

Instrucción I-GEN-03/2025

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: 30 de junio de 2025

Sustituye a: I-GEN-04/2024

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

Se modifica por la actualización del fichero armonizado CCPPOSITIONEMIR a la versión 4.0.

Según lo descrito en el punto 9 de la Circular '*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 actualizará el fichero armonizado CCPPOSITIONEMIR a la versión 4.0.

Adicionalmente, BME CLEARING genera 3 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.

Instrucción I-GEN-03/2025

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.

- 00X = Versión actual del fichero.

Siendo 004 la nueva versión del fichero CCPPOSITIONEMIR. En caso de futuras versiones, este número será consecutivo y siempre acordado en el grupo de EACH.

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.

Este sufijo se utiliza si el fichero armonizado debe ser generado nuevamente. Por ejemplo, para correcciones al contenido del fichero después de la generación inicial, el segundo informe generado finalizaría en 002.

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

Instrucción I-GEN-03/2025

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.

Emir Refit Table & Item	CCPTRADESEMIR
2_124_	Delivery start date
2_125_	Delivery end date
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	Formato	Valores aceptados
	C.O.B Date	AAAA-MM-DD	
1_4_	Counterparty 1 (Reporting counterparty)	LEI (ISO 17442)	
1_17_	Direction		SLLR, BYER
2_21_	Valuation amount	Numérico	
2_22_	Valuation currency	Divisa (ISO 4217)	
2_5_	Product identification type		
2_7_	ISIN	ISIN (ISO 6166)	
2_1_	UTI	UTI (ISO 23897)	
2_41_	Venue of execution	MIC (ISO 10383)	
2_48_	Price	Numérico	
2_60_	Total notional quantity of leg 1	Numérico	
2_132_	Option type		CALL, PUTO, OTHR
2_134_	Strike price	Numérico	
2_154_	Level		PSTN

¹ Único fichero acordado en el grupo EACH.

El objetivo de este fichero es recopilar todas las posiciones abiertas comunicadas a un Repositorio, con independencia de si han sido creadas (NEWT), modificadas (MODI) o si solamente han cambiado su valoración (VALU) durante la sesión.

Instrucción I-GEN-03/2025

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.

EMIR Refit Table & Item	CCPPOSITIONEMIR	Formato	Valores aceptados
-	Clearing Member Code	Alfanumérico	
-	Trading_Member_Code	Alfanumérico	
-	Exchange_Account_Code	Alfanumérico	
-	Position_Account_Owners	Alfanumérico	
-	Exchange_Product_Code	Alfanumérico	
2_44_	Expiration date	AAAA-MM-DD	
2_3_	Prior UTI	UTI (ISO 23897)	
2_14_	Underlying identification	ISIN (ISO 6166)	
2_25_	Delta	Numérico	
2_42_	Execution timestamp	AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ (ISO 8601)	
2_48_	Price Notation		MntryVal = valor monetario Pctg = en porcentaje
2_55_	Notional amount of leg 1	Numérico	
2_56_	Notional currency 1	Divisa (ISO 4217)	
2_46_	Final contractual settlement date	AAAA-MM-DD	
2_151_	Action type		NEWT, MODI, CORR, TERM, EROR, REVI, VALU
2_152_	Event type		NOVA, ETRM, EXER, CREV, INCP, TRAD, COMP, CORP, UPDT

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

Instrucción I-GEN-03/2025

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.

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
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.

Instrucción I-GEN-03/2025

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.

- En caso de no disponer de información que mostrar para un día concreto, por inactividad del miembro, los ficheros armonizados se generarán vacíos, aunque incluirán la cabecera y el pie de página, este último con valor = "NOL;0".

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.

2025 Bolsas y Mercados Españoles, Sociedad Holding de Mercados y Sistemas Financieros S. A. Todos los derechos reservados.

BME

www.bolsasymercados.es

Plaza de la Lealtad,1

Palacio de la Bolsa

28014 Madrid