



COMISIÓN  
EUROPEA

Bruselas, 29.10.2025  
C(2025) 7124 final

ANNEXES 1 to 3

## **ANEXOS**

**del**

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

**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 las condiciones operativas, la obligación de representatividad y los requisitos de información relacionados con el requisito de la cuenta activa**

## **ANEXO I**

Categorías de derivados y subcategorías relevantes para la obligación de representatividad

*Cuadro 1*

### **Subcategorías para EUR fijo contra variable**

|             | Tamaño de la operación (en millones EUR) |           |        |
|-------------|------------------------------------------|-----------|--------|
| Vencimiento | [0-25M]                                  | [25M-50M] | [50M+] |
| [0-5A]      |                                          |           |        |
| [5A-10A]    |                                          |           |        |
| [10A-15A]   |                                          |           |        |
| [15A+]      |                                          |           |        |

*Cuadro 2*

### **Subcategorías para EUR OIS**

|             | Tamaño de la operación (en millones EUR) |            |         |
|-------------|------------------------------------------|------------|---------|
| Vencimiento | [0-25M]                                  | [25M-100M] | [100M+] |
| [0-1A]      |                                          |            |         |
| [1A-2A]     |                                          |            |         |
| [2A-5A]     |                                          |            |         |
| [5A+]       |                                          |            |         |

*Cuadro 3*

### **Subcategorías para EUR FRA**

|             | Tamaño de la operación (en millones EUR) |            |         |
|-------------|------------------------------------------|------------|---------|
| Vencimiento | [0-75M]                                  | [75M-200M] | [200M+] |
| [0-6M]      |                                          |            |         |
| [6M-12M]    |                                          |            |         |
| [12M-18M]   |                                          |            |         |
| [18M+]      |                                          |            |         |

*Cuadro 4*

**Subcategorías para PLN fijo contra variable**

|                       |                                          |
|-----------------------|------------------------------------------|
|                       | Tamaño de la operación (en millones PLN) |
| Vencimiento           | Cualquier tamaño de operación            |
| Cualquier vencimiento |                                          |

*Cuadro 5*

**Subcategorías para PLN FRA**

|                       |                                          |
|-----------------------|------------------------------------------|
|                       | Tamaño de la operación (en millones PLN) |
| Vencimiento           | Cualquier tamaño de operación            |
| Cualquier vencimiento |                                          |

*Cuadro 6*

**Categorías de derivados para EUR STIR**

| Ejecución                                 | Subyacente                   | Índice de Referencia | Moneda de Liquidación | Tipo de moneda de liquidación | Opcionalidad |
|-------------------------------------------|------------------------------|----------------------|-----------------------|-------------------------------|--------------|
| Intercambio de la UE o de terceros países | Tipo de interés a tres meses | EURIBOR              | EUR                   | Moneda única                  | Excluida     |
| Intercambio de la UE o de terceros países | Tipo de interés a tres meses | €STR                 | EUR                   | Moneda única                  | Excluida     |

*Cuadro 7*

**Subcategorías para EUR STIR referenciado al EURIBOR**

|             |                                          |
|-------------|------------------------------------------|
|             | Tamaño de la operación (en millones EUR) |
| Vencimiento | Cualquier tamaño de operación            |
| [0-6M]      |                                          |
| [6M-12M]    |                                          |
| [12M-24M]   |                                          |
| [24M+]      |                                          |

*Cuadro 8*

**Subcategorías para EUR STIR referenciado al €STR**

|             | Tamaño de la operación (en millones EUR) |
|-------------|------------------------------------------|
| Vencimiento | Cualquier tamaño de operación            |
| [0-6M]      |                                          |
| [6M-12M]    |                                          |
| [12M-24M]   |                                          |
| [24M+]      |                                          |

## **ANEXO II**

Modelos a que se refiere el artículo 7

### *Cuadro 1*

#### **Información sobre la contraparte**

|   | <b>Campo</b>                                             | <b>Datos que deben comunicarse</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|---|----------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1 | Fecha de información                                     | Fecha de presentación del informe a la autoridad competente.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 2 | Contraparte sujeta al informe anual de actividades (IAA) | <p>El identificador de entidad jurídica (LEI) de la contraparte de una operación con derivados que esté cumpliendo su obligación de información a través del informe de que se trate.</p> <p>En el caso de una operación con derivados asignada ejecutada por un gestor de fondos en nombre de un fondo, se consignará como contraparte el fondo, y no el gestor del fondo.</p> |
| 3 | Naturaleza de la contraparte                             | Se indicará si la contraparte es una ECC, una contraparte financiera o una contraparte no financiera, según se definen en el artículo 2, puntos 1, 8 y 9, respectivamente, del Reglamento (UE) n.º 648/2012, o una entidad a la que se refiere el artículo 1, apartado 5, de dicho Reglamento.                                                                                  |
| 4 | Entidades del grupo                                      | Una lista de los identificadores de entidad jurídica (LEI) de las entidades del grupo.                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 5 | Entidad matriz última                                    | El identificador de entidad jurídica (LEI) de la entidad matriz última del grupo.                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 6 | Miembro compensador                                      | El identificador de entidad jurídica (LEI) del miembro compensador.                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |

Cuadro 2

Actividades y exposiciones al riesgo

|   | Campo                                                                                                                                                                                                                                               | Datos que deben comunicarse                                                                                                                                                                                                                                       | Total       |      |     |             |      |     |          |      |     |
|---|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------|------|-----|-------------|------|-----|----------|------|-----|
| 1 | Importe nocional bruto pendiente de la posición media agregada a final de mes durante los doce meses anteriores en las categorías de contratos de derivados compensados con arreglo al artículo 7 bis, apartado 6, del Reglamento (UE) n.º 648/2012 | Suma total del importe nocional del componente 1 y, en su caso, del importe nocional del componente 2, para los derivados incluidos en el ámbito de esta presentación de información, a que se refiere el artículo 5 del Reglamento (UE) 2022/1855 de la Comisión |             |      |     |             |      |     |          |      |     |
| 2 | Dimensión 1 — Desglose total por categoría de derivado                                                                                                                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                                                   | EUR OTC IRD |      |     | PLN OTC ORD |      |     | EUR STIR |      |     |
|   |                                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                                                                                                                                                                                                                   |             |      |     |             |      |     |          |      |     |
| 3 | Dimensión 2 — Desglose por ECC (UE / Nivel 2 / Nivel 1) (presentación de información a nivel de LEI de la ECC)                                                                                                                                      |                                                                                                                                                                                                                                                                   | ECC1        | ECC2 | ... | ECC1        | ECC2 | ... | ECC1     | ECC2 | ... |
|   |                                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                                                                                                                                                                                                                   |             |      |     |             |      |     |          |      |     |

### **ANEXO III**

Presentación de información sobre la obligación de representatividad

*\*Debe completarse con el número de operaciones por subcategoría por categoría de contratos de derivados y por período de referencia aplicable*

*Cuadro 1*

#### **Subcategorías para EUR fijo contra variable**

| Período de referencia                                                                                             |                                          |           |        |                                           |                                          |           |        |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------|-----------|--------|-------------------------------------------|------------------------------------------|-----------|--------|
| Servicio de compensación de importancia sistémica sustancial con arreglo al artículo 25, apartado 2 <i>quater</i> |                                          |           |        | ECC autorizada con arreglo al artículo 14 |                                          |           |        |
|                                                                                                                   | Tamaño de la operación (en millones EUR) |           |        |                                           | Tamaño de la operación (en millones EUR) |           |        |
| Vencimiento                                                                                                       | [0-25M]                                  | [25M-50M] | [50M+] | Vencimiento                               | [0-25M]                                  | [25M-50M] | [50M+] |
| [0-5A]                                                                                                            |                                          |           |        | [0-5A]                                    |                                          |           |        |
| [5A-10A]                                                                                                          |                                          |           |        | [5A-10A]                                  |                                          |           |        |
| [10A-15A]                                                                                                         |                                          |           |        | [10A-15A]                                 |                                          |           |        |
| [15A+]                                                                                                            |                                          |           |        | [15A+]                                    |                                          |           |        |

*Cuadro 2*

#### **Subcategorías para EUR OIS**

| Período de referencia                                                                                             |                                          |            |         |                                           |                                          |            |         |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------|------------|---------|-------------------------------------------|------------------------------------------|------------|---------|
| Servicio de compensación de importancia sistémica sustancial con arreglo al artículo 25, apartado 2 <i>quater</i> |                                          |            |         | ECC autorizada con arreglo al artículo 14 |                                          |            |         |
|                                                                                                                   | Tamaño de la operación (en millones EUR) |            |         |                                           | Tamaño de la operación (en millones EUR) |            |         |
| Vencimiento                                                                                                       | [0-25M]                                  | [25M-100M] | [100M+] | Vencimiento                               | [0-25M]                                  | [25M-100M] | [100M+] |
| [0-1A]                                                                                                            |                                          |            |         | [0-1A]                                    |                                          |            |         |
| [1A-2A]                                                                                                           |                                          |            |         | [1A-2A]                                   |                                          |            |         |

|         |  |  |  |         |  |  |  |
|---------|--|--|--|---------|--|--|--|
| [2A-5A] |  |  |  | [2A-5A] |  |  |  |
| [5A+]   |  |  |  | [5A+]   |  |  |  |

*Cuadro 3*

**Subcategorías para EUR FRA**

|                                                                                                                   |                                          |            |         |                                           |                                          |            |         |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------|------------|---------|-------------------------------------------|------------------------------------------|------------|---------|
| Período de referencia                                                                                             |                                          |            |         |                                           |                                          |            |         |
| Servicio de compensación de importancia sistémica sustancial con arreglo al artículo 25, apartado 2 <i>quater</i> |                                          |            |         | ECC autorizada con arreglo al artículo 14 |                                          |            |         |
|                                                                                                                   | Tamaño de la operación (en millones EUR) |            |         |                                           | Tamaño de la operación (en millones EUR) |            |         |
| Vencimiento                                                                                                       | [0-75M]                                  | [75M-200M] | [200M+] | Vencimiento                               | [0-25M]                                  | [25M-100M] | [100M+] |
| [0-6M]                                                                                                            |                                          |            |         | [0-6M]                                    |                                          |            |         |
| [6M-12M]                                                                                                          |                                          |            |         | [6M-12M]                                  |                                          |            |         |
| [12M-18M]                                                                                                         |                                          |            |         | [12M-18M]                                 |                                          |            |         |
| [18M+]                                                                                                            |                                          |            |         | [18M+]                                    |                                          |            |         |

*Cuadro 4*

**Subcategorías para PLN fijo contra variable**

|                                                                                                                   |                                         |                                           |                                         |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------|-------------------------------------------|-----------------------------------------|
| Servicio de compensación de importancia sistémica sustancial con arreglo al artículo 25, apartado 2 <i>quater</i> |                                         | ECC autorizada con arreglo al artículo 14 |                                         |
|                                                                                                                   | Tamaño de la operación (en millones PL) |                                           | Tamaño de la operación (en millones PL) |
| Vencimiento                                                                                                       | Cualquier tamaño de operación           | Vencimiento                               | Cualquier tamaño de operación           |
| Cualquier vencimiento                                                                                             |                                         | Cualquier vencimiento                     |                                         |

Cuadro 5

**Subcategorías para PLN FRA**

|                                                                                                                   |                                         |                                           |                                         |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------|-------------------------------------------|-----------------------------------------|
| Servicio de compensación de importancia sistémica sustancial con arreglo al artículo 25, apartado 2 <i>quater</i> |                                         | ECC autorizada con arreglo al artículo 14 |                                         |
|                                                                                                                   | Tamaño de la operación (en millones PL) |                                           | Tamaño de la operación (en millones PL) |
| Vencimiento                                                                                                       | Cualquier tamaño de operación           | Vencimiento                               | Cualquier tamaño de operación           |
| Cualquier vencimiento                                                                                             |                                         | Cualquier vencimiento                     |                                         |

Cuadro 6

**Subcategorías para EUR STIR referenciado al EURIBOR**

|                                                                                                                   |                                          |                                           |                                          |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------------|------------------------------------------|
| Período de referencia                                                                                             |                                          |                                           |                                          |
| Servicio de compensación de importancia sistémica sustancial con arreglo al artículo 25, apartado 2 <i>quater</i> |                                          | ECC autorizada con arreglo al artículo 14 |                                          |
|                                                                                                                   | Tamaño de la operación (en millones EUR) |                                           | Tamaño de la operación (en millones EUR) |
| Vencimiento                                                                                                       | Cualquier tamaño de operación            | Vencimiento                               | Cualquier tamaño de operación            |
| [0-6M]                                                                                                            |                                          | [0-6M]                                    |                                          |
| [6M-12M]                                                                                                          |                                          | [6M-12M]                                  |                                          |
| [12M-24M]                                                                                                         |                                          | [12M-24M]                                 |                                          |
| [24M+]                                                                                                            |                                          | [24M+]                                    |                                          |

Cuadro 7

**Subcategorías para EUR STIR referenciado al €STR**

|                                                                                                                   |                                          |                                           |                                          |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------------|------------------------------------------|
| Período de referencia                                                                                             |                                          |                                           |                                          |
| Servicio de compensación de importancia sistémica sustancial con arreglo al artículo 25, apartado 2 <i>quater</i> |                                          | ECC autorizada con arreglo al artículo 14 |                                          |
|                                                                                                                   | Tamaño de la operación (en millones EUR) |                                           | Tamaño de la operación (en millones EUR) |
| Vencimiento                                                                                                       | Cualquier tamaño de operación            | Vencimiento                               | Cualquier tamaño de operación            |
| [0-6M]                                                                                                            |                                          | [0-6M]                                    |                                          |
| [6M-12M]                                                                                                          |                                          | [6M-12M]                                  |                                          |
| [12M-24M]                                                                                                         |                                          | [12M-24M]                                 |                                          |
| [24M+]                                                                                                            |                                          | [24M+]                                    |                                          |