

Instrucción I-GEN-01/2023

Notificación de Operaciones a un Registro de Operaciones para el reporte EMIR: Estructura del fichero armonizado CCPPOSITIONEMIR.

BME CLEARING

10 marzo 2023

Instrucción General

Fecha de entrada en vigor: 10 de febrero de 2023

Sustituye a: I-GEN-03/2021

Descripción de la información que contiene cada campo en el nuevo fichero CCPPOSITIONEMIR para el reporte EMIR.

Esta modificación se debe a la incorporación de la operativa del segmento de Derivados de Tipos de Interés (IRS).

La presente Instrucción proporciona información sobre la estructura del fichero CCPPOSITIONEMIR para el reporte EMIR.

En colaboración con otras Cámaras de Contrapartida Central europeas, BME CLEARING proporciona a sus miembros un nuevo fichero diario con las posiciones sujetas a notificación bajo EMIR, incluyendo el UTI de la posición, así como otros campos acordados, con el fin de que aquellos miembros que lo utilicen puedan compararlos con sus propios registros y los incluyan en sus reportes EMIR. El objetivo de este nuevo fichero es permitir a los miembros utilizar el UTI de la posición de las ECCs utilizando un formato y contenido estandarizados en todas las ECCs.

1. EXPLICACIÓN SOBRE LA ESTRUCTURA DEL FICHERO CCPPOSITIONEMIR

A continuación se indica la estructura que contiene el nuevo fichero CCPPOSITIONEMIR.

ENCABEZADOS		FORMATO
Campo referenciado al reporte EMIR	Nombre del campo	
	C.O.B Date	Formato de fecha según la norma ISO 8601 YYYY-MM-DD.
1_2_	Reporting Counterparty ID	Notificación de la CCP: LEI de BME Clearing: 5299009QA8BBE200B349.
1_14_	Counterparty side	B= comprador. S= vendedor. Véase la pregunta "Q6" del documento Preguntas y respuestas fichero ECC armonizado EMIR (sólo disponible en inglés) .
1_17_	Value of contract	Hasta 20 dígitos, según el formato xxxx,yyyy La marca decimal no se cuenta como dígito numérico. Si se cumplimenta deberá hacerse con un punto. Respecto a los números negativos, el signo negativo. Si se cumplimenta, no se tendrá en cuenta como dígito numérico.

Instrucción I-GEN-01/2023

BME CLEARING

BME CLEARING, S.A.U., con domicilio social en Madrid, Plaza de la Lealtad 1, CIF A-78973864, e inscrita en el Registro Mercantil de Madrid en el Tomo 9.379, Folio 103, Libro 8142, Hoja 87.252.

ENCABEZADOS		FORMATO
Campo referenciado al reporte EMIR	Nombre del campo	
1_18_	Currency of the value	Código de la moneda según la norma ISO 4217, 3 caracteres
2_5_	Product identification type	I= ISIN. Para segmento IRS: N/A
2_6_	Product identification	Código ISIN de 12 caracteres alfanuméricos, según normativa ISO 6166 Para segmento IRS: N/A
2_12_	Trade ID	Hasta 52 caracteres alfanuméricos incluyendo cuatro caracteres alfanuméricos.
2_15_	Venue of execution	Código de identificación del mercado (MIC) según la norma ISO 10383, 4 letras.
2_17_	Price / rate	Hasta 20 dígitos, según el formato xxxx,yyyy. Para segmento IRS: 999999999999.9999
2_22_	Quantity	Hasta 20 dígitos, según el formato xxxx,yyyy.
2_78_	Option type	C = Call P = Put Para segmento IRS: N/A
2_80_	Strike price (cap/floor rate)	Hasta 20 dígitos, según el formato xxxx,yyyy. Si el precio de ejercicio se reportase en porcentaje, se expresará de manera que 100, representará un 100%. Para segmento IRS: N/A
2_94_	Level	P= Posición.
	Clearing Member Code	Código del miembro que compensa la operación. Este campo servirá para distinguir cuando el Miembro tenga múltiples códigos en la ECC.
	Trading_Member_Code	Código del miembro que realiza la operación. Este campo incluirá el mnemotécnico del Miembro que realiza la operación, sea por cuenta propia, clientes o Miembros No Compensadores.
	Exchange_Account_Code	Código de cuenta generado y asignado por la ECC para identificar las cuentas de compensación. En el caso de BMEC estará compuesto por Código de Miembro Compensador + código estructura de cuenta (AXXX00P)
	Position_Account_Owners	Campo opcional que ayuda a identificar a los propietarios de la cuenta de posición. En el caso de BMEC vendrá vacío.
	Exchange_Product_Code	Código de producto generado por las entidades para identificar el producto.
	Maturity Date	Formato de fecha según la norma ISO 8601 YYYY-MM-DD.
FOOTER	NOL	El número de líneas excluyendo el encabezado (header) y el pie de página (footer).

Instrucción I-GEN-01/2023

BME CLEARING

BME CLEARING, S.A.U., con domicilio social en Madrid, Plaza de la Lealtad 1, CIF A-78973864, e inscrita en el Registro Mercantil de Madrid en el Tomo 9.379, Folio 103, Libro 8142, Hoja 87.252.

2023 Bolsas y Mercados Españoles, Sociedad Holding de Mercados y Sistemas Financieros S. A. Todos los derechos reservados.

BME
Plaza de la Lealtad,1
Palacio de la Bolsa
28014 Madrid

www.bolsasymercados.es

