVM consolidará los datos recibidos de cada autoridad competente.
3. La AEVM pondrá los datos consolidados a disposición de todas las autoridades competentes a más tardar a las 08:00 horas CET del día siguiente al de su recepción, utilizando los canales de comunicación electrónica segura a que se refiere el apartado 1.
4. Las autoridades competentes utilizarán los datos consolidados correspondientes a un determinado día para validar las comunicaciones de las operaciones ejecutadas ese día que se hayan presentado de conformidad con el artículo 26 del Reglamento (UE) n.º 600/2014.
5. Cada autoridad competente utilizará los datos consolidados correspondientes a un determinado día para transmitir las comunicaciones de operaciones presentadas ese mismo día de conformidad con el artículo 26, apartado 1, párrafo segundo, del Reglamento (UE) n.º 600/2014.
6. La AEVM publicará los datos de referencia en formato electrónico, descargable y apto para lectura mecánica.

*Artículo 8***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 de la fecha a que se refiere el artículo 55, párrafo segundo, del Reglamento (UE) n.º 600/2014.

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

Hecho en Bruselas, el 14 de julio de 2016.

Por la Comisión
El Presidente
Jean-Claude JUNCKER

ANEXO

Cuadro 1

Leyenda del cuadro 3

SÍMBOLO	TIPO DE DATO	DEFINICIÓN
{ALPHANUM-n}	Hasta <i>n</i> caracteres alfanuméricos	Campo con texto libre
{CFI_CODE}	6 caracteres	Código CFI desarrollado según la norma ISO 10962
{COUNTRYCODE_2}	2 caracteres alfanuméricos	Código de país de 2 letra s), con arreglo al código de país ISO 3166-1 alfa-2
{CURRENCYCODE_3}	3 caracteres alfanuméricos	Código de moneda de 3 letra s), con arreglo a los códigos de moneda ISO 4217
{DATE_TIME_FORMAT}	Formato de fecha y hora ISO 8601	<ul style="list-style-type: none"> — Fecha y hora según el formato siguiente: AAAA-MM-DDThh:mm:ss.dddZ — «AAAA» corresponde al año — «MM» al mes — «DD» al día — «T» significa que debe utilizarse la letra «T» — «hh» corresponde a la hora — «mm» a los minutos — «ss.dddZ» a los segundos y las fracciones de segundo — Z corresponde a la hora UTC Las fechas y horas deben indicarse en UTC
{DATEFORMAT}	Formato de fecha ISO 8601	Las fechas deben indicarse en el formato siguiente: AAAA-MM-DD
{DECIMAL-n/m}	Número decimal de hasta <i>n</i> dígitos en total, de los cuales hasta <i>m</i> dígitos pueden ser decimales	Campo numérico que puede contener valores positivos y negativos <ul style="list-style-type: none"> — El separador decimal es el signo «.» (punto) — Los números negativos van precedidos del signo «-» (menos) — Deben indicarse valores redondeados y no truncados
{INDEX}	4 caracteres alfabéticos	«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

SÍMBOLO	TIPO DE DATO	DEFINICIÓN
		«CDOR»-CDOR «CIBO»-CIBOR «MOSP»-MOSPRIM «NIBO»-NIBOR «PRBO»-PRIBOR «TLBO»-TELBOR «WIBO»-WIBOR «TREA»-Tesoro «SWAP»-Permuta financiera «FUSW»-Permuta financiera a plazo
{INTEGER-n}	Número entero de hasta <i>n</i> dígitos en total	Campo numérico que puede contener valores enteros positivos y negativos
{ISIN}	12 caracteres alfanuméricos	Código ISIN en el sentido de la norma ISO 6166
{LEI}	20 caracteres alfanuméricos	Identificador de entidades jurídicas en el sentido de la norma ISO 17442
{MIC}	4 caracteres alfanuméricos	Identificador de mercado en el sentido de la norma ISO 10383
{FISN}	35 caracteres alfanuméricos	Código FISN en el sentido de la norma ISO 18774

Cuadro 2

Clasificación de los derivados sobre materias primas y sobre derechos de emisión para el cuadro 3 (campos 35 a 37)

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

Producto base	Subproducto	Otros subproductos
	«SEAF»-Productos del mar	
	«LSTK»-Ganado	
	«GRIN»-Cereales	«MWHT»-Trigo de molienda
«NRGY»-Energía	«ELEC»-Electricidad	«BSLD»-Carga base «FITR»-Derechos financieros de transporte «PKLD»-Carga de punta «OFFP»-Fuera de punta «OTHR»-Otros
	«NGAS»-Gas natural	«GASP»-GASPOOL «LNGG»-GNL «NBPG»-NBP «NCGG»-NCG «TTFG»-TTF
	«OILP»-Petróleo	«BAKK»-Bakken «BDSL»-Biodiésel «BRNT»-Brent «BRNX»-Brent NX «CNDA»-Canadian «COND»-Condensados «DSEL»-Diésel «DUBA»-Dubai «ESPO»-ESPO «ETHA»-Etanol «FUEL»-Fuel «FOIL»-Fuelóleo «GOIL»-Gasóleo «GSLN»-Gasolina «HEAT»-Gasóleo de calefacción «JTFL»-Carburorreactor «KERO»-Queroseno «LLSO»-Light Louisiana Sweet (LLS) «MARS»-Mars «NAPH»-Nafta «NGLO»-LGN «TAPI»-Tapis «URAL»-Urales «WTIO»-WTI
	«COAL»-Carbón «INRG»-Inter Energy «RNNG»-Energías renovables «LGHT»-Productos finales ligeros «DIST»-Destilados	

Producto base	Subproducto	Otros subproductos
«ENVR»-Medio ambiente	«EMIS»-Emisiones	«CERE»-Reducción certificada de emisiones (RCE) «ERUE»-Unidad de reducción de emisiones (URE) «EUAE»-Derechos de emisión UE «EUAA»-Derechos de emisión de la aviación UE «OTHR»-Otros
	«WTHR»-Meteorológicos «CRBR»-Relacionados con el carbono	
«FRGT»-Carga	«WETF»-Carga líquida	«TNKR»-Buques cisterna
	«DRYF»-Carga seca	«DBCR»-Graneleros de carga seca
	«CSHP»-Buques portacontenedores	
«FRTL»-Fertilizantes	«AMMO»-Amoníaco «DAPH»-DAP (fosfato diamónico) «PTSH»-Potasa «SLPH»-Azufre «UREA»-Urea «UAAN»-UAN (urea y nitrato de amonio)	
«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 «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

Producto base	Subproducto	Otros subproductos
«MCEX»-Multimaterias primas exóticas (Multi Commodity Exotic)		
«PAPR»-Papel	«CBRD»-Cartón ondulado «NSPT»-Papel prensa «PULP»-Pasta de papel «RCVP»-Papel reciclado	
«POLY»-Polipropileno	«PLST»-Plásticos	
«INFL»-Inflación		
«OEST»-Estadísticas económicas oficiales		
«OTHC»-Otros C10 tal como se definen en la sección 10, 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 (véase la página 229 del presente Diario Oficial).

Cuadro 3

Datos que deberán comunicarse como datos de referencia sobre los instrumentos financieros

N.º	CAMPO	INFORMACIÓN QUE DEBE NOTIFICARSE	FORMATO Y NORMAS PARA LAS NOTIFICACIONES
Campos generales			
1	Código de identificación del instrumento	Código utilizado para identificar el instrumento financiero.	{ISIN}
2	Nombre completo del instrumento	Nombre completo del instrumento financiero.	{ALPHANUM-350}
3	Clasificación del instrumento	Taxonomía utilizada para clasificar el instrumento financiero. Se facilitará un código CFI completo y exacto.	{CFI_CODE}
4	Indicador de derivados sobre materias primas o derechos de emisión	Indicación de si el instrumento financiero está comprendido en la definición de derivados sobre materias primas, con arreglo al artículo 2, apartado 1, punto 30, del Reglamento (UE) n.º 600/2014, o es un derivado relacionado con derechos de emisión tal como se contempla en la sección C, punto 4, del anexo I de la Directiva 2014/65/UE.	«true»-Sí «false»-No
Campos relativos al emisor			
5	Identificador del emisor o del gestor del centro de negociación	LEI del emisor o del gestor del centro de negociación.	{LEI}

N.º	CAMPO	INFORMACIÓN QUE DEBE NOTIFICARSE	FORMATO Y NORMAS PARA LAS NOTIFICACIONES
Campos relativos al centro de negociación			
6	Centro de negociación	MIC del segmento del centro de negociación o internalizador sistemático, cuando se disponga de él, o en su defecto MIC operativo.	{MIC}
7	Nombre abreviado del instrumento financiero	Nombre abreviado del instrumento financiero con arreglo a la norma ISO 18774.	{FISN}
8	Solicitud de admisión a negociación introducida por el emisor	Indicación de si el emisor del instrumento financiero ha solicitado o aprobado la negociación o la admisión a negociación de su instrumento financiero en un centro de negociación.	«true»-Sí «false»-No
9	Fecha de aprobación de la admisión a negociación	Fecha y hora en que el emisor ha aprobado la admisión a negociación o la negociación de sus instrumentos financieros en un centro de negociación.	{DATE_TIME_FORMAT}
10	Fecha de la solicitud de admisión a negociación	Fecha y hora de la solicitud de admisión a negociación en el centro de negociación.	{DATE_TIME_FORMAT}
11	Fecha de admisión a negociación o fecha de la primera negociación	Fecha y hora de la admisión a negociación en el centro de negociación o fecha y hora en que el instrumento se negoció por primera vez o se recibió por primera vez una orden o una cotización en el centro de negociación.	{DATE_TIME_FORMAT}
12	Fecha de terminación	En su caso, fecha y hora en que el instrumento financiero deja de negociarse o de admitirse a negociación en el centro de negociación.	{DATE_TIME_FORMAT}
Campos relativos al nocional			
13	Moneda nocional 1	Moneda en la que se denomina el nocional En el caso de un contrato de derivados sobre tipos de interés o divisas, será la moneda nocional del componente 1 o la moneda 1 del par. En el caso de opciones sobre permutas financieras en las que la permuta subyacente sea en una sola moneda, será la moneda nocional de la permuta subyacente. En las opciones sobre permutas financieras en las que el subyacente sea una permuta multidivisa, será la moneda nocional del componente 1 de la permuta.	{CURRENCYCODE_3}
Campos relativos a bonos u otras formas de deuda titulizada			
14	Importe nominal emitido total	Importe nominal emitido total en valor monetario	{DECIMAL-18/5}
15	Fecha de vencimiento	Fecha de vencimiento del instrumento financiero. Este campo se aplica a los instrumentos de deuda con un vencimiento definido.	{DATEFORMAT}
16	Moneda del valor nominal	Moneda del valor nominal de los instrumentos de deuda.	{CURRENCYCODE_3}
17	Valor nominal por unidad/valor negociado mínimo	Valor nominal de cada instrumento. Si no está disponible, se consignará el valor negociado mínimo.	{DECIMAL-18/5}

N.º	CAMPO	INFORMACIÓN QUE DEBE NOTIFICARSE	FORMATO Y NORMAS PARA LAS NOTIFICACIONES
18	Tipo fijo	Tipo fijo de rendimiento de un instrumento de deuda cuando se mantiene hasta la fecha de vencimiento, expresado en porcentaje.	{DECIMAL-11/10} Expresado en porcentaje (por ejemplo 7.0 = 7 % y 0.3 = 0,3 %)
19	Identificador del índice/índice de referencia de un bono con tipo de interés variable	Cuando exista un identificador.	{ISIN}
20	Nombre del índice/índice de referencia de un bono con tipo de interés variable	Cuando no exista un identificador, nombre del índice.	{INDEX} O {ALPHANUM-25}-Si el nombre del índice no figura en la lista {INDEX}
21	Duración del índice/índice de referencia de un bono con tipo de interés variable	Duración del índice/índice de referencia de un bono con tipo de interés variable. La duración se expresará en días, semanas, meses o años.	{INTEGER-3} + «DAYS»-días {INTEGER-3} + «WEEK»-semanas {INTEGER-3} + «MNTH»-meses {INTEGER-3} + «YEAR»-años
22	Diferencial en puntos básicos del índice/índice de referencia de un bono con tipo de interés variable	Número de puntos básicos por encima o por debajo del índice utilizado para calcular un precio.	{INTEGER-5}
23	Orden de prelación del bono	Indíquese el tipo de bono: deuda senior, mezzanine, subordinada o junior.	«SNDB»-Deuda senior «MZZD»-Deuda mezzanine «SBOD»-Deuda subordinada «JUND»-Deuda junior

Campos relativos a los derivados y los derivados titulizados

24	Fecha de expiración	Fecha de expiración del instrumento financiero. Este campo se aplica a los derivados con una fecha de expiración definida.	{DATEFORMAT}
25	Multiplificador del precio	Número de unidades del instrumento subyacente representadas por un único contrato de derivados. En los futuros u opciones sobre índices, indíquese el importe por cada punto del índice. En las apuestas por diferencias, indíquese la variación del precio del instrumento subyacente en que se basa la apuesta.	{DECIMAL-18/17}
26	Código del instrumento subyacente	Código ISIN del instrumento subyacente. En los ADR, GDR e instrumentos similares, indíquese el código ISIN del instrumento financiero en que se basan dichos instrumentos. En los bonos convertibles, indíquese el código ISIN del instrumento en que pueden convertirse. En los derivados u otros instrumentos que tienen un subyacente, indíquese el código ISIN del instrumento subyacente, cuando este esté admitido a negociación o se negocie en un centro de negociación. Cuando el subyacente sea un dividendo en acciones, indíquese el código ISIN de la acción correspondiente que dé derecho al dividendo subyacente.	{ISIN}

N.º	CAMPO	INFORMACIÓN QUE DEBE NOTIFICARSE	FORMATO Y NORMAS PARA LAS NOTIFICACIONES
		<p>En las permutas de cobertura por impago, debe indicarse el ISIN de la obligación de referencia.</p> <p>Cuando el subyacente sea un índice y tenga un código ISIN, indíquese el código ISIN de dicho índice.</p> <p>Cuando el subyacente sea una cesta, deben consignarse los ISIN de cada componente de la cesta que se admita a negociación o se negocie en un centro de negociación. Los campos 26 y 27 se cumplimentarán cuantas veces sea necesario para incluir todos los instrumentos de la cesta.</p>	
27	Emisor subyacente	En caso de que el instrumento remita a un emisor, en lugar de a un único instrumento, indíquese el código LEI del emisor.	{LEI}
28	Nombre del índice subyacente	Si el subyacente es un índice, indíquese el nombre del índice.	{INDEX} O {ALPHANUM-25}-Si el nombre del índice no figura en la lista {INDEX}
29	Duración del índice subyacente	Si el subyacente es un índice, indíquese la duración del índice.	{INTEGER-3} + «DAYS»-días {INTEGER-3} + «WEEK»-semanas {INTEGER-3} + «MNTN»-meses {INTEGER-3} + «YEAR»-años
30	Tipo de opción	<p>Indicación de si el contrato de derivados es una opción de compra (derecho a comprar un determinado activo subyacente) o una opción de venta (derecho a vender un determinado activo subyacente) o si no puede determinarse si se trata de una opción de compra o de venta en el momento de la ejecución. En el caso de las opciones sobre permutas financieras, será:</p> <ul style="list-style-type: none"> — «opción de venta» en el caso de opciones sobre permutas de receptor, en las que el comprador tiene derecho a participar en una permuta financiera como receptor fijo; — «opción de compra» en el caso de opciones sobre permutas de pagador, en las que el comprador tiene derecho a participar en una permuta financiera como pagador fijo. <p>En el caso de contratos Cap o Floor, será:</p> <ul style="list-style-type: none"> — «opción de venta» en el caso de un contrato Floor; — «opción de compra», en el caso de un contrato Cap. Este campo solo se aplica a los derivados que son opciones o <i>warrants</i>. 	«PUTO»-Opción de venta «CALL»-Opción de compra «OTHR»-Si no puede determinarse si se trata de una opción de compra o de una opción de venta
31	Precio de ejercicio	<p>Precio predeterminado al que el titular tendrá que comprar o vender el instrumento subyacente, o una indicación de que el precio no puede determinarse en el momento de la ejecución.</p> <p>Este campo solo se aplica a las opciones o <i>warrants</i> cuyo precio de ejercicio puede determinarse en el momento de la ejecución.</p> <p>Cuando el precio no esté aún disponible, sino pendiente, el valor será «PNDG».</p> <p>Cuando el precio de ejercicio no sea aplicable, el campo no debe cumplimentarse.</p>	{DECIMAL-18/13} en caso de que el precio se exprese en valor monetario {DECIMAL-11/10} en caso de que el precio se exprese en porcentaje o rendimiento {DECIMAL-18/17} en caso de que el precio se exprese en puntos básicos «PNDG» en caso de que el precio no esté disponible
32	Moneda del precio de ejercicio	Moneda del precio de ejercicio.	{CURRENCYCODE_3}

N.º	CAMPO	INFORMACIÓN QUE DEBE NOTIFICARSE	FORMATO Y NORMAS PARA LAS NOTIFICACIONES
33	Estilo de ejercicio de la opción	Indicación de si la opción puede ejercitarse solo en una fecha determinada (estilo europeo y asiático), en una serie de fechas predeterminadas (estilo «bermuda») o en cualquier momento durante el período de vigencia del contrato (estilo americano). Este campo solo es aplicable en el caso de opciones, <i>warrants</i> y certificados de derechos.	«EURO»-Opción de tipo europeo «AMER»-Opción de tipo americano «ASIA»-Opción de tipo asiático «BERM»-Opción de tipo «bermuda» «OTHR»-Cualquier otro tipo de opción
34	Tipo de entrega	Indicación de si el instrumento financiero se liquida físicamente o en efectivo. Cuando el tipo de entrega no pueda determinarse en el momento de la ejecución, el valor será «OPTL». Este campo solo es aplicable a los derivados.	«PHYS»-Liquidación física «CASH»-Liquidación en efectivo «OPTL»-Opcional para la contraparte o determinada por un tercero

Derivados sobre materias primas y sobre derechos de emisión

35	Producto base	Producto base de la clase de activos subyacentes especificado en el cuadro relativo a la clasificación de los derivados sobre materias primas y sobre derechos de emisión.	Indíquense solo valores que figuren en la columna «Producto base» del cuadro relativo a la clasificación de los derivados sobre materias primas.
36	Subproducto	Subproducto de la clase de activos subyacentes especificado en el cuadro relativo a la clasificación de los derivados sobre materias primas y sobre derechos de emisión. Este campo requiere un producto base.	Indíquense solo valores que figuren en la columna «Subproducto» del cuadro relativo a la clasificación de los derivados sobre materias primas.
37	Otros subproductos	Otro subproducto de la clase de activos subyacentes especificado en el cuadro relativo a la clasificación de los derivados sobre materias primas y sobre derechos de emisión. Este campo requiere un subproducto.	Indíquense solo valores que figuren en la columna «Otros subproductos» del cuadro relativo a la clasificación de los derivados sobre materias primas.
38	Tipo de operación	Tipo de operación, según lo especificado por el centro de negociación.	«FUTR»-Futuros «OPTN»-Opciones «TAPO»-TAPO «SWAP»-Permutas financieras «MINI»-Minis «OTCT»-OTC «ORIT»-Outright «CRCK»-Crack «DIFF»-Diferencial «OTHR»-Otros
39	Tipo de precio final	Tipo de precio final, según lo especificado por el centro de negociación.	«ARGM»-Argus/McCloskey «BLTC»-Baltic «EXOF»-Exchange «GBCL»-GlobalCOAL «IHSM»-IHS McCloskey «PLAT»-Platts «OTHR»-Otros

N.º	CAMPO	INFORMACIÓN QUE DEBE NOTIFICARSE	FORMATO Y NORMAS PARA LAS NOTIFICACIONES
-----	-------	----------------------------------	--

Derivados sobre tipos de interés

— Los campos de esta sección solo deben cumplimentarse en el caso de instrumentos que tengan como subyacente un instrumento no financiero, como los tipos de interés.

40	Tipo de referencia	Nombre del tipo de referencia.	{INDEX} O {ALPHANUM-25}-Si el tipo de referencia no figura en la lista {INDEX}
41	TI Duración del contrato	Si la clase de activos es Tipos de Interés, este campo indica la duración del contrato. La duración se expresará en días, semanas, meses o años.	{INTEGER-3} + «DAYS»-días {INTEGER-3} + «WEEK»-semanas {INTEGER-3} + «MNTH»-meses {INTEGER-3} + «YEAR»-años
42	Moneda nocional 2	En el caso de permutas de divisas cruzadas o multidivisa, indíquese la moneda en la que se denomina el componente 2 del contrato. En las opciones sobre permutas financieras en las que la permuta subyacente es multidivisa, indíquese la moneda en la que se denomina el componente 2 de la permuta.	{CURRENCYCODE_3}
43	Tipo fijo del componente 1	Indicación del tipo fijo del componente 1 utilizado, si procede.	{DECIMAL -11/10} Expresado en porcentaje (por ejemplo 7.0 = 7 % y 0.3 = 0,3 %)
44	Tipo fijo del componente 2	Indicación del tipo fijo del componente 2 utilizado, si procede.	{DECIMAL -11/10} Expresado en porcentaje (por ejemplo 7.0 = 7 % y 0.3 = 0,3 %)
45	Tipo variable del componente 2	Indicación del tipo de interés utilizado, si procede.	{INDEX} O {ALPHANUM-25}-Si el tipo de referencia no figura en la lista {INDEX}
46	TI Duración del contrato del componente 2	Indicación del período de referencia del tipo de interés, que se fija a intervalos predeterminados con relación a un tipo de referencia del mercado. La duración se expresará en días, semanas, meses o años.	{INTEGER-3} + «DAYS»-días {INTEGER-3} + «WEEK»-semanas {INTEGER-3} + «MNTH»-meses {INTEGER-3} + «YEAR»-años

Derivados sobre tipos de cambio

— Los campos de esta sección solo se cumplimentarán en el caso de instrumentos que tengan como subyacente un instrumento no financiero, como los tipos de cambio.

47	Moneda nocional 2	El campo se cumplimentará indicando la moneda subyacente 2 del par de monedas (la moneda 1 se consignará en el campo 13, moneda nocional 1).	{CURRENCYCODE_3}
48	Tipo de cambio	Tipo de moneda subyacente.	«FXCR»-Tipos cruzados «FXEM»-Mercados emergentes «FXM»-Divisas mayores