

REGLAMENTO (UE) 2019/113 DEL BANCO CENTRAL EUROPEO**de 7 de diciembre de 2018****por el que se modifica el Reglamento (UE) n.º 1333/2014 relativo a las estadísticas de los mercados monetarios (BCE/2018/33)**

EL CONSEJO DE GOBIERNO DEL BANCO CENTRAL EUROPEO,

Visto el Tratado de Funcionamiento de la Unión Europea,

Vistos los Estatutos del Sistema Europeo de Bancos Centrales y del Banco Central Europeo, en particular el artículo 5,

Visto el Reglamento (CE) n.º 2533/98 del Consejo, de 23 de noviembre de 1998, sobre la obtención de información estadística por el Banco Central Europeo ⁽¹⁾, en particular el artículo 5, apartado 1, y el artículo 6, apartado 4,

Consultada la Comisión Europea,

Considerando lo siguiente:

- (1) El Reglamento (UE) n.º 1333/2014 del Banco Central Europeo (BCE/2014/48) ⁽²⁾ exige a los agentes informadores que presenten datos estadísticos que permitan al Sistema Europeo de Bancos Centrales (SEBC), en el cumplimiento de sus funciones, producir estadísticas sobre el mercado monetario del euro.
- (2) Para garantizar la disponibilidad de estadísticas de gran calidad sobre el mercado monetario del euro, es preciso modificar ciertas disposiciones del Reglamento (UE) n.º 1333/2014 (BCE/2014/48). Importa especialmente garantizar que cada agente informador informe al Banco Central Europeo (BCE), o al banco central nacional (BCN) pertinente, de todas las operaciones que haya efectuado con instituciones financieras (salvo los bancos centrales para operaciones sin fines de inversión), con administraciones públicas y con ciertas sociedades no financieras. Además, es preciso velar por que la recopilación de datos se beneficie del uso obligatorio ampliado del identificador de persona jurídica (LEI) en la presentación de información en la Unión.
- (3) Dada la importancia de garantizar la disponibilidad de estadísticas puntuales sobre el mercado monetario del euro, es preciso también armonizar y reforzar las obligaciones de los agentes informadores de presentar puntualmente la información a los BCN o al BCE.
- (4) Debe velarse por que los agentes informadores recopilen, elaboren y presenten la información estadística preservando su integridad. Es importante subrayar en particular que la información estadística que reciban los BCN o el BCE debe ser imparcial, esto es, una representación neutral de las operaciones constatables efectuadas en condiciones de igualdad por el agente informador, además de objetiva y fiable, de manera que se ajuste a los principios generales del Compromiso público del SEBC en relación con las Estadísticas Europeas ⁽³⁾. Asimismo, los agentes informadores deben garantizar que todo error de la información estadística presentada se corrija y comunique lo antes posible al BCE y al BCN pertinente.
- (5) La aplicación de estas disposiciones garantizará que el SEBC se dota de una información estadística del mercado monetario del euro más puntual, completa, detallada, armonizada y fiable, que permitirá analizar más en profundidad el mecanismo de transmisión de la política monetaria. Además, los datos recopilados podrán utilizarse para crear y administrar un tipo de interés de depósito a un día del euro.
- (6) Debe modificarse en consecuencia el Reglamento (UE) n.º 1333/2014 (BCE/2014/48).

⁽¹⁾ DOL 318 de 27.11.1998, p. 8.

⁽²⁾ Reglamento (UE) n.º 1333/2014 del Banco Central Europeo, de 26 de noviembre de 2014, relativo a las estadísticas de los mercados monetarios (BCE/2014/48) (DOL 359 de 16.12.2014, p. 97).

⁽³⁾ Disponible en la dirección del BCE en internet, www.ecb.europa.eu

HA ADOPTADO EL PRESENTE REGLAMENTO:

Artículo 1

Modificaciones

El Reglamento (UE) n.º 1333/2014 (BCE/2014/48) se modifica como sigue:

1) El artículo 1 se modifica como sigue:

a) se inserta el siguiente punto 5 bis:

«5 bis) “instituciones financieras”, las unidades institucionales dotadas de personalidad jurídica que son productores de mercado y cuya actividad principal es la producción de servicios financieros, según el sistema europeo de cuentas revisado (SEC 2010) establecido por el Reglamento (UE) n.º 549/2013 del Parlamento Europeo y del Consejo (*);

(*) Reglamento (UE) n.º 549/2013 del Parlamento Europeo y del Consejo, de 21 de mayo de 2013, relativo al Sistema Europeo de Cuentas Nacionales y Regionales de la Unión Europea (DO L 174 de 26.6.2013, p. 1);

b) se suprimen los puntos 3 a 5;

c) el punto 9 se sustituye por el siguiente:

«9) “estadísticas de los mercados monetarios”, estadísticas relativas a las operaciones con instrumentos del mercado monetario garantizadas, no garantizadas y efectuadas con derivados financieros, concluidas en el período de referencia pertinente entre los agentes informadores e instituciones financieras (salvo los bancos centrales si la operación se efectúa sin fines de inversión), administraciones públicas, o ciertas sociedades no financieras clasificadas como mayoristas según el marco del coeficiente de cobertura de liquidez Basilea III, y excluidas las operaciones intragrupo»;

d) el punto 14 se sustituye por el siguiente:

«14) “población informadora de referencia”, las IFM residentes en la zona del euro, excepto los bancos centrales y los FMM, que reciban depósitos denominados en euros o emitan cualquier otro instrumento de deuda u otorguen préstamos denominados en euros de los enumerados en los anexos I, II o III, de/a otras instituciones financieras, administraciones públicas o sociedades no financieras»;

e) se inserta el siguiente punto 20 bis:

«20 bis) “entidad de crédito”, lo mismo que en el artículo 4, apartado 1, punto 1, del Reglamento (UE) n.º 575/2013 del Parlamento Europeo y del Consejo (*);

(*) Reglamento (UE) n.º 575/2013 del Parlamento Europeo y del Consejo, de 26 de junio de 2013, sobre los requisitos prudenciales de las entidades de crédito y las empresas de inversión, y por el que se modifica el Reglamento (UE) n.º 648/2012 (DO L 176 de 27.6.2013, p. 1).»;

f) el punto 25 se sustituye por el siguiente:

«25) “swap sobre índices a un día”, un swap de tipos de interés en el que el tipo de interés variable es igual a la media geométrica de un tipo de interés a un día (o índice a un día) durante un período determinado. El pago final se calculará como la diferencia entre el tipo de interés fijo y el tipo de interés compuesto a un día registrado durante la vida del swap sobre índices a un día aplicado al importe nominal de la operación».

2) El artículo 3 se modifica como sigue:

a) el apartado 1 se sustituye por el siguiente:

«1. A efectos de la producción periódica de estadísticas de los mercados monetarios, los agentes informadores presentarán al BCN del Estado miembro en el que residan, con carácter consolidado, incluso respecto de todas sus sucursales de la Unión y la AELC, información estadística diaria relativa a los instrumentos del mercado monetario. La información estadística exigida se especifica en los anexos I, II y III. Los agentes informadores la presentarán según las normas mínimas de transmisión, exactitud, conformidad conceptual, revisión e integridad de la información establecidas en el anexo IV. El BCN transmitirá la información estadística que reciba de los agentes informadores al BCE de conformidad con el artículo 4, apartado 2, del presente Reglamento»;

b) el apartado 2 se sustituye por el siguiente:

«2. Los BCN establecerán e implementarán los procedimientos de presentación de información que deban seguir los agentes informadores en relación con los instrumentos del mercado monetario. Estos procedimientos de presentación de información garantizarán la presentación de la información estadística exigida y permitirán comprobar fielmente el cumplimiento de las normas mínimas establecidas en el anexo IV»;

c) el apartado 5 se sustituye por el siguiente:

«5. Los BCN establecerán e implementarán los procedimientos de presentación de información aplicables a los agentes informadores adicionales de acuerdo con sus exigencias nacionales de presentación de información estadística. Los BCN velarán por que los procedimientos nacionales de presentación de información exijan a los agentes informadores adicionales el cumplimiento de requisitos equivalentes a los establecidos en los artículos 6 a 8, artículo 10, apartado 3, artículo 11 y artículo 12, del presente Reglamento. Los BCN velarán por que dichos procedimientos permitan obtener la información estadística exigida y comprobar fielmente el cumplimiento de las normas mínimas establecidas en el anexo IV»;

3) El artículo 4 se modifica como sigue:

a) el apartado 1 se sustituye por el siguiente:

«1. En el caso de que un BCN decida en virtud del artículo 3, apartado 3, que los agentes informadores presenten la información estadística especificada en los anexos I, II y III directamente al BCE, los agentes informadores transmitirán dicha información al BCE una vez al día entre las 18:00 horas de la fecha de contratación y las 7:00 horas, hora central europea (*), del primer día de liquidación en TARGET2 después de la fecha de contratación.

(*) La hora central europea tiene en cuenta el cambio a la hora central europea de verano»;

b) el apartado 2 se sustituye por el siguiente:

«2. En cualquier caso distinto del mencionado en el apartado 1, los BCN transmitirán diariamente la información estadística de los mercados monetarios a que se refieren los anexos I, II y III recibida de los agentes informadores seleccionados en virtud del artículo 2, apartados 2, 3 y 4, o de los agentes informadores adicionales seleccionados en virtud del artículo 2, apartado 6, al BCE, una vez al día, antes de las 7:00 horas, hora central europea, del primer día de liquidación en TARGET2 después de la fecha de contratación»;

c) se añade el siguiente apartado 5:

«5. Al evaluar si un agente informador ha cumplido las obligaciones del presente artículo, la infracción de cualquiera de las normas mínimas de transmisión establecidas en el anexo IV, apartado 1, incisos i) y ii), se considerará incumplimiento del mismo tipo de obligación de presentación de información a efectos de determinar el incumplimiento en el marco de incumplimiento estadístico del BCE».

4) Se suprime el artículo 5.

5) El anexo I del Reglamento (UE) n.º 1333/2014 (BCE/2014/48) se sustituye por el texto del anexo I del presente Reglamento.

6) El anexo II del Reglamento (UE) n.º 1333/2014 (BCE/2014/48) se sustituye por el texto del anexo II del presente Reglamento.

7) El anexo III del Reglamento (UE) n.º 1333/2014 (BCE/2014/48) se sustituye por el texto del anexo III del presente Reglamento.

8) El anexo IV del Reglamento (UE) n.º 1333/2014 (BCE/2014/48) se sustituye por el texto del anexo IV del presente Reglamento.

Artículo 2

Disposiciones finales

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

y será de aplicación a partir del 15 de marzo de 2019.

El presente Reglamento será obligatorio en todos sus elementos y directamente aplicable en los Estados miembros de conformidad con los Tratados.

Hecho en Fráncfort del Meno, el 7 de diciembre de 2018.

Por el Consejo de Gobierno del BCE

El Presidente del BCE

Mario DRAGHI

ANEXO I

«ANEXO I

Sistema de presentación de información de las estadísticas de los mercados monetarios relativas a operaciones garantizadas

PARTE 1

TIPO DE INSTRUMENTOS

Los agentes informadores presentarán al Banco Central Europeo (BCE) o al banco central nacional (BCN) pertinente información de todos los acuerdos de recompra y operaciones realizadas en virtud de los mismos, incluidas las compraventas con pacto de recompra con un tercer agente, que estén denominadas en euros y tengan un plazo de vencimiento de hasta un año (definidas como operaciones con una fecha de vencimiento de un máximo de 397 días después de la fecha de liquidación), que concluyan con instituciones financieras (salvo los bancos centrales si la operación se efectúa sin fines de inversión), administraciones públicas, o sociedades no financieras clasificadas como mayoristas según el marco del coeficiente de cobertura de liquidez Basilea III. Se excluyen las operaciones intragrupo.

PARTE 2

TIPO DE DATOS

1. Tipo de datos basados en operaciones (*) que deben presentarse por cada operación:

Campo	Descripción de los datos	Opción alternativa de presentación de información (en su caso) y otras cualificaciones
Reported transaction status (Estado de la operación presentada)	Este atributo especifica si la operación es nueva, o una modificación, cancelación o corrección de una operación presentada anteriormente.	
Novation status (Estado de novación)	Este atributo especifica si la operación es una novación.	
Unique transaction identifier (Identificador único de la operación)	Código único que permite identificar una operación en el segmento del mercado correspondiente.	Este dato debe presentarse si está disponible.
Proprietary transaction identification (Identificación de operación propia)	Identificador único interno que utiliza el agente informador para cada operación. La identificación de operación propia es única para cada operación presentada por segmento del mercado monetario y agente informador.	
Related proprietary transaction identification (Identificación de operación propia conexa)	Identificador único interno que utiliza el agente informador para la operación inicial posteriormente novada.	Este dato debe presentarse si procede.
Counterparty proprietary transaction identification (Identificación de operación propia de entidad de contrapartida)	Identificación de operación propia que la entidad de contrapartida del agente informador asigna a la misma operación.	Este dato debe presentarse si está disponible.

Campo	Descripción de los datos	Opción alternativa de presentación de información (en su caso) y otras cualificaciones
Counterparty identification (Identificación de entidad de contrapartida)	Código de identificación utilizado para reconocer a la entidad de contrapartida del agente informador para la operación presentada.	Debe usarse el identificador de la persona jurídica (LEI) siempre que la entidad de contrapartida lo tenga asignado. En caso contrario, debe presentarse el sector y la ubicación de la entidad de contrapartida.
Counterparty sector (Sector de la entidad de contrapartida)	Sector institucional de la entidad de contrapartida.	Dato obligatorio si no se presenta la identificación de la entidad de contrapartida.
Counterparty location (Ubicación de la entidad de contrapartida)	Código de país de la Organización Internacional de Normalización (ISO) para el país en el que esté constituida la entidad de contrapartida.	Dato obligatorio si no se presenta la identificación de la entidad de contrapartida.
Tri-party agent identification (Identificación de tercer agente)	Identificador de entidad de contrapartida del tercer agente.	Este dato debe presentarse para las operaciones con tercer agente. Debe usarse el LEI siempre que el agente lo tenga asignado.
Reporting date (Fecha de presentación de la información)	Fecha de inicio y final y hora del período al que se refieren los datos de la operación archivados.	
Electronic time stamp (Marca horaria electrónica)	Hora a la que se concluye o anota la operación.	
Trade date (Fecha de contratación)	Fecha en la que las partes concluyen la operación financiera.	
Settlement date (Fecha de liquidación)	Fecha en la que el efectivo se intercambia inicialmente por el activo conforme a lo acordado contractualmente.	En el caso de renovación de operaciones de recompra abiertas, esta es la fecha en la que se liquida la renovación, incluso aunque no tenga lugar un intercambio de efectivo.
Maturity date (Fecha de vencimiento)	Fecha de recompra, esto es, la fecha en la que el efectivo debe devolverse o recibirse a cambio del activo aportado o recibido en garantía.	
Transaction type (Tipo de operación)	Este atributo especifica si la operación se efectúa para tomar prestado o prestar efectivo.	
Transaction nominal amount (Valor nominal de la operación)	Importe en euros recibido o prestado inicialmente.	
Rate type (Clase de tipo de interés)	Indica si el instrumento tiene interés fijo o variable.	
Deal rate (Tipo de interés de la operación)	Tipo de interés expresado de conformidad con la convención del mercado monetario ACT/360 con el que se concluyó el acuerdo de recompra y con el que debe remunerarse el préstamo de efectivo.	Este dato solo debe presentarse para instrumentos de tipo de interés fijo.

Campo	Descripción de los datos	Opción alternativa de presentación de información (en su caso) y otras cualificaciones
Reference rate index (Índice del tipo de referencia)	Número Internacional de Identificación de Valores (ISIN) del tipo de referencia subyacente en función del cual se calculan los pagos periódicos de intereses.	Este dato solo debe presentarse para instrumentos de tipo de interés variable.
Basis point spread (Diferencial de puntos básicos)	Número de puntos básicos añadidos (en caso de ser positivos) o sustraídos (en caso de ser negativos) del tipo de referencia subyacente para calcular el tipo de interés efectivo aplicable durante un período determinado a la emisión del instrumento de tipo de interés variable.	Este dato solo debe presentarse para instrumentos de tipo de interés variable.
Collateral ISIN (ISIN del activo de garantía)	ISIN del activo aportado en garantía.	La presentación de este dato es opcional para compraventas con pacto de recompra con un tercer agente no efectuadas contra una cesta de valores para la que exista un ISIN genérico, o para tipos de activos de garantía para los que no se disponga de ISIN. Si no se presenta el ISIN del activo aportado en garantía, debe presentarse el tipo de activo de garantía, el sector de su emisor, y el conjunto de cobertura.
Collateral pool (Conjunto de cobertura)	Indica si el activo aportado en garantía es un conjunto de cobertura.	
Collateral type (Tipo de activo de garantía)	Identifica la clase de activo aportado como garantía.	Dato obligatorio si no se presenta el ISIN del activo de garantía.
Collateral issuer sector (Sector del emisor del activo de garantía)	Sector institucional del emisor del activo de garantía.	Dato obligatorio si no se presenta el ISIN del activo de garantía.
Special collateral indicator (Indicador del activo de garantía específico)	Identifica todos los acuerdos de recompra efectuados con activos de garantía genéricos y con activos de garantía específicos.	El agente informador debe presentar este dato solo si le es posible.
Collateral nominal amount (Valor nominal del activo de garantía)	Valor nominal en euros de los activos aportados como garantía.	Dato opcional para las compraventas con pacto de recompra con un tercer agente y cualquier otra operación en la que los activos aportados no se identifiquen por el ISIN.
Collateral haircut (Recorte de valoración del activo de garantía)	Medida de control de riesgos aplicada al activo de garantía subyacente por la cual el valor de dicho activo se calcula como su valor de mercado reducido en un determinado porcentaje (recorte).	La presentación de este dato es obligatoria para las operaciones con un único activo de garantía y opcional en los demás casos.

2. Umbral de importancia relativa:

Solo deberán presentarse las operaciones con sociedades no financieras clasificadas como mayoristas de conformidad con el marco del coeficiente de cobertura de liquidez Basilea III (**).

(*) Las normas de presentación de información electrónica y las especificaciones técnicas de los datos se establecen por separado y pueden consultarse en la dirección del BCE en internet, www.ecb.europa.eu.

(**) Véase "Basilea III: El coeficiente de cobertura de liquidez y las herramientas de seguimiento del riesgo de liquidez", Comité de Supervisión Bancaria de Basilea, enero de 2013, pp. 23 a 27, disponible en la dirección del Banco de Pagos Internacionales en internet, www.bis.org.

ANEXO II

«ANEXO II

Sistema de presentación de información de las estadísticas de los mercados monetarios relativas a operaciones no garantizadas

PARTE 1

TIPO DE INSTRUMENTOS

1. Los agentes informadores presentarán al Banco Central Europeo (BCE) o al banco central nacional (BCN) pertinente:
 - a) todos los préstamos que utilicen los instrumentos descritos en el cuadro siguiente que estén denominados en euros y tengan un vencimiento de hasta un año (definidos como operaciones con una fecha de vencimiento de un máximo de 397 días después de la fecha de liquidación), tomados de instituciones financieras (salvo los bancos centrales si la operación se efectúa sin fines de inversión), administraciones públicas, o sociedades no financieras clasificadas como mayoristas según el marco del coeficiente de cobertura de liquidez Basilea III;
 - b) todos los préstamos denominados en euros concedidos a otras entidades de crédito con un vencimiento de hasta un año (definidos como operaciones con una fecha de vencimiento de un máximo de 397 días desde la fecha de liquidación) a través de depósitos no garantizados o cuentas a la vista o a través de la adquisición de pagarés de empresa, certificados de depósito, bonos a tipo de interés variable y otros valores representativos de deuda de las entidades de crédito emisoras con una fecha de vencimiento de hasta un año.

Las operaciones intragrupo quedarán excluidas a los efectos del presente apartado.

2. El cuadro siguiente ofrece una descripción detallada y normalizada de las categorías de instrumentos en operaciones respecto de las cuales los agentes informadores deben presentar información al BCE. En el caso de que los agentes informadores deban informar de las operaciones a sus BCN, el BCN pertinente deberá transponer a nivel nacional estas descripciones de categorías de instrumentos de conformidad con el presente Reglamento.

Tipo de instrumento	Descripción
Deposits (Depósitos)	Depósitos remunerados no garantizados (incluidas las cuentas a la vista pero excluidas las cuentas corrientes) que estén disponibles con preaviso o tengan un vencimiento no superior a un año, es decir, de un máximo de 397 días desde la fecha de liquidación, y que hayan sido recibidos o colocados por el agente informador.
Call accounts/Call money (Cuentas a la vista)	Cuentas de efectivo con un tipo de interés aplicable que cambia diariamente y da lugar al pago o cómputo de intereses a intervalos regulares y de las cuales se pueden retirar fondos con preaviso. Cuenta de ahorro de la que se pueden retirar fondos con preaviso.
Certificate of deposit (Certificado de depósito)	Instrumento de renta fija negociable o no negociable emitido por una IFM que confiere al titular el derecho a un tipo de interés fijo específico durante un período fijo de tiempo de hasta un año, es decir, de un máximo de 397 días desde la fecha de liquidación, y que está remunerado o emitido al descuento.
Commercial paper (Pagarés de empresa)	Instrumento de deuda no garantizado emitido por una IFM que tiene un vencimiento no superior a un año, es decir, de un máximo de 397 días desde la fecha de liquidación, y que está remunerado o emitido al descuento.
Asset backed commercial paper (Pagarés de empresa respaldados por activos)	Instrumento de deuda emitido por una IFM que tiene un vencimiento no superior a un año, es decir, de un máximo de 397 días desde la fecha de liquidación, que está remunerado o emitido al descuento, y que está respaldado por algún tipo de activo de garantía.
Floating rate note (Bono a tipo de interés variable)	Instrumento de deuda en el que los pagos de intereses periódicos se calculan en función del valor, es decir, fijando un tipo de referencia subyacente como el tipo de interés de oferta en el mercado interbancario del euro (Euribor), en fechas predefinidas conocidas como fechas de fijación, y que tiene un vencimiento no superior a un año, es decir, de un máximo de 397 días desde la fecha de liquidación.

Tipo de instrumento	Descripción
Other short-term debt securities (Otros valores representativos de deuda a corto plazo)	<p>Valores no subordinados distintos de acciones con vencimiento de hasta un año, es decir, de un máximo de 397 días desde la fecha de liquidación, emitidos por los agentes informadores, que son instrumentos normalmente negociables y que se negocian en mercados secundarios o que pueden compensarse en el mercado y que no otorgan al titular derechos de propiedad sobre la entidad emisora. Esta partida incluye:</p> <p>a) valores que otorgan al titular un derecho incondicional a una renta fija o determinada contractualmente en forma de pago de cupones o un importe fijo y declarado en una fecha (o fechas) determinada(s) o que comienza a partir de una fecha establecida en el momento de la emisión;</p> <p>b) instrumentos no negociables emitidos por los agentes informadores y que luego se transforman en negociables y se reclasifican como “valores representativos de deuda”.</p>

PARTE 2

TIPO DE DATOS

1. Tipo de datos basados en operaciones (*) que deben presentarse por cada operación:

Campo	Descripción de los datos	Opción alternativa de presentación de información (en su caso) y otras cualificaciones
Reported transaction status (Estado de la operación presentada)	Este atributo especifica si la operación es nueva, o una modificación, cancelación o corrección de una operación presentada anteriormente.	
Novation status (Estado de novación)	Este atributo especifica si la operación es una novación.	
Unique transaction identifier (Identificador único de la operación)	Código único que permite identificar una operación en el segmento del mercado correspondiente.	Este dato debe presentarse si está disponible.
Proprietary transaction identification (Identificación de operación propia)	Identificador único interno que utiliza el agente informador para cada operación. La identificación de operación propia es única para cada operación presentada por segmento del mercado monetario y agente informador.	
Related proprietary transaction identification (Identificación conexa de operación propia)	Identificador único interno que utiliza el agente informador para la operación inicial posteriormente novada.	Este dato debe presentarse si procede.
Counterparty proprietary transaction identification (Identificación de entidad de contrapartida de operación propia)	Identificación de operación propia que la entidad de contrapartida del agente informador asigna a la misma operación.	Este dato debe presentarse si está disponible.

Campo	Descripción de los datos	Opción alternativa de presentación de información (en su caso) y otras cualificaciones
Counterparty identification (Identificación de entidad de contrapartida)	Código de identificación utilizado para reconocer a la entidad de contrapartida del agente informador para la operación presentada.	Debe usarse el identificador de la persona jurídica (LEI) siempre que la entidad de contrapartida lo tenga asignado. En caso contrario, debe presentarse el sector y la ubicación de la entidad de contrapartida.
Counterparty sector (Sector de la entidad de contrapartida)	Sector institucional de la entidad de contrapartida.	Dato obligatorio si no se presenta la identificación de la entidad de contrapartida.
Counterparty location (Ubicación de la entidad de contrapartida)	Código de país de la Organización Internacional de Normalización (ISO) para el país en el que esté constituida la entidad de contrapartida.	Dato obligatorio si no se presenta la identificación de la entidad de contrapartida.
Reporting date (Fecha de presentación de la información)	Fecha de inicio y final y hora del período al que se refieren los datos de la operación archivados.	
Electronic time stamp (Marca horaria electrónica)	Hora a la que se concluye o anota la operación.	
Trade date (Fecha de contratación)	Fecha en la que las partes concluyen la operación financiera.	
Settlement date (Fecha de liquidación)	Fecha en la que el efectivo se intercambia por las entidades de contrapartida o en la que se liquida la adquisición o venta de un instrumento de deuda.	En el caso de cuentas a la vista y otras cuentas de préstamos no garantizados disponibles con preaviso, la fecha en la que se renueva el depósito (es decir, en la que se habría pagado de no haber sido cancelado o no renovado).
Maturity date (Fecha de vencimiento)	Fecha en la que el prestatario debe pagar el efectivo al prestamista o en la que vence el instrumento de deuda y debe devolverse.	
Instrument type (Tipo de instrumento)	Instrumento a través del cual tiene lugar el préstamo.	
Transaction type (Tipo de operación)	Este atributo especifica si la operación se efectúa para tomar prestado o prestar efectivo.	
Transaction nominal amount (Valor nominal de la operación)	Efectivo en euros tomado o dado en préstamo en depósitos. En el caso de valores representativos de deuda, es el valor nominal de los valores emitidos o adquiridos.	
Transaction deal price (Precio de contratación de la operación)	El precio bruto (es decir, incluido el interés devengado) al que se emite o negocia el valor, en puntos porcentuales.	Dato igual a 100 para los depósitos no garantizados.
Rate type (Clase de tipo de interés)	Indica si el instrumento tiene interés fijo o variable.	

Campo	Descripción de los datos	Opción alternativa de presentación de información (en su caso) y otras cualificaciones
Deal rate (Tipo de interés de la operación)	Tipo de interés, expresado de conformidad con la convención del mercado monetario ACT/360, con el que se realizó el depósito y con el que se remunera el préstamo de efectivo. En el caso de instrumentos de deuda, es el tipo de interés efectivo, expresado de acuerdo con la convención del mercado monetario ACT/360, con el que se emitió o adquirió el instrumento.	Este dato solo debe presentarse para instrumentos de tipo de interés fijo.
Reference rate index (Índice del tipo de referencia)	Número Internacional de Identificación de Valores (ISIN) del tipo de referencia subyacente en función del cual se calculan los pagos periódicos de intereses.	Este dato solo debe presentarse para instrumentos de tipo de interés variable.
Basis point spread (Diferencial de puntos básicos)	Número de puntos básicos añadidos (en caso de ser positivos) o sustraídos (en caso de ser negativos) del tipo de referencia subyacente para calcular el tipo de interés efectivo aplicable durante un período determinado a la emisión del instrumento de tipo de interés variable.	Este dato solo debe presentarse para instrumentos de tipo de interés variable.
Call or put (Opción de compra o de venta)	Indica si el instrumento tiene una opción de compra o de venta.	Este dato solo debe presentarse para instrumentos con opción de compra o de venta.
First call/put date (Primera fecha de opción de compra o de venta)	Primera fecha en la que pueden ejercerse las opciones de compra o de venta.	Este dato solo debe presentarse para instrumentos con opción de compra o de venta en una o varias fechas preestablecidas.
Call/put notice period (Plazo de preaviso de la opción de compra o de venta)	Número de días naturales que el titular/emisor del instrumento debe dar al emisor/titular del instrumento antes de ejercer la opción de compra o de venta.	Este dato solo debe presentarse para instrumentos/operaciones con opción de compra o de venta con plazo de preaviso y para depósitos disponibles con un plazo de preaviso acordado previamente.

2. Umbral de importancia relativa:

Solo deberán presentarse las operaciones con sociedades no financieras clasificadas como mayoristas de conformidad con el marco del coeficiente de cobertura de liquidez Basilea III.

(*) Las normas de presentación de información electrónica y las especificaciones técnicas de los datos se establecen por separado y pueden consultarse en la dirección del BCE en internet, www.ecb.europa.eu»

ANEXO III

«ANEXO III

Sistema de presentación de información de las estadísticas de los mercados monetarios relativas a operaciones de derivados

PARTE 1

TIPO DE INSTRUMENTOS

Los agentes informadores presentarán al Banco Central Europeo (BCE) o al banco central nacional (BCN) pertinente:

- a) las operaciones de swaps de divisas en las que se compren o vendan euros al contado a cambio de una moneda extranjera y se revendan o recompren en una fecha futura a un tipo de cambio a plazo predeterminado con un vencimiento de hasta un año (definidas como operaciones con una fecha de vencimiento de un máximo de 397 días después de la fecha de liquidación del tramo al contado de la operación de swap de divisas), concluidas con instituciones financieras (salvo los bancos centrales si la operación se efectúa sin fines de inversión), administraciones públicas, o sociedades no financieras clasificadas como mayoristas según el marco del coeficiente de cobertura de liquidez Basilea III;
- b) las operaciones de swap sobre índices a un día denominadas en euros concluidas con instituciones financieras (salvo los bancos centrales si la operación se efectúa sin fines de inversión), administraciones públicas, o sociedades no financieras clasificadas como mayoristas según el marco del coeficiente de cobertura de liquidez Basilea III.

Las operaciones intragrupo quedarán excluidas a los efectos de la presente parte.

PARTE 2

TIPO DE DATOS

1. Tipo de datos basados en operaciones (*) para operaciones de swap de divisas que deben presentarse por cada operación:

Campo	Descripción de los datos	Opción alternativa de presentación de información (en su caso) y otras cualificaciones
Reported transaction status (Estado de la operación presentada)	Este atributo especifica si la operación es nueva, o una modificación, cancelación o corrección de una operación presentada anteriormente.	
Novation status (Estado de novación)	Este atributo especifica si la operación es una novación.	
Unique transaction identifier (Identificador único de la operación)	Código único que permite identificar una operación en el segmento del mercado correspondiente.	Este dato debe presentarse si está disponible.
Proprietary transaction identification (Identificación de operación propia)	Identificador único interno que utiliza el agente informador para cada operación. La identificación de operación propia es única para cada operación presentada por segmento del mercado monetario y agente informador.	
Related proprietary transaction identification (Identificación conexa de operación propia)	Identificador único interno que utiliza el agente informador para la operación inicial posteriormente novada.	Este dato debe presentarse si procede.
Counterparty proprietary transaction identification (Identificación de entidad de contrapartida de operación propia)	Identificación de operación propia que la entidad de contrapartida del agente informador asigna a la misma operación.	Este dato debe presentarse si está disponible.

Campo	Descripción de los datos	Opción alternativa de presentación de información (en su caso) y otras cualificaciones
Counterparty identification (Identificación de entidad de contrapartida)	Código de identificación utilizado para reconocer a la entidad de contrapartida del agente informador para la operación presentada.	Debe usarse el identificador de la persona jurídica (LEI) siempre que la entidad de contrapartida lo tenga asignado. En caso contrario, debe presentarse el sector y la ubicación de la entidad de contrapartida.
Counterparty sector (Sector de la entidad de contrapartida)	Sector institucional de la entidad de contrapartida.	Dato obligatorio si no se presenta la identificación de la entidad de contrapartida.
Counterparty location (Ubicación de la entidad de contrapartida)	Código de país de la Organización Internacional de Normalización (ISO) para el país en el que esté constituida la entidad de contrapartida.	Dato obligatorio si no se presenta la identificación de la entidad de contrapartida.
Reporting date (Fecha de presentación de la información)	Fecha de inicio y final y hora del período al que se refieren los datos de la operación archivados.	
Electronic time stamp (Marca horaria electrónica)	Hora a la que se concluye o anota la operación.	
Trade date (Fecha de contratación)	Fecha en la que las partes concluyen la operación financiera presentada.	
Spot value date (Fecha valor al contado)	Fecha en la que una parte vende a la otra un importe determinado de una divisa determinada a cambio del pago de un importe determinado de una divisa diferente sobre la base de un tipo de cambio acordado conocido como tipo de cambio al contado.	
Maturity date (Fecha de vencimiento)	Fecha en la que expira la operación de swap de divisas y se recompra la moneda vendida en la fecha valor al contado.	
Foreign exchange transaction type (Tipo de operación de divisas)	Este atributo especifica si el importe en euros del que se ha informado en el importe nominal de la operación se ha comprado o vendido en la fecha valor al contado. Debe referirse al tipo al contado en euros, es decir, a si se compran o venden en la fecha valor al contado.	
Transaction nominal amount (Valor nominal de la operación)	Importe nominal en euros del swap de divisas.	
Foreign currency code (Código de divisa)	Código ISO internacional de tres dígitos de la moneda comprada o vendida a cambio de euros.	
Foreign exchange spot rate (Tipo de cambio al contado)	Tipo de cambio entre el euro y la moneda extranjera aplicable al primer tramo de la operación de swap de divisas.	

Campo	Descripción de los datos	Opción alternativa de presentación de información (en su caso) y otras cualificaciones
Foreign exchange forward points (Puntos de cambio a plazo)	Diferencia entre el tipo de cambio al contado y el tipo de cambio a plazo expresado en puntos básicos cotizados de conformidad con las convenciones de mercado vigentes para el par de monedas.	

2. Tipo de datos basados en operaciones para operaciones de swap sobre índices a un día que deben presentarse por cada operación:

Campo	Descripción de los datos	Opción alternativa de presentación de información (en su caso) y otras cualificaciones
Reported transaction status (Estado de la operación presentada)	Este atributo especifica si la operación es nueva, o una modificación, cancelación o corrección de una operación presentada anteriormente.	
Novation status (Estado de novación)	Este atributo especifica si la operación es una novación.	
Unique transaction identifier (Identificador único de la operación)	Código único que permite identificar una operación en el segmento del mercado correspondiente.	Este dato debe presentarse si está disponible.
Proprietary transaction identification (Identificación de operación propia)	Identificador único interno que utiliza el agente informador para cada operación. La identificación de operación propia es única para cada operación presentada por segmento del mercado monetario y agente informador.	
Related proprietary transaction identification (Identificación conexa de operación propia)	Identificador único interno que utiliza el agente informador para la operación inicial posteriormente novada.	Este dato debe presentarse si procede.
Counterparty proprietary transaction identification (Identificación de entidad de contrapartida de operación propia)	Identificación de operación propia que la entidad de contrapartida del agente informador asigna a la misma operación.	Este dato debe presentarse si está disponible.
Counterparty identification (Identificación de entidad de contrapartida)	Código de identificación utilizado para reconocer a la entidad de contrapartida del agente informador para la operación presentada.	Debe usarse el identificador de la persona jurídica (LEI) siempre que la entidad de contrapartida lo tenga asignado. En caso contrario, debe presentarse el sector y la ubicación de la entidad de contrapartida.
Counterparty sector (Sector de la entidad de contrapartida)	Sector institucional de la entidad de contrapartida.	Dato obligatorio si no se presenta la identificación de la entidad de contrapartida.
Counterparty location (Ubicación de la entidad de contrapartida)	Código de país ISO para el país en el que esté constituida la entidad de contrapartida.	Dato obligatorio si no se presenta la identificación de la entidad de contrapartida.
Reporting date (Fecha de presentación de la información)	Fecha de inicio y final y hora del período al que se refieren los datos de la operación archivados.	

Campo	Descripción de los datos	Opción alternativa de presentación de información (en su caso) y otras cualificaciones
Electronic time stamp (Marca horaria electrónica)	Hora a la que se concluye o anota la operación.	Opcional.
Trade date (Fecha de contratación)	Fecha en la que las partes concluyen la operación financiera.	
Start date (Fecha de inicio)	Fecha en la que se computa el tipo de interés a un día del tramo variable.	
Maturity date (Fecha de vencimiento)	Última fecha del tramo sobre el que se calcula el tipo de interés compuesto a un día.	
Fixed interest rate (Tipo de interés fijo)	Tipo de interés fijo que se utiliza en el cálculo del pago de los swaps sobre índices a un día.	
Transaction type (Tipo de operación)	Este atributo especifica si el agente informador paga o recibe el tipo de interés fijo.	
Transaction nominal amount (Valor nominal de la operación)	Importe notional de los swaps sobre índices a un día.	

3. Umbral de importancia relativa:

Solo deberán presentarse las operaciones con sociedades no financieras clasificadas como mayoristas de conformidad con el marco del coeficiente de cobertura de liquidez Basilea III.

(*) Las normas de presentación de información electrónica y las especificaciones técnicas de los datos se establecen por separado y pueden consultarse en la dirección del BCE en internet, www.ecb.europa.eu

ANEXO IV

«ANEXO IV

Normas mínimas que debe aplicar la población informadora real

Los agentes informadores deben aplicar las siguientes normas mínimas para cumplir las exigencias de información estadística del Banco Central Europeo (BCE).

1. Normas mínimas de transmisión:

- i) la información debe presentarse puntualmente en los plazos establecidos por el BCE y el banco central nacional (BCN) pertinente;
- ii) la información estadística debe ajustarse a la forma y al formato de las exigencias técnicas de presentación de información estipuladas por el BCE y el BCN pertinente;
- iii) el agente informador debe facilitar al BCE y al BCN pertinente los datos de una o varias personas de contacto;
- iv) deben respetarse las especificaciones técnicas para la transmisión de datos al BCE y al BCN pertinente.

2. Normas mínimas de exactitud:

- i) la información estadística debe ser correcta;
- ii) los agentes informadores deben poder facilitar información sobre los hechos que se derivan de los datos proporcionados;
- iii) la información estadística debe ser completa y no contener lagunas continuas ni estructurales; las lagunas existentes deben señalarse expresamente, explicarse al BCE y al BCN pertinente y, en su caso, completarse lo antes posible;
- iv) los agentes informadores deben respetar las dimensiones, las instrucciones de redondeo y los decimales establecidos por el BCN pertinente para la transmisión técnica de datos.

3. Normas mínimas de conformidad conceptual:

- i) la información estadística debe ajustarse a las definiciones y clasificaciones contenidas en el presente Reglamento;
- ii) en caso de producirse desviaciones con respecto a dichas definiciones y clasificaciones, los agentes informadores deben supervisar periódicamente y cuantificar la diferencia entre la medida utilizada y la medida contemplada en el presente Reglamento;
- iii) los agentes informadores deben poder explicar toda falta de datos en relación con las cifras de períodos anteriores.

4. Normas mínimas de revisión:

Deben aplicarse la política y los procedimientos de revisión establecidos por el BCE y el BCN pertinente. Las revisiones extraordinarias deben ir acompañadas de notas explicativas.

5. Normas mínimas de integridad:

- i) los agentes informadores deben elaborar y presentar la información estadística de manera imparcial y objetiva;
 - ii) los agentes informadores deben corregir y presentar al BCE y al BCN pertinente, lo antes posible, los errores de la información presentada.»
-