

# Instrucción I-GEN-05/2024

Notificación de Operaciones a un Registro de Operaciones para cumplir las obligaciones de EMIR.  
Nuevos campos a reportar bajo EMIR Refit

**BME CLEARING**

## Instrucción General

Fecha de entrada en vigor: 29 de abril de 2024

Sustituye a: ---

**La Instrucción detalla los nuevos campos que deben notificarse tras la entrada en vigor de EMIR Refit.**

La presente Instrucción se publica con el fin de proporcionar más detalle de la información a la que se refiere el punto 5.2 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.

Los nuevos campos son:

<p><b>Venue of execution</b></p> <p><i>El valor de este campo varía en función del producto a reportar</i></p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>— Derivados financieros (incluyendo xRolling acciones): XMRV</li> <li>— Derivados electricidad: XMPW</li> <li>— Derivados FX – xRolling divisa: XMFY</li> <li>— IRS:</li> </ul> <p>En función de la plataforma de negociación, tomará distintos valores:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>— TradeWeb: TWEB</li> <li>— Bloomberg: BTFE</li> </ul> <p>En función de la plataforma de confirmación:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>— UE: XOFF</li> <li>— No UE: XXXX</li> </ul>
<p><b>Reporting tracking number (TRN)</b></p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>— Todos los productos excepto IRS:</li> </ul> <p style="text-align: center;"><i>Número de registro de la operación inicial + Fecha de ejecución de la operación <sup>1</sup></i></p>

<sup>1</sup> Formato de fecha: AAAAMMDD

*Se construirá a partir de la unión de 2 campos. El valor de este campo varía en función del producto a reportar.*

Estos campos estarán disponibles vía mensajería, ficheros de traspaso EoD y ficheros armonizados.

- Mensajería FIX:  
Tags # 527 - *SecondaryExecID* y 769 - *TrdRegTimestamp* <sup>1</sup>
- Ficheros de traspaso EoD:  
Campos 23 - *InitialTradeExecID* y 26 - *ExecutionDate* del fichero CTRADES.
- Fichero armonizado CCPTRADESEMIR  
Campo #2\_2

— IRS

*Initial trade ID + initial trading datatime* <sup>1</sup>

Estos campos estarán disponibles vía ficheros de traspaso EoD y ficheros armonizados.

- Ficheros de traspaso EoD:  
Campos 5.3 - *Initial Trade ID* y 5.5 - *Initial trading datatime* del fichero CTRADES.
- Fichero armonizado CCPTRADESEMIR  
Campo #2\_2

**Prior UTI**

*Este campo se reportará únicamente en los casos que se detallan a continuación, en función del producto a reportar*

- Todos los productos excepto IRS:

Aquellas operaciones que son reportadas como consecuencia de un life-cycle event en las operaciones de las que proceden, y formen parte de una posición cuyo Action Type sea 'NEWT' y su Event Type sea 'NOVA' o 'CORP', llevarán asignadas como PRIOR UTI, el UTI de la posición de procedencia.

- IRS:

El PRIOR UTI sólo vendrá comunicado para aquellas operaciones cuyo Event Type sea 'COMP', siendo este el UTI de la operación de procedencia.

**Subsequent Position UTI**

*Este campo se reportará únicamente para aquellas operaciones vayan a formar parte de una posición*

Este campo se reportará únicamente para aquellas operaciones cuyo Action Type sea 'POSC', es decir, vayan a formar parte de una posición.

El valor que tomará el Subsequent Position UTI será el UTI de la posición en la que se incluirá la operación.

Es aplicable a todos los productos salvo a IRS, dado que estos últimos sólo se reportan a nivel de operación.

Este campo estará disponible en el campo #2.4\_ del fichero armonizado CCPTRADESEMIR.

**Valuation y Collateral timestamps**

Fecha y hora de la última valoración a precios de mercado y fecha y hora a partir de la cual se informan los valores de las garantías, respectivamente, ambas proporcionadas por BME CLEARING.

Ambos campos estarán compuestos por la fecha de la sesión + "23:59:00" UTC como componente temporal, y estarán disponibles en los campos 2\_23\_ del fichero armonizado CCPVALUATIONEMIR y campo 3\_7\_ del fichero armonizado CCPCOLLATERALEMIR, respectivamente.

**Direction of Leg 1 / 2**

Será informado con cuatro caracteres, 'SLLR' (Vendedor) o 'BYER' (Comprador) para todos los productos.

Adicionalmente, aquellos productos que estén compuestos por 2 'patas', llevarán informados también los valores 'MAKE' en el caso del pagador o 'TAKE', en el caso del receptor.

**Post Trade Risk Reduction (PTRR ID)**

Solo aplicable a IRS

El ID de PTRR deberá notificarse cuando el Event Type sea 'COMP' y el tipo de técnica de PTRR sea compresión con un proveedor de servicios externo o reequilibrio.

Este campo estará disponible en el campo 2\_5\_ del fichero armonizado CCPTRADESEMIR y se construirá a partir de la unión de los siguientes campos:

Número de caracteres	Componentes	Descripción	Ejemplo
20	LEI	Código LEI de BME CLEARING	5299009QA8BBE2O0B349
11	ID de la transacción	Identificador de la operación neteada	00000000077
8	Fecha	Fecha sesión del neteo. Formato (AAMMDD)	20160901

Ejemplo: 5299009QA8BBE2O0B3490000000007720160901

Estos campos estarán disponibles vía ficheros de traspaso EoD y ficheros armonizados:

- Ficheros de traspaso EoD:  
Campos 3.1 - *CCP Trade ID* y 3.13 - *Trade Date* del fichero CTRADES.
- Fichero armonizado CCPTRADESEMIR:  
Campo #2\_5

---

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](http://www.bolsasymercados.es)