



Consejo de la  
Unión Europea

Bruselas, 17 de junio de 2022  
(OR. en)

10384/22

EF 178  
ECOFIN 637  
DELECT 97

#### NOTA DE TRANSMISIÓN

---

De:	Por la secretaria general de la Comisión Europea, D. <sup>a</sup> Martine DEPREZ, directora
A:	D. Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, secretario general del Consejo de la Unión Europea
N.º doc. Ción.:	C(2022) 3581 final
Asunto:	REGLAMENTO DELEGADO (UE) .../... DE LA COMISIÓN de 10.6.2022 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

---

Adjunto se remite a las Delegaciones el documento – C(2022) 3581 final.

---

Adj.: C(2022) 3581 final



Bruselas, 10.6.2022  
C(2022) 3581 final

**REGLAMENTO DELEGADO (UE) .../... DE LA COMISIÓN**

**de 10.6.2022**

**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**

(Texto pertinente a efectos del EEE)

## **EXPOSICIÓN DE MOTIVOS**

### **1. CONTEXTO DEL ACTO DELEGADO**

El Reglamento (UE) 2019/834 del Parlamento Europeo y del Consejo, de 20 de mayo de 2019, que modifica el Reglamento (UE) n.º 648/2012 (EMIR REFIT), introduce varias habilitaciones para que la AEVM elabore normas técnicas de ejecución y de regulación relativas al marco de notificación con arreglo al EMIR.

En particular, el artículo 78, apartado 10, de este Reglamento exige a la AEVM que elabore normas técnicas de regulación que especifiquen los procedimientos de conciliación de los datos entre registros de operaciones y los que estos han de aplicar para verificar que los datos notificados con arreglo al artículo 9 sean completos y correctos.

### **2. CONSULTAS PREVIAS A LA ADOPCIÓN DEL ACTO**

#### ***Aspectos relacionados con el procedimiento***

La AEVM llevó a cabo una consulta pública sobre su proyecto de normas técnicas de regulación y de ejecución entre el 26 de marzo de 2020 y el 3 de julio de 2020. La AEVM recibió en total cuarenta y una respuestas públicas y diez respuestas confidenciales.

#### ***Posición de las partes interesadas***

##### **Verificación de los derivados por un registro de operaciones**

Un elemento clave para el correcto funcionamiento del régimen de notificación con arreglo al EMIR y para garantizar la calidad de la notificación de derivados es la validación por los registros de operaciones de los datos presentados por las contrapartes que están sujetas a la obligación de notificación. Aunque el artículo 9, apartado 1 *sexies*, del EMIR, modificado por el EMIR REFIT, establece que «[las] contrapartes y las ECC que deban notificar los detalles de los contratos de derivados velarán por que no se produzcan repeticiones en la notificación de dichos detalles», con el artículo 78, apartado 9, y con el artículo 78, apartado 10, del EMIR, modificado por el EMIR REFIT, también atribuye a los registros de operaciones responsabilidades en relación con los procedimientos de verificación de los datos.

En el documento de consulta, la AEVM propuso un marco para la recogida y la validación de datos por parte de los registros de operaciones.

A fin de garantizar la seguridad jurídica en relación con el cumplimiento de la obligación de notificación al establecer los procedimientos de verificación por parte de los registros de operaciones, la AEVM propuso rechazar los datos no notificados de conformidad con los requisitos del artículo 9 del EMIR, en lugar de enviar únicamente advertencias a la entidad pertinente.

La mayoría de los consultados apoyó la propuesta de marco de la AEVM y convino en que contribuiría a la calidad general de los datos.

##### **Procedimiento para la actualización de los identificadores de las entidades jurídicas (LEI)**

En el documento de consulta, la AEVM destacó la importancia del proceso que deben aplicar los registros de operaciones y las contrapartes en caso de que se produzcan cambios en los LEI debido a fusiones, adquisiciones u otros actos de reestructuración empresarial. La mayoría de los consultados se mostró de acuerdo con la propuesta de la AEVM de aclarar estos aspectos e incluir en las normas técnicas de regulación los elementos clave del proceso, especialmente en lo que respecta a los elementos relacionados con el calendario de actualización de los LEI, fundamentales para garantizar la calidad de los datos.

### Conciliación de datos por los registros de operaciones

El hecho de que la AEVM no ofreciera inicialmente especificaciones sobre el proceso de conciliación, por falta de mandato legal, dio lugar a i) incoherencias en los procedimientos de conciliación, ii) incoherencias en los calendarios de conciliación, iii) límites de tolerancia y categorización de los campos decididos por los registros de operaciones, y iv) largos plazos de ejecución de las solicitudes de cambio. Para resolver estas cuestiones, la AEVM propuso que, una vez validados los datos por los registros de operaciones, estos deberían conciliar los detalles de los dos lados del derivado notificados. Esta propuesta tiene su base jurídica en el artículo 78, apartado 9, letra a), del EMIR, modificado por el EMIR REFIT, que establece que los registros de operaciones deben establecer «procedimientos adecuados para la conciliación efectiva de datos entre registros de operaciones». La AEVM propuso en el documento de consulta varios principios generales para llevar a cabo la conciliación. Los participantes en la consulta pública apoyaron la armonización del proceso de conciliación y presentaron una serie de observaciones que la AEVM ha tenido en cuenta en los principios establecidos en el presente proyecto de Reglamento Delegado.

### Mecanismo de respuesta al cierre

Los registros de operaciones deben proporcionar a las contrapartes notificantes, a las entidades que remiten las notificaciones, a las entidades responsables de la notificación y a los terceros a los que se haya concedido acceso a la información de conformidad con el artículo 78, apartado 7, del EMIR, según proceda, determinada información al cierre que les permita mejorar la calidad de los datos notificados con arreglo al EMIR.

La AEVM considera que disponer de información al cierre sobre las operaciones rechazadas resulta práctico para que las entidades i) corroboren sus notificaciones, ii) actúen en relación con cualquier derivado potencial que aún no haya sido corregido, y iii) puedan efectuar un tratamiento totalmente automatizado y automatizar su flujo de trabajo.

La AEVM recibió un número importante de respuestas muy detalladas a sus propuestas. Tras estudiar esta información, la AEVM ha propuesto un conjunto mínimo de notificaciones al cierre que los registros de operaciones deben facilitar.

## **3. EVALUACIÓN DE IMPACTO**

La Comisión no ha llevado a cabo una evaluación de impacto detallada sobre las normas técnicas de regulación propuestas, sino que ha basado su evaluación en el análisis de costes y beneficios de la AEVM incluido en su informe final.

Las principales decisiones de actuación han sido analizadas y publicadas ya por la Comisión en la propuesta legislativa que dio lugar al Reglamento (UE) 2019/834 del Parlamento Europeo y del Consejo, de 20 de mayo de 2019, que modifica el Reglamento (UE) n.º 648/2012.

La AEVM entiende que las normas técnicas propuestas mejorarán la calidad de los datos notificados con arreglo al EMIR y, por lo tanto, aportarán un beneficio claro a las autoridades que están facultadas para acceder a los datos del EMIR, pero también a las entidades notificantes y a los registros de operaciones. Por ejemplo, se espera que las modificaciones propuestas para adaptar los requisitos de la UE a las directrices mundiales sobre la notificación de derivados extrabursátiles supongan una reducción significativa de los costes para las entidades que notifican en varias jurisdicciones. Del mismo modo, además de la normalización de los formatos y el uso de la norma ISO 20022 para la notificación por las contrapartes a los registros de operaciones, una información más completa sobre los rechazos y las advertencias contribuirá a facilitar la corrección de los datos por parte de las entidades

notificantes y a reducir los problemas de calidad de los datos, lo que mejorará aún más la automatización de la notificación y reducirá los problemas de calidad de los datos. En caso de conciliación, se espera que las modificaciones propuestas para ajustar los requisitos referentes a la conciliación entre los registros de operaciones hagan que se proporcione a las entidades notificantes una información más coherente sobre la conciliación y contribuyan a facilitar la conciliación de las notificaciones, lo que reducirá la necesidad de los gravosos procesos de seguimiento sobre los fallos en la conciliación, y los consiguientes costes de cumplimiento, y mejorará la calidad de los datos.

Aunque estos beneficios superan a los costes, es inevitable que, a corto plazo, las modificaciones de los sistemas de notificación derivadas de las normas técnicas de regulación y de ejecución propuestas conlleven costes para las autoridades, las contrapartes y los registros de operaciones. La AEVM propone un calendario de ejecución que debería contribuir a mitigar las implicaciones en cuanto a costes.

#### **4. ASPECTOS JURÍDICOS DEL ACTO DELEGADO**

En el artículo 1 se establece el proceso para la verificación de las notificaciones sobre derivados por parte de los registros de operaciones.

En el artículo 2 se establece el procedimiento para la actualización de los LEI.

En el artículo 3 se establece el procedimiento para la conciliación de los datos por parte de los registros de operaciones.

En el artículo 4 se establece la información disponible al cierre sobre los derivados notificados que los registros de operaciones deben poner a disposición de determinadas entidades.

En el artículo 5 se establece la fecha de entrada en vigor del Reglamento Delegado.

# REGLAMENTO DELEGADO (UE) .../... DE LA COMISIÓN

de 10.6.2022

**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**

(Texto pertinente a efectos del EEE)

LA COMISIÓN EUROPEA,

Visto el Tratado de Funcionamiento de la Unión Europea,

Visto el Reglamento (UE) n.º 648/2012 del Parlamento Europeo y del Consejo, de 4 de julio de 2012, relativo a los derivados extrabursátiles, las entidades de contrapartida central y los registros de operaciones<sup>1</sup>, y en particular su artículo 78, apartado 10,

Considerando lo siguiente:

- (1) Para garantizar una calidad elevada de los datos relativos a los derivados notificados a los registros de operaciones, estos deben verificar la identidad de las entidades que remiten las notificaciones, la integridad lógica de la secuencia de comunicación de los datos de los derivados y que dichos datos sean completos y correctos.
- (2) Por la misma razón, los registros de operaciones deben conciliar los datos de cada notificación de derivados recibida cuando ambas contrapartes tengan una obligación de notificación. Conviene especificar un proceso normalizado que permita a los registros de operaciones proceder a la conciliación de manera coherente y que reduzca el riesgo de que los datos de los derivados no se concilien. No obstante, algunos datos de los derivados podrían no ser idénticos debido a las especificidades de los sistemas tecnológicos utilizados por las entidades que remiten las notificaciones. Es preciso, por tanto, aplicar ciertos límites de tolerancia, de manera que las diferencias de poca importancia existentes en los datos de los derivados notificados no impidan a las autoridades analizar estos datos con un nivel adecuado de confianza.
- (3) Además, y sin perjuicio de otras obligaciones relativas a los datos de los derivados recogidos y registrados al llevar a cabo el proceso de conciliación, los registros de operaciones deben garantizar la confidencialidad de los datos intercambiados entre ellos y puestos a disposición de las contrapartes notificantes, las entidades responsables de la notificación y las entidades que remiten la notificación.
- (4) Cuando un acto de reestructuración empresarial tiene como resultado la modificación del identificador de entidad jurídica («LEI») de una contraparte, es preciso actualizar los datos de las entidades identificadas en la notificación del derivado. Para garantizar la integridad de esa información, esencial para el seguimiento de los riesgos sistémicos

---

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

que pueden afectar a la estabilidad financiera, es necesario que la actualicen de forma centralizada los registros de operaciones. Por esta razón, debe establecerse un procedimiento que garantice que los registros de operaciones puedan actualizar de manera centralizada el identificador de la entidad, lo que asegurará la eficiencia, la solidez y la oportunidad del proceso.

- (5) Las entidades que remiten las notificaciones deben disponer de tiempo suficiente para adaptarse a los requisitos de notificación, en particular para impedir que se acumulen operaciones no conciliadas inmediatamente después de que se empiece a aplicar la obligación de notificación. Conviene, por consiguiente, que, en una primera fase, solo deba conciliarse un conjunto reducido de campos.
- (6) Las entidades que remiten las notificaciones y las entidades responsables de la notificación, en su caso, deben poder realizar un seguimiento del cumplimiento de sus obligaciones de notificación con arreglo al Reglamento (UE) n.º 648/2012. Así pues, deben poder acceder diariamente a determinada información en relación con dichas notificaciones, en particular los resultados de la verificación de estas, también cuando se haya generado una advertencia, así como la situación de la conciliación de los datos notificados. Resulta necesario, por tanto, especificar la información que los registros de operaciones deben poner a disposición de esas entidades al final de cada día hábil.
- (7) El presente Reglamento se basa en los proyectos de normas técnicas de regulación presentados por la Autoridad Europea de Valores y Mercados a la Comisión.
- (8) La Autoridad Europea de Valores y Mercados ha consultado a los miembros del Sistema Europeo de Bancos Centrales, ha llevado a cabo consultas públicas abiertas sobre los proyectos de normas técnicas de regulación en que se basa el presente Reglamento, ha analizado los costes y beneficios potenciales conexos y ha recabado el asesoramiento del Grupo de partes interesadas del sector de los valores y mercados, establecido de conformidad con el artículo 37 del Reglamento (UE) n.º 1095/2010 del Parlamento Europeo y del Consejo<sup>2</sup>.
- (9) Para que las contrapartes y los registros de operaciones puedan adoptar todas las medidas necesarias para adaptarse a los nuevos requisitos, la fecha de aplicación del presente Reglamento debe aplazarse dieciocho meses.

HA ADOPTADO EL PRESENTE REGLAMENTO:

#### *Artículo 1*

#### ***Verificación de los derivados por los registros de operaciones***

1. Los registros de operaciones verificarán todos los aspectos siguientes de las notificaciones de derivados recibidas:
  - a) la identidad de la entidad que remite la notificación a la que se refieren el campo 2 del cuadro 1 y el campo 2 del cuadro 3 del anexo del [OP: insértese la referencia a C(2022) 3588];

---

<sup>2</sup> 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).

- b) que la plantilla XML utilizada para la notificación de un derivado cumple la metodología de la norma ISO 20022 de conformidad con el artículo 1 del [OP: *insértese la referencia a C(2022) 3588*];
  - c) que la entidad que remite la notificación, si es diferente de la entidad responsable de la notificación a que se refieren el campo 3 del cuadro 1 y el campo 3 del cuadro 3 del anexo del [OP: *insértese la referencia a C(2022) 3588*], está debidamente autorizada para notificar en nombre de la contraparte 1 o de la entidad responsable de la notificación, si es diferente de la contraparte 1, según se indica en el campo 4 del cuadro 1 y en el campo 4 del cuadro 3 del anexo del [OP: *insértese la referencia a C(2022) 3588*];
  - d) que no se ha presentado anteriormente la misma notificación de derivado;
  - e) que una notificación de derivado con un tipo de acción «Modificación», «Actualización del margen», «Valoración», «Corrección», «Error» o «Terminación» se refiere a una notificación de derivado presentada anteriormente;
  - f) que una notificación de derivado con un tipo de acción «Modificación» no se refiere a un derivado notificado como anulado con el tipo de acción «Error» que no se haya notificado posteriormente con el tipo de acción «Reactivación»;
  - g) que la notificación de derivado no indica el tipo de acción «Nueva» respecto de un derivado que se ha notificado anteriormente;
  - h) que la notificación de derivado no indica el tipo de acción «Componente de posición» respecto de un derivado que se ha notificado anteriormente;
  - i) que la notificación de derivado no pretende modificar los datos de los campos «Contraparte 1» o «Contraparte 2» de un derivado notificado anteriormente;
  - j) que la notificación de derivado no pretende modificar un derivado existente especificando una fecha efectiva posterior a la fecha de vencimiento notificada del derivado;
  - k) que un derivado notificado con el tipo de acción «Reactivación» está relacionado con una notificación de derivado presentada anteriormente con un tipo de acción «Error» o «Terminación» o con un derivado que ha vencido;
  - l) que la notificación de derivado es correcta y completa.
2. Los registros de operaciones rechazarán toda notificación de derivado que no cumpla alguno de los requisitos establecidos en el apartado 1 y le asignarán una de las categorías de rechazo que figuran en el cuadro 1 del anexo.
3. Los registros de operaciones facilitarán a las entidades que remitan las notificaciones información detallada sobre los resultados de la verificación de datos a que se refiere el apartado 1 en los sesenta minutos siguientes a su recepción de la notificación de derivado. Los registros de operaciones presentarán dichos resultados en formato XML y en una plantilla elaborada de conformidad con la metodología ISO 20022. En los resultados se especificarán los motivos para el rechazo de una notificación de derivado de conformidad con el cuadro 1 del anexo.

## Artículo 2

### **Procedimiento para las actualizaciones de los identificadores de las entidades jurídicas (LEI)**

1. Los registros de operaciones a los que se dirija una solicitud con arreglo al artículo 8 del [OP: *insértese la referencia a C(2022) 3588*] identificarán los derivados pendientes a los que se refiere el artículo 2, apartado 2, del [OP: *insértese la referencia a C(2022) 3588*] en el momento de producirse el acto de reestructuración empresarial, cuando la entidad esté notificada con el identificador utilizado antes del acto de reestructuración empresarial en el campo «Contraparte 1» o «Contraparte 2», según la información de la solicitud correspondiente. Sustituirán el antiguo identificador por el nuevo identificador de la entidad jurídica (LEI) en las notificaciones relativas a todos aquellos derivados que, en el momento de producirse el acto a que se refiere el artículo 8 del [OP: *insértese la referencia a C(2022) 3588*], pertenezcan a esa contraparte. Los registros de operaciones llevarán a cabo el procedimiento de actualización del identificador a más tardar el día de la reestructuración o en un plazo de treinta días naturales a partir de la recepción de la solicitud si se notifica menos de treinta días naturales antes de la fecha del acto de reestructuración empresarial.
2. Los registros de operaciones identificarán los derivados pertinentes a que se refiere el artículo 2, apartado 2, del [OP: *insértese la referencia a C(2022) 3588*] en el momento de producirse el acto de reestructuración empresarial, cuando la entidad esté identificada con el antiguo identificador en cualquiera de los campos, y sustituirán ese identificador por el nuevo LEI. Cuando un acto de reestructuración empresarial esté relacionado con una actualización del LEI para campos que no sean los de «Contraparte 1» o «Contraparte 2», el registro de operaciones llevará a cabo dicha actualización de los derivados pertinentes únicamente tras la oportuna confirmación de la contraparte 1 o de la entidad responsable de la notificación.
3. Los registros de operaciones llevarán a cabo las siguientes acciones:
  - a) tras la recepción de la confirmación pertinente con arreglo al apartado 2, aplicar la actualización del LEI a partir de la fecha a que se refiere el apartado 1;
  - b) comunicar la siguiente información lo antes posible, y a más tardar cinco días hábiles después de haber recibido la notificación completa, a todos los demás registros de operaciones y a las contrapartes notificantes, a las entidades que remitan la notificación, a las entidades responsables de la notificación vinculadas a los contratos de derivados afectados por la actualización del LEI y a los terceros a los que se haya concedido acceso a la información de conformidad con el artículo 78, apartado 7, del Reglamento (UE) n.º 648/2012, según proceda:
    - i) el(los) antiguo(s) identificador(es);
    - ii) el nuevo identificador;
    - iii) la fecha a partir de la cual será efectiva la actualización;
    - iv) en el caso de los actos societarios que afecten a un subconjunto de derivados pendientes en la fecha del acto, la lista de los identificadores únicos de operaciones (UTI) de los derivados a los que afecte la actualización del LEI;

- c) notificar, a más tardar el día hábil anterior a la fecha en que se aplique la actualización, a las entidades enumeradas en el artículo 81, apartado 3, del Reglamento (UE) n.º 648/2012 que tengan acceso a los datos relativos a los derivados que se hayan actualizado, mediante un fichero específico en formato legible electrónicamente:
    - i) el(los) antiguo(s) identificador(es);
    - ii) el nuevo identificador;
    - iii) la fecha a partir de la cual será efectiva la actualización;
    - iv) en el caso de los actos societarios que afecten a un subconjunto de derivados pendientes en la fecha del acto, la lista de los identificadores únicos de operaciones (UTI) de los derivados a los que afecte la actualización del LEI;
  - d) registrar la actualización del LEI en el libro de notificaciones.
4. Los registros de operaciones no actualizarán los LEI notificados para derivados que no sean aquellos a los que se refiere el artículo 2, apartado 2, del [OP: *insértese la referencia a C(2022) 3588*] en el momento de producirse el acto societario.

### *Artículo 3*

#### ***Conciliación de datos por los registros de operaciones***

1. Los registros de operaciones procurarán conciliar los derivados notificados siguiendo los pasos contemplados en el apartado 3, siempre que se cumplan todas las condiciones siguientes:
  - a) que el registro de operaciones haya realizado por completo las verificaciones previstas en el artículo 1, apartados 1 y 2;
  - b) que ambas contrapartes del derivado notificado tengan una obligación de notificación de conformidad con el artículo 9 del Reglamento (UE) n.º 648/2012;
  - c) que el registro de operaciones no haya recibido una notificación con el tipo de acción «Error» con respecto al derivado notificado, a menos que a dicha notificación haya seguido una notificación con el tipo de acción «Reactivación».
2. Los registros de operaciones dispondrán de mecanismos para garantizar la confidencialidad de los datos cuando intercambien información con otros registros de operaciones y cuando proporcionen información a las contrapartes notificantes, las entidades que remitan la notificación, las entidades responsables de la notificación, así como a los terceros a los que se haya concedido acceso a la información de conformidad con el artículo 78, apartado 7, del Reglamento (UE) n.º 648/2012, sobre los valores de todos los campos sujetos a conciliación.
3. Cuando se cumplan todas las condiciones del apartado 1, los registros de operaciones seguirán los pasos siguientes, utilizando el último valor notificado en cada uno de los campos del cuadro 2 del anexo en la fecha del día hábil anterior:
  - a) el registro de operaciones que haya recibido una notificación de derivado verificará si ha recibido una notificación correspondiente de la otra contraparte o en nombre de esta;

- b) cuando el registro de operaciones no haya recibido la notificación de derivado correspondiente a que se refiere la letra a), tratará de identificar el registro de operaciones que la haya recibido, comunicando a todos los registros de operaciones inscritos los valores de los siguientes campos del derivado notificado: «Identificador único de operación», «Contraparte 1» y «Contraparte 2»;
  - c) cuando el registro de operaciones determine que otro registro de operaciones ha recibido la notificación de derivado correspondiente a que se refiere la letra a), intercambiará con este los datos del derivado notificado en formato XML y en una plantilla elaborada de conformidad con la metodología ISO 20022;
  - d) el registro de operaciones considerará conciliado un derivado notificado cuando los datos del derivado objeto de conciliación coincidan con los del derivado correspondiente a que se refiere la letra a) y de conformidad con los límites de tolerancia aplicables y las fechas de aplicación pertinentes establecidos en el cuadro 2 del anexo;
  - e) el registro de operaciones asignará seguidamente valores a las categorías de conciliación respecto de cada operación con derivados notificada, tal como se establece en el cuadro 3 del anexo;
  - f) el registro de operaciones llevará a cabo los pasos indicados en las letras a) a e) a la mayor brevedad y, a más tardar, a las 00:00 horas (UTC) de un determinado día hábil;
  - g) cuando el registro de operaciones no pueda conciliar un derivado notificado, procurará casar los datos de dicho derivado el siguiente día hábil. El registro de operaciones dejará de intentar conciliar el derivado notificado treinta días naturales después de que el derivado haya dejado de estar pendiente.
4. Al final de cada día hábil, el registro de operaciones confirmará el número total de derivados casados y el número de derivados conciliados con cada registro de operaciones con el que haya procedido a la conciliación de derivados. El registro de operaciones dispondrá de procedimientos escritos para garantizar la resolución de todas las discrepancias detectadas en este proceso.
5. A más tardar sesenta minutos después de la conclusión del proceso de conciliación con arreglo al apartado 3, letra f), el registro de operaciones proporcionará a las entidades que remitieron la notificación los resultados del proceso de conciliación realizado respecto de los derivados notificados. El registro de operaciones facilitará dichos resultados en formato XML y en una plantilla elaborada de conformidad con la metodología ISO 20022, incluyendo información sobre los campos que no hayan sido conciliados.

#### *Artículo 4*

##### *Mecanismos de respuesta al cierre*

1. Con respecto a cada día hábil, los registros de operaciones pondrán a disposición de las contrapartes notificantes, las entidades que remitieron la notificación, las entidades responsables de la notificación y los terceros a los que se haya concedido acceso a la información de conformidad con el artículo 78, apartado 7, del Reglamento (UE) n.º 648/2012, según proceda, la siguiente información sobre los derivados de que se trate, en formato XML y en una plantilla elaborada de conformidad con la metodología ISO 20022:

- a) los derivados notificados durante ese día;
  - b) el último estado de las operaciones de los derivados pendientes;
  - c) las notificaciones de derivados que hayan sido rechazadas durante ese día;
  - d) la situación de la conciliación de todos los derivados notificados sujetos a conciliación con arreglo al artículo 3, apartado 1;
  - e) los derivados pendientes para los que no se haya notificado ninguna valoración, o para los que la fecha de la valoración notificada sea más de catorce días naturales anterior al día en el que se generó el informe;
  - f) los derivados pendientes para los que no se haya notificado información sobre los márgenes, o para los que la fecha de la información sobre los márgenes notificada sea más de catorce días naturales anterior al día para el que se generó el informe;
  - g) los derivados que se recibieron ese día con el tipo de acción «Nueva», «Componente de posición», «Modificación» o «Corrección» y cuyo importe notional sea anormal para esa clase de derivados.
2. Los registros de operaciones facilitarán esa información a más tardar a las 06:00 horas (tiempo universal coordinado) del día hábil siguiente al día al que se refiera la información establecida en el apartado 1.

#### *Artículo 5*

#### ***Entrada en vigor y aplicación***

El presente Reglamento entrará en vigor a los veinte días de su publicación en el *Diario Oficial de la Unión Europea*.

Será aplicable a partir del [OP: insértese la fecha del primer lunes siguiente a la fecha correspondiente a dieciocho meses después de la fecha de entrada en vigor.].

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

Hecho en Bruselas, el 10.6.2022

*Por la Comisión*  
*La Presidenta*  
*Ursula VON DER LEYEN*