

 Instrucción	Número:	I-GEN-02/2021
	Segmento:	General
	Fecha:	12 de abril de 2021
	Fecha entrada en vigor:	22 de abril de 2021
	Sustituye a:	---
Asunto	Notificación de Operaciones a un Registro de Operaciones para cumplir las obligaciones de reporte a EMIR: Cumplimentación de los datos de los informes 'Datos de la Contraparte' y 'Datos comunes'.	
Resumen	Descripción de la información a reportar en los campos para el reporte EMIR.	

1.- EXPLICACIÓN SOBRE CÓMO VA A RELLENAR BME CLEARING LOS DATOS DEL INFORME “DATOS DE LA CONTRAPARTE”

A continuación se indica cómo va a rellenar BME Clearing los datos del informe de “Datos de la Contraparte”. Se ha utilizado como base para escribir este apartado el documento “EACH Field Analysis - Counterparty Data” publicado por EACH.

<http://www.eachorg.com/dam/downloads/documents/131213-each-field-analysis-counterparty-data.pdf>

Campo RD (EU) nº 148/2013 y RE (EU) nº 1247/2012	Datos a indicar RD (EU) nº 148/2013	Formato RE (EU) nº 1247/2012	Explicación para la notificación BME Clearing Versus MC	
1.1	Marca de tiempo de la notificación	Fecha y hora de la notificación al TR	Formato de fecha según la norma ISO 8601 / hora UTC YYYY-MM-DD-THH:MM:SSZ.	Se rellenará por el Registro de Operaciones al recibir la notificación.
1.2	Identificación de la contraparte notificante.	Código único de identificación de la contraparte notificante.	Identificador de entidades jurídicas (LEI) (20 caracteres alfanuméricos).	- Notificación de la CCP: LEI de BME Clearing: 5299009QA8BBE200B349 - Notificación del MC: LEI del MC.
1.3	Tipo de identificación de la otra contraparte.	Tipo de código de identificación de la otra contraparte.	LEI= ISO 17442, Identificador de entidades jurídicas. CLC= Código Cliente.	- Notificación de la CCP: LEI. - Notificación del MC: LEI.
1.4	Identificación de la otra contraparte	Código único de identificación de la otra contraparte del contrato. Este campo deberá cumplimentarse desde la perspectiva de la contraparte notificante. Cuando se trate de una persona física, se utilizará un código de cliente.	Identificador de entidades jurídicas (LEI) (20 caracteres alfanuméricos), o código de cliente (50 caracteres alfanuméricos).	- Notificación de la CCP: LEI del MC - Notificación del MC: LEI de BME Clearing: 5299009QA8BBE200B349
1.5	País de la contraparte	Código del país en el que se encuentra el domicilio social de la contraparte o el país de residencia cuando se trate de una persona física.	Código ISO 3166, del país de la contraparte (2 caracteres).	- CCP: Código ISO (2 caracteres) del país del MC. - MC: ES.
1.6	Sector empresarial de la contraparte	Naturaleza de la actividad empresarial.	Taxonomía para contrapartidas financieras: A = empresa de seguros de vida C = entidad de crédito	- Notificación de la CCP: Blanco. - Notificación del MC: Sector empresarial del MC.

Campo RD (EU) nº 148/2013 y RE (EU) nº 1247/2012	Datos a indicar RD (EU) nº 148/2013	Formato RE (EU) nº 1247/2012	Explicación para la notificación BME Clearing Versus MC
		<p>F = empresa de inversión I = empresa de seguros L = fondo de inversión alternativo gestionado por un GFIA autorizado o registrado O = fondo de pensiones R = empresa de reaseguros; U = OICVM y sociedad de gestión del mismo. Taxonomía para contrapartidas no financieras: 1= Agricultura, silvicultura y pesca 2= Minería 3= Manufactura 4= Suministro de electricidad, gas, vapor y aire acondicionado. 5= Suministro de agua, alcantarillado y gestión de residuos 6=Construcción 7= Venta al por mayor y minorista, reparación de motos y coches 8= Transporte y almacenamiento 9= Hostelería 10= Información y comunicación 11= Servicios financieros y seguros. 12= Real estate 13= Ciencia y tecnología 14= Servicios de administración y soporte 15= Administración pública y defensa 16= Educación 17= Sanidad y trabajo social 18= Arte y entretenimiento 19= Otras actividades de servicios 20=Actividades de los hogares como empleadores de personal doméstico; actividades de los hogares como productores de bienes y servicios para uso propio 21= Actividad de organizaciones y cuerpos extraterritoriales</p> <p>Si se reportase más de una actividad, se listarán los códigos ordenados por la importancia de las actividades correspondientes, separándolos con "-". Se dejará en blanco en caso de CCPs y los tipos de contrapartida indicados en el Artículo 1 (5) del Reglamento (EU) No 648/2012.</p>	

Campo	RD (EU) nº 148/2013 y RE (EU) nº 1247/2012	Datos a indicar RD (EU) nº 148/2013	Formato RE (EU) nº 1247/2012	Explicación para la notificación BME Clearing Versus MC
1.7	Carácter financiero no financiero de la contraparte	Indíquese si la contraparte notificante es una contraparte financiera o no financiera. Con arreglo al punto 5 del Artículo 1 o los puntos 1.6 y 1.9 del Artículo 2 del Reglamento (EU) No 648/2012.	F= contraparte financiera, N= contraparte no financiera. C= CCP. O= Otros	<ul style="list-style-type: none"> - Notificación de la CCP: C. - Notificación del MC: Si el MC es una entidad financiera "F", si no "N" u "O".
1.8	Identificación del agente intermediario	En caso de que un intermediario actué por cuenta de la contraparte notificante, sin pasar a ser el intermediario una contraparte, la contraparte notificante deberá identificar a este intermediario	Identificador de entidades jurídicas (LEI) (20 caracteres alfanuméricos).	
1.9	Identificación de la entidad notificante	En caso de que la contraparte notificante haya delegado la presentación de la notificación en un tercero o en la otra contraparte, esta entidad deberá estar identificada. En su defecto este campo se dejará en blanco.	Identificador de entidades jurídicas (LEI) (20 caracteres alfanuméricos).	<ul style="list-style-type: none"> - Notificación de la CCP y del MC: Blanco cuando la CCP o el MC hacen el reporte ellos mismos. - LEI de la entidad que hace el reporte delegado, si existe esa delegación.
1.10	Identificación del Miembro Compensador	En caso de que la contraparte notificante no sea un miembro compensador, el miembro compensador de la misma estará identificado en este campo.	Identificador de entidades jurídicas (LEI) (20 caracteres alfanuméricos).	Notificación de la CCP y del MC: Blanco en ambos casos.
1.11	Tipo de identificación del beneficiario	Tipo de código de identificación del beneficiario.	LEI= ISO 17442, Identificador de entidades jurídicas.	<ul style="list-style-type: none"> - Notificación de la CCP: LEI. - Notificación del MC: LEI.
1.12	Identificación del beneficiario	Parte sujeta a los derechos y obligaciones del contrato.	Identificador de entidades jurídicas (LEI) (20 caracteres alfanuméricos), o código de cliente (50 caracteres alfanuméricos).	<ul style="list-style-type: none"> - Notificación de la CCP: LEI de BME Clearing: 5299009QA8BBE200B349 - Notificación del MC: LEI del MC.
1.13	Calidad en la que se actúa en la negociación	Indica si la contraparte notificante ha celebrado el contrato en calidad de principal que actúa por cuenta propia (en su propio nombre o en nombre de un cliente), o como agente, por cuenta y en nombre de un cliente.	P= principal, A= agente.	<ul style="list-style-type: none"> - Notificación de la CCP: "P" - Notificación del MC: "P"
1.14	Lado de la contraparte	Indica si el contrato ha consistido en una compra o una venta. En el caso de un contrato de derivados sobre tipos de interés, el lado comprador corresponderá al pagador del componente 1 y el lado vendedor será	B= comprador S= vendedor.	<p>Segmentos de Derivados Financieros y de Energía: Desde la perspectiva de Counterparty ID (campo 2);</p> <ul style="list-style-type: none"> - "B" en operaciones donde Counterparty ID es comprador o en posiciones donde Counterparty ID está largo. - "S" en operaciones donde el Counterparty ID es vendedor

	Campo RD (EU) nº 148/2013 y RE (EU) nº 1247/2012	Datos a indicar RD (EU) nº 148/2013	Formato RE (EU) nº 1247/2012	Explicación para la notificación BME Clearing Versus MC
		el pagador del componente 2.		<p>y en posiciones donde Counterparty ID está corto.</p> <p>Segmento IRS: Desde la perspectiva de Counterparty ID (campo 2):</p> <ul style="list-style-type: none"> - Si los primeros tres caracteres del campo "ContractCode" del fichero CTRADES no son "BSW" (Basis Swap): <ul style="list-style-type: none"> ▪ "B" si el campo "Side" del fichero CTRADES es igual a 1. ▪ "S" si el campo "Side" del fichero CTRADES es igual a 2. -Si los primeros tres caracteres del campo "ContractCode" del fichero CTRADES son "BSW" (Basis Swap): <ul style="list-style-type: none"> ▪ "B" si el campo "Side" del fichero CTRADES es igual a 2. ▪ "S" si el campo "Side" del fichero CTRADES es igual a 1.
1.15	Vinculación directa con la actividad comercial o financiación de tesorería	Información sobre si el contrato está directamente vinculado, de manera objetivamente mensurable, con la actividad comercial o la actividad de financiación de tesorería de la contraparte notificante, Este campo deberá dejarse en blanco cuando la contraparte notificante sea una contraparte financiera.	Y= Sí, N= No.	<ul style="list-style-type: none"> • Notificación de la CCP: Blanco • Notificación del MC: Blanco
1.16	Umbral de Compensación	Información sobre si la contraparte notificante supera el umbral de compensación Este campo deberá dejarse en blanco cuando la contraparte notificante sea una contraparte financiera.	Y= por encima N= por debajo.	<ul style="list-style-type: none"> • Notificación de la CCP: Blanco • Notificación del MC: Blanco
1.17	Valor del contrato a precios del mercado	Valoración del contrato a precios de mercado, o valoración según modelo.	Hasta 20 dígitos, según el formato xxxx,yyyyy	<p>Segmentos de Derivados Financieros y de Energía: <u>Para operaciones</u> N/A <u>Para posiciones</u> Véase apartado 11 de la circular*</p> <p>Segmento de IRS:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Para IRS: Campo "NPV" del fichero COPINIRS. • Para FRAs: Campo "NPV" del fichero COPINFRA.
1.18	Moneda de denominación del valor del contrato a precios de mercado	Moneda utilizada en la valoración del contrato a precios de mercado, o valoración según modelo, en su caso.	Código de la moneda según la norma ISO 4217, 3 caracteres.	<p>Segmentos de Derivados Financieros y de Energía: <u>Para operaciones</u> N/A <u>Para posiciones</u> Véase apartado 11 de la circular*</p> <p>Segmento IRS:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Para IRS: Campo "Currency" del fichero COPINIRS.

	Campo RD (EU) nº 148/2013 y RE (EU) nº 1247/2012	Datos a indicar RD (EU) nº 148/2013	Formato RE (EU) nº 1247/2012	Explicación para la notificación BME Clearing Versus MC
				<ul style="list-style-type: none"> Para FRAs: Campo "Currency" del fichero COPINFRA.
1.19	Fecha y hora de la valoración	Fecha y hora de la última valoración a precios de mercado o valoración según modelo.	Formato de fecha según la norma ISO 8601 YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ.	<p>Segmentos de Derivados Financieros y de Energía: <u>Para operaciones</u> N/A <u>Para posiciones</u> Véase apartado 11 de la circular*</p> <p>Segmento de IRS: Para operaciones, véase apartado 11 de la circular*</p>
1.20	Tipo de valoración	Indicación de si la valoración se ha realizado a precios de mercado, según modelo o proporcionado por una CCP.	M= a precios de mercado. O= según modelo. C= Valoración de la CCP.	<p>Segmentos de Derivados Financieros y de Energía: <u>Para operaciones</u> "C" <u>Para posiciones</u> "C"</p> <p>Segmento IRS <u>Para operaciones</u> "C"</p>
1.21	Aportación de garantías	Indicación de si se ha procedido a la constitución de garantías.	U= sin garantía PC= con garantía parcial OC= con garantía unilateral FC= con garantía íntegra.	<p><u>Para operaciones</u> N/A</p> <p><u>Para posiciones</u></p> <ul style="list-style-type: none"> Notificación de la CCP: U Notificación del MC: OC <p>Véase apartado 12 de la circular*</p>
1.22	Cartera de garantías	Indicación de si las garantías se han constituido «por cartera».	Y= Sí. N= No.	<p><u>Para operaciones</u> N/A</p> <p><u>Para posiciones</u> Y</p> <p>Véase apartado 12 de la circular*</p>
1.23	Código de cartera de garantías	Si las garantías se notifican por cartera, las carteras deberán estar identificadas mediante un código único determinado por la contraparte notificante.	Hasta 52 caracteres alfanuméricos incluyendo 4 caracteres especiales.	<p>Segmentos de Derivados Financieros y de Energía: <u>Para operaciones</u> N/A <u>Para posiciones</u> Véase apartado 12 de la circular*</p> <p>Segmento IRS Véase apartado 12 de la circular*</p>
1.24	Garantía Inicial aportada	Valor de la garantía inicial aportada por la contraparte notificante a la otra contraparte. Cuando la garantía inicial se constituya a nivel cartera, este campo deberá incluir el valor de todas la Garantía Inicial aportada en relación con esa cartera.	Hasta 20 dígitos, según el formato xxxx,yyyyy.	<p>Segmentos de Derivados Financieros y de Energía <u>Para operaciones</u> N/A <u>Para posiciones</u></p> <ul style="list-style-type: none"> Notificación de la CCP: 0 Notificación del MC: Suma del campo 6 "InitialMargin" del fichero CACCOUNTSETL de la sesión anterior (T-1) de todas las cuentas compensadas por el MC. <p>Segmento IRS <u>Para operaciones</u> N/A <u>Para posiciones</u></p> <ul style="list-style-type: none"> Notificación de la CCP: 0 Notificación del CM: Campo "InitialMargin" del fichero CTOTALINITIALMARGIN de la sesión anterior (T-1).
1.25	Divisa de la Garantía Inicial aportada	Divisa de la Garantía Inicial aportada	Código de la moneda según la norma ISO 4217, 3 caracteres.	<p>Segmentos de Derivados Financieros y de Energía <u>Para operaciones</u> N/A <u>Para posiciones</u></p>

	Campo RD (EU) nº 148/2013 y RE (EU) nº 1247/2012	Datos a indicar RD (EU) nº 148/2013	Formato RE (EU) nº 1247/2012	Explicación para la notificación BME Clearing Versus MC
				<p>Véase apartado 12 de la circular*</p> <ul style="list-style-type: none"> • Campo 5 “Currency” del fichero CACCOUNTSETL. <p>Segmento de IRS <u>Para operaciones</u> N/A <u>Para posiciones</u></p> <ul style="list-style-type: none"> • Notificación de la CCP: Campo “Currency” del fichero CTOTALINITIALMARGIN. • Notificación del CM: Campo “Currency” del fichero CTOTALINITIALMARGIN.
1.26	Variation Margin aportado	Valor del Variation Margin aportado por la contraparte notificante a la otra contraparte. Cuando las garantías se constituyan por cartera, este campo deberá incluir el valor de todo el Variation Margin aportado, en relación con esa cartera.	Hasta 20 dígitos, según el formato xxxx,yyyyy.	<p>Segmentos de Derivados Financieros y de Energía <u>Para operaciones</u> N/A <u>Para posiciones</u></p> <p>Véase apartado 12 de la circular*</p> <ul style="list-style-type: none"> • Notificación de la CCP: 0 • Notificación del CM: La suma del Campo 9 “VariationMargin” del fichero CACCOUNTSETL de la sesión anterior (T-1), de todas las cuentas del MC, si este valor es negativo, en caso contrario 0. <p>Segmento de IRS <u>Para operaciones</u> N/A <u>Para posiciones</u></p> <ul style="list-style-type: none"> • Notificación de la CCP: 0 • Notificación del CM: El Campo “VM” del fichero CTOTALINITIALMARGIN de la sesión anterior (T-1), si es negativo, en caso contrario 0.
1.27	Divisa del Variation Margin aportado	Divisa del Variation Margin aportado	Código de la moneda según la norma ISO 4217, 3 caracteres.	<p>Segmentos de Derivados Financieros y de Energía <u>Para operaciones</u> N/A <u>Para posiciones</u></p> <p>Véase apartado 12 de la circular*</p> <ul style="list-style-type: none"> • Campo 5 “Currency” del fichero CACCOUNTSETL. <p>Segmento de IRS <u>Para operaciones</u> N/A <u>Para posiciones</u></p> <ul style="list-style-type: none"> • Notificación de la CCP: Campo “Currency” del fichero CTOTALINITIALMARGIN. <p>Notificación del CM: Campo “Currency” del fichero CTOTALINITIALMARGIN.</p>
1.28	Garantía Inicial recibida	Valor de la garantía inicial recibida por la contraparte notificante de la otra contraparte. Cuando la garantía inicial se constituya a nivel cartera, este campo deberá incluir el valor de todas la Garantía Inicial recibida en relación con esa cartera.	Hasta 20 dígitos, según el formato xxxx,yyyyy.	<p>Segmentos de Derivados Financieros y de Energía <u>Para operaciones</u> N/A <u>Para posiciones</u></p> <p>Véase apartado 12 de la circular*</p> <ul style="list-style-type: none"> • Notificación de la CCP: Suma del campo 6 “InitialMargin” del fichero CACCOUNTSETL de la sesión anterior (T-1) de todas las cuentas compensadas por el MC. • Notificación del CM: 0. <p>Segmento IRS <u>Para operaciones</u> N/A</p>

	Campo RD (EU) nº 148/2013 y RE (EU) nº 1247/2012	Datos a indicar RD (EU) nº 148/2013	Formato RE (EU) nº 1247/2012	Explicación para la notificación BME Clearing Versus MC
				<p><u>Para posiciones</u></p> <ul style="list-style-type: none"> Notificación de la CCP: Campo "InitialMargin" del fichero CTOTALINITIALMARGIN de la sesión anterior (T-1). Notificación del CM: 0.
1.29	Divisa de la Garantía Inicial recibida	Divisa de la Garantía Inicial recibida	Código de la moneda según la norma ISO 4217, 3 caracteres.	<p>Segmentos de Derivados Financieros y de Energía <u>Para operaciones</u> N/A <u>Para posiciones</u> Véase apartado 12 de la circular*</p> <ul style="list-style-type: none"> Campo 5 "Currency" del fichero CACCOUNTSETL. <p>Segmento de IRS <u>Para operaciones</u> N/A <u>Para posiciones</u></p> <ul style="list-style-type: none"> Notificación de la CCP: Campo "Currency" del fichero CTOTALINITIALMARGIN. Notificación del CM: Campo "Currency" del fichero CTOTALINITIALMARGIN.
1.30	Variation Margin recibido	Valor del Variation Margin recibido por la contraparte notificante de la otra contraparte. Cuando las garantías se constituyan por cartera, este campo deberá incluir el valor de todo el Variation Margin recibido en relación con esa cartera.	Hasta 20 dígitos, según el formato xxxx,yyyyy.	<p>Segmentos de Derivados Financieros y de Energía <u>Para operaciones</u> N/A <u>Para posiciones</u> Véase apartado 12 de la circular*</p> <ul style="list-style-type: none"> Notificación de la CCP: 0 Notificación del CM: La suma del Campo 9 "VariationMargin" del fichero CACCOUNTSETL de la sesión anterior (T-1), de todas las cuentas del MC, si este valor es positivo, en caso contrario 0. <p>Segmento de IRS <u>Para operaciones</u> N/A <u>Para posiciones</u></p> <ul style="list-style-type: none"> Notificación de la CCP: 0 Notificación del CM: El Campo "VM" del fichero CTOTALINITIALMARGIN de la sesión anterior (T-1), si es positivo, en caso contrario 0.
1.31	Divisa del Variation Margin recibido	Divisa del Variation Margin recibido	Código de la moneda según la norma ISO 4217, 3 caracteres.	<p>Segmentos de Derivados Financieros y de Energía <u>Para operaciones</u> N/A <u>Para posiciones</u> Véase apartado 12 de la circular*</p> <ul style="list-style-type: none"> Campo 5 "Currency" del fichero CACCOUNTSETL. <p>Segmento de IRS <u>Para operaciones</u> N/A <u>Para posiciones</u></p> <ul style="list-style-type: none"> Notificación de la CCP: Campo "Currency" del fichero CTOTALINITIALMARGIN. Notificación del CM: Campo "Currency" del fichero CTOTALINITIALMARGIN.
1.32	Exceso de colateral aportado	Valor del colateral aportado, en exceso del requerido.	Hasta 20 dígitos, según el formato xxxx,yyyyy.	<p>Segmentos de Derivados Financieros y Energía <u>Para operaciones</u> N/A <u>Para posiciones</u></p>

	Campo RD (EU) nº 148/2013 y RE (EU) nº 1247/2012	Datos a indicar RD (EU) nº 148/2013	Formato RE (EU) nº 1247/2012	Explicación para la notificación BME Clearing Versus MC
				<p>Véase apartado 12 de la circular*</p> <ul style="list-style-type: none"> • Notificación de la CCP: 0 • Notificación del CM: Sumatorio por cuenta de garantías e isin del campo 21 "AssetValueExcess" del fichero CCPALLOCBS de hace dos sesiones (T-2). <p>Segmento IRS <u>Para operaciones</u> N/A <u>Para posiciones</u></p> <ul style="list-style-type: none"> • Notificaciones de la CCP: 0 • Notificación del CM: Sumatorio por cuenta de garantías e isin del campo 21 "AssetValueExcess" del fichero CCPALLOCBS de hace dos sesiones (T-2).
1.33	Divisa del exceso de colateral aportado	Divisa del exceso de colateral aportado	Código de la moneda según la norma ISO 4217, 3 caracteres.	<p>Segmentos de Derivados Financieros y Energía <u>Para operaciones</u> N/A <u>Para posiciones</u></p> <p>Véase apartado 12 de la circular*</p> <ul style="list-style-type: none"> • Campo 5 "Currency" del fichero CACCOUNTSETL. <p>Segmento IRS <u>Para operaciones</u> N/A <u>Para posiciones</u></p> <ul style="list-style-type: none"> • Notificación de la CCP: Campo "Currency" del fichero CTOTALINITIALMARGIN. • Notificación del CM: Campo "Currency" del fichero CTOTALINITIALMARGIN.
1.34	Exceso de colateral recibido	Valor del colateral recibido, en exceso del requerido.	Hasta 20 dígitos, según el formato xxxx,yyyyy.	<p>Segmentos de Derivados Financieros y Energía <u>Para operaciones</u> N/A <u>Para posiciones</u></p> <p>Véase apartado 12 de la circular*</p> <ul style="list-style-type: none"> • Notificación de la CCP: Sumatorio por cuenta de garantías e isin del campo 21 "AssetValueExcess" del fichero CCPALLOCBS de hace dos sesiones (T-2). • Notificación del CM: 0 <p>Segmento IRS <u>Para operaciones</u> N/A <u>Para posiciones</u></p> <ul style="list-style-type: none"> • Notificación de la CCP: Sumatorio por cuenta de garantías e isin del campo 21 "AssetValueExcess" del fichero CCPALLOCBS de hace dos sesiones (T-2). • Notificaciones del CM: 0
1.35	Divisa del exceso de colateral recibido	Divisa del exceso de colateral recibido	Código de la moneda según la norma ISO 4217, 3 caracteres.	<p>Segmentos de Derivados Financieros y Energía <u>Para operaciones</u> N/A <u>Para posiciones</u></p> <p>Véase apartado 12 de la circular*</p> <ul style="list-style-type: none"> • Campo 5 "Currency" del fichero CACCOUNTSETL. <p>Segmento IRS</p>

	Campo RD (EU) nº 148/2013 y RE (EU) nº 1247/2012	Datos a indicar RD (EU) nº 148/2013	Formato RE (EU) nº 1247/2012	Explicación para la notificación BME Clearing Versus MC
				<p><u>Para operaciones</u> N/A</p> <p><u>Para posiciones</u></p> <ul style="list-style-type: none"> • Notificación de la CCP: Campo "Currency" del fichero CTOTALINITIALMARGIN. • Notificación del CM: Campo "Currency" del fichero CTOTALINITIALMARGIN.

2.- EXPLICACIÓN SOBRE CÓMO VA A RELLENAR BME CLEARING LOS DATOS DEL INFORME “DATOS COMUNES”

A continuación se indica cómo se deben rellenar los datos del informe de “Datos Comunes”. Se ha utilizado como base para escribir este anexo el documento “EACH Field Analysis - Common Data” publicado por EACH. Recuérdese que el producto XRolling FX forma parte del segmento de Derivados Financieros.

<http://www.eachorg.com/dam/downloads/documents/131213-each-field-analysis-common-data.pdf>

Nº	Campo RD (EU) nº 148/2013 y RE (EU) nº 1247/2012	Datos a indicar RD (EU) nº 148/2013	Formato RE (EU) nº 1247/2012	Explicación para la notificación BME Clearing Versus MC
Sección 2a – Tipo de contrato				Todos los contratos
2.1	Tipo de contrato	Todos los contratos reportados deben ser clasificados.	CD: Contratos financieros por diferencias. FR: FRAs FU: Futuros FW: Forwards OP: Opciones SB: SpreadBet SW: Swap ST: Swaption OT: Otros	Segmentos de Derivados Financieros y Energía Futuros: FU Opciones: OP Swaps Energía: SW xRolling FX: FU Segmento IRS IRS: SW FRAs: FR
2.2	Clase de Activo	Todos los contratos reportados deben ser clasificados en función de su clase de activo.	CO: Commodity CR: Crédito CU: Divisa EQ: Equity IR: Tipo de interés	Segmento de Derivados Financieros EQ, excepto el “contrato de bono” que se reportará como IR y el xRolling FX que se reportará como CU. Segmento de Energía CO Segmento de IRS IR
Sección 2b – Información del contrato				Todos los contratos
2.3	Tipo de clasificación del producto	Tipo de clasificación del producto	C= CFI U= UPI	C
2.4	Clasificación del Producto	Para los productos identificados mediante ISIN o All, el código de clasificación de instrumentos financieros (CFI) debe ser especificado. Para productos para los que ISIN o All no estén disponibles, el identificador único de producto (UPI) correspondiente debe ser especificado. Hasta que se asocie un UPI a esos productos, deberán ser clasificados con el código CFI.	Código CFI de 6 caracteres alfanuméricos, según normativa ISO 10692. UPI	Segmentos de Derivados Financieros y Energía Código CFI oficial, Campo 21 del fichero CCONTRTYP (versión 9.95). Segmento IRS - OIS: SRHCSC. - Zero Coupon: SRZCSC. - Fixed-Floating: SRXXSC - Basis Swap: SRAXSC - FRA: JRIXFC.
2.5	Tipo de identificación del tipo de producto	Tipo de identificación del producto	I= ISIN A= All	Segmentos de Derivados Financieros y Energía “I” Segmento IRS Blanco
2.6	Identificación del producto	El producto se identificará mediante ISIN o All.	Para identificador de producto tipo I: Código ISIN de 12 caracteres	Segmentos de Derivados Financieros y Energía

Nº	Campo RD (EU) nº 148/2013 y RE (EU) nº 1247/2012	Datos a indicar RD (EU) nº 148/2013	Formato RE (EU) nº 1247/2012	Explicación para la notificación BME Clearing Versus MC
			alfanuméricos, según normativa ISO 6166. Para identificador de producto tipo A: Código All completo, de acuerdo con el Artículo 4(8) del Reglamento (EU) 2017/105.	ISIN de los productos. Véase Campo 16 (ISINCode) del fichero CCONTRACTS. Segmento IRS Blanco
2.7	Tipo de Identificación del subyacente	Tipo de identificación del subyacente	I= ISIN A= All U= UPI B= Cesta X= Índice	Segmentos de Derivados Financieros Derivados sobre acciones: "I" Derivados sobre el índice: "X" Futuro del Bono: "I". xRolling FX: "I" Segmento Energía Blanco Segmento IRS Blanco
2.8	Tipo de subyacente	El subyacente se identificará mediante un identificador único para ese subyacente. En caso de cestas o índices, se utilizará una indicación de dicha cesta o índice cuando no exista un identificador único.	Para tipo de identificación del subyacente "I": Código ISIN de 12 caracteres alfanuméricos, según normativa ISO 6466. Para tipo de identificación del subyacente "A": Código All, de acuerdo con el Artículo 4(8) del Reglamento (EU) 2017/105. Para tipo de identificación del subyacente "U": UPI. Para tipo de identificación del subyacente "B": Código ISIN o código All, de acuerdo con el Artículo 4(8). Para tipo de identificación del subyacente "X": Código ISO si estuviese disponible o el nombre completo asignado por el proveedor del Índice.	Segmento de Derivados Financieros Futuro del Bono se reportará "ES0SBN110007". Para el resto de productos el ISIN del subyacente: Obtener campo 5 "ContractSubgroupUnderlying" de CCONTRGRP, obtener después el ISIN de este subyacente (campo 16 "ISINCode" del fichero CCONTRACTS). Segmentos IRS y Energía Blanco
2.9	Moneda nacional 1	La moneda del importe nacional. En el caso de un contrato de derivados sobre tipos de interés, se tratará de la moneda nacional del componente 1.	Código de la moneda según la norma ISO 4217, 3 letras.	xRolling FX: BaseCurrency, campo 23 del fichero CCONTRTYP. Resto de productos: Currency, campo 8 del fichero CCONTRTYP. También se puede usar el campo 16 del fichero CTRADES.
2.10	Moneda nacional 2	La moneda del importe nacional. En el caso de un contrato de derivados sobre tipos de interés, se tratará de la moneda nacional del componente 2.	Código de la moneda según la norma ISO 4217, 3 letras.	xRolling FX: Currency, campo 8 del fichero CCONTRTYP. Resto de productos: Blanco
2.11	Moneda entregable	La moneda que habrá de entregarse.	Código de la moneda según la norma ISO 4217, 3 letras.	xRolling FX: SettlCurrency, campo 24 del fichero CCONTRTYP. Resto de productos: Currency, campo 8 del fichero CCONTRTYP. También se

Nº	Campo RD (EU) nº 148/2013 y RE (EU) nº 1247/2012	Datos a indicar RD (EU) nº 148/2013	Formato RE (EU) nº 1247/2012	Explicación para la notificación BME Clearing Versus MC
				puede usar el campo 16 del fichero CTRADES.
Sección 2c – Detalles de la transacción				Todos los contratos
2.12	Identificación de la operación	Identificador único de operación acordado a escala europea y facilitado por la contraparte notificante. De no existir un identificador único de operación, deberá crearse un código único de común acuerdo con la contraparte	Hasta 52 caracteres alfanuméricos.	<p><u>Para operaciones</u> UTI, campo 32 del fichero CTRADES. Véase apartado 3 de la circular*.</p> <p><u>Para posiciones</u> Trade ID, campo 8 del fichero CCPPOSITIONEMIR. Véase apartado 3 de la circular*</p>
2.13	Traza del reporte	Número de identificación del grupo de reportes que pertenecen al mismo contrato.	Campo alfanumérico de hasta 35 caracteres.	<p>Segmentos de Derivados Financieros y de Energía <u>Para operaciones</u> Campo 21 (InitialTradeID) del fichero CTRADES.</p> <p>Segmento IRS <u>Para operaciones</u> Campo "Approved Trade Source Trade Id-BETA" del fichero CTRADES.</p>
2.14	Identificación de la estructura	Identificador interno, que relaciona todos los reportes de un contrato de derivados, compuesto por una combinación de contratos de derivados.	Campo alfanumérico de hasta 35 caracteres.	Blanco
2.15	Plataforma de ejecución	La plataforma de ejecución se identificará mediante un código único para la misma.	Código de identificación del mercado (MIC) según la norma ISO 10383, 4 letras. En su caso, XOFF para los derivados cotizados que se negocien fuera de la bolsa o XXXX para los derivados OTC.	<p>Segmentos de Derivados Financieros y de Energía <u>Para operaciones y posiciones</u> XMRV para C2. XMXF para CD. XMPW para C7.</p> <p>Segmento IRS XXXX</p>
2.16	Compresión	Indíquese si el contrato es fruto de un ejercicio de compresión.	Y = el contrato es resultado de una compresión N = el contrato no es resultado de una compresión.	<p>Segmentos de Derivados Financieros y de Energía <u>Para operaciones</u> "N" <u>Para posiciones</u> "Y"</p> <p>Segmento IRS Véase la sección 9 de la circular*</p>
2.17	Precio/tipo	El precio por derivado, con exclusión, si procede, de las comisiones y los intereses devengados.	Hasta 20 dígitos, según el formato xxxx,yyyyy.	<p>Segmentos de Derivados Financieros y de Energía <u>Para operaciones</u> Price, campo 10 del fichero CTRADES.</p> <p><u>Para posiciones</u> Precio de Liquidación (SettlePrice, campo 8 del fichero CCONTRSTAT)</p> <p>Segmento IRS 999999999999.9999</p>
2.18	Notación del precio	La forma en que se expresa el precio.	U= Unidades P= Porcentaje Y= Yield	<p>Segmento de Derivados Financieros "U", excepto el Futuro del Bono que se reportará como "P".</p> <p>Segmento de Energía "U"</p>

Nº	Campo RD (EU) nº 148/2013 y RE (EU) nº 1247/2012	Datos a indicar RD (EU) nº 148/2013	Formato RE (EU) nº 1247/2012	Explicación para la notificación BME Clearing Versus MC
				Segmento IRS "X"
2.19	Divisa del precio	Divisa en al que se denomina el precio	Código de la moneda según la norma ISO 4217, 3 caracteres.	Si el campo 2.18 se ha rellenado con U, entonces, Campo "Currency" del fichero CTRADES. Si no, blanco.
2.20	Importe Nocional	Importe de referencia sobre el que se calculan los diferentes flujos contractuales. Si el nocional varía a lo largo del tiempo, este campo reflejará el nocional vivo.	Hasta 20 dígitos, según el formato xxxx,yyyyy.	Segmentos de Derivados Financieros y Energía <i>Para operaciones</i> GrossTradeAmount, campo 29 del fichero CTRADES. En valor absoluto. <i>Para posiciones</i> El resultado de multiplicar la cantidad (campo 16 de esta tabla) por el Precio de Liquidación (SettlePrice, campo 8 del fichero CCONTRSTAT) por el Multiplicador del Precio (campo 15 de esta tabla). En valor absoluto. Segmento IRS Campo "Notional" del fichero CTRADES, en valor absoluto.
2.21	Multiplicador del Precio	El número de unidades del instrumento financiero que componen un paquete negociado.	Hasta 20 dígitos, según el formato xxxx,yyyyy.	Segmento de Derivados Financieros y Energía PriceMultiplier, campo 6 del fichero CCONTRTYP. Segmento IRS 1
2.22	Cantidad	Número de contratos incluidos en la notificación, en caso de que se notifique más de un contrato de derivados.	Hasta 20 dígitos, según el formato xxxx,yyyyy.	Segmentos de Derivados Financieros y Energía <i>Para operaciones</i> Quantity, campo 11 del fichero CTRADES <i>Para posiciones</i> Quantity, campo 11 del fichero CCPPOSITIONEMIR. Segmento IRS 1
2.23	Anticipo	Importe de cualquier pago anticipado que la contraparte informante haya realizado o recibido.	Hasta 20 dígitos, según el formato xxxx,yyyyy. Se usará el signo negativo para indicar que el importe se paga, no se recibe.	Segmentos de Derivados Financieros y Energía 0 Segmento IRS Suma del campo "Amount" de una misma operación, del fichero CCONSIDERATIONS.
2.24	Tipo de entrega	Indica si el contrato se liquida físicamente o en efectivo.	C= efectivo P= física O= opcional para la contraparte o cuando sea determinado por un tercero.	Segmentos de Derivados Financieros y Energía Campo 17 'SettleMethod' del fichero CCONTRTYP Segmento IRS 'C'
2.25	Marca del tiempo de la ejecución	Fecha y hora de ejecución del contrato.	Formato de fecha según la norma ISO 8601 / hora UTC YYYY-MM-DD-THH:MM:SSZ.	Segmentos de Derivados Financieros y Energía <i>Para operaciones</i> Execution Time, campo 27 del fichero CTRADES. <i>Para posiciones</i>

Nº	Campo RD (EU) nº 148/2013 y RE (EU) nº 1247/2012	Datos a indicar RD (EU) nº 148/2013	Formato RE (EU) nº 1247/2012	Explicación para la notificación BME Clearing Versus MC
				COB Date, campo 1 del fichero CCPPOSITIONEMIR y 23:59:00 UTC. Segmento IRS Campo "InitialTrading data timing" del fichero CTRADES.
2.26	Fecha efectiva	Fecha en que las obligaciones previstas en el contrato entran en vigor.	Formato de fecha según la norma ISO 8601 YYYY-MM-DD.	Segmentos de Derivados Financieros y Energía Fecha de la sesión. Segmento IRS Si la fecha de sesión > Campo "Effective Date" del fichero CREGISTER, Fecha de Sesión, en caso contrario, el Campo "Effective Date" del fichero CREGISTER.
2.27	Fecha de vencimiento	Fecha inicial de expiración del contrato notificado. No deberá indicarse en este campo la resolución anticipada de un contrato.	Formato de fecha según la norma ISO 8601 YYYY-MM-DD.	Segmentos de Derivados Financieros y Energía Maturity Date, campo 7 del fichero CCONTRACTS. Segmento IRS Campo "Maturity Date" del fichero CTRADES.
2.28	Fecha de terminación	Fecha de terminación del contrato, en caso de resolución anticipada del mismo.	Formato de fecha según la norma ISO 8601 YYYY-MM-DD.	Segmentos de Derivados Financieros y Energía <u>Para operaciones</u> N/A <u>Para posiciones</u> N/A Segmento IRS En el caso de Z (neteo) o C (cancelación), fecha de sesión.
2.29	Fecha de liquidación	Fecha de liquidación del subyacente. Si hay más de una, podrán usarse campos adicionales.	Formato de fecha según la norma ISO 8601 YYYY-MM-DD.	Segmentos de Derivados Financieros y Energía Maturity Date, campo 7 del fichero CCONTRACTS. Segmento IRS Campo "Payment date" del fichero CCOUPONS. Puede haber varias fechas de liquidación.
2.30	Tipo de acuerdo marco	Referencia a cualquier acuerdo marco, si existiera.	Texto libre, campo de hasta 50 caracteres	N/A
2.31	Versión del acuerdo marco	Referencia al año del acuerdo marco aplicable a la operación.	Año, XXXX.	N/A
Sección 2d – Reducción del riesgo/Notificación				Todos los contratos
2.32	Marca de tiempo de la confirmación	Fecha y hora de la confirmación.	Formato de fecha según la norma ISO 8601, hora UTC YYYY-MM-DD-TTHH:MM:SSZ	Mismo dato que el campo 2.36 de esta tabla (Marca de tiempo de la compensación)
2.33	Medios de confirmación	Indicación de si el contrato se ha confirmado por vía electrónica, por medios no electrónicos o permanece sin confirmar.	Y= confirmado por vía no electrónica N= no confirmado E= confirmado por vía electrónica.	"N"
Sección 2e – Compensación				Todos los contratos
2.34	Obligación de compensación	Indicación de si el contrato pertenece a alguna de las clases de	Y = Si N = No	Segmentos de Derivados Financieros y de Energía

Nº	Campo RD (EU) nº 148/2013 y RE (EU) nº 1247/2012	Datos a indicar RD (EU) nº 148/2013	Formato RE (EU) nº 1247/2012	Explicación para la notificación BME Clearing Versus MC
		derivados OTC que están sujetas a la obligación de compensación.		Por el momento "N" en todos los productos. Segmento IRS "Y"
2.35	Compensado	Indicación de si la compensación ha tenido lugar.	Y = Si N = No	"Y"
2.36	Marca de tiempo de la compensación	Fecha y hora de la compensación.	Formato de fecha según la norma ISO 8601 / hora UTC YYYY-MM-DD-THH:MM:SSZ.	Segmentos de Derivados Financieros y de Energía <u>Para operaciones</u> RegDate, campo 18 del fichero CTRADES y RegTime, campo 19 del fichero CTRADES. <u>Para posiciones</u> COB Date, campo 1 del fichero CCPPOSITIONEMIR y 23:59:00 UTC. Segmento IRS Campo "RegTimestamp" del fichero CTRADES.
2.37	CCP	Cuando el contrato haya sido objeto de compensación, el código único correspondiente a la CCP que la haya efectuado.	Identificador de entidades jurídicas (LEI) (20 caracteres alfanuméricos).	LEI de BME Clearing: 5299009QA8BBE200B349
2.38	Intragrupo	Indicación de si el contrato se ha celebrado en una operación intragrupo.	Y = Si N = No	"N"
Sección 2f – Tipos de interés				Derivados sobre tipo de interés
2.39	Tipo fijo de la pata 1	Indicación del tipo fijo aplicable la pata 1, si procede.	Hasta 10 caracteres numérico, incluyendo decimales, expresados como porcentaje, dónde 100% se reportará como 100.	Segmentos de Derivados Financieros y de Energía N/A Segmento IRS <ul style="list-style-type: none"> Para todas las operaciones, excepto los FRAs, si el campo "LEG Type A" del fichero CREGISTER es igual a "FIX", se informará el campo "RateA", en caso contrario blanco. Para FRAs: N/A
2.40	Tipo fijo de la pata 2	Indicación del tipo fijo aplicable la pata 2, si procede.	Hasta 10 caracteres numérico, incluyendo decimales, expresados como porcentaje, dónde 100% se reportará como 100.	Segmentos de Derivados Financieros y de Energía N/A Segmento IRS <ul style="list-style-type: none"> Para todas las operaciones, excepto los FRAs, si el campo "LEG Type B" del fichero CREGISTER es igual a "FIX", se informará el campo "RateB", en caso contrario blanco. Para FRAs, campo "FRAFixedRate" del fichero COPINFRA.
2.41	Computo de días del tipo fijo de la pata 1	Número efectivo de días del período de cálculo aplicado por el pagador del tipo fijo de la pata 1, si procede.	Numerador/Denominador, donde ambos son valores numéricos o alfabéticos (ej. 30/360 ó Actual/365).	Segmentos de Derivados Financieros y de Energía N/A Segmento IRS

Nº	Campo RD (EU) nº 148/2013 y RE (EU) nº 1247/2012	Datos a indicar RD (EU) nº 148/2013	Formato RE (EU) nº 1247/2012	Explicación para la notificación BME Clearing Versus MC
				<ul style="list-style-type: none"> Para todas las operaciones, excepto los FRAs, si el campo "LEG Type A" del fichero CREGISTER es igual a "FIX", se informará el campo "Day Count Fraction A", en caso contrario blanco. Para FRAs: N/A
2.42	Computo de días del tipo fijo de la pata 2	Número efectivo de días del período de cálculo aplicado por el pagador del tipo fijo de la pata 2, si procede.	Numerador/Denominador, donde ambos son valores numéricos o alfabéticos (ej. 30/360 ó Actual/365).	<p>Segmentos de Derivados Financieros y de Energía N/A</p> <p>Segmento IRS</p> <ul style="list-style-type: none"> Para todas las operaciones, excepto los FRAs, si el campo "LEG Type B" del fichero CREGISTER es igual a "FIX", se informará el campo "Day Count Fraction B", en caso contrario blanco. Para FRAs: Campo "Day Count Fraction" del fichero COPINFRA.
2.43	Frecuencia de pago del tipo fijo de la pata 1 – Periodo temporal	Periodo temporal de la frecuencia de pago del tipo fijo de la pata 1, si procede.	Y= Año M= Mes W= Semana D= Día	<p>Segmentos de Derivados Financieros y de Energía N/A</p> <p>Segmento IRS</p> <ul style="list-style-type: none"> Para todas las operaciones, excepto los FRAs, si el campo "LEG Type A" del fichero COPINIRS es igual a "FIX": <ul style="list-style-type: none"> Si Zero Coupon Swap: "Y". Para el resto de productos, se informará el último carácter del campo "Payment Period A". <p>En caso contrario blanco.</p> <ul style="list-style-type: none"> Para FRAs: N/A
2.44	Frecuencia de pago del tipo fijo de la pata 1 – Multiplicador	Multiplicador del periodo temporal que describe la frecuencia de pago del tipo fijo de la pata 1, si procede	Número entero de hasta 3 caracteres numéricos	<p>Segmentos de Derivados Financieros y de Energía N/A</p> <p>Segmento IRS</p> <ul style="list-style-type: none"> Para todas las operaciones, excepto los FRAs, si el campo "LEG Type A" del fichero COPINIRS es igual a "FIX": <ul style="list-style-type: none"> Si Zero Coupon Swap: 0. Para el resto de productos, se informará el primer carácter del campo "Payment Period A". <p>En caso contrario blanco.</p> <ul style="list-style-type: none"> Para FRAs: N/A
2.45	Frecuencia de pago del tipo fijo de la pata 2 – Periodo temporal	Periodo temporal de la frecuencia de pago del tipo fijo de la pata 2, si procede.	Y= Año M= Mes W= Semana D= Día	<p>Segmentos de Derivados Financieros y de Energía N/A</p> <p>Segmento IRS</p> <ul style="list-style-type: none"> Para todas las operaciones, excepto los FRAs, si el campo "LEG Type B" del fichero COPINIRS es igual a "FIX": <ul style="list-style-type: none"> Si Zero Coupon Swap: "Y".

Nº	Campo RD (EU) nº 148/2013 y RE (EU) nº 1247/2012	Datos a indicar RD (EU) nº 148/2013	Formato RE (EU) nº 1247/2012	Explicación para la notificación BME Clearing Versus MC
				<ul style="list-style-type: none"> - Para el resto de productos, se informará el último carácter del campo "Payment Period B". En caso contrario blanco. • Para FRAs: N/A
2.46	Frecuencia de pago del tipo fijo de la pata 2 – Multiplicador	Multiplicador del periodo temporal que describe la frecuencia de pago del tipo fijo de la pata 2, si procede	Número entero de hasta 3 caracteres numéricos	<p>Segmentos de Derivados Financieros y de Energía N/A</p> <p>Segmento IRS</p> <ul style="list-style-type: none"> • Para todas las operaciones, excepto los FRAs, si el campo "LEG Type B" del fichero COPINIRS es igual a "FIX": <ul style="list-style-type: none"> - Si Zero Coupon Swap: 0. - Para el resto de productos, se informará el primer carácter del campo "Payment Period B". <p>En caso contrario blanco.</p> • Para FRAs: N/A
2.47	Frecuencia de pago del tipo variable de la pata 1 – Periodo temporal	Periodo temporal de la frecuencia de pago del tipo variable de la pata 1, si procede.	Y= Año M= Mes W= Semana D= Día	<p>Segmentos de Derivados Financieros y de Energía N/A</p> <p>Segmento IRS</p> <ul style="list-style-type: none"> • Para todas las operaciones, excepto los FRAs, si el campo "LEG Type A" del fichero COPINIRS es igual a "FL": <ul style="list-style-type: none"> - Si Zero Coupon Swap: "Y". - Para el resto de productos, se informará el último carácter del campo "Payment Period A". <p>En caso contrario blanco.</p> • Para FRAs: N/A
2.48	Frecuencia de pago del tipo variable de la pata 1 – Multiplicador	Multiplicador del periodo temporal que describe la frecuencia de pago del tipo variable de la pata 1, si procede	Número entero de hasta 3 caracteres numéricos	<p>Segmentos de Derivados Financieros y de Energía N/A</p> <p>Segmento IRS</p> <ul style="list-style-type: none"> • Para todas las operaciones, excepto los FRAs, si el campo "LEG Type A" del fichero COPINIRS es igual a "FL": <ul style="list-style-type: none"> - Si Zero Coupon Swap: 0. - Para el resto de productos, se informará el primer carácter del campo "Payment Period A". <p>En caso contrario blanco.</p> • Para FRAs: N/A
2.49	Frecuencia de pago del tipo variable de la pata 2 – Periodo temporal	Periodo temporal de la frecuencia de pago del tipo variable de la pata 2, si procede.	Y= Año M= Mes W= Semana D= Día	<p>Segmentos de Derivados Financieros y de Energía N/A</p> <p>Segmento IRS</p> <ul style="list-style-type: none"> • Para todas las operaciones, excepto los FRAs, si el campo "LEG Type B" del fichero COPINIRS es igual a "FL": <ul style="list-style-type: none"> - Si Zero Coupon Swap: "Y".

Nº	Campo RD (EU) nº 148/2013 y RE (EU) nº 1247/2012	Datos a indicar RD (EU) nº 148/2013	Formato RE (EU) nº 1247/2012	Explicación para la notificación BME Clearing Versus MC
				<ul style="list-style-type: none"> - Para el resto de productos, se informará el último carácter del campo "Payment Period B". En caso contrario blanco. • Para FRAs: N/A
2.50	Frecuencia de pago del tipo variable de la pata 2 – Multiplicador	Multiplicador del periodo temporal que describe la frecuencia de pago del tipo variable de la pata 2, si procede	Número entero de hasta 3 caracteres numéricos	Segmentos de Derivados Financieros y de Energía N/A Segmento IRS <ul style="list-style-type: none"> • Para todas las operaciones, excepto los FRAs, si el campo "LEG Type B" del fichero COPINIRS es igual a "FL": <ul style="list-style-type: none"> - Si Zero Coupon Swap: 0. - Para el resto de productos, se informará el primer carácter del campo "Payment Period B". En caso contrario blanco. <ul style="list-style-type: none"> • Para FRAs: N/A
2.51	Frecuencia de reseteo del tipo variable de la pata 1- Periodo temporal	Periodo temporal de la frecuencia de reseteo del tipo variable de la pata 1, si procede.	Y= Año M= Mes W= Semana D= Día	Segmentos de Derivados Financieros y de Energía N/A Segmento IRS <ul style="list-style-type: none"> • Para todas las operaciones, excepto los FRAs, si el campo "LEG Type A" del fichero COPINIRS es igual a "FL", se informará el campo "Index Tenor A Period", en caso contrario blanco. • Para FRAs: campo "IndexTenor A Period" del fichero COPINFRA
2.52	Frecuencia de reseteo del tipo variable de la pata 1- Multiplicador	Multiplicador del periodo temporal que describe la frecuencia de reseteo del tipo variable de la pata 1, si procede	Número entero de hasta 3 caracteres numéricos	Segmentos de Derivados Financieros y de Energía N/A Segmento IRS <ul style="list-style-type: none"> • Para todas las operaciones, excepto los FRAs, si el campo "LEG Type A" del fichero COPINIRS es igual a "FL", se informará el campo "Index Tenor A Multiplier", en caso contrario blanco. • Para FRAs: campo "IndexTenor A Multiplier" del fichero COPINFRA
2.53	Frecuencia de reseteo del tipo variable de la pata 2- Periodo temporal	Periodo temporal de la frecuencia de reseteo del tipo variable de la pata 2, si procede.	Y= Año M= Mes W= Semana D= Día	Segmentos de Derivados Financieros y de Energía N/A Segmento IRS <ul style="list-style-type: none"> • Para todas las operaciones, excepto los FRAs, si el campo "LEG Type B" del fichero COPINIRS es igual a "FL", se informará el campo "Index Tenor B Period", en caso contrario blanco. • Para FRAs: N/A
2.54	Frecuencia de reseteo del tipo variable de la	Multiplicador del periodo temporal que describe la frecuencia de reseteo del	Número entero de hasta 3 caracteres numéricos	Segmentos de Derivados Financieros y de Energía N/A

Nº	Campo RD (EU) nº 148/2013 y RE (EU) nº 1247/2012	Datos a indicar RD (EU) nº 148/2013	Formato RE (EU) nº 1247/2012	Explicación para la notificación BME Clearing Versus MC
	pata 2- Multiplicador	tipo variable de la pata 2, si procede		Segmento IRS <ul style="list-style-type: none"> Para todas las operaciones, excepto los FRAs, si el campo "LEG Type B" del fichero COPINIRS es igual a "FL", se informará el campo "Index Tenor B Multiplier", en caso contrario blanco. Para FRAs: N/A
2.55	Tipo variable de la pata 1	Indicación del tipo de interés variable aplicable a la pata 1, que se reajusten a intervalos predeterminados con relación a un tipo de referencia del mercado, si procede.	Nombre del índice del tipo variable: 'EONA' - EONIA 'EONS' - EONIA SWAP 'EURI' - EURIBOR 'EUUS' - EURODOLLAR 'EUCH' - EuroSwiss 'GCFR' - GCF REPO 'ISDA' - ISDAFIX 'LIBI' - LIBID 'LIBO' - LIBOR 'MAAA' - Muni AAA 'PFAN' - Pfandbriefe 'TIBO' - TIBOR 'STBO' - STIBOR 'BBSW' - BBSW 'JIBA' - JIBAR 'BUBO' - BUBOR 'CDOR' - CDOR 'CIBO' - CIBOR 'MOSP' - MOSPRIM 'NIBO' - NIBOR 'PRBO' - PRIBOR 'TLBO' - TELBOR 'WIBO' - WIBOR 'TREA' - Treasury 'SWAP' - SWAP 'FUSW' - Future SWAP O hasta 25 caracteres, si no estuviese incluido en el listado anterior.	Segmentos de Derivados Financieros y Energía N/A Segmento IRS <ul style="list-style-type: none"> Para todas las operaciones, excepto FRAs, si el campo "LEG Type A", del fichero CREGISTER, es igual a "FL", si el campo "Index A" es igual a "EONIA", "EONA", en caso contrario "EURI". Para FRAs, "EURI"
2.56	Periodo de referencia del tipo variable de la pata 1- Periodo temporal	Periodo temporal de la referencia del tipo variable de la pata 1, si procede.	Y= Año M= Mes W= Semana D= Día	Segmentos de Derivados Financieros y de Energía N/A Segmento IRS <ul style="list-style-type: none"> Para todas las operaciones, excepto los FRAs, si el campo "LEG Type A" del fichero COPINIRS es igual a "FL", se informará el campo "Index Tenor A Period", en caso contrario blanco. Para FRAs: campo "IndexTenor A Period" del fichero COPINFRA
2.57	Periodo de referencia del tipo variable de la pata 1- Multiplicador	Multiplicador del periodo temporal de la referencia del tipo variable de la pata 1, si procede	Número entero de hasta 3 caracteres numéricos	Segmentos de Derivados Financieros y de Energía N/A Segmento IRS <ul style="list-style-type: none"> Para todas las operaciones, excepto los FRAs, si el campo "LEG Type A" del fichero COPINIRS es igual a "FL", se informará el campo "Index

Nº	Campo RD (EU) nº 148/2013 y RE (EU) nº 1247/2012	Datos a indicar RD (EU) nº 148/2013	Formato RE (EU) nº 1247/2012	Explicación para la notificación BME Clearing Versus MC
				Tenor A Multiplier", en caso contrario blanco. <ul style="list-style-type: none"> Para FRAs: campo "IndexTenor A Multiplier" del fichero COPINFRA
2.58	Tipo variable de la pata 2	Indicación del tipo de interés variable aplicable a la pata 2, que se reajusten a intervalos predeterminados con relación a un tipo de referencia del mercado, si procede.	Nombre del índice del tipo variable: 'EONA' - EONIA 'EONS' - EONIA SWAP 'EURI' - EURIBOR 'EUUS' - EURODOLLAR 'EUCH' - EuroSwiss 'GCFR' - GCF REPO 'ISDA' - ISDAFIX 'LIBI' - LIBID 'LIBO' - LIBOR 'MAAA' - Muni AAA 'PFAN' - Pfandbriefe 'TIBO' - TIBOR 'STBO' - STIBOR 'BBSW' - BBSW 'JIBA' - JIBAR 'BUBO' - BUBOR 'CDOR' - CDOR 'CIBO' - CIBOR 'MOSP' - MOSPRIM 'NIBO' - NIBOR 'PRBO' - PRIBOR 'TLBO' - TELBOR 'WIBO' - WIBOR 'TREA' - Treasury 'SWAP' - SWAP 'FUSW' - Future SWAP O hasta 25 caracteres, si no estuviese incluido en el listado anterior.	Segmentos de Derivados Financieros y Energía N/A Segmento IRS <ul style="list-style-type: none"> Para todas las operaciones, excepto FRAs, si el campo "LEG Type B", del fichero CREGISTER, es igual a "FL", si el campo "Index B" es igual a "EONIA", "EONA", en caso contrario "EURI". Para FRAs, "N/A"
2.59	Periodo de referencia del tipo variable de la pata 2- Periodo temporal	Periodo temporal de la referencia del tipo variable de la pata 2, si procede.	Y= Año M= Mes W= Semana D= Día	Segmentos de Derivados Financieros y de Energía N/A Segmento IRS <ul style="list-style-type: none"> Para todas las operaciones, excepto los FRAs, si el campo "LEG Type B" del fichero COPINIRS es igual a "FL", se informará el campo "Index Tenor B Period", en caso contrario blanco. Para FRAs: "N/A"
2.60	Periodo de referencia del tipo variable de la pata 2- Multiplicador	Multiplicador del periodo temporal de la referencia del tipo variable de la pata 2, si procede	Número entero de hasta 3 caracteres numéricos	Segmentos de Derivados Financieros y de Energía N/A Segmento IRS <ul style="list-style-type: none"> Para todas las operaciones, excepto los FRAs, si el campo "LEG Type B" del fichero COPINIRS es igual a "FL", se informará el campo "Index Tenor B Multiplier", en caso contrario blanco. Para FRAs: "N/A"
Sección 2g – Divisas				Derivados sobre divisas
2.61	Moneda 2	La otra moneda de la operación, si difiere de la moneda de entrega.	Código de la moneda según la norma ISO 4217, 3 letras.	Segmentos de Derivados Financieros <ul style="list-style-type: none"> xRolling: N/A.

Nº	Campo RD (EU) nº 148/2013 y RE (EU) nº 1247/2012	Datos a indicar RD (EU) nº 148/2013	Formato RE (EU) nº 1247/2012	Explicación para la notificación BME Clearing Versus MC
				<ul style="list-style-type: none"> Resto de productos: N/A. Segmentos de Energía e IRS N/A.
2.62	Tipo de cambio 1	Tipo de cambio contractual de las monedas.	Hasta 10 dígitos, según el formato xxxx,yyyyy.	Segmentos de Derivados Financieros <ul style="list-style-type: none"> xRolling: <ul style="list-style-type: none"> <i>Operaciones:</i> Price, campo 10 del fichero CTRADES. <i>Posiciones:</i> SettPrice, campo 8 del fichero CCONTRSTAT. Resto de productos: N/A Segmentos de Energía e IRS N/A
2.63	Tipo de cambio a plazo	Tipo de cambio a plazo en la fecha de valor.	Hasta 10 dígitos, según el formato xxxx,yyyyy.	Segmentos de Derivados Financieros N/A Segmentos de Energía e IRS N/A
2.64	Base del tipo de cambio	Paridad en que se basa el tipo de cambio.	P.ej. EUR/USD or USD/EUR.	Segmentos de Derivados Financieros <ul style="list-style-type: none"> xRolling: <ul style="list-style-type: none"> 3 primeros caracteres del campo ContractCode, seguido de "/" y de los 3 últimos caracteres de ese mismo campo (Campo 3 del fichero CCONTRACTS). Resto de productos: N/A Segmentos de Energía e IRS N/A
Sección 2h – Materias primas				Derivados sobre materias primas
2.65	Base de la materia prima	Indicación del tipo de materia prima subyacente al contrato.	AG = agrícola EN = energía FR = transporte de mercancías ME = metales IN = índice EV = medioambiental EX = exótica OT= otros	Segmento de Energía "EN". Segmentos de Derivados Financieros e IRS N/A.
2.66	Detalles de la materia prima	Detalles de la materia prima considerada adicionales a los indicados en el campo 65.	<i>Agricultura</i> GO = semillas oleaginosas DA = productos lácteos LI = ganado FO = productos forestales SO = materias primas blandas SF= productos marítimos OT= Otros <i>Energía</i> OI = petróleo NG = gas natural CO = carbón EL = electricidad IE = inter-energía OT=Otros Flete/Carga DR = Seco WT = Humedo OT = Other <i>Metales</i>	Segmento de Energía "EL". Segmentos de Derivados Financieros e IRS N/A.

Nº	Campo RD (EU) nº 148/2013 y RE (EU) nº 1247/2012	Datos a indicar RD (EU) nº 148/2013	Formato RE (EU) nº 1247/2012	Explicación para la notificación BME Clearing Versus MC
			PR = preciosos NP = no preciosos <i>Medioambiental</i> WE = tiempo meteorológico EM = emisiones OT= otros	
Energía				
2.67	Punto o zona de entrega	Punto o puntos de entrega del área o áreas de mercado.	Código EIC, 16 caracteres alfanuméricos	Segmento de Energía "10YES-REE-----0" Segmentos de Derivados Financieros e IRS N/A
2.68	Punto de interconexión	Identificación de las fronteras o puntos fronterizos de un contrato de transporte.	Código EIC, 16 caracteres alfanuméricos	Segmento de Energía XXXXXXXXXXXXXXXXXX Segmentos de Derivados Financieros e IRS N/A
2.69	Tipo de carga	Identificación del perfil de entrega.	BL = carga base PL = punta de carga OP = fuera de punta BH = bloque horario SH= Shaped GD= Gas day OT = otros	Segmento Energía "BL" si "01" ó "02" "PL" si "11" ó "12" del campo ContractSubgroupCode, campo 3 en el fichero CCONTRTYP ó campo 4 del fichero CCONTRACTS. Segmentos de Derivados Financieros e IRS N/A
2.70	Intervalo de entrega	Intervalo temporal para cada bloque o paquete	hh:mmZ	Segmento Energía 01:00Z Segmentos de Derivados Financieros e IRS N/A
2.71	Fecha y hora de comienzo de la entrega	Fecha y hora de comienzo de la entrega	Formato de fecha según la norma ISO 8601 / hora UTC YYYY-MM-DD-Thh:mm:ssZ.	Segmento Energía Campo 17 "StartMaturityMonthYear", del fichero CCONTRACTS. Si el campo 69 de esta tabla es igual a "BL" añadir 23:59:59 como hora. Si el campo 69 de esta tabla es igual a "PL" añadir "08:00:00" como hora. Segmentos de Derivados Financieros e IRS N/A
2.72	Fecha y hora de conclusión de la entrega	Fecha y hora de conclusión de la entrega	Formato de fecha según la norma ISO 8601 / hora UTC YYYY-MM-DD-THH:MM:SSZ.	Segmento Energía Campo 18 "EndMaturityMonthYear", del fichero CCONTRACTS. Si el campo 69 de esta tabla es igual a "BL" añadir 23:59:59 como hora. Si el campo 69 de esta tabla es igual a "PL", añadir 21:59:59 como hora. Segmento Derivados Financieros e IRS N/A
2.73	Duración	La duración del periodo de entrega	N= Minutos H= Horas D= Días W= Semanas	Segmento Energía Campo 19 "Periodicity" del fichero CCONTRTYP.

Nº	Campo RD (EU) nº 148/2013 y RE (EU) nº 1247/2012	Datos a indicar RD (EU) nº 148/2013	Formato RE (EU) nº 1247/2012	Explicación para la notificación BME Clearing Versus MC
			M= Meses Q= Trimestres S= Temporadas Y= Años O=Otros	Los siguientes productos requerirán una modificación: Para productos semanales, "K", fin de semana ("E") o semana laborable "B" se reportará "W".
2.74	Días de la semana	Días de la semana de la entrega	WD= Días entresemana WN= Fines de semana MO= Lunes TU= Martes WE= Miércoles TH= Jueves FR= Viernes SA= Sábados SU= Domingos Se admiten varios de estos valores separados por "/".	<p>Segmento Energía Si el campo 2.69 es igual a "BL":</p> <ul style="list-style-type: none"> • Si el campo 2.73 es igual a Y, Q o M, entonces WD/WN. • Si el campo 73 de esta tabla es igual a "W": <ul style="list-style-type: none"> • Si el campo 19 "Periodicity" del fichero CCONTRTYP es: <ul style="list-style-type: none"> o igual a "K", WD/WN o igual a "E", "WN", o igual a "B", "WD". • Si el campo 2.73 de esta tabla es igual a "D" convertir el día del contrato diario a día de la semana. <p>Si el campo 2.69 de esta tabla es igual a "PL":</p> <ul style="list-style-type: none"> • Si el campo 73 de esta tabla es igual a "Y", "Q", "M" o "W": entonces "WD". • - Si el campo 2.73 de esta tabla es igual a "D" convertir el día del contrato diario a día de la semana. <p>Segmentos de Derivados Financieros e IRS N/A</p>
2.75	Capacidad del contrato	Cantidad por intervalo de tiempo de la entrega, especificado en el campo 70.	Hasta 20 dígitos, según el formato xxxx,yyyyy.	<p>Segmento Energía Campo 6 "Price Multiplier" del fichero CCONTRTYP</p> <p>Segmentos de Derivados Financieros e IRS N/A</p>
2.76	Unidad de cantidad	Cantidad por día u hora en MWh o kWh/d que corresponda a la materia prima subyacente.	KW KWh/h KWh/d MW MWh/h MWh/d GW GWh/h GWh/d Therm/d KTherm/d MTherm/d cm/d mcm/d	<p>Segmento Energía "MW"</p> <p>Segmentos de Derivados Financieros e IRS N/A</p>
2.77	Precio por cantidad por intervalo de tiempo de entrega	Si procede, precio por cantidad por intervalo de tiempo de la entrega.	Hasta 20 dígitos, según el formato xxxx,yyyyy.	<p>Segmento Energía Igual que el campo 2.17 (Precio/Tipo) de este fichero.</p> <p>Segmentos de Derivados Financieros e IRS N/A.</p>
Sección 2i - Opciones				Contratos que contienen una opción
2.78	Tipo de opción	Indicación de si el contrato representa una	C = Call P = Put	Segmento de Derivados Financieros

Nº	Campo RD (EU) nº 148/2013 y RE (EU) nº 1247/2012	Datos a indicar RD (EU) nº 148/2013	Formato RE (EU) nº 1247/2012	Explicación para la notificación BME Clearing Versus MC
		<p>opción de compra o de venta o si no puede determinarse si es una call o una put en el momento de ejecución del contrato.</p> <p>En caso de Caps y Floors, será:</p> <ul style="list-style-type: none"> • "Put": En caso de un Floor. • "Call": En caso de un Cap. 	O= Cuando no pueda determinarse si es una call o una put.	<p>Campo 18 "PutorCall" del fichero CCONTRTYP¹.</p> <p>Segmentos de Energía e IRS N/A</p>
2.79	Estilo de opción (ejercicio)	Indicación de si la opción solo puede ejercitarse en una fecha determinada, (estilo europeo y asiático), en una serie de fechas predeterminadas (estilo «bermuda») o en cualquier momento durante el período de vigencia del contrato (estilo americano).	<p>A= americana B= bermuda E= europea S= asiática. Se admite más de un valor.</p>	<p>Segmento de Derivados Financieros Si se ha informado "C" o "P" en el campo 2.78 de esta tabla, entonces campo 16 "ExerciseStyle" del fichero CCONTRTYP.</p> <p>Segmentos de Energía e IRS N/A</p>
2.80	Precio de ejercicio (máximo/mínimo)	Precio de ejercicio de la opción.	<p>Hasta 20 dígitos, según el formato xxxx,yyyyy.</p> <p>Si el precio de ejercicio se reportase en porcentaje, se expresará de manera que 100, representará un 100%.</p>	<p>Segmento de Derivados Financieros Si se ha informado "C" o "P" en el campo 2.78 de esta tabla entonces Strikeprice, campo 6 del fichero CCONTRACTS.</p> <p>Segmentos de Energía e IRS N/A</p>
2.81	Notación del precio de ejercicio	Modo en el que el strike Price está expresado	<p>U= Unidades P= Porcentaje Y= Yield</p>	<p>Segmentos de Derivados Financieros Si se ha informado "C" o "P" en el campo 78, entonces "U".</p> <p>Segmentos de Energía e IRS N/A</p>
2.82	Fecha de Vencimiento del subyacente	En caso de swaptions, fecha de vencimiento del swap subyacente.	Formato de fecha según la norma ISO 8601 / hora UTC YYYY-MM-DD.	<p>Segmentos de Derivados Financieros N/A</p> <p>Segmentos de Energía e IRS N/A</p>
Sección 2j – Derivados de Crédito				Derivados de Crédito
2.83	Seniority	Información sobre la seniority en caso de contratos sobre índices o sobre una sola entidad.	<p>SNDB= Senior, como Deuda Senior no garantizada (Financiera/No Financiera), Deuda pública extranjera. SBOD= Subordinada, como Deuda subordinada o por debajo de Tier 2 (Bancos), Deuda Junior Subordinada o superior a Tier 2 (Bancos). OTHR= Otros, como Participaciones preferentes o capital Tier 1 (Bancos) o otros derivados de crédito.</p>	N/A
2.84	Entidad de Referencia	Identificación de la entidad de referencia subyacente.	Código país de 2 caracteres (ISO 3166) o Código país de 2	N/A

¹ Se ha modificado el fichero CCONTRTYP para facilitar la implementación a los miembros.

Nº	Campo RD (EU) nº 148/2013 y RE (EU) nº 1247/2012	Datos a indicar RD (EU) nº 148/2013	Formato RE (EU) nº 1247/2012	Explicación para la notificación BME Clearing Versus MC
			caracteres (ISO 3166) seguido de "-" y hasta 3 caracteres alfanuméricos indicando el código de subdivisión del país o el Identificador de entidades jurídicas (LEI), de 20 caracteres alfanuméricos.	
2.85	Frecuencia de Pago	La frecuencia de pago del tipo de interés o cupón.	MNTH= Mensual QURT= Trimestral MIAN= Semi-Anual YEAR= Anual	N/A
2.86	Base de cálculo	Base de cálculo del tipo de interés	Numerador/Denominador, donde ambos son valores numéricos o alfabéticos (ej. 30/360 ó Actual/365).	N/A
2.87	Series	Numero de series de la composición del índice, si aplica.	Número entero de hasta 5 caracteres.	N/A
2.88	Versión	Una nueva versión de una serie será emitida si uno de los constituyentes hiciese default y el índice tendría que re-balancearse para tener en cuenta el nuevo número de constituyentes del índice.	Número entero de hasta 5 caracteres.	N/A
2.89	Factor del Índice	Factor a aplicar al notional (campo 20) para ajustarlo a eventos de crédito pasados en esa seire del Índice. La cifra variará entre 0 y 100.	Hasta 10 caracteres numéricos, incluyendo decimales.	N/A
2.90	Tranche	Indica si el derivado está o no dividido en tranches.	T= Dividido en tranches U= No dividido en tranches	N/A
2.91	Attachment point	Punto en el que las pérdidas de la cesta atacarán a un tranche en particular.	Hasta 10 caracteres numéricos, incluyendo decimales.	N/A
2.92	Detachment point	Punto al partir del que las pérdidas no afectarán a un tranche en particular.	Hasta 10 caracteres numéricos, incluyendo decimales.	N/A
Sección 2k – Modificaciones de la notificación				Todos los contratos
2.93	Tipo de actuación	Indicación de si la notificación se refiere a: - un contrato de derivados o una actuación postnegociación por primera vez, en cuyo caso se indicará «new», - una modificación de los términos o detalles de un contrato de derivados previamente notificado, pero no una corrección de un reporte previo, en cuyo caso se indicará «modify». Esto incluye una mejora de los	N = nuevo M = modificación E = error C = Terminación anticipada R= Corrección Z = compresión V = actualización de la valoración P= Position component	En función del tipo de acción. Véase apartado 6 de la circular*

Nº	Campo RD (EU) nº 148/2013 y RE (EU) nº 1247/2012	Datos a indicar RD (EU) nº 148/2013	Formato RE (EU) nº 1247/2012	Explicación para la notificación BME Clearing Versus MC
		<p>reportes previos de una posición, para reflejar nuevas operaciones incluidas en la misma.</p> <ul style="list-style-type: none"> - una anulación de una notificación presentada erróneamente, en caso de que el contrato nunca entrase en vigor o no fuese objeto de las obligaciones de reporte del Reglamento No 648/2012, pero que fue reportado a un repositorio por error, en cuyo caso, se indicará «error», - la terminación anticipada de un contrato en vigor, en cuyo caso se indicará «early termination», - Una notificación anterior que contenía errores en campos de datos, en cuyo caso el nuevo reporte corregirá los campos erróneos, se identificará como «correction», - la compresión del contrato notificado, en cuyo caso se indicará «compression», - una actualización de la valoración o colateral de un contrato, en cuyo caso se indicará «valuation update». - Un contrato de derivados a ser reportado como una nueva operación que haya sido incluida en otra posición reportada ese mismo día, en cuyo caso se identificará como «position component». Este valor será equivalente a reportar una nueva operación y una actualización posterior para informar su compresión. 		

Nº	Campo RD (EU) nº 148/2013 y RE (EU) nº 1247/2012	Datos a indicar RD (EU) nº 148/2013	Formato RE (EU) nº 1247/2012	Explicación para la notificación BME Clearing Versus MC
2.94	Nivel	Indica si el reporte se ha realizado a nivel operación o posición.	T= Operación P= Posición	Segmentos de Derivados Financieros y Energía -Para operaciones: T -Para posiciones: P Segmento de IRS T

* La Circular a la que se hace referencia a lo largo de esta Instrucción es la C-GEN-09/2021 'Notificación de Operaciones a un Registro de Operaciones para cumplir las obligaciones de EMIR' o aquella que la sustituya.