



## Encuesta de la EBA destinada a recopilar información sobre entidades en el ámbito de la autorización del modelo de margen inicial bajo EMIR 3

### [EBA Survey addressed to entities in scope of initial margin model authorisation under EMIR 3](#)

#### A quién va dirigida

Se espera que participen en la encuesta las entidades sujetas al requisito de intercambiar el margen inicial (MI) de conformidad con el artículo 36 de las RTS conjuntas de las ESAs sobre derivados OTC no compensados<sup>1</sup>. Se espera que todas las entidades sujetas a este requisito y pertenecientes a un grupo, completen la encuesta por separado (a nivel de entidad).

#### Nota Informativa

La EBA, en cooperación con ESMA y EIOPA, ha iniciado una breve encuesta destinada a recopilar información (con anterioridad a la publicación de EMIR 3), sobre las entidades en el ámbito de la autorización del modelo de MI en la UE acerca de la información específica pertinente para el cálculo de tasas, así como información sobre los MI y los modelos utilizados.

Esta información servirá de guía a la EBA en la creación de su función de validación central para los modelos de margen proforma (como el ISDA SIMM) y servirá de base para la respuesta de la EBA a la solicitud de asesoramiento de la Comisión Europea sobre un posible Acto Delegado en materia de comisiones. Además, se utilizará para la elaboración de requisitos razonables para las entidades incluidas en el ámbito de aplicación del modelo de autorización de IM, en particular para las entidades más pequeñas (entidades de Fase 5 y Fase 6), como parte de los próximos mandatos que se elaborarán en el marco de EMIR 3 en cooperación con ESMA y EIOPA (es decir, el proyecto revisado de RTS sobre IMMV y las Directrices sobre el proceso de solicitud y autorización).

#### Envío de respuestas

La fecha límite de esta encuesta es el 29 de noviembre de 2024.

Los interesados deben enviar sus aportaciones a través de la web de EBA: [EUSurvey - Survey](#). Para acceder a la encuesta, se debe utilizar una contraseña, que puede obtenerse desde asociaciones y autoridades competentes. Las entidades no supervisadas pueden ponerse en contacto con [eba-immv@eba.europa.eu](mailto:eba-immv@eba.europa.eu). Asimismo, se ruega se remita a la CNMV una copia de las respuestas remitidas por correo electrónico a la siguiente dirección: [documentosinternacional@cnmv.es](mailto:documentosinternacional@cnmv.es)

#### Departamento de Asuntos Internacionales

CNMV  
c/ Edison 4  
28006 Madrid

---

<sup>1</sup> Reglamento Delegado (UE) 2016/2251 de la Comisión, de 4 de octubre de 2016, por el que se completa el Reglamento (UE) n.º 648/2012 del Parlamento Europeo y del Consejo, relativo a los derivados extrabursátiles, las entidades de contrapartida central y los registros de operaciones, en lo que atañe a las normas técnicas de regulación sobre las técnicas de reducción del riesgo aplicables a los contratos de derivados extrabursátiles no compensados por una entidad de contrapartida central