

Instrucción I-GEN-04/2024

Notificación de Operaciones a un Registro de Operaciones para cumplir las obligaciones de EMIR.
Ficheros armonizados EMIR Refit

BME CLEARING

Instrucción General

Fecha de entrada en vigor: 29 de abril de 2024

Sustituye a: I-GEN-03/2021

Adaptación del fichero armonizado CCPPOSITIONEMIR a EMIR Refit y generación de 3 nuevos ficheros armonizados.

Esta Instrucción detalla los campos, nomenclatura, estructura y generación de los ficheros armonizados.

Según lo descrito en el punto 9 de la Circular C-GEN-08/2024 '*Notificación de Operaciones a un Registro de Operaciones para cumplir las obligaciones de EMIR. Adaptación a EMIR Refit*' o aquella que la sustituya, conforme al acuerdo alcanzado por los miembros del grupo EACH, BME CLEARING mantendrá el fichero armonizado CCPPOSITIONEMIR existente para el reporte EMIR, manteniendo su estructura, pero adaptándolo a los requerimientos de EMIR Refit.

Adicionalmente, BME CLEARING generará 3 nuevos ficheros armonizados:

- CCPTRADESEMIR, a nivel de operación
- CCPVALUATIONEMIR, con los datos de valoración, y
- CCPCOLLATERALEMIR, con los datos de colateral.

La información que muestran todos estos ficheros siempre refleja el punto de vista de la ECC.

1. NOMENCLATURA

El nombre de los ficheros armonizados estará compuesto por:

Nombre del fichero_EEE_00X_zzzz_MMMMCC_AAAAMMDD_vvv.csv

Siendo:

- Fichero:

Posibles valores: CCPTRADESMIR, CCPPOSITIONEMIR, CCPVALUATIONEMIR o CCPCOLLATERALEMIR

- EEE = Código de entorno,

PRD para indicar que es el entorno de producción.

SIM para indicar que es el entorno de pruebas.

- 00X = Versión actual del fichero.

El fichero CCPPOSITIONEMIR, comenzará con la versión 003 según el acuerdo alcanzado en el grupo de EACH. En caso de futuras versiones, este número será consecutivo y siempre acordado con las demás ECCs.

Para el resto de los ficheros, se comenzará con la versión 001. Para futuras versiones este número será consecutivo.

- zzzz = Código MIC de BME CLEARING

BMCL

- MMMM = Código de miembro.

Cuando un MC tenga distintos códigos de miembro, en función del segmento al que pertenezca, prevalecerá el código de miembro según el siguiente orden: 1º, el código de miembro de C2: Derivados Financieros; 2º, el de C9: Swaps; 3ª, el de C7: Segmento Energía; 4º, el de CD: FX y por último, el de CC: Derivados Activos Digitales.

- CC = Código de la ECC

CM

- AAAAMMDD = Fecha del fichero.
- vvv = Número de versión del fichero, empezando por 001.

2. GENERACIÓN

La hora de generación será las 04:30 am de D+1, donde D es la fecha de la sesión a reportar.

En caso de existir errores u omisión en algún dato de los ficheros, éstos se reportarán, pero utilizando como máscara el símbolo '?'.
'?'

Los errores u omisiones de datos reportados en la versión vvv = **001**, serán corregidos en un segundo envío del fichero a partir de las 9.00 a.m. de D+1, una vez recibida la respuesta del Trade Repository (TR) al que BME CLEARING reporta sus posiciones, pasando vvv a tomar el valor **002**.

3. DESCRIPCIÓN

3.1 Fichero armonizado CCPTRADESEMIR

Emir Refit Table & Item	CCPTRADESEMIR
2_1_	UTI
2_2_	Report tracking number
2_3_	Prior UTI
2_4_	Subsequent position UTI
2_5_	PTRR_ID
2_7_	ISIN
2_8_	Unique product identifier (UPI)
2_9_	Product classification
2_11_	Asset class
2_16_	Name of the underlying index
2_32_	Clearing timestamp
2_33_	Central counterparty
2_37_	Intragroup
2_41_	Venue of execution
2_42_	Execution timestamp
2_43_	Effective date
2_44_	Expiration date
2_47_	Delivery type
2_48_	Price
2_49_	Price currency
2_55_	Notional amount of leg 1
2_56_	Notional currency 1
2_60_	Total notional quantity of leg 1
2_83_	Identifier of the floating rate of leg 1
2_99_	Identifier of the floating rate of leg 2
2_113_	Exchange rate 1
2_115_	Exchange rate basis
2_116_	Base product
2_117_	Sub-product
2_118_	Further sub-product
2_121_	Load type
2_122_	Delivery interval start time
2_123_	Delivery interval end time
2_124_	Delivery start date
2_125_	Delivery end date

Emir Refit Table & Item	CCPTRADESEMIR
2_126_	Duration
2_132_	Option type
2_133_	Option style
2_134_	Strike price
2_139_	Option premium amount
2_140_	Option premium currency
2_141_	Option premium payment date
2_151_	Action type
2_152_	Event type
2_153_	Event date
2_154_	Level

3.2 Fichero armonizado CCPPOSITIONEMIR ¹

EMIR Refit Table & Item	CCPPOSITIONEMIR
	C.O.B Date
1_4_	Counterparty 1 (Reporting counterparty)
1_17_	Direction
2_21_	Valuation amount
2_22_	Valuation currency
2_5_	Product identification type
2_7_	ISIN
2_1_	UTI
2_41_	Venue of execution
2_48_	Price
2_60_	Total notional quantity of leg 1
2_132_	Option type
2_134_	Strike price
2_154_	Level
-	Clearing Member Code
-	Trading_Member_Code
-	Exchange_Account_Code
-	Position_Account_Owners
-	Exchange_Product_Code

¹ Único fichero acordado en el grupo EACH

EMIR Refit Table & Item	CCPOSITIONEMIR
2_44	Expiration date
2_3_	Prior UTI
2_14_	Underlying identification
2_25_	Delta
2_42_	Execution timestamp
2_48_	Price notation
2_55_	Notional amount
2_56_	Notional amount currency

3.3 Fichero armonizado CCPVALUATIONEMIR

Emir Refit Table & Item	CCPVALUATIONEMIR
1_1_	Reporting timestamp
2_21_	Valuation amount
2_22_	Valuation currency
2_23_	Valuation timestamp
2_24_	Valuation method
2_25_	Delta
2_1_	UTI

3.4 Fichero armonizado CCPCOLLATERALEMIR

Emir Refit Table & Item	CCPCOLLATERALEMIR
3_1_	Reporting timestamp
3_2_	Report submitting entity ID
3_4_	Counterparty 1 (Reporting counterparty)
3_6_	Counterparty 2
3_7_	Collateral timestamp
3_8_	Collateral portfolio indicator
3_9_	Collateral portfolio code
3_11_	Collateralisation category
3_12_	Initial margin posted by the counterparty 1 (pre-haircut)
3_13_	Initial margin posted by the counterparty 1 (post-haircut)
3_14_	Currency of the initial margin posted

Emir Refit Table & Item	CCPCOLLATERALEMIR
3_15_	Variation margin posted by the counterparty 1 (pre-haircut)
3_16_	Variation margin posted by the counterparty 1 (post-haircut)
3_17_	Currency of the variation margins posted
3_18_	Excess collateral posted by the counterparty 1
3_20_	Initial margin collected by the counterparty 1 (pre-haircut)
3_21_	Initial margin collected by the counterparty 1 (post-haircut)
3_22_	Currency of initial margin collected
3_23_	Variation margin collected by the counterparty 1 (pre-haircut)
3_24_	Variation margin collected by the counterparty 1 (post-haircut)
3_25_	Currency of variation margin collected
3_26_	Excess collateral collected by the counterparty 1
3_27_	Currency of excess collateral collected

4. CONSIDERACIONES Y DISTRIBUCIÓN

Algunas consideraciones importantes son:

- Su formato será .csv
- Se generará un único fichero por código de Miembro Compensador, con independencia de los segmentos a los que pertenezca.

La forma de distribución de los ficheros armonizados será vía sftp, aprovechando aquellas conexiones que el miembro pueda tener para los segmentos de Derivados Financieros (C2), Energía (C7) o IRS (C9).

Para aquellos miembros con obligación de reporte que no tengan ninguna conexión a uno de los segmentos mencionados, podrán utilizar el sftp que ya tengan configurado para otros segmentos; Renta Variable (C0) o Renta Fija (C8). En caso contrario, será necesario configurar una nueva conexión sftp.

El fichero se distribuirá encriptado, con las mismas claves de encriptación que el Miembro tiene en la actualidad en el sftp en el que se utilice en cada caso. Para nuevas conexiones, el Miembro tendrá que suministrar dicha clave de encriptación.

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