

| | | |
|---|--|-----------------------|
|  Instrucción | Número: | I-VRF-01/2021 |
| | Segmento: | Valores Renta Fija |
| | Fecha: | 22 de febrero de 2021 |
| | Fecha entrada en vigor: | 15 de marzo de 2021 |
| | Sustituye a: | I-VRF-02/2020 |
| Asunto | Notificación de Operaciones a un Registro de Operaciones para cumplir las obligaciones de SFTR. | |
| Resumen | Cambios en la información a reportar en el campo 2.12 Fecha Ejecución reportando la misma información que la contenida en el campo 2.6 Fecha Compensación. | |

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

A continuación, se indica cómo va a rellenar BME CLEARING los datos de la tabla 1 “Datos de la Contraparte”:

| N.º | Campo | Detalles de los reportes | Formato | 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 | Entidad que envía el reporte | LEI de la entidad que envía el reporte | ISO 17442, Identificador de entidades jurídicas (LEI) con 20 caracteres alfanuméricos | * LEI de BME CLEARING 5299009QA8BBE20OB349 |
| 1.3 | Identificación de la contraparte notificante | LEI de la contrapartida que reporta | ISO 17442, Identificador de entidades jurídicas (LEI) con 20 caracteres alfanuméricos | * Notificación de la CCP: LEI de BME CLEARING.: * Notificación del MC: LEI del MC |
| 1.4 | Naturaleza de la contraparte que reporta | Indíquese si la contraparte notificante es una contraparte financiera o no financiera | F' - Contraparte financiera 'N' - Contraparte no financiera | * Notificación de la CCP: "F" * Notificación del MC: Si el MC es una entidad financiera "F", si no "N". |
| 1.5 | Sector empresarial de la contraparte | Sector de la entidad contraparte. Cuando se reporte más de una actividad, los códigos deben ser cumplimentados en orden relativo a la importancia de | Taxonomía para contrapartidas financieras: CDTI = entidad de crédito INVF = empresa de inversión INUN = empresa de seguros AIFD = fondo de inversión alternativo | * Notificación de la CCP: "CCPS" * Notificación del MC: Sector empresarial del MC, en el caso de que no esté el sector empresarial del MC aquí deberemos cumplimentar en el campo 1.6 |

| N.º | Campo | Detalles de los reportes | Formato | Explicación para la notificación BME CLEARING versus MC |
|-----|-------|-------------------------------|---|---|
| | | las actividades de la entidad | gestionado por un GFIA autorizado o registrado ORPI = fondo de pensiones CCPS = Entidades de Contrapartida Central REIN = empresa de reaseguros CSDS = Depositario de Valores Centrales UCIT = OICVM y sociedad de gestión del mismo Taxonomía para contrapartidas no financieras: A= Agricultura, silvicultura y pesca B= Minería C= Manufactura D= Suministro de electricidad, gas, vapor y aire acondicionado. E= Suministro de agua, alcantarillado y gestión de residuos F=Construcción G= Venta al por mayor y minorista, reparación de motos y coches H= Transporte y almacenamiento I= Hostelería J= Información y comunicación K= Servicios financieros y seguros. L= Real estate M= Ciencia y tecnología N= Servicios de administración y soporte O= Administración pública y defensa P= Educación Q= Sanidad y trabajo social R= Arte y entretenimiento S= Otras actividades de servicios T=Actividades de los hogares como empleadores de | |

| N.º | Campo | Detalles de los reportes | Formato | Explicación para la notificación BME CLEARING versus MC |
|-----|------------------------------------|---|--|--|
| | | | personal doméstico; actividades de los hogares como productores de bienes y servicios para uso propio U= Actividad de organizaciones y cuerpos extraterritoriales | |
| 1.6 | Sector adicional de clasificación | Solo necesario si el sector de la contrapartida no está en el campo anterior | ETFT = ETF MMFT = MMF REIT = REIT OTHR = Otros | * Notificación de la CCP: En blanco * Notificación del MC: Blanco |
| 1.7 | Sucursal de la entidad que reporta | Solo necesario en el caso de que la operación termine en una sucursal de la entidad | ISO 17442, Identificador de entidades jurídicas (LEI) con 20 caracteres alfanuméricos o ISO 3166-1 alpha-2 código del país con 2 caracteres alfanuméricos | * Notificación de la CCP= En blanco *Notificación del MC = Si MC=Sucursal, entonces Código país de la sucursal |
| 1.8 | Sucursal de la contrapartida | Cuando la operación termine en alguna sucursal de la contrapartida | ISO 3166-1 alfa-2 código del país con 2 caracteres alfanuméricos | * Notificación de la CCP= En blanco *Notificación del MC = Si MC=Sucursal, entonces Código de país de la sucursal |

| N.º | Campo | Detalles de los reportes | Formato | Explicación para la notificación BME CLEARING versus MC |
|------|--|---|---|---|
| 1.9 | Lado de la contrapartida | Se identifica quien es el que entrega o recibe el colateral | TAKE' - Recibe Colateral 'GIVE' - Entrega Colateral | <ul style="list-style-type: none"> * Notificación de la CCP: <ul style="list-style-type: none"> - "TAKE" cuando en el campo "Side" en el fichero CTRADES sea igual a 2. - Si "Side" = 1, entonces usar "GIVE". * Notificación del CM: <ul style="list-style-type: none"> - "TAKE" cuando en el campo "Side" en el fichero CTRADES sea igual a 1. - Si "Side" = 2, entonces usar "GIVE". |
| 1.10 | Entidad responsable de enviar el reporte | LEI de la entidad responsable del reporte | ISO 17442, Identificador de entidades jurídicas (LEI) con 20 caracteres alfanuméricos | <ul style="list-style-type: none"> * Notificación de la CCP: LEI CCP * Notificación del MC: LEI del MC en reporte delegado |
| 1.11 | Entidad la otra Contrapartida | LEI de la contrapartida | ISO 17442, Identificador de entidades jurídicas (LEI) con 20 caracteres alfanuméricos o un Código de Cliente (hasta 50 caracteres alfanuméricos). | <ul style="list-style-type: none"> * Notificación de la CCP: LEI CM * Notificación MC: BME CLEARING LEI 5299009QA8BBE20OB349 |
| 1.12 | País de la otra contrapartida | País de la contrapartida | ISO 3166-1 alfa-2 código del país con 2 caracteres alfanuméricos | <ul style="list-style-type: none"> * Notificación de la CCP: 2 caracteres alfanuméricos que indican el Código país del MC *Notificación MC: ES, el país de BME CLEARING contrapartida del MC |
| 1.13 | Beneficiario | Si existe algún beneficiario que no sea la contrapartida | ISO 17442, Identificador de entidades jurídicas (LEI) con 20 caracteres alfanuméricos o un Código de Cliente (hasta 50 caracteres alfanuméricos). | <ul style="list-style-type: none"> * Notificación CCP: En blanco. * Notificación MC: LEI MC a menos que sea un cliente, en ese caso usar campo Sub ID (LEI) > Typ = 4107 del fichero CACCOUNT |
| 1.14 | Agente try-party | Si existe agente tri-party | ISO 17442, Identificador de entidades jurídicas (LEI) con 20 caracteres alfanuméricos | En blanco |

| N.º | Campo | Detalles de los reportes | Formato | Explicación para la notificación BME CLEARING versus MC |
|------|--|---|---|--|
| 1.15 | Intermediario | Si existe intermediario | ISO 17442, Identificador de entidades jurídicas (LEI) con 20 caracteres alfanuméricos | En blanco |
| 1.16 | Miembro Compensador | LEI del MC | ISO 17442, Identificador de entidades jurídicas (LEI) con 20 caracteres alfanuméricos | * Notificación de la CCP: En blanco * Notificación MC: LEI del MC. |
| 1.17 | Participante directo o indirecto del CSD | LEI del participante del CSD | ISO 17442, Identificador de entidades jurídicas (LEI) con 20 caracteres alfanuméricos | * Notificación de la CCP: LEI del CCP * Notificación MC: LEI MC a menos que sea un cliente, en ese caso usar campo Sub ID (LEI) > Typ = 4107 del fichero CACCOUNT |
| 1.18 | Agente prestatario | Código del agente prestatario involucrado en el préstamo de valores | ISO 17442, Identificador de entidades jurídicas (LEI) con 20 caracteres alfanuméricos | En blanco |

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

A continuación, se indica cómo se deben rellenar los datos del informe de “Datos del Principal y del Colateral”.

| N.º | Campo | Detalles de los reportes | Formato | Explicación para la notificación BME CLEARING versus MC |
|-----|--|---|--|--|
| 2.1 | UTI Identificador Único de la operación | Identificador único de operación acordado a escala europea y facilitado por la contraparte notificante | Hasta 52 caracteres alfanuméricos incluyendo cuatro caracteres especiales: ".", ":", " ", "-" Solo letras alfabéticas en mayúscula A-Z y los dígitos del 0-9 están permitidos | Véase apartado 3 de la Circular C-VRF-10/2020 |
| 2.2 | Report tracking number | Para las operaciones que se liquiden, el UTI previo deberá ser reportado. Sin embargo, cuando las contrapartidas sean CCPs el UTI previo no deberá ser reportado por estas. Cuando la operación sea ejecutada en una plataforma de negociación y liquidada el mismo día que se ejecuta, el número generado por la plataforma deberá ser usado. | Hasta 52 caracteres alfanuméricos incluyendo cuatro caracteres especiales: ".", ":", " ", "-" Solo letras alfabéticas en mayúscula A-Z y los dígitos del 0-9 están permitidos | * Notificación CCP: En blanco * Notificación MC: Si viene de una operación bilateral, Prior UTI operación Bilateral, Si viene de un MTF número de transacción del MTF |
| 2.3 | Fecha del Evento | Fecha del evento, los tipos de evento son new, modification, Error, Correction, Position Component, Collateral | ISO 8601 fecha en el formato YYYY-MM-DD | Campo "BizDt" del fichero CTRADES/CALLTRADES |

| | | Update, Termination, Margin Update, Collateral Reuse Update y Valuation Update | | |
|-----|------------------------------------|--|---|---|
| 2.4 | Tipo de SFT | SBSC para simultaneas y REPO para repo | SLEB' - prestamista de valores o materias primas o prestatario de valores o materias primas 'SBSC' - Operaciones simultaneas 'REPO' - Operación con pacto de recompra 'MGLD' - Préstamo de garantías | Campo "SFTTYPE" del fichero CTRADES, CALLTRADES Y CHISTRADES |
| 2.5 | Compensado | Si la operación pasa por ECC o no | 'true' = Si 'false' = No | "True" |
| 2.6 | Marca de tiempo de la compensación | Fecha y hora de la compensación. | Formato de fecha según la norma ISO 8601 / hora UTC YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ | Para el campo "ExchTrdTyp" = "1" en fichero CALLTRADES usar campo "TxnTm" |
| 2.7 | CCP | Cuando el contrato haya sido objeto de compensación, el código único correspondiente a la CCP que la haya efectuado. | ISO 17442 Identificador de entidades jurídicas (LEI) (20 caracteres alfanuméricos) | Notificación CPP & CM: LEI de BME CLEARING: 5299009QA8BBE2O0B349 |
| 2.8 | Plataforma de negociación | Se identificará con el MIC de la plataforma, pero si es OTC se usará XOFF o XXXX | ISO 10383 Código de Identificación de Mercado (MIC), 4 caracteres alfanuméricos | Si Campo "PtySrc" = D > ID de los ficheros CTRADES/CALLTRADES contiene valor "BTAM", entonces usar BTAM. Si Campo "PtySrc" = D > ID de los ficheros CTRADES/CALLTRADES contiene valor "IBRC, entonces usar XXXX. |
| 2.9 | Tipo de acuerdo marco | Referencia a cualquier acuerdo marco, si existiera. | 'MRAA' - MRA 'GMRA' - GMRA 'MSLA' - MSLA 'GMSL' - GMSLA 'ISDA' - ISDA 'DERP' - Deutscher Rahmenvertrag für Wertpapierpensionsges chäfte 'CNBR' - China Bond Repurchase Master Agreement, 'KRRR' - Korea Financial Investment Association (KOFIA) Standard Repurchase | "OTHR" |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | <p>Agreement 'CARA' - Investment Industry Regulatory Organization of Canada (IIROC) Repurchase/Reverse Repurchase Transaction Agreement 'FRFB' - Convention-Cadre Relative aux Operations de Pensions Livrees, 'CHRA' -Swiss Master Repurchase Agreement 'DEMA' - German Master Agreement 'JPBR' - Japanese Master Agreement on the Transaction with Repurchase Agreement of the Bonds 'ESRA' - Contrato Marco de compraventa y Reporto de valores 'OSLA' - Overseas Securities Lending Agreement (OSLA) 'MEFI' - Master Equity and Fixed Interest Stock Lending Agreement (MEFISLA) 'GESL' - Gilt Edged Stock Lending Agreement (GESLA) 'KRSL' - Korean Securities Lending Agreement (KOSLA) 'DERD' - Deutscher Rahmenvertrag für Wertpapierdarlehen 'AUSL' - Australian Masters Securities Lending Agreement (AMSLA) 'JPBL' - Japanese Master Agreement on Lending Transaction of Bonds 'JPBL' - Japanese Master Agreement on the Borrowing and Lending Transactions of Share Certificates 'BIAG' - bilateral agreement 'CSDA' - CSD bilateral agreement Or 'OTHR' Si el tipo de</p> | |
|--|--|--|--|--|

| | | | master agreement no está incluido en la lista | |
|------|----------------------------------|--|--|--|
| 2.10 | Otro acuerdo marco | En el caso de que se ponga OTHR arriba, hay que rellenar con el nombre del máster agreement este campo | Hasta 50 caracteres alfanuméricos | "BMECLEARINGFIXEDINCOMEGENERALCONDITIONS" |
| 2.11 | Versión del acuerdo marco | Año de referencia del máster agreement si es aplicable | ISO 8601 fecha en formato YYYY | En blanco |
| 2.12 | 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-DDThh:mm:ssZ | Para el campo "ExchTrdTyp" = "1 " en fichero CALLTRADES usar campo "TxnTm" de ese mismo fichero. |
| 2.13 | Fecha Valor (Fecha de Inicio) | Fecha en la que las contrapartidas acordaron el intercambio del efectivo por los valores en la pata de ida | ISO 8601 fecha en formato YYYY-MM-DD | Usar campo "ExchTrdTyp" = "1" para operación y el campo "SettlDt" para la fecha ambos del fichero CALLTRADES |
| 2.14 | Fecha de vencimiento (Fecha fin) | Fecha en la que las contrapartidas acordaron el intercambio de efectivo por los valores en la pata de vuelta | ISO 8601 fecha en formato YYYY-MM-DD | Usar campo ExchTrdTyp = "2" para operación y el campo SettlDt para la fecha ambos del fichero CALLTRADES |
| 2.15 | Fecha de terminación | Fecha de terminación del contrato, en caso de resolución anticipada del mismo. | ISO 8601 fecha en formato YYYY | En blanco |
| 2.16 | Plazo Mínimo de Aviso | Número mínimo de días hábiles que las contrapartidas deben cumplir para ejercer el ejercicio anticipado. | Número entero hasta 3 dígitos | En blanco |
| 2.17 | Earliest call-back date | La fecha en las que el que entrega cash en la operación tiene derecho a recibir una parte de los fondos o | ISO 8601 fecha en formato YYYY | En blanco |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | terminar por completo la operación. | | |
| 2.18 | Indicador General de colateral | Indica si la operación está sujeta a un colateral específico o general. | 'SPEC' - colateral específico 'GENE' - colateral general | Notificación CCP & MC: Usar SPEC |
| 2.19 | Indicador DBV | Este campo indica si la operación fue liquidada usando el mecanismo Delivery-by-Value | 'true' = Si 'false' = No | Si Campo 2.4 = Repo, entonces usar "False" Si campo 2.4 = SBSC, entonces dejar este campo en blanco |
| 2.20 | Método usado para proveer el colateral | Indica si el colateral de la operación está sujeta a un acuerdo de la transferencia del título de colateral, acuerdo | TTCA'- Acuerdo de la transferencia de títulos del colateral 'SICA'- Acuerdo de los intereses de los valores del colateral 'SIUR'- Intereses de los valores con derechos de uso | Si Campo 2.4 = Repo, entonces usar TTCA Si campo 2.4 = SBSC, entonces dejar este campo en blanco |
| 2.21 | Vencimiento Abierto | Indica si la operación tiene un vencimiento abierto o un vencimiento cerrado | 'true' = Si 'false' = No | Si Campo 2.4 = Repo, entonces usar False Si campo 2.4 = SBSC, entonces dejar este campo en blanco |
| 2.22 | Opción de ejercicio anticipado | Índica si la operación es una evergreen o una operación extensible | "EGRN" - evergreen 'ETSB' - extensible NOAP - no Aplica | Si Campo 2.4 = Repo, entonces usar NOAP Si campo 2.4 = SBSC, entonces dejar este campo en blanco |
| En el caso del prestamos de garantías, los campos 23 al 34 deberán ser repetidos y completados por cada moneda diferente usada | | | | |
| 2.23 | Tipo de interés fijo | En el caso de los repos, será el tipo de interés anualizado del nominal principal de la operación teniendo en cuenta los días a contar | Hasta 11 caracteres numérico, incluyendo decimales, expresados como porcentaje, dónde 100% se reportará como 100. | Si Campo 2.4 = Repo, entonces usar campo 'Tipo interés' de los ficheros CTRADES, CALLTRADES y CHISTRADES. Si campo 2.4 = SBSC, entonces dejar este campo en blanco |
| 2.24 | Computo de días del tipo fijo | Número efectivo de días del período de cálculo aplicado por el pagador del tipo fijo | El código representa el computo de días convenido: 'A001' - IC30360ISDAor30360A mericanBasicRule 'A002' - IC30365 'A003' - IC30Actual | Valor A004 |

| | | | | |
|---|--|--|--|--|
| | | | 'A004' - Actual360 'A005' - Actual365Fixed 'A006' - ActualActualCMA 'A007' - IC30E360orEuroBondBasismodel1 'A008' - ActualActualISDA 'A009' - Actual365LorActuActubasisRule 'A010' - ActualActualAFB 'A011' - IC30360ICMAor30360basicrule 'A012' - IC30E2360orEurobondbasismodel2 'A013' - IC30E3360orEurobondbasismodel3 'A014' - Actual365NL O hasta 35 caracteres alfanuméricos si el computo de días convenido no está presente en la lista | |
| Los campos 35 y 36 deberán ser repetidos por cada ajuste del tipo de interés variable | | | | |
| 2.37 | Cantidad a liquidar en la fecha de inicio | Efectivo que debe ser liquidado en la FTL ida | Hasta 18 caracteres incluyendo hasta 5 decimales. La marca decimal no se contará como carácter numérico. Si es cumplimentado, deberá ser representado con un punto. | Campo "ExchTrdTyp" =1 y la cantidad que ponga en el campo "Stip Tym" > "Val" del fichero CALLTRADES |
| 2.38 | Cantidad a liquidar en la fecha de vencimiento | Efectivo que debe ser liquidado en la FTL vuelta | Hasta 18 caracteres incluyendo hasta 5 decimales. La marca decimal no se contará como carácter numérico. Si es cumplimentado, deberá ser representado con un punto. | Campo "ExchTrdTyp" = 2 y la cantidad que ponga en el campo "Stip Tym" > "Val" del fichero CALLTRADES |
| 2.39 | Divisa del principal | Moneda del efectivo | ISO 4217 Código de Divisa, 3 caracteres alfanuméricos | Campo "Ccy" del fichero CALLTRADES |

| | | | | |
|--|-----------------------------------|---|---|--|
| 2.49 | Precio del valor o materia prima | Para el caso de simultaneas, poner el precio del valor o materia prima usado para calcular la cantidad de la pata de ida de la simultánea. | Hasta 18 caracteres incluyendo hasta 5 decimales si el precio está expresado en unidades. Hasta 11 caracteres incluyendo hasta 10 decimales si el precio está expresado en porcentaje o rentabilidad. La marca decimal no se contará como carácter numérico. Si es cumplimentado, deberá ser representado con un punto. | Si Campo 2.4 = Repo, entonces dejar este campo en blanco Si campo 2.4 = SBSC, entonces usar campo "LastPx" del fichero CALLTRADES Se pondrá precio en porcentaje |
| 2.50 | Divisa del precio | Divisa en la que está denominada el valor o la materia prima. | ISO 4217 Código Divisa, 3 caracteres alfabéticos. | Si campo 2.4 = Repo, entonces dejar en blanco Si campo 2.4 = SBSC, entonces usar el campo "Ccy" del fichero CALLTRADES |
| 2.73 | Collateralisation of net exposure | Indica si el colateral ha sido aportado por exposición neta en lugar de una operación | 'true' 'false' | Usar "False" tanto en los mensajes tipo de acción NEWT y COLU. |
| 2.74 | Fecha Valor del Colateral | Cuando la operación haya sido colateralizada como exposición neta se utilizará la última valoración de dicha exposición neta considerando todas las operaciones por las que el colateral ha sido provisto | ISO 8601 fecha en el formato YYYY-MM-DD | En blanco |
| Cuando se utilice un colateral específico, se deberán cumplimentar los campos desde el 75 al 94 por cada componente del colateral, cuando sea aplicable. | | | | |
| 2.75 | Tipo de colateral | Indica el tipo de colateral | SECU' - Valores 'COMM' - Materias Primas (solo para repos y simultaneas) 'CASH' - Efectivo | Notificación CCP & MC: * Usar SECU |
| Cuando el efectivo sea usado como colateral, se deberá especificar en los campos 76 y 77 | | | | |

| | | | | |
|---|---|---|--|--|
| 2.76 | Cantidad de efectivo en colateral | Cantidad de fondos provistos como colateral por el prestatario de los valores | Hasta 18 caracteres incluyendo hasta 5 decimales. La marca decimal no se contará como carácter numérico. Si es cumplimentado, deberá ser representado con un punto. | Notificación CCP & MC: Si campo 2.75 = SECU entonces dejar en blanco |
| 2.77 | Divisa del efectivo del colateral | Moneda del efectivo del colateral | ISO 4217 Código de Divisa, 3 caracteres alfanuméricos | Notificación CCP & MC: Si campo 2.75 = SECU entonces dejar en blanco |
| 2.78 | Identificación del valor usado como colateral | Identificación del valor usado como colateral | ISO 6166 Código ISIN 12 caracteres alfanuméricos | Notificación CCP & MC: Si el campo 2.75 = SECU, entonces usar campo ID del fichero CALLTRADES Si campo 2.75 = CASH entonces dejar en blanco |
| 2.79 | Clasificación del valor usado como colateral | Código CFI del valor usado como colateral | ISO 10692 Código CFI, 6 caracteres alfabéticos | Notificación CCP & MC: Si el campo 2.75 = SECU, entonces usar campo "CFI" del fichero CISINCODE Si campo 2.75 = CASH entonces dejar en blanco |
| Cuando una materia prima sea usada como colateral, la clasificación de esa materia prima deberá especificarse en los campos 80,81 y 82. | | | | |
| 2.83 | Cantidad de colateral o cuantía del nominal | Cantidad o cuantía de nominal del valores o materia prima usada como colateral | Hasta 18 caracteres incluyendo hasta 5 decimales. La marca decimal no se contará como carácter numérico. Si es cumplimentado, deberá ser representado con un punto. | Notificación CCP& MC: Si el campo 2.75 = SECU, entonces usar entonces usar campo "Stip Typ = QTYM" > Campo "Val" del fichero CALLTRADES. Si el campo 2.75 = CASH, entonces dejarlo en blanco. |
| 2.85 | Divisa de la cuantía del nominal | En el caso donde la cuantía del nominal es reportada, la divisa de la cuantía del nominal debe ser cumplimentada en este campo. | ISO 4217 Código de Divisa, 3 caracteres alfanuméricos | Notificación CCP& MC: Usar Campo "Ccy" del fichero CALLTRADES. Si el campo 2.75 = CASH entonces dejar en blanco. |
| 2.86 | Divisa del precio | Divisa del precio del colateral | ISO 4217 Código de Divisa, 3 caracteres alfanuméricos | Notificación CCP& MC: Usar Campo "Ccy" del fichero CALLTRADES. Si el campo 2.75 = CASH entonces dejar en blanco. |

| | | | | |
|------|--------------------------------|--|---|--|
| 2.87 | Precio por unidad | Precio por unidad del colateral incluyendo el cupón corrido | Hasta 18 caracteres incluyendo hasta 5 decimales si el precio está expresado en unidades. Hasta 11 caracteres incluyendo hasta 10 decimales si el precio está expresado en porcentaje o rentabilidad. La marca decimal no se contará como carácter numérico. Si es cumplimentado, deberá ser representado con un punto. | Notificación CCP& MC: Si el campo 2.75 = SECU, entonces usar entonces usar Campo "LastPx" del fichero CALLTRADES para mensajes NEWT. Mientras que para los mensajes COLU usar campo "SetPx" del CMARGINCALC. Si el campo 2.75 = CASH, entonces dejarlo en blanco. |
| 2.88 | Valor de mercado del colateral | El valor de mercado del colateral | Hasta 18 caracteres incluyendo hasta 5 decimales. La marca decimal no se contará como carácter numérico. Si es cumplimentado, deberá ser representado con un punto. | Notificación de la CCP & MC: Si el campo 2.75 = SECU, entonces usar campo 1003 si la operación en una compra o 1004 si es una venta del fichero CMARGINCALC para los escenarios PIT y TRF. Si el campo 2.75 = CASH, entonces dejar en blanco. |
| 2.89 | Descuento del colateral | Para repos o simultaneas, cualquier descuento del colateral deberá ser especificado referenciándolo a cualquier medida para el control del riesgo a nivel de ISIN. | Hasta 11 caracteres numérico, incluyendo decimales, expresados como porcentaje, dónde 100% se reportará como 100. | 0 |
| 2.90 | Calidad del colateral | Código que clasifica el riesgo del valor usado como colateral. | INVG' - Grado de Inversión 'NIVG' - Grado de No inversión 'NOTR' - Sin Calificación 'NOAP' - No Aplicable | Notificación CCP& MC: Si el campo 2.75 = SECU, entonces usar campo 'Evt Text' con un "eventTyp = 216" del fichero CISINCODE Si el campo 2.75 = CASH, entonces dejarlo en blanco. |
| 2.91 | Vencimiento del valor | Fecha de vencimiento del colateral | ISO 8601 fecha en el formato YYYY-MM-DD | Notificación CCP& MC: Si el campo 2.75 = SECU, entonces usar Campo "MatDt" del fichero CISINCODE. Si el campo 2.75 = CASH, entonces dejarlo en blanco. |
| 2.92 | Jurisdicción del emisor | País del emisor de valor usado como colateral | ISO 3166-1 alpha-2 Código País 2 caracteres alfabéticos | Notificación CCP& MC: Si el campo 2.75 = SECU, entonces usar campo 'Instrmt IssuCtry' del fichero CISINCODE. Si el campo 2.75 = CASH, entonces dejarlo en blanco. |

| | | | | |
|--|---|--|---|---|
| 2.93 | LEI del emisor | LEI del emisor del valor usado como colateral | ISO 17442 Identificador Legal de Entidades (LEI) con 20 caracteres alfanumérico | Notificación CCP& MC: Si el campo 2.75 = SECU, entonces usar campo 'Event Txt' con "EventType = 218" del fichero CISINCODE. Si el campo 2.75 = CASH, entonces dejarlo en blanco. |
| 2.94 | Tipo de colateral | Código que clasifica el tipo de valor usado como colateral | GOVS' - Valores Públicos 'SUNS' - Supranacional y agencias de valores 'FIDE' - Valores de Deuda (incluyendo bonos garantizados) emitidos por Bancos y otras entidades financieras 'NFID' - Valores Deuda Privada (incluyendo bonos garantizados) emitidos por entidades no financieras 'SEPR' - Productos Bursátiles (inclusión CDO, CMBS, ABCP) 'MEQU' - Acciones en un Índice Bursátil Principal (incluyendo bonos convertibles) 'OEUQ' - Otras acciones (incluyendo bonos convertibles) 'OTHR'- Otros activos (incluyendo participaciones en fondos de inversión) | Notificación CCP& MC: Si el campo 2.75=SECU, entonces usar campo 'Evt Txt' con "EventTyp = 219" del fichero CISINCODE. Si campo 2.75 = CASH, entonces dejarlo en blanco. |
| 2.95 | Disponibilidad del colateral para reuso | Disponibilidad de poder hacer reuso del colateral o no | 'true' 'false' | Notificación CCP& MC: Si el campo 2.75 = SECU, entonces usar "True". Si el campo 2.75 = CASH, entonces dejarlo en blanco. |
| El campo 96 deberá especificarse cuando una cesta de colateral sea usada. El detalle de la distribución del colateral por las operaciones realizada contra la mancomunación del colateral deberá ser especificada en los campos 75 a 94 cuando aplique | | | | |
| 2.96 | Identificador de la cesta del colateral | Si la cesta del colateral puede ser identificada con un ISIN se pondrá dicho ISIN, de otro modo pondremos NTAV | ISO 6166 Código ISIN, 12 caracteres alfanuméricos, o 'NTAV' | En blanco |
| 2.97 | Código de la cartera | Cuando la operación es liquidada e incluida en una cartera de operaciones se | Hasta 52 caracteres alfanuméricos incluyendo cuatro caracteres especiales: ":", ":", ":", "_". Los caracteres especiales | Véase apartado 12 de la Circular C-VRF-10/2020 |

| | | utilizará el código único de la cartera | no están permitidos al inicio o al final del código. | |
|------|----------------|---|---|--|
| 2.98 | Tipo de acción | <p>Si el reporte contiene:</p> <ul style="list-style-type: none"> - una operación reportada por primera vez, se usará "new" - una modificación de una operación reportada anteriormente se usará "modification", este estado se usará cuando el miembro tenga posición ya existente y se actualice esta. - un cambio de valor del activo se usará "Valuation Update". - una modificación de los datos del colateral, incluido su valoración, se usará "Collateral Update" - una cancelación por enviar una operación de manera equivocada o que no tenga que pasar por reporte, se usará "Error". - alguna operación enviada con algún dato erróneo, se usará "correction" - un open repo que llega a su fin o existe un vencimiento | <p>NEWT' - Nuevo 'MODI' - Modificación 'VALU' - Valoración 'COLU' - Actualización del Colateral 'EROR' - Error 'CORR' - Corrección 'ETRM' - Finalización / Finalización Anticipada 'POSC' - Componentes de la Posición</p> | <p>En función del tipo de acción. En operaciones nuevas 'NEWT'. Para actualización del colateral 'COLU'.</p> |



| | | | | |
|------|-------|--|--|--------|
| | | <p>anticipado se usará "termination/earl y termination" - una operación que es reportada como nueva y que también incluye un reporte de posición separado en el mismo día se identificará como "position component"</p> | | |
| 2.99 | Nivel | <p>Indica si el reporte está hecho a nivel operación o de posición. El reporte a nivel de posición puede ser usado solo como suplemento del reporte a nivel de operación para reportar los eventos post operación y solamente si las operaciones individuales han dado lugar a un cambio en la posición.</p> | <p>TCTN' - Operación 'PSTN' - Posición</p> | "TCTN" |

3.- EXPLICACIÓN SOBRE CÓMO VA A RELLENAR BME CLEARING LOS DATOS DEL INFORME “DATOS DE GARANTÍAS”

A continuación, se indica cómo se deben rellenar los datos del informe de “Datos de garantías”.

| N.º | Campo | Detalles de los reportes | Formato | Explicación para la notificación BME CLEARING versus MC |
|-----|--|---|---|--|
| 3.1 | 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-DDThh:mm:ssZ. | Se rellenará por el Registro de Operaciones al recibir la notificación |
| 3.2 | Event date | Fecha del evento, los tipos de evento son new, modification, Error, Correction, Position Component, Collateral Update, Termination, Margin Update, Collateral Reuse Update y Valuation Update | ISO 8601 fecha en el formato YYYY-MM-DD | Campo "BizDt" del fichero CMARGINCALC |
| 3.3 | Entidad que envía el reporte | LEI de quién envía el reporte | ISO 17442, Identificador de entidades jurídicas (LEI) con 20 caracteres alfanuméricos | * LEI de BME CLEARING 5299009QA8BBE2O0B349 |
| 3.4 | Identificación de la contraparte notificante | LEI de la contrapartida que reporta | ISO 17442, Identificador de entidades jurídicas (LEI) con 20 caracteres alfanuméricos | * Notificación de la CCP: LEI de BME CLEARING:. * Notificación del MC: LEI del MC |

| N.º | Campo | Detalles de los reportes | Formato | Explicación para la notificación BME CLEARING versus MC |
|-----|--|---|--|--|
| 3.5 | Entidad responsable de enviar el reporte | LEI de la entidad responsable del reporte | ISO 17442, Identificador de entidades jurídicas (LEI) con 20 caracteres alfanuméricos | * Notificación de la CCP: LEI CCP * Notificación del MC: LEI del MC en reporte delegado |
| 3.6 | Entidad la otra Contrapartida | LEI de la contrapartida | ISO 17442, Identificador de entidades jurídicas (LEI) con 20 caracteres alfanuméricos o un Código de Cliente (hasta 50 caracteres alfanuméricos). | * Notificación de la CCP: LEI CM * Notificación MC: BME CLEARING LEI 5299009QA8BBE2O0B349 |
| 3.7 | Código de la 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: ":", ";", "-", "_" | Véase apartado 12 de la Circular C-VRF-10/2020 |
| 3.8 | 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 18 caracteres numéricos incluyendo hasta el quinto decimal. Los cinco decimales no cuentan para los 18 caracteres. Si se cumplimenta se representará con un punto. | * Notificación CCP: 0 * Notificación MC: Si IM - VM > 0, entonces usar sumatorio del campo 1060 del escenario TOT del fichero CMARGINCALC en D-1 Si IM - VM < 0, entonces usar 0 |
| 3.9 | Divisa de la Garantía Inicial aportada | Divisa de la Garantía Inicial aportada | Código de la moneda según la norma ISO 4217, 3 caracteres. | Campo "Ccy" del fichero CMARGINCALC |

| N.º | Campo | Detalles de los reportes | Formato | Explicación para la notificación BME CLEARING versus MC |
|------|--|--|--|--|
| 3.10 | 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 18 caracteres numéricos incluyendo hasta el quinto decimal. Los cinco decimales no cuentan para los 18 caracteres. Si se cumplimenta se representará con un punto. | <p>*Notificación CCP: Si VM en contra del miembro, entonces usar 0.</p> <p>Si VM a favor del miembro, entonces se deberá poner la cantidad de VM a favor en VM depositado.</p> <p>* Notificación MC: Si VM en contra del miembro, entonces usar sumatorio del campo 1022 del escenario IES y el campo 1022 del escenario TRF del fichero CMARGINCALC de D-1.</p> <p>Si VM a favor del miembro, entonces se deberá poner la cantidad de VM a favor en el campo VM recibido.</p> |
| 3.11 | Divisa del Variation Margin aportado | Divisa del Variation Margin aportado | Código de la moneda según la norma ISO 4217, 3 caracteres. | Campo "Ccy" del fichero CMARGINCALC |
| 3.12 | 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 18 caracteres numéricos incluyendo hasta el quinto decimal. Los cinco decimales no cuentan para los 18 caracteres. Si se cumplimenta se representará con un punto. | <p>* Notificación CCP: Si $IM - VM > 0$, entonces usar sumatorio del campo 1060 del fichero CMARGINCALC de D-1.</p> <p>Si $IM - VM < 0$, entonces poner 0.</p> <p>* Notificación MC: 0</p> |
| 3.13 | Divisa de la Garantía Inicial recibida | Divisa de la Garantía Inicial recibida | Código de la moneda según la norma ISO 4217, 3 caracteres. | Campo "Ccy" del fichero CMARGINCALC |

| N.º | Campo | Detalles de los reportes | Formato | Explicación para la notificación BME CLEARING versus MC |
|------|---|--|--|---|
| 3.14 | 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 18 caracteres numéricos incluyendo hasta el quinto decimal. Los cinco decimales no cuentan para los 18 caracteres. Si se cumplimenta se representará con un punto. | <p>*Notificación CCP: Si VM en contra del miembro, entonces usar sumatorio del campo 1022 del escenario IES y el campo 1022 del escenario TRF del fichero CMARGINCALC de D-1.</p> <p>Si VM a favor del miembro, entonces se deberá poner la cantidad de VM a favor en el campo VM depositado.</p> <p>* Notificación MC: Si VM en contra del miembro, entonces usar 0. Si VM a favor del miembro, entonces se deberá poner la cantidad de VM a favor en el campo VM recibido</p> |
| 3.15 | Divisa del variation margins recibido | Divisa del Variation Margin recibido | Código de la moneda según la norma ISO 4217, 3 caracteres. | Campo "Ccy" del fichero CMARGINCALC |
| 3.16 | Exceso de colateral aportado | Valor del colateral aportado, en exceso del requerido. | Hasta 18 caracteres numéricos incluyendo hasta el quinto decimal. Los cinco decimales no cuentan para los 18 caracteres. Si se cumplimenta se representará con un punto. | <p>* Notificación CCP: 0</p> <p>* Notificación MC: Campo StipulationType [233] = ASSET_VALEXC "Exceso Colateral" de la correspondiente cuenta de colateral del fichero CALLOCBS de D</p> |
| 3.17 | Divisa del exceso de colateral aportado | Divisa del exceso de colateral aportado | Código de la moneda según la norma ISO 4217, 3 caracteres. | Campo "Ccy" del fichero CMARGINCALC |
| 3.18 | Exceso de colateral recibido | Valor del colateral recibido, en exceso del requerido. | Hasta 18 caracteres numéricos incluyendo hasta el quinto decimal. Los cinco decimales no cuentan para los 18 caracteres. Si se cumplimenta se representará con un punto. | <p>* Notificación CCP: Campo StipulationType [233] = ASSET_VALEXC "Exceso Colateral" de la correspondiente cuenta de colateral del fichero CALLOCBS de D</p> <p>* Notificación MC: 0</p> |

| N.º | Campo | Detalles de los reportes | Formato | Explicación para la notificación BME CLEARING versus MC |
|------|---|--|--|---|
| 3.19 | Divisa del exceso de colateral recibido | Divisa del exceso de colateral recibido | Código de la moneda según la norma ISO 4217, 3 caracteres. | Campo "Ccy" del fichero CMARGINCALC |
| 3.20 | Tipo de Acción | <p>Si el reporte contiene:</p> <ul style="list-style-type: none"> - un nuevo balance de garantías, se usará "new" - una modificación de las garantías reportadas anteriormente se usará "Margin Update" - una cancelación por enviar un reporte de garantías de manera equivocada o que no tenga que pasar por reporte, se usará "Error". - algún dato incorrecto o erróneo, se usará "correction" | <p>NEWT' - New 'MARU' - Margin update 'EROR' - Error 'CORR' - Correction</p> | <p>En función del tipo de acción. Para la primera vez 'NEWT'. Para actualización de garantías 'MARU'.</p> |