

Instrucción I-GEN-02/2025

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: 19 de marzo de 2025

Sustituye a: I-GEN-05/2024

Se modifica por el cambio en el campo 'Post Trade Risk Reduction (PTRR ID)'

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>Venue of execution</p> <p><i>El valor de este campo varía en función del producto a reportar</i></p>	<ul style="list-style-type: none"> — Derivados financieros (incluyendo xRolling acciones): XMRV — Derivados electricidad: XMPW — Derivados FX – xRolling divisa: XMFx — IRS: <p>En función de la plataforma de negociación, tomará distintos valores:</p> <ul style="list-style-type: none"> — TradeWeb: TWEB — Bloomberg: BTFE <p>En función de la plataforma de confirmación:</p> <ul style="list-style-type: none"> — UE: XOFF — No UE: XXXX
<p>Reporting tracking number (TRN)</p> <p><i>Se construirá a partir de la unión de 2</i></p>	<ul style="list-style-type: none"> — Todos los productos excepto IRS: <p style="text-align: center;"><i>Número de registro de la operación inicial + Fecha de ejecución de la operación ¹</i></p> <p>Estos campos estarán disponibles vía mensajería, ficheros de traspaso EoD y ficheros armonizados.</p> <ul style="list-style-type: none"> — Mensajería FIX:

¹ Formato de fecha: AAAAMMDD

campos. El valor de este campo varía en función del producto a reportar.

Tags # 527 - *SecondaryExecID* y 769 - *TrdRegTimestamp* ¹

- 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 ¹

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	5299009QA8BBE2OOB349
11	CCP Grouping ID	Código de grupo generado por la ECC	00000077777
8	Fecha	Fecha sesión del neteo. Formato (AAAAMMDD)	20160901

Ejemplo: 5299009QA8BBE2OOB3490000007777720160901

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

- Ficheros de traspaso EoD:
Campos 5.8 - *Grouping ID* y 1.6 - *rptSessionDate* del fichero CTRADES.
- Fichero armonizado CCPTRADESEMIR:
Campo #2_5

2025 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