

A large, abstract graphic in the center of the page. It consists of several overlapping, semi-transparent geometric shapes, primarily triangles and polygons, in shades of blue and grey. The shapes are arranged in a way that creates a sense of depth and movement, resembling a complex data visualization or a network diagram. The background is white, and the overall aesthetic is clean and modern.

# Segmentos de Renta Variable y Renta Fija

Ficheros de Datos / 11 de noviembre de 2022

## Historia de Revisiones

| FECHA                    | VERSIÓN | DESCRIPCIÓN  | AUTOR           |
|--------------------------|---------|--|-----------------|
| 20 de diciembre de 2013  | 1.0     | Versión Inicial  | BME CLEARING IT |
| 4 de julio de 2014       | 1.1     | Change Requests junio 2014   | BME CLEARING IT |
| 27 de noviembre de 2014  | 1.2     | Change Requests octubre 2014   | BME CLEARING IT |
| 23 de marzo de 2015      | 1.3     | Change Requests enero 2015   | BME CLEARING IT |
| 18 de mayo de 2015       | 1.4     | Cambios menores mayo 2015  | BME CLEARING IT |
| 13 de noviembre de 2015  | 1.5     | Cambios menores noviembre 2015   | BME CLEARING IT |
| 23 de septiembre de 2016 | 1.6     | Versión producción septiembre 2016   | BME CLEARING IT |
| 24 de noviembre de 2016  | 1.7     | Inclusion de campos a informar por el segmento de Renta Fija y cambios en Renta Variable por implantación T2S.   | BME CLEARING IT |
| 18 de mayo de 2017       | 1.8     | Cambio nomenclatura: rating por solvencia.   | BME CLEARING IT |
| 1 de diciembre de 2017   | 1.9     | Fichero CACCOUNTS incluye el LEI. Cambios en valores válidos del Indicador de Capacidad.   | BME CLEARING IT |
| 1 de febrero de 2018     | 1.10    | Registro de Deuda Indexada en Renta Fija.  | BME CLEARING IT |
| 6 de febrero de 2018     | 1.11    | Cambios por MiFID II y Nueva estructura de cuentas   | BME CLEARING IT |
| 3 de septiembre de 2018  | 1.12    | Fichero CTRANSFTRADES: en asignaciones múltiples el campo TrdDt contiene la Fecha Teórica de Liquidación.  | BME CLEARING IT |
| 5 de noviembre de 2018   | 1.13    | Cambio en campo TrdDt de los ficheros CGIVEIN, CGIVEOUT y CGIVEINCLM. Cambios en ficheros por la Separación de Flujos de Efectivo.   | BME CLEARING IT |
| 15 de marzo de 2019      | 1.14    | Fichero CENTITIES: no informa del BIC del Agente de Pagos.   | BME CLEARING IT |
| 30 de octubre de 2019    | 1.16    | Fichero CISINDATA: se modifica el contenido de los campos EventType y EventText del bloque Instrmt/Evnt.<br>Nuevos ficheros CREQMARGM y CREQMARGMCCP.<br>Fichero CMARGINSCLM: incluye el Límite de Riesgo Intradía resultante a fin de sesión. | BME CLEARING IT |

| FECHA                   | VERSIÓN | DESCRIPCIÓN   | AUTOR           |
|-------------------------|---------|---|-----------------|
| 15 de febrero de 2020   | 1.17    | Nuevos ficheros CALLOCAS y CALLOCBS.<br>Cambios en ficheros CISINCODES, CTRADES, CHISTTRADES, CALLTRADES y CBALANCEBYDATE, para el segmento de Renta Fija.<br><br>Cambios en fichero CMARGINSCLM. | BME CLEARING IT |
| 19 de junio de 2020     | 1.18    | Cambios en fichero CMARGINSCLM  | BME CLEARING IT |
| 1 de febrero de 2021    | 1.19    | Cambios en CTRADES, CHISTTRADES y CALLTRADES para el segmento de Renta Fija   | BME CLEARING IT |
| 1 de marzo de 2022      | 1.20    | Cambios en fichero CFAILPENALTIES y nuevo fichero CFAILFEES   | BME CLEARING IT |
| 24 de marzo de 2022     | 1.21    | CSTRESSTESTING: Revisión descripción MarginAmtType 313  | BME CLEARING IT |
| 11 de noviembre de 2022 | 1.24    | Cambios en ficheros CPLEDGES, CALLOCAS y CALLOCBS.<br><br>Nuevo fichero COLLATERALFEES.   | BME CLEARING IT |

## Modificaciones realizadas en la última revisión

### Principales cambios respecto a la documentación v1.21 publicada el 24 de marzo de 2022:

- Cambios en ficheros CPLEDGES, CALLOCAS y CALLOCBS: nuevos valores para los campos StipulationType[233] y StipulationType[234].
- Nuevo fichero COLLATERALFEES (apartado 9.2 Comisiones Colateral).

## Tabla de Contenidos

|          |  |           |
|----------|--|-----------|
| <b>1</b> | <b>INTRODUCCIÓN .....</b>  | <b>8</b>  |
| 1.1      | Alcance  | 8         |
| 1.2      | Estructura del documento   | 8         |
| 1.3      | Convenciones utilizadas en este documento  | 9         |
| 1.4      | Futuras versiones de este documento  | 10        |
| <b>2</b> | <b>MECANISMO DE OBTENCIÓN DE LOS FICHEROS.....</b>                                       | <b>11</b> |
| <b>3</b> | <b>DATOS GENERALES .....</b>   | <b>12</b> |
| 3.1      | Estado de la sesión  | 12        |
| 3.2      | Entidades de la ECC  | 13        |
| 3.3      | Datos de Valores   | 14        |
| <b>4</b> | <b>INFORMACIÓN PÚBLICA .....</b>   | <b>20</b> |
| 4.1      | Datos Diarios de Valores para el cálculo de Garantías                                    | 20        |
| <b>5</b> | <b>DATOS PRIVADOS DE CONFIGURACIÓN .....</b>   | <b>25</b> |
| 5.1      | Cuentas de Posición  | 25        |
| 5.2      | Cuentas de Garantías   | 30        |
| 5.3      | Cuentas de Colateral   | 32        |
| 5.4      | Referencias de Asignación Externa (Miembro Origen)                                       | 34        |
| 5.5      | Referencias de aceptación de Asignación Externa (Miembro Destino)                        | 36        |
| 5.6      | Filtros de aceptación de Asignación Externa (Miembro Destino)                            | 37        |
| 5.7      | Filtros de Aceptación de Asignación Externa (Compensador de Miembro Destino)             | 39        |
| 5.8      | Módulo de Parametrización por Miembro Origen   | 41        |
| <b>6</b> | <b>INFORMACIÓN DE OPERACIONES .....</b>  | <b>44</b> |
| 6.1      | Operaciones de la sesión procedentes de plataformas y movimientos entre Miembros/Cuentas | 44        |

|           |   |            |
|-----------|---|------------|
| 6.2       | Operaciones de cualquier sesión procedentes de plataformas y movimientos entre Miembros/Cuentas | 49         |
| 6.3       | Detalle de todas las Operaciones registradas en la sesión                                       | 55         |
| <b>7</b>  | <b>ASIGNACIÓN DE LA CUENTA DE POSICIÓN</b>  | <b>64</b>  |
| 7.1       | Asignaciones Internas de Cuenta y Traspasos realizados  | 64         |
| 7.2       | Asignaciones Externas (Miembro Origen)  | 67         |
| 7.3       | Asignaciones Externas (Miembro Destino)   | 73         |
| 7.4       | Asignaciones Externas (Compensador de Miembro Destino)  | 80         |
| <b>8</b>  | <b>RENTENCIÓN Y LIBERACIÓN DE OPERACIONES</b>   | <b>87</b>  |
| 8.1       | Retenciones/liberaciones realizadas   | 87         |
| 8.2       | Operaciones Retenidas   | 89         |
| <b>9</b>  | <b>COMISIONES</b>   | <b>94</b>  |
| 9.1       | Comisiones Miembro Compensador  | 94         |
| 9.2       | Comisiones Colateral  | 96         |
| <b>10</b> | <b>GARANTÍAS DEPOSITADAS</b>  | <b>100</b> |
| 10.1      | Detalle de Garantías Depositadas  | 100        |
| 10.2      | Previsión del colateral asignado a cada cuenta de colateral para la siguiente sesión            | 103        |
| 10.3      | Colateral asignado a cada cuenta de colateral   | 107        |
| <b>11</b> | <b>RESULTADOS A NIVEL DE CUENTA</b>   | <b>111</b> |
| 11.1      | Saldo neto y saldo agregado por Fecha Teórica de Liquidación                                    | 111        |
| 11.2      | Detalle del cálculo de Garantía Diaria (Garantía por Posición)                                  | 115        |
| 11.3      | Garantías por Cuenta de Garantías   | 120        |
| 11.4      | Garantías por Cuenta de Colateral   | 122        |
| 11.5      | Información de las Pruebas Retrospectivas   | 124        |
| 11.6      | Información de las Pruebas de Resistencia   | 126        |
| 11.7      | Detalle por cuenta de colateral de los Movimientos de efectivo                                  | 127        |
| 11.8      | Resumen agregado por cuenta de colateral de los Movimientos de efectivo                         | 129        |
| 11.9      | Garantías por cuenta de garantías no asociadas a cuentas de posición                            | 131        |

|                   |  |            |
|-------------------|--|------------|
| 11.10             | Garantías exigidas y colateral depositado por cuenta de colateral no asociadas a cuentas de posición | 132        |
| <b>12</b>         | <b>RESULTADOS A NIVEL DE MIEMBRO COMPENSADOR</b>   | <b>135</b> |
| 12.1              | Garantías requeridas al Miembro Compensador a nivel de Contrapartida Central                         | 135        |
| 12.2              | Movimientos de efectivo para el Miembro Compensador a nivel de Contrapartida Central                 | 139        |
| <b>13</b>         | <b>RESULTADOS A NIVEL DE AGENTE DE PAGOS</b>   | <b>142</b> |
| 13.1              | Movimientos de efectivo para el Agente de Pagos a nivel de Contrapartida Central                     | 142        |
| <b>14</b>         | <b>COMPENSACIÓN E INSTRUCCIONES DE LIQUIDACIÓN</b>   | <b>144</b> |
| 14.1              | Instrucciones a liquidar en la siguiente sesión  | 144        |
| 14.2              | Nuevas Instrucciones generadas por liberación  | 147        |
| 14.3              | Detalle de Operaciones de cada Instrucción de Liquidación  | 150        |
| <b>15</b>         | <b>INFORMACIÓN DE LIQUIDACIONES Y FALLIDOS</b>   | <b>154</b> |
| 15.1              | Instrucciones liquidadas en la sesión  | 154        |
| 15.2              | Instrucciones pendientes de liquidar   | 157        |
| 15.3              | Liquidación de Fallidos por Recompra   | 161        |
| 15.4              | Liquidación de Fallidos en Efectivo  | 164        |
| 15.5              | Penalizaciones DCV   | 167        |
| 15.6              | Comisiones por fallidos  | 169        |
| <b>16</b>         | <b>INFORMACIÓN DE EVENTOS</b>  | <b>173</b> |
| 16.1              | Instrucciones generadas sobre Fallidos por Eventos Corporativos                                      | 173        |
| <b>APÉNDICE A</b> | <b>INFORMACIÓN ADICIONAL</b>   | <b>176</b> |
| A.1               | Campos de Usuario  | 176        |

## Índice de Ficheros

|                              |     |                         |     |
|------------------------------|-----|-------------------------|-----|
| CACCOUNTS.sc.....            | 25  | CGIVEOUT.sc.....        | 67  |
| CACCOUNTSETTL.sc .....       | 121 | CGIVEOUTREF.sc .....    | 34  |
| CACCOUNTSETTLCCP.cc .....    | 123 | CHELDTRADES.sc .....    | 89  |
| CALLOCAS.cc.....             | 103 | CHISTTRADES.sc.....     | 49  |
| CALLOCBS.cc .....            | 107 | CHOLDRELEASE.sc.....    | 87  |
| CALLTRADES.sc.....           | 55  | CISINCODES.sc .....     | 14  |
| CBACKTESTING.sc.....         | 125 | CISINDATA.sc.....       | 20  |
| CBALANCEBYDATE.sc .....      | 112 | CMARGINACCOUNTS.sc..... | 30  |
| CCASHMOVBRKD.cc .....        | 128 | CMARGINCALC.sc.....     | 116 |
| CCASHMOVCC.cc.....           | 130 | CMARGINSCLM.cc.....     | 136 |
| CCASHMOVCLM.cc.....          | 140 | CMONTHLYFEES.sc .....   | 94  |
| CCASHMOVTREAS.cc .....       | 143 | CPARMODULE.sc.....      | 41  |
| CCOLLATERALACCOUNTS.sc ..... | 32  | CPENDINGINST.sc.....    | 158 |
| CCOLLATERALFEES.cc.....      | 96  | CPLEDGES.cc.....        | 100 |
| CENTITIES.sc .....           | 13  | CREQMARGM.sc.....       | 132 |
| CFAILBUYIN.sc .....          | 162 | CREQMARGMCCP.cc.....    | 133 |
| CFAILCASHSETTL.sc .....      | 165 | CSETTLEDINST.sc .....   | 155 |
| CFAILFEES.sc.....            | 170 | CSETTLINSTDET.sc .....  | 151 |
| CFAILPENALTIES.sc .....      | 168 | CSETTLINSTNEXT.sc.....  | 145 |
| CFAILSADJUST.sc .....        | 174 | CSETTLINSTREL.sc.....   | 148 |
| CGIVEIN.sc.....              | 73  | CSTATUS.sc .....        | 12  |
| CGIVEINCLM.sc.....           | 80  | CSTRESSTESTING.sc.....  | 127 |
| CGIVEINFILT.sc .....         | 37  | CTRADES.sc.....         | 44  |
| CGIVEINFILTCLM.sc.....       | 39  | CTRANSFTRADES.sc .....  | 64  |
| CGIVEINREF.sc .....          | 36  |                         |     |

# 1 Introducción

## 1.1 Alcance

Este documento tiene como objetivo la descripción técnica de los ficheros de datos que pueden ser obtenidos por los usuarios de los segmentos de Renta Variable y Renta Fija de BME CLEARING.

Esta información será suministrada en ficheros con formato XML cuya definición se encuentra más adelante en este documento. El formato de ficheros sigue, tanto como es posible, las especificaciones de FIX 5.0 (FIXML 5.0 SP2 Extension pack 178). En la mayoría de los casos la estructura y semántica de los mensajes es idéntica al estándar.

La implementación propia de BME Clearing se describe en el esquema incluido en el archivo BMEClearing-FIXML-5-0-SP2-v1.0.zip, que es el que deberá ser tenido en cuenta por los desarrolladores.

## 1.2 Estructura del documento

En el primer capítulo se incluye información genérica sobre este manual, incluyendo los aspectos técnicos del formato de los ficheros, como pueden ser los tipos de datos utilizados, etc.

En los capítulos restantes se definen los ficheros agrupándolos funcionalmente.

- Datos Generales: estado de la sesión, datos de entidades y Valores.
- Información pública diaria: datos empleados por los algoritmos de cálculo de Garantías.
- Datos privados de configuración: características de la configuración de Cuentas (de posición, garantías y colateral) Referencias y Filtros de Asignación Externa y Módulo de Parametrización.
- Operaciones: detalle de las Operaciones del día y de todas aquellas que están pendientes de liquidar.
- Asignación de la Cuenta de Posición: acciones de Asignación Interna de cuenta, Traspaso o Asignación Externa efectuadas sobre las Operaciones.
- Gestión de Operaciones para la Liquidación: retenciones/liberaciones realizadas, y resumen de Operaciones retenidas.
- Comisiones: datos relativos al importe de comisiones.
- Garantías Depositadas: datos relativos a las Garantías Depositadas.
- Resultados a nivel de Cuenta de Posición: saldo por cuenta de posición (neto para cuentas netas y agregado para cuentas brutas).
- Resultados a nivel de Cuenta de Garantías para Miembros Compensadores: datos relativos a las Garantías Exigidas y datos de Movimientos de Efectivo.
- Resultados a nivel de Cuenta de Colateral para Miembros Compensadores: datos relativos a las Garantías Depositadas, y datos de Movimientos de Efectivo.
- Resultados para Agentes de Pagos: datos relativos a los Movimientos de Efectivo para el Agente de Pagos.

- Información de Compensación e Instrucciones: Instrucciones a liquidar en la siguiente sesión, con el detalle de las Operaciones que incluyen.
- Información de Liquidaciones y Fallidos: Instrucciones de Liquidación, Fallidos, Liquidaciones por Recompra y en Efectivo y Penalizaciones.
- Información de Eventos: datos sobre Instrucciones generadas por Eventos Corporativos.

### 1.3 Convenciones utilizadas en este documento

#### 1.3.1 Información general de cada fichero

Para cada fichero contenido en este documento se presenta una primera tabla como la descrita a continuación.

Esta tabla presenta la información genérica del fichero con el siguiente formato:

|                      | (1) |
|----------------------|-----|
| <i>Grupo</i>         | (2) |
| <i>Descripción</i>   | (3) |
| <i>Destinatarios</i> | (4) |
| <i>Privacidad</i>    | (5) |
| <i>Timing</i>        | (6) |

(1) Nombre del fichero tal y como es generado. Todos los ficheros contienen en su nombre el código de entorno correspondiente (genéricamente, se indica “.cc” para la cámara, y “.sc” para un determinado segmento dentro de la cámara).

Aunque no se indica expresamente, todos tienen la extensión XML.

(2) Grupo al que pertenece el fichero.

(3) Descripción del fichero.

(4) Destinatarios del fichero.

(5) Informa de si el fichero contiene datos públicos o privados.

(6) Informa del momento en el que el fichero está disponible, cuándo varía y la forma de actualización de los registros.

#### 1.3.2 Formato de las tablas de definición de mensajes

La definición de cada fichero se realiza mediante una tabla que describe de forma detallada los campos que lo conforman.

Estas tablas contienen un campo por fila y presentan las siguientes columnas:

| COLUMNA         | SIGNIFICADO  |
|-----------------|--|
| Tag             | Número de campo. Los campos añadidos al mensaje en esta implementación presentan un asterisco ("*") a continuación de este número  |
| Nombre          | Nombre del campo según el estándar FIX   |
| FIXML           | Nombre del campo según el estándar FIXML   |
| Req             | "S" indica que el campo es requerido, "N" significa que el campo es opcional. "S*" significa que el campo es requerido en esta implementación, pero opcional en el estándar FIX 5.0  |
| Valores válidos | Valores válidos del campo en el contexto del mensaje. Puede ser una lista de Valores, o un rango de Valores numéricos, p.ej. ">=3, <= 10". En esta columna también se indica el valor por defecto del campo<br>Para evitar confusiones con los términos, en los Valores asociados a códigos se ha respetado la descripción del valor original de FIX, y por tanto no se ha traducido |
| Formato         | Tipo de dato del campo. Es uno de los tipos definidos por FIX, o uno de estos tipos con alguna restricción adicional. String(n) es un tipo String con un máximo de n caracteres, o en algunos casos con exactamente n caracteres   |
| Descripción     | Descripción del campo en el contexto del mensaje   |

### 1.3.3 Estructura de cada fichero

La especificación FIXML en cuanto a ficheros indica que la forma estándar de poner varios mensajes del mismo tipo en un mismo fichero es recoger dichos registros dentro de un bloque único con tag <Batch>.

Por ejemplo, un fichero que tenga registros de formato "Trade Capture Report" contendrá un bloque único <Batch> con varios registros <TrdCaptRpt>:

```
<Batch>
  <TrdCaptRpt>...</TrdCaptRpt>
  <TrdCaptRpt>...</TrdCaptRpt>
  <TrdCaptRpt>...</TrdCaptRpt>
</Batch>
```

En los diferentes apartados de este documento se describe el formato de cada uno de los registros contenidos en el fichero correspondiente.

## 1.4 Futuras versiones de este documento

### 1.4.1 Nuevos ficheros

Este documento puede ser modificado en un futuro para incluir nuevos ficheros.

### 1.4.2 Resaltando cambios

Todo cambio se reflejará sombreado en gris. El texto eliminado en la última revisión se presentará con fuente tachada y sombreado en gris.

## 2 Mecanismo de obtención de los ficheros

Ver documento de conectividad.

## 3 Datos Generales

### 3.1 Estado de la sesión

| CSTATUS.sc    |   |
|---------------|---|
| Grupo         | Datos Generales   |
| Descripción   | Estado de la sesión de la ECC                                   |
| Destinatarios | Todos los usuarios del Segmento de RV y RF de la ECC            |
| Privacidad    | Contiene datos públicos   |
| Timing        | Disponible durante la sesión. Dinámico, varía durante la sesión |

| TAG                                  | NOMBRE               | FIXML     | REQ | VALORES VÁLIDOS   | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|--------------------------------------|----------------------|-----------|-----|---|---------------|---|
| <b>CSTATUS / RgstInstrctns</b>       |                      |           |     |   | (1 time)      |   |
| 513                                  | RegistID             | ID        | S   |   | String        | Identificador único para cada mensaje Registration Instructions     |
| 514                                  | RegistTransType      | TransType | S   | 0 = New   | Char          |   |
| 58*                                  | Text                 | Txt       | N   | I = Iniciada<br>1 = 1ª ventana agregación<br>2 = 2ª ventana agregación durante la sesión<br>3 = última ventana agregación<br>F = Finalizada | String        | Indica el estado de la sesión actual                                |
| 715                                  | ClearingBusinessDate | BizDt     | S   |   | LocalMktDate  | Fecha de la sesión  |
| 716*                                 | SettSessID           | SetSesID  | N   | ITD = Intradía<br>EOD = Fin de sesión   | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión               |
| <b>CSTATUS / RgstInstrctns / Hdr</b> |                      |           |     |   |               |   |
| 35                                   | MsgType              | MsgTyp    | S   | o   | String        | Identifica el tipo de mensaje                                       |
| 49                                   | SenderCompID         | SID       | S   |   | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL" |
| 56                                   | TargetCompID         | TID       | S   |   | String        | Contiene "???"  |
| 50                                   | SenderSubID          | SSub      | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"  | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC                            |
| 52                                   | SendingTime          | Snt       | S   |   | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero                                      |

### 3.2 Entidades de la ECC

| CENTITIES.sc  |  |
|---------------|--|
| Grupo         | Datos Generales  |
| Descripción   | Información pública de las entidades que intervienen en la ECC                 |
| Destinatarios | Todos los usuarios del Segmento de RV y RF de la ECC                           |
| Privacidad    | Contiene datos públicos  |
| Timing        | Disponible a inicio y fin de sesión. Estático, no varía durante toda la sesión |

| TAG  | NOMBRE                   | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|--|--------------------------|----------|-----|--|---------------|---|
| <b>CENTITIES / PtyDetlListRpt</b>                            |                          |          |     |  |               | (n times)   |
| 1510   | PartyDetailsListReportID | RptID    | S   |  | String        | Identificador único para cada mensaje Party Details List Report                                   |
| 715*   | ClearingBusinessDate     | BizDt    | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión  |
| 716*   | SettlSessID              | SetSesID | N   | ITD = Intradía<br>EOD = Fin de sesión              | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión   |
| <b>CENTITIES / PtyDetlListRpt / Hdr</b>                      |                          |          |     |  |               |   |
| 35   | MsgType                  | MsgTyp   | S   | CG   | String        | Identifica el tipo de mensaje   |
| 49   | SenderCompID             | SID      | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"                               |
| 56   | TargetCompID             | TID      | S   |  | String        | Contiene "????"   |
| 50   | SenderSubID              | SSub     | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC  |
| 52   | SendingTime              | Snt      | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero  |
| <b>CENTITIES /PtyDetlListRpt/ PtyDetl</b>                    |                          |          |     |  |               | (n times)   |
| →1691  | PartyDetailID            | ID       | N   |  | String        | Contiene el código de la Entidad en la ECC  |
| →1692  | PartyDetailID Source     | Src      | N   | D = Proprietary/<br>Custom code                    | char          |   |
| →1693  | PartyDetailRole          | R        | N   | 1 = Firm   | int           |   |
| →1672  | PartyDetailStatus        | Stat     | N   | 0 = Activo<br>1 = Baja                             | int           | Situación del party   |
| <b>CENTITIES /PtyDetlListRpt/ PtyDetl/ ReltdPtyDetl/ Sub</b> |                          |          |     |  |               | (n times)   |
| →→1567   | RelatedPartyDetailSubID  | ID       | N   |  | String        | Información del party. Contiene la información especificada en RelatedPartyDetailSubIDType [1568] |

| TAG    | NOMBRE                      | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS   | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|--------|-----------------------------|-------|-----|---|---------|---|
|        |                             |       |     | 1 = Nombre de la Entidad  |         | Si<br>RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4100, contiene el tipo de Entidad en la ECC (ver Tabla 7 del documento "Tablas de Codificación") |
|        |                             |       |     | 16 = Código BIC de la Entidad Participante en el DCV                            |         |   |
| à→1568 | RelatedPartyDetailSubIDType | Type  | N   | 23 = Código de la Entidad Participante en el Banco Central Europeo (código ECB) | int     |   |
|        |                             |       |     | 4100 = Tipo de Entidad en la ECC  |         |   |

### 3.3 Datos de Valores

| CISINCODES.sc |  |
|---------------|--|
| Grupo         | Datos Generales  |
| Descripción   | Información general de los Valores del Segmento de RV y RF de la ECC   |
| Destinatarios | Todos los usuarios   |
| Privacidad    | Contiene datos públicos  |
| Timing        | Disponible a inicio y fin de sesión. Dinámico, pueden añadirse nuevos registros en cualquier momento. No se modifican o eliminan registros |

| TAG                              | NOMBRE               | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                       | FORMATO      | DESCRIPCIÓN   |
|----------------------------------|----------------------|----------|-----|---------------------------------------|--------------|---|
| <b>CISINCODES / SecList/</b>     |                      |          |     |                                       | (n times)    |   |
| 715                              | ClearingBusinessDate | BizDt    | S   |                                       | LocalMktDate | Fecha de la sesión  |
| 716*                             | SettSessID           | SetSesID | N   | ITD = Intradía<br>EOD = Fin de sesión | String       | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión               |
| <b>CISINCODES / SecList/ Hdr</b> |                      |          |     |                                       |              |   |
| 35                               | MsgType              | MsgTyp   | S   | y                                     | String       | Identifica el tipo de mensaje                                       |
| 49                               | SenderCompID         | SID      | S   |                                       | String       | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL" |
| 56                               | TargetCompID         | TID      | S   |                                       | String       | Contiene "????"   |

| TAG                                       | NOMBRE             | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS   | FORMATO       | DESCRIPCIÓN  |
|---|--------------------|----------|-----|---|---------------|--|
| 50  | SenderSubID        | SSub     | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"        | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC   |
| 52  | SendingTime        | Snt      | S   |   | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero (1 time)  |
| <b>CISINCODES /SecList/ SecL</b>          |                    |          |     |   |               |  |
| →15                                       | Currency           | Ccy      | N   |   | Currency      | Código de divisa. Expresada según estándar ISO 4217  |
| →58                                       | Text               | Txt      | N   |   | String        | Descripción del valor  |
| <b>CISINCODES /SecList/ SecL/ Instrmt</b> |                    |          |     |   |               |  |
| →55                                       | Symbol             | Sym      | N   | [N/A] o código de valor                                   | String(5)     |  |
| →48                                       | SecurityID         | ID       | N   |   | String(12)    | Código ISIN  |
| →22                                       | SecurityIDSource   | Src      | N   | 4 = ISIN number   | String        |  |
| →1151                                     | SecurityGroup      | SecGrp   | N   | Ver Tabla 2 del documento "Tablas de Codificación"        | String        | Grupo de Valores   |
| →167                                      | SecurityType       | SecTyp   | N   | Ver Tabla 3 del documento "Tablas de Codificación"        | String        | Tipo de producto   |
| →200                                      | MaturityMonthYear  | MMY      | N   | AAAAMM  | Month-Year    | Vencimiento del valor  |
| →541                                      | MaturityDate       | MatDt    | N   |   | LocalMktDate  | Fecha de vencimiento   |
| →225                                      | IssueDate          | Issued   | N   |   | UTCDate       | Fecha de emisión del valor   |
| →202                                      | StrikePrice        | StrkPx   | N   |   | Price         | Precio de Ejercicio. Sólo para activos de RV   |
| →968                                      | StrikeValue        | StrkValu | N   |   | Float         | Unidad de contratación. Número de acciones equivalentes a cada valor. Sólo para activos de RV                    |
| →206                                      | OptAttribute       | OptAt    | N   | A = Americano<br>E = Europeo<br>B = Bermudas<br>O = Otros | Char          | Estilo del ejercicio. Sólo para activos de RV  |
| →231                                      | ContractMultiplier | Mult     | N   |   | Float         | Indica el factor multiplicativo para convertir unidades de precio a unidades monetarias. Sólo para activos de RV |
| →201                                      | PutOrCall          | PutCall  | N   | 0 - Put<br>1 - Call                                       | Int           | Indica si el valor es call o put. Sólo para activos de RV  |

| TAG   | NOMBRE              | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS  | FORMATO      | DESCRIPCIÓN   |
|---|---------------------|----------|-----|--|--------------|---|
| à106  | Issuer              | Issr     | N   |  | String       | Código de la entidad emisora del valor o Código de gestora  |
| →223  | CouponRate          | CpnRt    | N   |  | Percentage   | Cupón en porcentaje del nominal.<br>Sólo para activos de Renta Fija.  |
| →874  | InterestAccrualDate | IntAcrl  | N   |  | LocalMktDate | Fecha en la que el activo empieza a devengar cupón.<br>Sólo para activos de Renta Fija.   |
| →1639*  | MarginClass         | Clss     | N   |  | String       | Grupo de compensación del activo.<br>Sólo para activos de Renta Fija.   |
| → 461   | CFICode             | CFI      | N   |  | String       | Clasificación del valor usado como colateral (estándar ISO 10692 Código CFI, 6 caracteres alfabéticos).<br>Sólo para activos de Renta Fija. |
| → 470   | CountryOfIssue      | IssuCtry | N   |  | String       | Jurisdicción del Emisor (código de país según estándar ISO 3166).<br>Sólo para activos de Renta Fija.                                       |
| <b>CISINCODES /SecList/ SecL/ Instrmt/ AID</b>  |                     |          |     |  |              | (n times)   |
| →→455   | SecurityAltID       | AltID    | N   |  | String(22)   | Nombre corto del valor  |
| →→456   | SecurityAltIDSource | AltIDSrc | N   | 8 = Exchange Symbol  | String       |   |
| <b>CISINCODES /SecList/ SecL/ Instrmt/ Evnt</b> |                     |          |     |  |              | (n times)   |
|   |                     |          |     | 100 = Barrera (turbo warrants) / Barrera inferior (Inlines). Sólo para activos de RV |              |   |
|   |                     |          |     | 101 = Último día de negociación  |              |   |
| →→865   | EventType           | EventTyp | N   | 104 = Barrera superior (inlines) Sólo para activos de RV                             | Int          |   |
|   |                     |          |     | 105 = Barrera inferior activación (turbo pro) Sólo para activos de RV                |              |   |

| TAG   | NOMBRE    | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS   | FORMATO      | DESCRIPCIÓN   |
|-------|-----------|-------|-----|---|--------------|---|
|       |           |       |     | 106 = Barrera superior activación (turbo pro) Sólo para activos de RV |              |   |
|       |           |       |     | 114 = Número de decimales en el precio del valor                      |              |   |
|       |           |       |     | 120 = Código del Sistema de Liquidación                               |              |   |
|       |           |       |     | 122 = Barrera (bonus) Sólo para activos de RV                         |              |   |
|       |           |       |     | 201 = Periodicidad del cupón  |              |   |
|       |           |       |     | 215 = Método de cálculo del cupón corrido                             |              |   |
|       |           |       |     | 216 = Índice Base   |              |   |
|       |           |       |     | 217 = Calidad del colateral   |              |   |
|       |           |       |     | 218 = LEI emisor  |              |   |
|       |           |       |     | 219 = Tipo de colateral   |              |   |
| →→866 | EventDate | Dt    | N   |   | LocalMktDate | Último día de negociación, cuando EventType = 101<br>Precio barrera del warrant (turbowarrants) o Precio barrera inferior del warrant inline, cuando EventType = 100<br>Precio barrera superior del warrant inline cuando EventType = 104 |
| →→867 | EventPx   | Px    | N   |   | Price        | Precio barrera inferior del warrant para la activación del turbo pro cuando EventType = 105<br>Precio barrera superior para la activación del turbo pro cuando EventType = 106  |

| TAG   | NOMBRE    | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|-------|-----------|-------|-----|-----------------|---------|---|
|       |           |       |     |                 |         | Precio barrera del bonus warrant cuando EventType = 122   |
|       |           |       |     |                 |         | Si EventType = 114, contiene el número de decimales en el precio del valor  |
|       |           |       |     |                 |         | Si EventType = 120, contiene el Código del Sistema de Liquidación (DCV, misma codificación que para PartyRole[452]=10)  |
|       |           |       |     |                 |         | Segmento de Renta Fija:<br>Si EventType [865] = 201, contiene el nº de cupones al año   |
| à→868 | EventText | Txt   | N   |                 | String  | Si EventType [865] = 215, contiene el método de cálculo del c.corrido:<br>1 = Actual/Actual<br>2 = Actual/360<br>3 = Actual/365                                     |
|       |           |       |     |                 |         | Si EventType [865] = 216, contiene el índice base   |
|       |           |       |     |                 |         | Si EventType [865] = 217 contiene la calidad del colateral:<br>'INVG'-Grado de inversión<br>'NIVG'-Grado de especulación<br>'NOTR'-Sin Rating<br>'NOAP' - No aplica |
|       |           |       |     |                 |         | Si EventType [865] = 218 contiene el LEI emisor   |
|       |           |       |     |                 |         | Si EventType [865] = 219 contiene el tipo de colateral:   |

| TAG                                     | NOMBRE                     | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO   | DESCRIPCIÓN   |
|---|----------------------------|-------|-----|-----------------|-----------|---|
|   |                            |       |     |                 |           | 'GOVS' - Deuda Soberana   |
|   |                            |       |     |                 |           | 'SUNS' - Deuda Supranacional  |
|   |                            |       |     |                 |           | 'FIDE' - Deuda Entidades Financieras  |
|   |                            |       |     |                 |           | 'NFID' - Deuda Corporativa  |
|   |                            |       |     |                 |           | 'SEPR' - Productos Titulizados  |
|   |                            |       |     |                 |           | 'MEQU' - Principales índices RV   |
|   |                            |       |     |                 |           | 'OEQU' - Otros índices RV   |
|   |                            |       |     |                 |           | 'OTHR' - Otros Activos  |
|   |                            |       |     |                 |           | 'NA' - No aplica  |
| <b>CISINCODES /SecList/ SecL/ Undly</b> |                            |       |     |                 |           | (n times)   |
| →→311                                   | UnderlyingSymbol           | Sym   | N   |                 | String(5) | Símbolo del valor que actúa como subyacente   |
| →→309                                   | UnderlyingSecurityID       | ID    | N   |                 | String    | Código ISIN del valor subyacente  |
| →→305                                   | UnderlyingSecurityIDSource | Src   | N   | 4 = ISIN number | String    |   |
| →→318                                   | UnderlyingCurrency         | Ccy   | N   |                 | Currency  | Código de divisa en que se expresa el subyacente y el strike. Expresada según estándar ISO 4217 |

## 4 Información Pública

### 4.1 Datos Diarios de Valores para el cálculo de Garantías

| CISINDATA.sc  |  |
|---------------|--|
| Grupo         | Información Pública  |
| Descripción   | Precio de cierre y Parámetros para el cálculo de Garantías                             |
| Destinatarios | Todos los usuarios del Segmento de RV y RF de la ECC                                   |
| Privacidad    | Contiene datos públicos  |
| Timing        | Disponible a inicio y fin de sesión. Dinámico: pueden añadirse o modificarse registros |

| TAG                                    | NOMBRE               | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|--|----------------------|----------|-----|--|---------------|---|
| <b>CISINDATA / MktDataFull</b>         |                      |          |     |  |               | (n times)   |
| 715                                    | ClearingBusinessDate | BizDt    | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión  |
| 716*                                   | SettlSessID          | SetSesID | N   | ITD = Intradía<br>EOD = Fin de sesión              | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión   |
| <b>CISINDATA / MktDataFull / Hdr</b>   |                      |          |     |  |               |   |
| 35                                     | MsgType              | MsgTyp   | S   | W  | String        | Identifica el tipo de mensaje   |
| 49                                     | SenderComplD         | SID      | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"                                 |
| 56                                     | TargetComplD         | TID      | S   |  | String        | Contiene "????"   |
| 50                                     | SenderSubID          | SSub     | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC  |
| 52                                     | SendingTime          | Snt      | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero  |
| <b>CISINDATA /MktDataFull/ Instrmt</b> |                      |          |     |  |               |   |
| 55                                     | Symbol               | Sym      | N   | [N/A]<br>o código de valor                         | String(5)     |   |
| 48                                     | SecurityID           | ID       | N   |  | String(12)    | Código ISIN   |
| 22                                     | SecurityIDSource     | Src      | N   | 4 = ISIN number                                    | String        |   |
| 971                                    | NTPositionLimit      | NTPosLmt | N   |  | Int           | Número de títulos a partir del cual se deben aplicar Parámetros de Garantías por Grandes Posiciones |
| →224                                   | CouponPaymentDate    | CpnPmt   | N   |  | LocalMktDate  | Fecha del próximo cupón.  |

| TAG    | NOMBRE                  | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO          | DESCRIPCIÓN  |
|--------|-------------------------|----------|-----|-----------------|------------------|--|
|        |                         |          |     |                 |                  | Sólo aplica al segmento de RF.   |
| à874   | InterestAccru<br>alDate | IntrAcrl | N   |                 | LocalMktD<br>ate | Fecha de inicio de devengo de cupón. Presente si es diferente de la fecha de emisión. Sólo aplica al segmento de RF. |
| →1639* | MarginClass             | Clss     | N   |                 | String           | Grupo de compensación del activo<br>Sólo aplica al segmento de RF.   |

**CISINDATA /MktDataFull/ Instrmt/ Evnt**

|      |           |          |   |  |     |  |
|------|-----------|----------|---|--|-----|--|
|      |           |          |   | 300: Primer Margin Rate para Grandes Posiciones  |     |  |
|      |           |          |   | 301: Porcentaje a aplicar sobre el precio de cierre para determinar los precios para el cálculo del Variation Margin para posiciones compradoras y vendedoras (0 => usar precio de cierre) |     |  |
|      |           |          |   | 302: Segundo Margin Rate para grandes posiciones   |     |  |
| →865 | EventType | EventTyp | N | 303: Tercer Margin Rate para grandes posiciones  | Int |  |
|      |           |          |   | 304: Cuarto Margin Rate para grandes posiciones  |     |  |
|      |           |          |   | 305: Quinto Margin Rate para grandes posiciones  |     |  |
|      |           |          |   | 306: Sexto Margin Rate para grandes posiciones   |     |  |
|      |           |          |   | 307: Séptimo Margin Rate para grandes posiciones   |     |  |
|      |           |          |   | 308: Octavo Margin Rate para grandes posiciones  |     |  |

| TAG                                       | NOMBRE               | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS                         | FORMATO    | DESCRIPCIÓN  |
|---|----------------------|-------|-----|---|------------|--|
|   |                      |       |     | 320: Coeficiente de Indexación          |            |  |
| →868                                      | EventText            | Txt   | N   |   | String     | <p>Si EventType es 300, 302, 303...308 contiene los porcentajes a aplicar para el cálculo de Garantías de Grandes Posiciones</p> <p>Si EventType = 301, contiene el porcentaje a aplicar sobre el precio de cierre para determinar los precios de cálculo del Variation Margin para posiciones compradoras y vendedoras (0 =&gt; usar precio de cierre)</p> <p>Segmento de Renta Fija:<br/>Si EventType = 320, contiene el Coeficiente de Indexación</p> |
| <b>CISINDATA /MktDataFull/ Leg</b>        |                      |       |     |   |            | (n times)  |
| 600                                       | LegSymbol            | Sym   | N   | [N/A]<br>o código de valor              | String(5)  | Otro valor con el que se puede calcular una compensación de Garantías por haber correlación<br>Sólo aplica al segmento de RV.  |
| 602                                       | LegSecurityID        | ID    | N   |   | String(12) | Código ISIN<br>Sólo aplica al segmento de RV.  |
| 603                                       | LegSecurityID Source | Src   | N   | 4 = ISIN number                         | String     | Sólo aplica al segmento de RV.   |
| →1639*                                    | MarginClass          | Clss  | N   |   | String     | Grupo de compensación del activo.<br>Sólo aplica al segmento de RF.  |
| <b>CISINDATA /MktDataFull/ Leg/ Stip*</b> |                      |       |     |   |            | (n times)  |
| → 233*                                    | StipulationType      | Typ   | N   | SPRPRIO<br>SPRQTYM<br>SPRQTYO<br>SPRPER | String     |  |

| TAG                                 | NOMBRE           | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS  | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|-------------------------------------|------------------|-------|-----|------------------|---------|--|
| à 234*                              | StipulationValue | Val   | N   |                  | String  | <p>Si StipulationType = SPRPRIO, es el número de orden de prioridad de la compensación</p> <p>Si StipulationType = SPRQTYM, es el número de títulos del valor principal (del bloque Instrument).</p> <p>Igual a 1 para el segmento de Renta Fija</p> <p>Si StipulationType = SPRQTYO, es el número de títulos del valor compensable (del bloque InstrumentLeg).</p> <p>Igual a 1 para el segmento de Renta Fija</p> <p>Si StipulationType = SPRPER, es el porcentaje de compensación a aplicar</p> |
| <b>CISINDATA /MktDataFull/ Full</b> |                  |       |     |                  |         | (n times)  |
| →269                                | MDEntryType      | Typ   | S   | 5<br>G<br>R<br>U | Char    | <p>Tipo de información que contiene la presente entrada:</p> <p>5: Para el precio de cierre (de la sesión actual o de la sesión anterior).</p> <p>Igual al precio de referencia para el segmento de Renta Fija</p> <p>G: Para el intervalo de Garantías del Initial Margin</p> <p>R: Precio para el cálculo de Variation Margin en posiciones compradoras (calculado según el precio de cierre de la sesión actual y/o de la anterior).</p>  |

| TAG   | NOMBRE              | FIXML             | REQ | VALORES VÁLIDOS   | FORMATO              | DESCRIPCIÓN   |
|-------|---------------------|-------------------|-----|---|----------------------|---|
|       |                     |                   |     |   |                      | Igual al precio de referencia para el segmento de Renta Fija<br><br>U: Precio para el cálculo de Variation Margin en posiciones vendedoras (calculado según el precio de cierre de la sesión actual y/o de la anterior).<br><br>Igual al precio de referencia para el segmento de Renta Fija  |
| ®270  | MDEntryPx           | Px                | N   |   | Price                | Precio. Presente cuando MDEntryType es igual a 5, R o U   |
| →286  | OpenCloseSettleFlag | OpenClsSettleFlag | N   | 1 = Session Open / Close / Settlement entry<br>4 = Entry from previous business day | MultipleValue String | Cuando MDEntryType = 5, los Valores 1 y 4 se usan para indicar si el precio de cierre es el de la sesión anterior (valor 4) o el de la sesión actual (valor 1)<br><br>Cuando MDEntryType = R o U, los Valores 1 y 4 se usan para indicar si el precio según el que están calculados es el de cierre de la sesión anterior (valor 4) o de la sesión actual (valor 1) |
| →1026 | MDEntrySpotRate     | MDEntrySpotRt     | N   |   | float                | Presente cuando MDEntryType=G   |
| →158* | AccruedInterestRate | AcrIntRt          | N   |   | Porcentaje           | Cupón corrido porcentaje  |
| →159* | AccruedInterestAmt  | AcrdIntAmt        | N   |   | Amt                  | Importe del cupón corrido.<br>Sólo para activos de Renta Fija.  |

## 5 Datos Privados de Configuración

### 5.1 Cuentas de Posición

| CACCOUNTS.sc  |   |
|---------------|---|
| Grupo         | Datos Privados de Configuración   |
| Descripción   | Información de las Cuentas de Posición abiertas por un Miembro en el Segmento de RV y RF de la ECC y la relación con las Cuentas de Garantías y Colateral |
| Destinatarios | Miembro, Miembro Compensador  |
| Privacidad    | Contiene datos privados   |
| Timing        | Disponible a inicio y fin de sesión. Dinámico, pueden añadirse nuevos registros en cualquier momento. No se modifican o eliminan registros                |

| TAG                                      | NOMBRE                   | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN  |
|--|--------------------------|----------|-----|--|---------------|--|
| <b>CACCOUNTS / PtyDetListRpt</b>         |                          |          |     |  |               | (n times)  |
| 1510                                     | PartyDetailsListReportID | RptID    | S   |  | String        | Identificador único para cada mensaje Party Details List Report  |
| 715*                                     | ClearingBusinessDate     | BizDt    | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión   |
| 716*                                     | SettSessID               | SetSesID | N   | ITD = Intradía<br>EOD = Fin de sesión              | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión  |
| <b>CACCOUNTS / PtyDetListRpt / Hdr</b>   |                          |          |     |  |               |  |
| 35                                       | MsgType                  | MsgTyp   | S   | CG   | String        | Identifica el tipo de mensaje  |
| 49                                       | SenderCompID             | SID      | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"  |
| 56                                       | TargetCompID             | TID      | S   |  | String        | Contiene "????"  |
| 50                                       | SenderSubID              | SSub     | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC   |
| 52                                       | SendingTime              | Snt      | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero   |
| <b>CACCOUNTS /PtyDetListRpt/ PtyDetl</b> |                          |          |     |  |               | (n times)  |
| →1691                                    | PartyDetailID            | ID       | N   |  | String        | Si PartyDetailRole [1693] = 1, contiene el código de Miembro de la ECC al que pertenece la cuenta de posición<br><br>Si PartyDetailRole [1693] = 4, contiene el código de miembro que actúa como Compensador de la cuenta de posición de la que se está tratando<br><br>Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV |

| TAG  | NOMBRE                  | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS                 | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|--|-------------------------|-------|-----|---------------------------------|---------|---|
|  |                         |       |     |                                 |         | <p>Si PartyDetailRole [1693] = 30, contiene el código del Agente de Pagos para movimientos de efectivo</p> <p>Si PartyDetailRole [1693] = 38, contiene el código de la Cuenta de posición</p> <p>Si PartyDetailRole [1693] = 15, contiene el código de miembro al que pertenece la Cuenta de garantías</p> <p>Si PartyDetailRole [1693] = 100, contiene el código de la Cuenta de garantías</p> <p>Si PartyDetailRole [1693] = 49, contiene el código de miembro al que pertenece la Cuenta de colateral</p> <p>Si PartyDetailRole [1693] = 101, contiene el código de la Cuenta de colateral</p> |
| à1692  | PartyDetailID<br>Source | Src   | N   | D = Proprietary/<br>Custom code | char    |   |
|  |                         |       |     | 1 = Executing Firm              |         |   |
|  |                         |       |     | 4 = Clearing Firm               |         |   |
|  |                         |       |     | 10 = CSD Code                   |         |   |
|  |                         |       |     | 30 = Payment Agent              |         |   |
|  |                         |       |     | 38 = Position<br>Account        |         |   |
| →1693  | PartyDetailRole         | R     | N   | 15 = Margin Firm                | int     |   |
|  |                         |       |     | 100 = Margin<br>Account         |         |   |
|  |                         |       |     | 49 = Collateral Firm            |         |   |
|  |                         |       |     | 101 = Collateral<br>Account     |         |   |
| →1672  | PartyDetailStatus       | Stat  | N   | 0 = Activo<br>1 = Baja          | int     | Situación del party   |
| <b>CACCOUNTS /PtyDetlListRpt/ PtyDetl/ ReltdPtyDetl/ Sub</b> |                         |       |     |                                 |         | (n times)   |
| →→156<br>7   | RelatedPartyDetailSubID | ID    | N   |                                 | String  | Información del party. Contiene la información especificada en RelatedPartyDetailSubIDType [1568]   |

| TAG | NOMBRE | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|-----|--------|-------|-----|-----------------|---------|---|
|     |        |       |     |                 |         | <p>Para PartyDetailRole [1693] = 38 (Position Account) los Valores posibles son:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 26 contiene el tipo de Cuenta de posición (ver Tabla 9 del documento "Tablas de Codificación")</li> <li>• Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4110, contiene la Cuenta Residual. Este campo sólo es significativo cuando el registro se refiere a una Cuenta Diaria. Cuenta de posición a la que se moverán las Operaciones pendientes de asignar una vez finalizado el periodo de Asignación de Cuenta Diaria. Sólo aplica al Segmento de RV</li> </ul> <p>Para PartyDetailRole [1693] = 101: (Collateral Account) los Valores posibles son:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 2, contiene el tipo de persona (ver Tabla 8 del documento "Tablas de Codificación")</li> <li>• Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 5, contiene la Razón Social</li> <li>• Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 9, contiene el Nombre del Titular</li> <li>• Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 39, contiene la Nacionalidad del Titular según estándar ISO 3166</li> </ul> |

| TAG | NOMBRE | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|-----|--------|-------|-----|-----------------|---------|--|
|     |        |       |     |                 |         | <ul style="list-style-type: none"> <li>• Si<br/>RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4101, contiene el 1er Apellido del Titular</li> <li>• Si<br/>RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4102, contiene el 2º Apellido del Titular</li> <li>• Si<br/>RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4103, contiene el tipo de Identificación del Titular (ver Tabla 15 del documento "Tablas de Codificación")</li> <li>• Si<br/>RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4104, contiene la Identificación del Titular</li> <li>• Si<br/>RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 34 contiene la Población</li> <li>• Si<br/>RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 36, contiene el Código Postal</li> <li>• Si<br/>RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 37, contiene el Domicilio</li> <li>• Si<br/>RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 38, contiene el País de Residencia según estándar ISO 3166</li> <li>• Si<br/>RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4105, contiene el Modelo de Cuenta: 'A' (Agente), 'P' (Principal-to-Principal)</li> <li>• Si<br/>RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4107, contiene el LEI</li> </ul> |

| TAG    | NOMBRE                      | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS                  | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|--------|-----------------------------|-------|-----|----------------------------------|---------|--|
|        |                             |       |     |                                  |         | <ul style="list-style-type: none"> <li>• Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4108, contiene el Indicador de Clearing Indirecto</li> </ul> <p>Para PartyDetailRole [1693] = 10 (CSD Code) los Valores posibles son:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 90, contiene el código de la Entidad Participante</li> <li>• RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación</li> </ul> |
|        |                             |       |     | 26 = Clase de Cuenta de posición |         |  |
|        |                             |       |     | 4110 = Cuenta Residual           |         |  |
|        |                             |       |     | 2 = Tipo de Persona              |         |  |
|        |                             |       |     | 5 = Razón Social                 |         |  |
|        |                             |       |     | 9 = Nombre                       |         |  |
|        |                             |       |     | 39 = Nacionalidad                |         |  |
|        |                             |       |     | 4101 = 1er Apellido              |         |  |
|        |                             |       |     | 4102 = 2º Apellido               |         |  |
|        |                             |       |     | 4103 = Tipo Identificación       |         |  |
| à→1568 | RelatedPartyDetailSubIDType | Type  | N   | 4104 = Int Identificación        |         |  |
|        |                             |       |     | 34 = Población                   |         |  |
|        |                             |       |     | 36 = Código Postal               |         |  |
|        |                             |       |     | 37 = Domicilio                   |         |  |
|        |                             |       |     | 38 = País Residencia             |         |  |
|        |                             |       |     | 90 = Settlement Firm             |         |  |
|        |                             |       |     | 91 = Settlement Account          |         |  |
|        |                             |       |     | 4105 = Modelo de Cuenta          |         |  |
|        |                             |       |     | 4107 = LEI                       |         |  |

| TAG | NOMBRE | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS                        | FORMATO | DESCRIPCIÓN |
|-----|--------|-------|-----|--|---------|-------------|
|     |        |       |     | 4108 = Indicador de Clearing Indirecto |         |             |

## 5.2 Cuentas de Garantías

| CMARGINACCOUNTS.sc |  |
|--------------------|--|
| Grupo              | Datos Privados de Configuración  |
| Descripción        | Información de las Cuentas de Garantías abiertas por un Miembro en el Segmento de RV y RF de la ECC  |
| Destinatarios      | Miembro, Miembro Compensador   |
| Privacidad         | Contiene datos privados  |
| Timing             | Disponible a inicio y fin de sesión. Dinámico, pueden añadirse nuevos registros en cualquier momento. No se modifican o eliminan registros |

| TAG   | NOMBRE                   | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN  |
|---|--------------------------|----------|-----|--|---------------|--|
| <b>CMARGINACCOUNTS / PtyDetlListRpt</b>         |                          |          |     |  |               | (n times)  |
| 1510  | PartyDetailsListReportID | RptID    | S   |  | String        | Identificador único para cada mensaje Party Details List Report  |
| 715*  | ClearingBusinessDate     | BizDt    | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión   |
| 716*  | SettlSessID              | SetSesID | N   | ITD = Intradía<br>EOD = Fin de sesión              | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión  |
| <b>CMARGINACCOUNTS / PtyDetlListRpt / Hdr</b>   |                          |          |     |  |               |  |
| 35  | MsgType                  | MsgTyp   | S   | CG   | String        | Identifica el tipo de mensaje  |
| 49  | SenderComplD             | SID      | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"  |
| 56  | TargetComplD             | TID      | S   |  | String        | Contiene "????"  |
| 50  | SenderSubID              | SSub     | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC   |
| 52  | SendingTime              | Snt      | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero   |
| <b>CMARGINACCOUNTS /PtyDetlListRpt/ PtyDetl</b> |                          |          |     |  |               | (n times)  |
| →1691   | PartyDetailID            | ID       | N   |  | String        | Si PartyDetailRole [1693] = 4, contiene el código de miembro que actúa como Compensador de la cuenta de Garantías de la que se está tratando |

| TAG  | NOMBRE                      | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS  | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|--|-----------------------------|-------|-----|--|---------|---|
|  |                             |       |     |  |         | <p>Si PartyDetailRole [1693] = 15, contiene el código de miembro al que pertenece la Cuenta de garantías</p> <p>Si PartyDetailRole [1693] = 100, contiene el código de la Cuenta de garantías</p> <p>Si PartyDetailRole [1693] = 49, contiene el código de miembro al que pertenece la Cuenta de colateral</p> <p>Si PartyDetailRole [1693] = 101, contiene el código de la Cuenta de colateral</p> |
| à1692  | PartyDetailID Source        | Src   | N   | D = Proprietary/<br>Custom code<br>4 = Clearing Firm   | char    |   |
| →1693  | PartyDetailRole             | R     | N   | 15 = Margin Firm<br>100 = Margin Account<br>49 = Collateral Firm<br>101 = Collateral Account | int     |   |
| →1672  | PartyDetailStatus           | Stat  | N   | 0 = Activo<br>1 = Baja   | int     | Situación del party   |
| <b>CMARGINACCOUNTS /PtyDetlListRpt/ PtyDetl/ ReltdPtyDetl/ Sub</b> |                             |       |     |  |         | (n times)   |
|  |                             |       |     |  |         | <p>Información del party. Contiene la información especificada en RelatedPartyDetailSubIDType [1568]</p> <p>Para PartyDetailRole [1693] = 100 (Margin Account) los Valores posibles son:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4109, Tipo de Garantías que cubre la cuenta</li> </ul>  |
| →→1567   | RelatedPartyDetailSubID     | ID    | N   |  | String  |   |
| →→1568   | RelatedPartyDetailSubIDType | Typ   | N   | 4109=Tipo de Garantías que cubre la cuenta   | Int     |   |

### 5.3 Cuentas de Colateral

| CCOLLATERALACCOUNTS.sc |  |
|------------------------|--|
| Grupo                  | Datos Privados de Configuración  |
| Descripción            | Información de las Cuentas de Colateral abiertas por un Miembro en el Segmento de RV y RF de la ECC  |
| Destinatarios          | Miembro, Miembro Compensador   |
| Privacidad             | Contiene datos privados  |
| Timing                 | Disponible a inicio y fin de sesión. Dinámico, pueden añadirse nuevos registros en cualquier momento. No se modifican o eliminan registros |

| TAG   | NOMBRE                   | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN  |
|---|--------------------------|----------|-----|--|---------------|--|
| <b>CCOLLATERALACCOUNTS / PtyDetListRpt</b>          |                          |          |     |  |               | (n times)  |
| 1510  | PartyDetailsListReportID | RptID    | S   |  | String        | Identificador único para cada mensaje Party Details List Report  |
| 715*  | ClearingBusinessDate     | BizDt    | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión   |
| 716*  | SettlSessID              | SetSesID | N   | ITD = Intradía<br>EOD = Fin de sesión              | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión  |
| <b>CCOLLATERALACCOUNTS / PtyDetListRpt / Hdr</b>    |                          |          |     |  |               |  |
| 35  | MsgType                  | MsgTyp   | S   | CG   | String        | Identifica el tipo de mensaje<br>Identificador de la entidad que envía el mensaje  |
| 49  | SenderComplD             | SID      | S   |  | String        | Contiene "BMCL"  |
| 56  | TargetComplD             | TID      | S   |  | String        | Contiene "????"  |
| 50  | SenderSubID              | SSub     | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC   |
| 52  | SendingTime              | Snt      | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero   |
| <b>CCOLLATERALACCOUNTS / PtyDetListRpt/ PtyDetl</b> |                          |          |     |  |               | (n times)  |
| →1691   | PartyDetailID            | ID       | N   |  | String        | Si PartyDetailRole [1693] = 4, contiene el código de miembro que actúa como Compensador de la cuenta de Colateral de la que se está tratando<br><br>Si PartyDetailRole [1693] = 30, contiene el código del Agente de Pagos para movimientos de efectivo<br><br>Si PartyDetailRole [1693] = 49, contiene el código de miembro al que pertenece la Cuenta de colateral |

| TAG  | NOMBRE                  | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS  | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|--|-------------------------|-------|-----|--|---------|--|
|  |                         |       |     |  |         | Si PartyDetailRole [1693] = 101, contiene el código de la Cuenta de colateral  |
| à1692  | PartyDetailID Source    | Src   | N   | D = Proprietary/<br>Custom code<br>4 = Clearing Firm                   | char    |  |
| →1693  | PartyDetailRole         | R     | N   | 30 = Payment Agent<br>49 = Collateral Firm<br>101 = Collateral Account | int     |  |
| →1672  | PartyDetailStatus       | Stat  | N   | 0 = Activo<br>1 = Baja   | int     | Situación del party  |
| <b>CCOLLATERALACCOUNTS /PtyDetlListRpt/ PtyDetl/ ReltdPtyDetl/ Sub</b> |                         |       |     |  |         | (n times)  |
|  |                         |       |     |  |         | Información del party. Contiene la información especificada en RelatedPartyDetailSubIDType [1568]<br>Para PartyDetailRole [1693] = 101: (Collateral Account) los Valores posibles son:   |
| →→1567   | RelatedPartyDetailSubID | ID    | N   |  | String  | <ul style="list-style-type: none"> <li>• Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4105, contiene el Modelo de Cuenta: 'A' (Agente), 'P' (Principal-to-Principal)</li> <li>• Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4108, contiene el Indicador de Clearing Indirecto</li> <li>• Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4111, contiene el Grupo de movimientos de efectivo asociados al Agente de Pagos</li> <li>• Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4112, contiene el Tipo ajuste Efectivo</li> </ul> |

| TAG    | NOMBRE                      | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS  | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|--------|-----------------------------|-------|-----|--|---------|---|
|        |                             |       |     |  |         | <ul style="list-style-type: none"> <li>• Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4113, contiene el Indicador de reinversión</li> <li>• Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4114, contiene la Referencia estructura de cuenta</li> <li>• Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4115, contiene el Tipo de estructura. Ver tabla 17 Tipos de Estructura de Cuenta</li> </ul> |
|        |                             |       |     | 4105 = Modelo de Cuenta  |         |   |
|        |                             |       |     | 4108 = Indicador de Clearing Indirecto                               |         |   |
|        |                             |       |     | 4111 = Grupo de movimientos de efectivo asociados al Agente de Pagos |         |   |
| à→1568 | RelatedPartyDetailSubIDType | Typ   | N   | 4112 = Tipo ajuste Efectivo  | Int     |   |
|        |                             |       |     | 4113 = Indicador de reinversión                                      |         |   |
|        |                             |       |     | 4114 = Referencia estructura de cuenta                               |         |   |
|        |                             |       |     | 4115 = Tipo de estructura  |         |   |

#### 5.4 Referencias de Asignación Externa (Miembro Origen)

| CGIVEOUTREF.sc |  |
|----------------|--|
| Grupo          | Datos Privados de Configuración  |
| Descripción    | Referencias de Asignación Externa definidas en el sistema por el Miembro Origen del segmento de RV |
| Destinatarios  | Miembro Origen   |
| Privacidad     | Contiene datos privados  |
| Timing         | Disponible a inicio y fin de sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros |

| TAG   | NOMBRE               | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|---|----------------------|----------|-----|--|---------------|---|
| <b>CGIVEOUTREF / RgstInstrctns</b>          |                      |          |     |  |               | (n times)   |
| 513   | RegistID             | ID       | S   |  | String (30)   | Identificador único para cada mensaje Registration Instructions                                       |
| 514   | RegistTransType      | TransTyp | S   | 0 = New  | Char          |   |
| 715   | ClearingBusinessDate | BizDt    | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión  |
| <b>716*</b>                                 | SettlSessID          | SetSesID | N   | ITD = Intradía<br>EOD = Fin de sesión              | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión   |
| <b>CGIVEOUTREF / RgstInstrctns / Hdr</b>    |                      |          |     |  |               |   |
| 35  | MsgType              | MsgTyp   | S   | o  | String        | Identifica el tipo de mensaje   |
| 49  | SenderComplID        | SID      | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"                                   |
| 56  | TargetComplID        | TID      | S   |  | String        | Contiene "???"  |
| 50  | SenderSubID          | SSub     | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC  |
| 52  | SendingTime          | Snt      | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero  |
| <b>CGIVEOUTREF /RgstInstrctns/ Pty</b>      |                      |          |     |  |               |   |
| → 448                                       | PartyID              | ID       | S*  |  | String        | Si PartyRole[452]=96, contiene el Miembro Destino de la Asignación                                    |
| → 447                                       | PartyIDSource        | Src      | S   | D = Proprietary / Custom code                      | String        |   |
| → 452                                       | PartyRole            | R        | S   | 96= Take-up Trading Firm                           | Int           | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID  |
| <b>CGIVEOUTREF /RgstInstrctns/ Pty/ Sub</b> |                      |          |     |  |               | (1 time)  |
| →→ 523                                      | PartySubID           | ID       | S*  | GOR = Give-out references                          | String        |   |
| →→ 803                                      | PartySubIDType       | Typ      | S   |  | Int           | El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta, está presente por requerimiento del estándar |
| <b>CGIVEOUTREF /RgstInstrctns/ Alloc*</b>   |                      |          |     |  |               |   |
| →1729*                                      | FirmMnemonic         | FirmMnem | N   |  | String(10)    | Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm)                      |
| →161*                                       | AllocText            | Txt      | N   |  | String(18)    | Referencia de Asignación Externa  |

| TAG    | NOMBRE         | FIXML   | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO    | DESCRIPCIÓN   |
|--------|----------------|---------|-----|-----------------|------------|---|
| à1732* | Firm AllocText | FirmTxt | N   |                 | String(18) | Referencia de Asignación definida por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm) para uso interno |

## 5.5 Referencias de aceptación de Asignación Externa (Miembro Destino)

| CGIVEINREF.sc |   |
|---------------|---|
| Grupo         | Datos Privados de Configuración   |
| Descripción   | Referencias de Asignación Externa definidas en el sistema por el Miembro Destino del segmento de RV |
| Destinatarios | Miembro Destino   |
| Privacidad    | Contiene datos privados   |
| Timing        | Disponible a inicio y fin de sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros. |

| TAG                                     | NOMBRE               | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|---|----------------------|----------|-----|--|---------------|---|
| <b>CGIVEINREF / RgstInstrctns</b>       |                      |          |     |  | (n times)     |   |
| 513                                     | RegistID             | ID       | S   |  | String (30)   | Identificador único para cada mensaje Registration Instructions     |
| 514                                     | RegistTrans Type     | TransTyp | S   | 0 = New  | Char          |   |
| 715                                     | ClearingBusinessDate | BizDt    | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión  |
| 716*                                    | SettlSessID          | SetSesID | N   | ITD = Intradía<br>EOD = Fin de sesión              | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión               |
| <b>CGIVEINREF / RgstInstrctns / Hdr</b> |                      |          |     |  |               |   |
| 35                                      | MsgType              | MsgTyp   | S   | o  | String        | Identifica el tipo de mensaje                                       |
| 49                                      | SenderCompID         | SID      | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL" |
| 56                                      | TargetCompID         | TID      | S   |  | String        | Contiene "????"   |
| 50                                      | SenderSubID          | SSub     | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC                            |
| 52                                      | SendingTime          | Snt      | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero                                      |
| <b>CGIVEINREF /RgstInstrctns/ Pty</b>   |                      |          |     |  |               | (n times)   |
| →<br>448                                | PartyID              | ID       | S*  |  | String        | Si PartyRole[452]=38,   |

| TAG  | NOMBRE             | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                       | FORMATO    | DESCRIPCIÓN  |
|--|--------------------|----------|-----|---|------------|--|
|  |                    |          |     |   |            | contiene la Cuenta de Posición Destino en la que debe registrarse la Asignación en caso de ser aceptada<br><br>Si PartyRole[452]=95, contiene el Miembro Origen de la Asignación |
| à 447                                      | PartyIDSour<br>ce  | Src      | S   | D = Proprietary /<br>Custom code                      | String     |  |
| → 452                                      | PartyRole          | R        | S   | 38 = Position Account<br>95 = Give-up Trading<br>Firm | Int        | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID   |
| <b>CGIVEINREF /RgstInstrctns/ Pty/ Sub</b> |                    |          |     |   |            | (1 time)   |
| →→<br>523                                  | PartySubID         | ID       | S*  | GIR = Give-in<br>references                           | String     |  |
| →→ 803                                     | PartySubIDT<br>ype | Typ      | S   |   | Int        | El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta, está presente por requerimiento del estándar  |
| <b>CGIVEINREF /RgstInstrctns/ Alloc*</b>   |                    |          |     |   |            | (1 time)   |
| →1729*                                     | FirmMnemo<br>nic   | FirmMnem | N   |   | String(10) | Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Destino (Take-up Trading Firm)  |
| →161*                                      | AllocText          | Txt      | N   |   | String(18) | Referencia de Asignación Externa   |

## 5.6 Filtros de aceptación de Asignación Externa (Miembro Destino)

| <b>CGIVEINFILT.sc</b> |   |
|-----------------------|---|
| Grupo                 | Datos Privados de Configuración   |
| Descripción           | Filtros de aceptación de Asignación Externa establecidos por el Miembro Destino para la aceptación automática de Operaciones del segmento de RV |
| Destinatarios         | Miembro Destino   |
| Privacidad            | Contiene datos privados   |
| Timing                | Disponible a inicio y fin de sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros.   |

| TAG                                | NOMBRE   | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO     | DESCRIPCIÓN   |
|------------------------------------|----------|-------|-----|-----------------|-------------|---|
| <b>CGIVEINFILT / RgstInstrctns</b> |          |       |     |                 | (n times)   |   |
| 513                                | RegistID | ID    | S   |                 | String (30) | Identificador único para cada mensaje Registration Instructions |

| TAG   | NOMBRE               | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN  |
|---|----------------------|----------|-----|--|---------------|--|
| 514   | RegistTransType      | TransTyp | S   | 0 = New  | Char          |  |
| 715   | ClearingBusinessDate | BizDt    | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión   |
| 716*  | SettlSessID          | SetSesID | N   | ITD = Intradía<br>EOD = Fin de sesión              | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión  |
| <b>CGIVEINFILT / RgstInstrctns / Hdr</b>    |                      |          |     |  |               |  |
| 35  | MsgType              | MsgTyp   | S   | o  | String        | Identifica el tipo de mensaje  |
| 49  | SenderComplID        | SID      | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"  |
| 56  | TargetComplID        | TID      | S   |  | String        | Contiene "????"  |
| 50  | SenderSubID          | SSub     | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC   |
| 52  | SendingTime          | Snt      | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero   |
| <b>CGIVEINFILT /RgstInstrctns/ Pty</b>      |                      |          |     |  |               |  |
|   |                      |          |     |  |               | (n times)<br>Si PartyRole[452]=95, contiene el Miembro Origen de la Asignación<br>El uso del carácter comodín "?" está permitido sólo si se utiliza en todas las posiciones tanto en el Miembro Origen de la Asignación como en la Referencia de Asignación AllocText [161] (pero no en ambos campos a la vez) |
| → 448                                       | PartyID              | ID       | S*  |  | String        |  |
| → 447                                       | PartyIDSource        | Src      | S   | D = Proprietary / Custom code                      | String        |  |
| → 452                                       | PartyRole            | R        | S   | 95 = Give-up Trading Firm                          | Int           | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID   |
| <b>CGIVEINFILT /RgstInstrctns/ Pty/ Sub</b> |                      |          |     |  |               |  |
| →→ 523                                      | PartySubID           | ID       | S*  | GIF = Give-in filters                              | String        | (1 time)   |
| →→ 803                                      | PartySubIDType       | Typ      | S   |  | Int           | El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta, está presente por requerimiento del estándar  |
| <b>CGIVEINFILT /RgstInstrctns/ Stip*</b>    |                      |          |     |  |               |  |
|   |                      |          |     |  |               | (n times)  |

| TAG                                | NOMBRE           | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS                                      | FORMATO    | DESCRIPCIÓN  |
|------------------------------------|------------------|-------|-----|--|------------|--|
| à 233*                             | StipulationType  | Typ   | N   | TAL<br>SAL   | String     | Si StipulationType = TAL,<br>es el importe efectivo máximo para una Asignación que será aceptado automáticamente para ese Miembro Origen de la Asignación y Referencia de Asignación<br><br>Si StipulationType = SAL,<br>es el importe efectivo acumulado máximo por sesión de asignaciones que serán aceptados automáticamente para ese Miembro Origen y Referencia de Asignación |
| → 234*                             | StipulationValue | Val   | N   | [N/A]<br>o un valor numérico<br>>=0 and <= 999999999 | String     | Se informará a [N/A] cuando se desee que el Filtro sea totalmente abierto, esto es, no haya un importe efectivo máximo específico a comprobar  |
| CGIVEINFILT /RgstInstrctns/ Alloc* |                  |       |     |  |            | (1 time)<br>Referencia de Asignación Externa<br><br>El uso del carácter comodín "?" está permitido sólo si se utiliza en todas las posiciones tanto en el Miembro Origen de la Asignación como en la Referencia de Asignación AllocText [161] (pero no en ambos campos a la vez)   |
| → 161*                             | AllocText        | Txt   | N   |  | String(18) |  |

## 5.7 Filtros de Aceptación de Asignación Externa (Compensador de Miembro Destino)

| CGIVEINFILTCLM.sc |   |
|-------------------|---|
| Grupo             | Datos Privados de Configuración   |
| Descripción       | Filtros de aceptación de Asignación Externa establecidos por el Miembro Compensador del Miembro Destino para la aceptación automática de Operaciones del segmento de RV |

| CGIVEINFILTCLM.sc |  |
|-------------------|--|
| Destinatarios     | Miembro Compensador  |
| Privacidad        | Contiene datos privados  |
| Timing            | Disponible a inicio y fin de sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros |

| TAG  | NOMBRE               | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|--|----------------------|----------|-----|--|---------------|---|
| <b>CGIVEINFILTCLM / RgstInstrctns</b>          |                      |          |     |  | (n times)     |   |
| 513  | RegistID             | ID       | S   |  | String (30)   | Identificador único para cada mensaje Registration Instructions   |
| 514  | RegistTransType      | TransTyp | S   | 0 = New  | Char          |   |
| 715  | ClearingBusinessDate | BizDt    | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión  |
| 716*   | SettlSessID          | SetSesID | N   | ITD = Intradía<br>EOD = Fin de sesión              | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión   |
| <b>CGIVEINFILTCLM / RgstInstrctns / Hdr</b>    |                      |          |     |  |               |   |
| 35   | MsgType              | MsgTyp   | S   | o  | String        | Identifica el tipo de mensaje   |
| 49   | SenderComplID        | SID      | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"   |
| 56   | TargetComplID        | TID      | S   |  | String        | Contiene "????"   |
| 50   | SenderSubID          | SSub     | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC  |
| 52   | SendingTime          | Snt      | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero  |
| <b>CGIVEINFILTCLM /RgstInstrctns/ Pty</b>      |                      |          |     |  |               |   |
| → 448  | PartyID              | ID       | S*  |  | String        |   |
| → 447  | PartyIDSource        | Src      | S   | D = Proprietary / Custom code                      | String        | Si PartyRole[452] = 38, contiene la Cuenta de Posición Destino de la Asignación<br>Si PartyRole[452] = 96, contiene el Código de Miembro Destino de la Asignación |
| → 452  | PartyRole            | R        | S   | 38 = Position Account<br>96= Take-up Trading Firm  | Int           | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID  |
| <b>CGIVEINFILTCLM /RgstInstrctns/ Pty/ Sub</b> |                      |          |     |  |               | (1 time)  |

| TAG   | NOMBRE           | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS                                      | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|---|------------------|-------|-----|--|---------|--|
| →→<br>523                                   | PartySubID       | ID    | S*  | GIFCM = Give-in<br>filters of clearing<br>member     | String  |  |
| →→ 803                                      | PartySubIDType   | Typ   | S   |  | Int     | El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta, está presente por requerimiento del estándar  |
| <b>CGIVEINFILTCLM /RgstInstrctns/ Stip*</b> |                  |       |     |  |         | (n times)  |
| →<br>233*                                   | StipulationType  | Typ   | N   | TAL<br>SAL   | String  | Si StipulationType = TAL, es el importe efectivo máximo para una Asignación para que sea aceptada automáticamente para ese Miembro Destino   |
| → 234*                                      | StipulationValue | Val   | N   | [N/A]<br>o un valor numérico<br>>=0 and <= 999999999 | String  | Si StipulationType = SAL, es el importe efectivo acumulado máximo por sesión de asignaciones que serán aceptados automáticamente para ese Miembro Destino<br><br>Se informará a [N/A] cuando se desee que el Filtro sea totalmente abierto, esto es, no haya un importe efectivo máximo específico a comprobar |

## 5.8 Módulo de Parametrización por Miembro Origen

| CPARMODULE.sc |   |
|---------------|---|
| Grupo         | Datos Privados de Configuración   |
| Descripción   | Datos del Módulo de Parametrización configurados por Miembro Origen del segmento de RV              |
| Destinatarios | Miembro Origen  |
| Privacidad    | Contiene datos privados   |
| Timing        | Disponible a inicio y fin de sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros. |

| TAG                                     | NOMBRE               | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN  |
|---|----------------------|----------|-----|--|---------------|--|
| <b>CPARMODULE / RgstInstrctns</b>       |                      |          |     |  | (n times)     |  |
| 513                                     | RegistID             | ID       | S   |  | String (30)   | Identificador único para cada mensaje Registration Instructions  |
| 514                                     | RegistTransType      | TransTyp | S   | 0 = New  | Char          |  |
| 1                                       | Account              | Acct     | N   |  | String        | Código de cliente introducido en la orden  |
| 493                                     | RegistAcctType       | AcctTyp  | S*  | 1 - AOTC<br>3 - MTCH<br>4 - DEAL                   | String        | Indicador de capacidad   |
| 1300*                                   | MarketSegmentID      | MktSegID | N   | Ver Tabla 5 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Código de Segmento de Negociación<br>Si no está informado, significa "para todos los Segmentos de Negociación"   |
| 58*                                     | Text                 | Txt      | N   |  | String        | Referencia externa: Referencia de la orden asignada por el usuario   |
| 715                                     | ClearingBusinessDate | BizDt    | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión   |
| 716*                                    | SettlSessID          | SetSesID | N   | ITD = Intradía<br>EOD = Fin de sesión              | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión  |
| <b>CPARMODULE / RgstInstrctns / Hdr</b> |                      |          |     |  |               |  |
| 35                                      | MsgType              | MsgTyp   | S   | o  | String        | Identifica el tipo de mensaje  |
| 49                                      | SenderCompID         | SID      | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"  |
| 56                                      | TargetCompID         | TID      | S   |  | String        | Contiene "????"  |
| 50                                      | SenderSubID          | SSub     | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC   |
| 52                                      | SendingTime          | Snt      | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero   |
| <b>CPARMODULE /RgstInstrctns / Pty</b>  |                      |          |     |  | (n times)     |  |
| →<br>448                                | PartyID              | ID       | S*  |  | String        | Si PartyRole[452]=11, contiene el código del Usuario Origen de la plataforma<br>Si PartyRole[452]=13, contiene el código del Miembro Origen en la plataforma |

| TAG  | NOMBRE           | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS  | FORMATO    | DESCRIPCIÓN  |
|--|------------------|----------|-----|--|------------|--|
|  |                  |          |     |  |            | Si Usuario Origen (PartyRole[452]=11) no está informado, significa "para todos los usuarios del Miembro"<br><br>Si PartyRole[452]=38, contiene la Cuenta de Posición |
| à 447                                      | PartyIDSource    | Src      | S   | D = Proprietary / Custom code                            | String     |  |
|  |                  |          |     | 11 = Order Origination Trader                            |            |  |
| → 452                                      | PartyRole        | R        | S   | 13 = Order Origination Firm<br><br>38 = Position Account | Int        | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID   |
| <b>CPARMODULE /RgstInstrctns/ Pty/ Sub</b> |                  |          |     |  |            | (1 time)   |
| →→ 523                                     | PartySubID       | ID       | S*  | PAM = Parameter Module                                   | String     |  |
| →→ 803                                     | PartySubIDType   | Typ      | S   |  | Int        | El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta, está presente por requerimiento del estándar  |
| <b>CPARMODULE /RgstInstrctns/ Alloc*</b>   |                  |          |     |  |            | (1 time)   |
| →1729*                                     | FirmMnemonic     | FirmMnem | N   |  | String(10) | Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm)   |
| <b>CPARMODULE /RgstInstrctns/ Stip*</b>    |                  |          |     |  |            | (n times)  |
| → 233*                                     | StipulationType  | Typ      | N   | PL   | String     |  |
| → 234*                                     | StipulationValue | Val      | N   |  | String     | Código de Plataforma<br><br>Si no está informado, significa "para todas las Plataformas"   |

## 6 Información de Operaciones

### 6.1 Operaciones de la sesión procedentes de plataformas y movimientos entre Miembros/Cuentas

| CTRADES.sc    |  |
|---------------|--|
| Grupo         | Información de Operaciones   |
| Descripción   | Información de todas las Operaciones registradas en la sesión procedentes de las plataformas y los movimientos de Operaciones entre Miembros/Cuentas de Posición del segmento de RV y RF |
| Destinatarios | Miembro, Miembro Compensador, Entidad Participante   |
| Privacidad    | Contiene datos privados  |
| Timing        | Disponible a fin de sesión.  |

| TAG                         | NOMBRE           | FIXML     | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|-----------------------------|------------------|-----------|-----|--|---------|---|
| <b>CTRADES / TrdCaptRpt</b> |                  |           |     |  |         | (n times)   |
| 1003                        | TradeID          | TrdID     | N   |  | String  | Identificador de registro en la ECC. Este campo siempre está presente en el mensaje   |
| 1040                        | SecondaryTradeID | TrdID2    | N   |  | String  | Contiene el identificador de registro en la ECC de la Operación inicial   |
| 828                         | TrdType          | TrdTyp    | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | Int     | Tipo de Operación FIX. Este valor es usado conjuntamente con TrdSubType [829]   |
| 829                         | TrdSubType       | TrdSubTyp | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | Int     | Este valor es usado conjuntamente con TrdType [828]   |
| 1126                        | OrigTradeID      | OrigTrdID | N   |  | String  | Contiene el identificador de registro de la ECC de la Operación previa  |
| 150                         | ExecType         | ExecTyp   | N   | F = Trade  | Char    | Referencia original primaria de la Operación.   |
| 820                         | TradeLinkID      | LinkID    | N   |  | String  | Para el segmento de RF: Se informa de la referencia común de las operaciones que vincula la ida y la vuelta del repo.       |
| 880                         | TrdMatchID       | MtchID    | N   |  | String  | Número de registro de negociación de la Operación inicial.<br>Coincide con el campo TrdMatchID del mensaje Execution Report |

| TAG                                 | NOMBRE               | FIXML       | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|-------------------------------------|----------------------|-------------|-----|--|---------------|---|
|                                     |                      |             |     |  |               | Este campo estará vacío para activos de RF.                         |
| 17                                  | ExecID               | ExecID      | N   |  | String        | Referencia original secundaria de la Operación asignada por la ECC  |
| 1300                                | MarketSegmentID      | MktSegID    | N   | Ver Tabla 5 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Código de Segmento de Negociación                                   |
| 32                                  | LastQty              | LastQty     | S   | >= 0, sin decimales                                | Qty           | Volumen/Nominal de la Operación                                     |
| 151*                                | LeavesQty            | LeavesQty   | N   |  | Qty           | Volumen/Nominal vivo de la Operación                                |
| 31                                  | LastPx               | LastPx      | S   |  | Price         | Precio de la Operación. Para RF se mostrará en %                    |
| 15                                  | Currency             | Ccy         | N   |  | Currency      | Código de divisa. Expresada según estándar ISO 4217                 |
| 75                                  | TradeDate            | TrdDt       | N   |  | LocalMktDate  | Fecha de Contratación   |
| 60                                  | TransactTime         | TxnTm       | N   |  | UTCTimestamp  | Fecha y hora, en formato UTC, en que se realizó la transacción      |
| 64                                  | SettlDate            | SettlDt     | N   |  | LocalMktDate  | Fecha Teórica de Liquidación  |
| 381                                 | GrossTradeAmt        | GrossTrdAmt | N   |  | Amt           | Importe Efectivo de la Operación                                    |
| 5681*                               | ExchangeTradeType    | ExchTrdTyp  | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Tipo de Operación de la ECC   |
| 715                                 | ClearingBusinessDate | BizDt       | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión  |
| 716                                 | SettlSessID          | SetSesID    | N   | ITD = Intradía<br>EOD = Fin de sesión              | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión               |
| <b>CTRADES / TrdCaptRpt / Hdr</b>   |                      |             |     |  |               |   |
| 35                                  | MsgType              | MsgTyp      | S   | AE   | String        | Identifica el tipo de mensaje                                       |
| 49                                  | SenderCompID         | SID         | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL" |
| 56                                  | TargetCompID         | TID         | S   |  | String        | Contiene "????"   |
| 50                                  | SenderSubID          | SSub        | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC                            |
| 52                                  | SendingTime          | Snt         | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero                                      |
| <b>CTRADES /TrdCaptRpt/ Instrmt</b> |                      |             |     |  |               |   |
| 55                                  | Symbol               | Sym         | N   | [N/A]  | String(5)     |   |

| TAG                                      | NOMBRE                  | FIXML   | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO          | DESCRIPCIÓN  |
|--|-------------------------|---------|-----|--|------------------|--|
|  |                         |         |     | o código de valor                                  |                  |  |
| 48                                       | SecurityID              | ID      | N   |  | String(12)       | Código ISIN  |
| 22                                       | SecurityIDSou<br>rce    | Src     | N   | 4 = ISIN number                                    | String           |  |
| <b>CTRADES /TrdCaptRpt/ Amt</b>          |                         |         |     |  |                  | (n times)  |
| →<br>708                                 | PosAmt                  | Amt     | N   |  | Amt              |  |
| →<br>1585                                | PosAmtReaso<br>n        | Rsn     | N   | 1000 = Importe<br>Efectivo vivo de la<br>Operación | Int              |  |
| <b>CTRADES /TrdCaptRpt/ TrdRegTS</b>     |                         |         |     |  |                  | (1 time)   |
| →<br>769                                 | TrdRegTimest<br>amp     | TS      | N   |  | UTCTimesta<br>mp | Día y hora de la Operación<br>inicial en el Sistema de<br>Negociación  |
| →<br>770                                 | TrdRegTimest<br>ampType | Typ     | N   | 3 = Time Out                                       | Int              |  |
| <b>CTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide</b>      |                         |         |     |  |                  | (1 time)   |
|  |                         |         |     |  |                  | Siempre 1 ya que sólo se<br>incluye la parte<br>compradora o vendedora,<br>según corresponda al<br>destinatario del mensaje                      |
| → 54                                     | Side                    | Side    | S   | 1 = Buy<br>2 = Sell                                | Char             | Signo de la Operación  |
| → 1                                      | Account                 | Acct    | N   |  | String           | Código de cliente<br>introducido en la orden.<br>Sólo aplica al Segmento de<br>RV  |
| → 581                                    | AccountType             | AcctTyp | N   | 1 - AOTC<br>3 - MTCH<br>4 - DEAL                   | Int              | Indicador de capacidad<br>Sólo aplica al Segmento de<br>RV   |
| → 77                                     | PositionEffect          | PosEfct | N   | "O" = Open<br>"C" = Close                          |                  | Indica si la Operación abre<br>o cierra posición   |
|  |                         |         |     |  |                  | Para el segmento de RV:<br><br>Si es una Operación<br>procedente de una orden,<br>contiene la Referencia<br>asignada en la orden                 |
| → 58                                     | Text                    | Txt     | N   |  | String           | Si es una Asignación de<br>Cuenta Diaria o un<br>traspaso, contiene la<br>Referencia de la<br>Operación previa. Solo<br>aplica al segmento de RV |
| <b>CTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ Pty</b> |                         |         |     |  |                  | (n times)  |

| TAG       | NOMBRE        | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|-----------|---------------|-------|-----|--|---------|--|
| →→<br>448 | PartyID       | ID    | N   |  | String  | <p>Si PartyRole[452]=1, contiene el código de Miembro de la ECC</p> <p>Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador</p> <p>Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV</p> <p>Si PartyRole[452]=11, contiene el código del usuario de la plataforma</p> <p>Si PartyRole[452]=13, contiene el código del Miembro de la plataforma</p> <p>Si PartyRole[452]=16, contiene el código de plataforma de negociación</p> <p>Si PartyRole[452]=38, contiene el código de la Cuenta de Posición asociada con la Operación</p> <p>Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante</p> <p>Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación</p> |
| →→<br>447 | PartyIDSource | Src   | N   | D = Proprietary/<br>Custom code                    | Char    |  |
|           |               |       |     | 1 = Executing Firm                                 |         |  |
|           |               |       |     | 4 = Clearing Firm                                  |         |  |
|           |               |       |     | 10 = CSD Code                                      |         |  |
|           |               |       |     | 11 = Order Origination<br>Trader                   |         |  |
| →→<br>452 | PartyRole     | R     | N   | 13 = Order Origination<br>Firm                     | Int     | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID   |
|           |               |       |     | 16 = Executing System<br>(Código de<br>plataforma) |         |  |
|           |               |       |     | 38 = Position Account                              |         |  |
|           |               |       |     | 90 = Settlement Firm                               |         |  |

| TAG                                       | NOMBRE           | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS  | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|---|------------------|-------|-----|--|---------|---|
|   |                  |       |     | 91 = Settlement account  |         |   |
| <b>CTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ Stip</b> |                  |       |     |  |         | (n times)   |
| →→ 233                                    | StipulationType  | Typ   | N   | TOPEM<br>QTYM<br>AMTM<br>UTI<br>SFTTYPE<br>FINRATE<br>UTIPRIOR | String  | <p>Para Operaciones de compraventa:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Si StipulationType [233] = TOPEM, contiene el código de la ejecución en la plataforma de negociación</li> <li>• Si StipulationType [233] = QTYM, contiene el volumen / nominal de la ejecución en la plataforma de negociación</li> <li>• Si StipulationType [233] = AMTM, contiene el importe efectivo de la ejecución en la plataforma de negociación</li> </ul> |
| →→ 234                                    | StipulationValue | Val   | N   |  | String  | <p>Sólo para RF:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Si StipulationType [233] = UTI, contiene el UTI de la operación</li> <li>• Si StipulationType [233] = SFTTYPE, contiene el Tipo de SFT:<br/>B: Simultánea<br/>R: Repo<br/>N: No aplica</li> <li>• Si StipulationType [233] = FINRATE, contiene el tipo de interés fijo.</li> <li>• Si StipulationType [233] = UTIPRIOR, contiene el UTI PRIOR de la operación.</li> </ul>             |

| TAG  | NOMBRE           | FIXML        | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO      | DESCRIPCIÓN  |
|--|------------------|--------------|-----|-----------------|--------------|--|
| <b>CTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ MiscFees</b>      |                  |              |     |                 |              | (1 time)   |
| →→ 137   | MiscFeeAmt       | Amt          | N   |                 | Amt          | Corretaje de la Operación<br>Sólo aplica al Segmento de RV   |
| →→ 139   | MiscFeeType      | Typ          | N   | 12 = Agent      | String       |  |
| <b>CTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ TrdRptOrdDetl</b> |                  |              |     |                 |              | (1 time) Sólo aplica al Segmento de RV   |
| → 198  | SecondaryOrderID | OrdID2       | N   |                 | String       | Identificador único de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación.   |
| → 586  | OrigOrdModTime   | OrigOrdModTm | N   |                 | UTCTimestamp | Fecha y hora de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación   |
| → 1729*  | FirmMnemonic     | FirmMnem     | N   |                 | String(10)   | Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm) o Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Destino (Take-up Trading Firm) |
| → 161*   | AllocText        | Txt          | N   |                 | String(18)   | Referencia de Asignación   |

## 6.2 Operaciones de cualquier sesión procedentes de plataformas y movimientos entre Miembros/Cuentas

| <b>CHISTRADES.sc</b> |  |
|----------------------|--|
| Grupo                | Información de Operaciones   |
| Descripción          | Información de las Operaciones de compraventa y sus movimientos entre Cuentas de Posición o entre Miembros que están pendientes de generación de Instrucciones de Liquidación del segmento de RV y RF. |
| Destinatarios        | Miembro, Miembro Compensador, Entidad Participante   |
| Privacidad           | Contiene datos privados  |
| Timing               | Disponible a fin de sesión. Dinámico: pueden añadirse o modificarse registros  |

| TAG                             | NOMBRE  | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO   | DESCRIPCIÓN   |
|---------------------------------|---------|-------|-----|-----------------|-----------|---|
| <b>CHISTTRADES / TrdCaptRpt</b> |         |       |     |                 | (n times) |   |
| 1003                            | TradeID | TrdID | N   |                 | String    | Identificador de registro de la ECC. Este campo siempre está presente en el mensaje |

| TAG  | NOMBRE           | FIXML     | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO      | DESCRIPCIÓN  |
|------|------------------|-----------|-----|--|--------------|--|
| 1040 | SecondaryTradeID | TrdID2    | N   |  | String       | Contiene el identificador de registro de la ECC de la Operación inicial  |
| 828  | TrdType          | TrdTyp    | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | Int          | Tipo de Operación FIX. Este valor es usado conjuntamente con TrdSubType [829]  |
| 829  | TrdSubType       | TrdSubTyp | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | Int          | Este valor es usado conjuntamente con TrdType [828]  |
| 1126 | OrigTradeID      | OrigTrdID | N   |  | String       | Contiene el identificador de registro de la ECC de la Operación previa   |
| 150  | ExecType         | ExecTyp   | N   | F = Trade  | Char         | Referencia original primaria de la Operación asignada por la ECC.  |
| 820  | TradeLinkID      | LinkID    | N   |  | String       | Para el segmento de RF: Se informa de la referencia común de las operaciones que vincula la ida y la vuelta del repo.<br>Número de registro de negociación de la Operación inicial |
| 880  | TrdMatchID       | MtchID    | N   |  | String       | Coincide con el campo TrdMatchID del mensaje Execution Report<br>Sólo aplica al Segmento de RV   |
| 17   | ExecID           | ExecID    | N   |  | String       | Referencia original secundaria de la Operación asignada por la ECC   |
| 1300 | MarketSegmentID  | MktSegID  | N   | Ver Tabla 5 del documento "Tablas de Codificación" | String       | Código de Segmento de Negociación  |
| 32   | LastQty          | LastQty   | S   | >= 0, sin decimales                                | Qty          | Volumen/Nominal de la Operación  |
| 151* | LeavesQty        | LeavesQty | N   |  | Qty          | Volumen/Nominal vivo de la Operación   |
| 31   | LastPx           | LastPx    | S   |  | Price        | Precio de la Operación. Para RF se mostrará en %   |
| 15   | Currency         | Ccy       | N   |  | Currency     | Código de divisa. Expresada según estándar ISO 4217  |
| 75   | TradeDate        | TrdDt     | N   |  | LocalMktDate | Fecha de Contratación  |

| TAG  | NOMBRE                   | FIXML           | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO          | DESCRIPCIÓN   |
|--|--------------------------|-----------------|-----|--|------------------|---|
| 60   | TransactTime             | TxnTm           | N   |  | UTCTimesta<br>mp | Fecha y hora, en formato UTC, en que se realizó la transacción      |
| 64   | SettlDate                | SettlDt         | N   |  | LocalMktDa<br>te | Fecha Teórica de Liquidación  |
| 381  | GrossTradeA<br>mt        | GrossTrdAm<br>t | N   |  | Amt              | Importe Efectivo de la Operación                                    |
| 5681*  | ExchangeTrad<br>eType    | ExchTrdTyp      | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | String           | Tipo de Operación de la ECC   |
| 715  | ClearingBusin<br>essDate | BizDt           | S   |  | LocalMktDa<br>te | Fecha de la sesión  |
| 716  | SettlSessID              | SetSesID        | N   | ITD = Intradía<br>EOD = Fin de sesión              | String           | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión               |
| <b>CHISTRADES / TrdCaptRpt / Hdr</b>             |                          |                 |     |  |                  |   |
| 35   | MsgType                  | MsgTyp          | S   | AE   | String           | Identifica el tipo de mensaje                                       |
| 49   | SenderCompl<br>D         | SID             | S   |  | String           | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL" |
| 56   | TargetCompl<br>D         | TID             | S   |  | String           | Contiene "????"   |
| 50   | SenderSubID              | SSub            | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String           | Contiene el código de Segmento de la ECC                            |
| 52   | SendingTime              | Snt             | S   |  | UTC<br>Timestamp | Hora de generación del fichero                                      |
| <b>CHISTRADES /TrdCaptRpt/ Instrmt</b>           |                          |                 |     |  |                  |   |
| 55   | Symbol                   | Sym             | N   | [N/A]<br>o código de valor                         | String(5)        |   |
| 48   | SecurityID               | ID              | N   |  | String(12)       | Código ISIN   |
| 22   | SecurityIDSou<br>rce     | Src             | N   | 4 = ISIN number                                    | String           |   |
| <b>CHISTRADES /TrdCaptRpt/ Amt</b> (n times)     |                          |                 |     |  |                  |   |
| →<br>708   | PosAmt                   | Amt             | N   |  | Amt              |   |
| →<br>1585  | PosAmtReaso<br>n         | Rsn             | N   | 1000 = Importe Efectivo vivo de la Operación       | Int              |   |
| <b>CHISTRADES /TrdCaptRpt/ TrdRegTS</b> (1 time) |                          |                 |     |  |                  |   |
| →<br>769   | TrdRegTimest<br>amp      | TS              | N   |  | UTCTimesta<br>mp | Día y hora de la Operación inicial en el Sistema de Negociación     |
| →<br>770   | TrdRegTimest<br>ampType  | Typ             | N   | 3 = Time Out                                       | Int              |   |

| TAG  | NOMBRE         | FIXML   | REQ | VALORES VÁLIDOS                  | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|--|----------------|---------|-----|----------------------------------|---------|--|
|  |                |         |     |                                  |         | (1 time)   |
| <b>CHISTTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide</b>      |                |         |     |                                  |         | Siempre 1 ya que sólo se incluye la parte compradora o vendedora, según corresponda al destinatario del mensaje  |
| → 54   | Side           | Side    | S   | 1 = Buy<br>2 = Sell              | Char    | Signo de la Operación  |
| → 1  | Account        | Acct    | N   |                                  | String  | Código de cliente introducido en la orden<br>Sólo aplica al Segmento de RV   |
| → 581  | AccountType    | AcctTyp | N   | 1 - AOTC<br>3 - MTCH<br>4 - DEAL | Int     | Indicador de capacidad<br>Sólo aplica al Segmento de RV  |
| → 77   | PositionEffect | PosEfct | N   | "O" = Open<br>"C" = Close        |         | Indica si la Operación abre o cierra posición  |
|  |                |         |     |                                  |         | Si es una Operación procedente de una orden, contiene la Referencia asignada en la orden   |
| → 58   | Text           | Txt     | N   |                                  | String  | Si es una Asignación de Cuenta Diaria o un Traspaso, contiene la Referencia de la Operación previa<br><br>Sólo aplica al Segmento de RV.   |
| <b>CHISTTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ Pty</b> |                |         |     |                                  |         | (n times)  |
|  |                |         |     |                                  |         | Si PartyRole[452]=1, contiene el código de Miembro de la ECC   |
|  |                |         |     |                                  |         | Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador   |
| →→<br>448                                    | PartyID        | ID      | N   |                                  | String  | Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV<br><br>Si PartyRole[452]=11, contiene el código del usuario de la plataforma<br><br>Si PartyRole[452]=13, contiene el código del Miembro de la plataforma |

| TAG  | NOMBRE           | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS   | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|--|------------------|-------|-----|---|---------|--|
|  |                  |       |     |   |         | <p>Si PartyRole[452]=16, contiene el código de plataforma de negociación</p> <p>Si PartyRole[452]=38, contiene el código de la Cuenta de Posición asociada con la Operación</p> <p>Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante</p> <p>Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación</p> |
| à→<br>447                                    | PartyIDSource    | Src   | N   | D = Proprietary/<br>Custom code                                 | Char    |  |
|  |                  |       |     | 1 = Executing Firm  |         |  |
|  |                  |       |     | 4 = Clearing Firm   |         |  |
|  |                  |       |     | 10 = CSD Code   |         |  |
|  |                  |       |     | 11 = Order<br>Origination Trader                                |         |  |
| →→<br>452                                    | PartyRole        | R     | N   | 13 = Order<br>Origination Firm                                  | Int     | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID.  |
|  |                  |       |     | 16 = Executing<br>System (Código de<br>plataforma)              |         |  |
|  |                  |       |     | 38 = Position Account   |         |  |
|  |                  |       |     | 90 = Settlement Firm  |         |  |
|  |                  |       |     | 91 = Settlement<br>account                                      |         |  |
| <b>CHISTRADER /TrdCaptRpt/ RptSide/ Stip</b> |                  |       |     |   |         | (n times)  |
| →→ 233                                       | StipulationType  | Typ   | N   | TOPEM<br>QTYM<br>AMTM<br>UTI<br>SFTTYPE<br>FINTRATE<br>UTIPRIOR | String  |  |
| →→ 234                                       | StipulationValue | Val   | N   |   | String  | <p>Para Operaciones de compraventa:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Si StipulationType [233] = TOPEM, contiene el código de la ejecución en la plataforma de negociación</li> </ul>   |

| TAG   | NOMBRE           | FIXML  | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|---|------------------|--------|-----|-----------------|---------|---|
|   |                  |        |     |                 |         | <ul style="list-style-type: none"> <li>Si StipulationType [233] = QTYM, contiene el volumen / nominal de la ejecución en la plataforma de negociación</li> <li>Si StipulationType [233] = AMTM, contiene el importe efectivo de la ejecución en la plataforma de negociación</li> </ul> <p>Sólo para RF:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Si StipulationType [233] = UTI, contiene el UTI de la operación</li> <li>Si StipulationType [233] = SFTTYPE, contiene el Tipo de SFT:<br/>B: Simultánea<br/>R: Repo<br/>N: No aplica</li> <li>Si StipulationType [233] = FINRATE, contiene el tipo de interés fijo.</li> <li>Si StipulationType [233] = UTIPRIOR, contiene el UTI PRIOR de la operación.</li> </ul> |
|   |                  |        |     |                 |         | (1 time)  |
| <b>CHISTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ MiscFees</b>      |                  |        |     |                 |         | Sólo aplica al Segmento de RV   |
| →→ 137  | MiscFeeAmt       | Amt    | N   |                 | Amt     | Corretaje de la Operación   |
| →→ 139  | MiscFeeType      | Typ    | N   | 12 = Agent      | String  |   |
|   |                  |        |     |                 |         | (1 time)  |
| <b>CHISTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ TrdRptOrdDetl</b> |                  |        |     |                 |         | Sólo aplica al Segmento de RV   |
| → 198   | SecondaryOrderID | OrdID2 | N   |                 | String  | Identificador único de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación   |

| TAG     | NOMBRE         | FIXML        | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO      | DESCRIPCIÓN  |
|---------|----------------|--------------|-----|-----------------|--------------|--|
| à 586   | OrigOrdModTime | OrigOrdModTm | N   |                 | UTCTimestamp | Fecha y hora de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación   |
| → 1729* | FirmMnemonic   | FirmMnem     | N   |                 | String(10)   | Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm) o Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Destino (Take-up Trading Firm) |
| → 161*  | AllocText      | Txt          | N   |                 | String(18)   | Referencia de Asignación   |

### 6.3 Detalle de todas las Operaciones registradas en la sesión

| CALLTRADES.sc |   |
|---------------|---|
| Grupo         | Información de Operaciones  |
| Descripción   | Información de todas las Operaciones registradas en la sesión, tanto las procedentes de las plataformas y los movimientos de Operaciones entre Miembros/Cuentas de Posición, como las correspondientes a las Instrucciones generadas por neteo/agregación, los Ajustes y la liquidación de Instrucciones del segmento de RV y RF.<br>Permiten actualizar los saldos de cara al cálculo de Garantías |
| Destinatarios | Miembro, Miembro Compensador, Entidad Participante  |
| Privacidad    | Contiene datos privados   |
| Timing        | Disponible a fin de sesión.   |

| TAG                            | NOMBRE           | FIXML     | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO   | DESCRIPCIÓN   |
|--------------------------------|------------------|-----------|-----|--|-----------|---|
| <b>CALLTRADES / TrdCaptRpt</b> |                  |           |     |  | (n times) |   |
| 1003                           | TradeID          | TrdID     | N   |  | String    | Identificador de registro en la ECC. Este campo siempre está presente en el mensaje |
| 1040                           | SecondaryTradeID | TrdID2    | N   |  | String    | Contiene el identificador de registro en la ECC de la Operación inicial             |
| 828                            | TrdType          | TrdTyp    | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | Int       | Tipo de Operación FIX. Este valor es usado conjuntamente con TrdSubType [829]       |
| 829                            | TrdSubType       | TrdSubTyp | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | Int       | Este valor es usado conjuntamente con TrdType [828]                                 |
| 1126                           | OrigTradeID      | OrigTrdID | N   |  | String    | Contiene el identificador de registro de la ECC de la Operación previa              |

| TAG  | NOMBRE          | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|------|-----------------|----------|-----|--|---------|--|
|      |                 |          |     |  |         | <p>Si se trata de Recompensas o Liquidaciones en Efectivo, contiene el identificador de registro de la ECC de la Instrucción fallida que liquida</p> <p>Si se trata de un Ajuste y éste cancela una Instrucción, este campo contiene el identificador de registro de la ECC de la Instrucción que cancela</p>  |
| 820  | TradeLinkID     | LinkID   | N   |  | String  | <p>Referencia original primaria de la Operación asignada por la ECC.</p> <p>Si se trata de una operación de Neteo / Agregación contiene el Identificador de Registro de la ECC (TradeId[1003]) de la Instrucción de Liquidación</p> <p>Para el segmento de RF: Se informa de la referencia común de las operaciones que vincula la ida y la vuelta del repo.</p> |
| 150  | ExecType        | ExecTyp  | N   | F = Trade  | Char    |  |
| 880  | TrdMatchID      | MtchID   | N   |  | String  | <p>Número de registro de negociación de la Operación inicial</p> <p>Coincide con el campo TrdMatchID del mensaje Execution Report</p> <p>Sólo está informado para Operaciones procedentes de plataformas y movimientos entre Miembros/Cuentas de Posición</p>  |
| 17   | ExecID          | ExecID   | N   |  | String  | Referencia original secundaria de la Operación asignada por la ECC   |
| 1300 | MarketSegmentID | MktSegID | N   | Ver Tabla 5 del documento "Tablas de Codificación" | String  | Código de Segmento de Negociación  |

| TAG                                  | NOMBRE               | FIXML       | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO      | DESCRIPCIÓN   |
|--------------------------------------|----------------------|-------------|-----|--|--------------|---|
|                                      |                      |             |     |  |              | Volumen/Nominal de la Operación / Instrucción   |
| 32                                   | LastQty              | LastQty     | S   | >= 0, sin decimales                                | Qty          | Puede ser cero en Instrucciones sólo de efectivo  |
| 151*                                 | LeavesQty            | LeavesQty   | N   |  | Qty          | Volumen/Nominal vivo de la Operación  |
|                                      |                      |             |     |  |              | Precio de la Operación.   |
| 31                                   | LastPx               | LastPx      | S   |  | Price        | Si se trata de una Instrucción se trata de un precio medio.<br>Para RF se mostrará en %                                 |
| 15                                   | Currency             | Ccy         | N   |  | Currency     | Código de divisa. Expresada según estándar ISO 4217   |
| 75                                   | TradeDate            | TrdDt       | N   |  | LocalMktDate | Fecha de Contratación   |
| 60                                   | TransactTime         | TxnTm       | N   |  | UTCTimestamp | Fecha y hora, en formato UTC, en que se realizó la transacción  |
| 64                                   | SettlDate            | SettlDt     | N   |  | LocalMktDate | Fecha Teórica de Liquidación  |
|                                      |                      |             |     |  |              | Importe Efectivo de la Operación  |
| 381                                  | GrossTradeAmt        | GrossTrdAmt | N   |  | Amt          | En caso de una Instrucción, puede ser negativo en función del resultado de la compensación en cuentas de Posición netas |
| 5681*                                | ExchangeTradeType    | ExchTrdTyp  | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | String       | Tipo de Operación de la ECC   |
| 715                                  | ClearingBusinessDate | BizDt       | S   |  | LocalMktDate | Fecha de la sesión  |
| 716                                  | SettlSessID          | SetSesID    | N   | ITD = Intradía<br>EOD = Fin de sesión              | String       | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión   |
| <b>CALLTRADES / TrdCaptRpt / Hdr</b> |                      |             |     |  |              |   |
| 35                                   | MsgType              | MsgTyp      | S   | AE   | String       | Identifica el tipo de mensaje   |
| 49                                   | SenderCompID         | SID         | S   |  | String       | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"   |
| 56                                   | TargetCompID         | TID         | S   |  | String       | Contiene "????"   |

| TAG                                     | NOMBRE              | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS   | FORMATO       | DESCRIPCIÓN  |
|---|---------------------|-------|-----|---|---------------|--|
| 50                                      | SenderSubID         | SSub  | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"  | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC   |
| 52                                      | SendingTime         | Snt   | S   |   | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero   |
| <b>CALLTRADES /TrdCaptRpt/ Instrmt</b>  |                     |       |     |   |               |  |
| 55                                      | Symbol              | Sym   | N   | [N/A]<br>o código de valor  | String(5)     |  |
| 48                                      | SecurityID          | ID    | N   |   | String(12)    | Código ISIN  |
| 22                                      | SecurityIDSource    | Src   | N   | 4 = ISIN number   | String        |  |
| <b>CALLTRADES /TrdCaptRpt/ Amt</b>      |                     |       |     |   |               | (n times)  |
| →<br>708                                | PosAmt              | Amt   | N   |   | Amt           |  |
| →<br>1585                               | PosAmtReason        | Rsn   | N   | 1000 = Importe Efectivo vivo de la Operación<br>1001 = Importe Efectivo de Valores retenidos<br>Sólo aplica al Segmento de RV | Int           | En caso de una Instrucción parcialmente liquidada, contiene el importe efectivo pendiente de liquidar  |
| <b>CALLTRADES /TrdCaptRpt/ TrdRegTS</b> |                     |       |     |   |               | Bloque sólo cumplimentado para compraventas<br>(1 time)  |
| →<br>769                                | TrdRegTimestamp     | TS    | N   |   | UTCTimestamp  | Día y hora de la Operación inicial en el Sistema de Negociación  |
| →<br>770                                | TrdRegTimestampType | Typ   | N   | 3 = Time Out  | Int           |  |
| <b>CALLTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide</b>  |                     |       |     |   |               | (1 time)<br>Siempre 1 ya que sólo se incluye la parte compradora o vendedora, según corresponda al destinatario del mensaje  |
| → 54                                    | Side                | Side  | S   | 1 = Buy<br>2 = Sell   | Char          | Signo de la Operación / signo de la posición de Valores<br><br>Si es una Instrucción de sólo efectivo: si es 1 es efectivo a pagar y si es 2 es efectivo a recibir |

| TAG       | NOMBRE         | FIXML   | REQ | VALORES VÁLIDOS                  | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|-----------|----------------|---------|-----|----------------------------------|---------|---|
| à 1       | Account        | Acct    | N   |                                  | String  | Para compraventas, contiene el código de cliente introducido en la orden<br>Sólo aplica al Segmento de RV   |
| → 581     | AccountType    | AcctTyp | N   | 1 – AOTC<br>3 – MTCH<br>4 – DEAL | Int     | Indicador de capacidad<br>Sólo aplica al Segmento de RV   |
| → 77      | PositionEffect | PosEfct | N   | “O” = Open<br>“C” = Close        |         | Indica si la Operación abre o cierra posición   |
|           |                |         |     |                                  |         | Si es una Operación procedente de una orden, contiene la Referencia asignada en la orden. Sólo aplica al Segmento de RV   |
| → 58      | Text           | Txt     | N   |                                  | String  | Si es una Asignación de Cuenta Diaria (Sólo aplica al Segmento de RV) o un traspaso, contiene la Referencia de la Operación previa.<br><br>Solo aplica el segmento de RV.   |
|           |                |         |     |                                  |         | (n times)   |
|           |                |         |     |                                  |         | Si PartyRole[452]=1, contiene el código de Miembro de la ECC  |
|           |                |         |     |                                  |         | Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador  |
|           |                |         |     |                                  |         | Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV  |
| →→<br>448 | PartyID        | ID      | N   |                                  | String  | Si PartyRole[452]=11, contiene el código del usuario de la plataforma<br><br>Si PartyRole[452]=13, contiene el código del Miembro de la plataforma<br><br>Si PartyRole[452]=16, contiene el código de plataforma de negociación |

| TAG  | NOMBRE           | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS  | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|--|------------------|-------|-----|--|---------|---|
|  |                  |       |     |  |         | <p>Si PartyRole[452]=38, contiene el código de la Cuenta de Posición asociada con la Operación</p> <p>Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante</p> <p>Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación</p> |
| à→<br>447                                    | PartyIDSource    | Src   | N   | D = Proprietary/<br>Custom code<br><br>1 = Executing Firm<br><br>4 = Clearing Firm<br><br>10 = CSD Code<br><br>11 = Order<br>Origination Trader<br><br>13 = Order<br>Origination Firm<br><br>16 = Executing<br>System (Código de<br>plataforma)<br><br>38 = Position Account<br><br>90 = Settlement Firm<br><br>91 = Settlement<br>account | Char    |   |
| →→<br>452                                    | PartyRole        | R     | N   |  | Int     | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID  |
| <b>CALLTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ Stip</b> |                  |       |     |  |         | (n times)   |
| →→ 233                                       | StipulationType  | Typ   | N   | TOPEM<br>QTYM<br>AMTM<br>CLIQ<br>ILIQDCV<br>TINST<br>ICORPDCV<br>UTI<br>SFTTYPE<br>FINTRATE<br>UTIPRIOR  | String  |   |
| →→ 234                                       | StipulationValue | Val   | N   |  | String  | <p>Para Operaciones de compraventa:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Si StipulationType [233] = TOPEM, contiene el código de la ejecución en la plataforma de negociación.</li> </ul>   |

| TAG | NOMBRE | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|-----|--------|-------|-----|-----------------|---------|---|
|     |        |       |     |                 |         | <ul style="list-style-type: none"> <li>• Si StipulationType [233] = QTYM, contiene el volumen / nominal de la ejecución en la plataforma de negociación</li> <li>• Si StipulationType [233] = AMTM, contiene el importe efectivo de la ejecución en la plataforma de negociación</li> </ul> <p>Para Instrucciones de Liquidación:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Si StipulationType [233] = CLIQ, contiene el número de la ventana de agregación en la que se envía la Instrucción a liquidar.</li> <li>• Si StipulationType [233] = ILIQDCV, contiene el identificador de la Instrucción Liquidación en el DCV</li> <li>• Si StipulationType [233] = TINST, contiene el Tipo Instrucción: <ul style="list-style-type: none"> <li>* DVP = Entrega contra pago</li> <li>* RVP = Recepción contra pago</li> <li>* DWP = Entrega con pago</li> <li>* DFP = Entrega libre de pago</li> <li>* RFP = Recepción libre de pago</li> <li>* PWD = Pago / cobro sin entrega de Valores</li> <li>* ROC = Instrucciones de pago sin entrega con efectivo cero</li> <li>* RWP = Recepción con pago</li> </ul> </li> </ul> |

| TAG | NOMBRE | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|-----|--------|-------|-----|-----------------|---------|--|
|     |        |       |     |                 |         | <ul style="list-style-type: none"> <li>Si StipulationType [233] = QTYM, contiene el número de Valores / Nominal de la Instrucción fallida que liquida</li> <li>Si StipulationType [233] = AMTM, contiene el importe efectivo de la Instrucción fallida que liquida</li> </ul> <p>Para Eventos Corporativos:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Si StipulationType [233] = ICORPDCV, contiene el identificador del Evento en el DCV</li> <li>Si StipulationType [233] = QTYM, contiene el número de Valores / Nominal de la Instrucción fallida que liquida</li> <li>Si StipulationType [233] = AMTM, contiene el importe efectivo de la Instrucción fallida que liquida</li> </ul> <p>Sólo para RF:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Si StipulationType [233] = UTI, contiene el UTI de la operación</li> <li>Si StipulationType [233] = SFTTYPE, contiene el Tipo de SFT:<br/>B: Simultánea<br/>R: Repo<br/>N: No aplica</li> <li>Si StipulationType [233] = FINRATE, contiene el tipo de interés fijo.</li> <li>Si StipulationType [233] = UTIPRIOR, contiene el UTI PRIOR de la operación.</li> </ul> |

| TAG   | NOMBRE           | FIXML        | REQ | VALORES VÁLIDOS     | FORMATO      | DESCRIPCIÓN  |
|---|------------------|--------------|-----|---------------------|--------------|--|
| <b>CALLTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ MiscFees</b>      |                  |              |     |                     |              | (1 time) Sólo aplica al Segmento de RV   |
| →→ 137  | MiscFeeAmt       | Amt          | N   |                     | Amt          | Corretaje de la Operación  |
| →→ 139  | MiscFeeType      | Typ          | N   | 12 = Agent          | String       |  |
| <b>CALLTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ TrdRptOrdDetl</b> |                  |              |     |                     |              | Bloque sólo cumplimentado para compraventas (1 time)<br>Sólo aplica al Segmento de RV  |
| →→ 198  | SecondaryOrderID | OrdID2       | N   |                     | String       | Identificador único de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación  |
| →→ 586  | OrigOrdModTime   | OrigOrdModTm | N   |                     | UTCTimestamp | Fecha y hora de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación   |
| →→ 1729*  | FirmMnemonic     | FirmMnem     | N   |                     | String(10)   | Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm) o Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Destino (Take-up Trading Firm) |
| → 161*  | AllocText        | Txt          | N   |                     | String(18)   | Referencia de Asignación   |
| <b>CALLTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ Qty</b>           |                  |              |     |                     |              | (n times)  |
| →→ 703  | PosType          | Typ          | N   | RCV                 | String       | Para Operaciones de compraventa: RCV indica los Valores retenidos por la Entidad Liquidadora<br>Sólo aplica al Segmento de RV  |
| →→ 705  | ShortQty         | Short        | N   | >= 0, sin decimales | Qty          |  |

## 7 Asignación de la Cuenta de Posición

### 7.1 Asignaciones Internas de Cuenta y Traspasos realizados

| CTRAFTRADES.sc |  |
|----------------|--|
| Grupo          | Designación de la Cuenta de Posición                                       |
| Descripción    | Asignaciones Internas de cuenta y Traspasos realizados del segmento de RV. |
| Destinatarios  | Miembro que realiza la Asignación o Traspaso                               |
| Privacidad     | Contiene datos privados  |
| Timing         | Disponible a fin de sesión.  |

| TAG                           | NOMBRE                   | FIXML      | REQ | VALORES VÁLIDOS              | FORMATO      | DESCRIPCIÓN   |
|-------------------------------|--------------------------|------------|-----|------------------------------|--------------|---|
| <b>CTRAFTRADES / AllocRpt</b> |                          |            |     |                              |              | (n times)   |
| 755                           | AllocReportID            | RptID      | S   |                              | String       | Identificador único para cada mensaje Allocation Report   |
| 70                            | AllocID                  | ID         | N   |                              | String(30)   | Identificador del mensaje Allocation Instruction relacionado  |
| 71                            | AllocTransType           | TransType  | S   | 0 = New<br>2 = Cancel        | Char         |   |
| 795                           | AllocReportRefID         | RptRefID   | N   |                              | String       | Presente cuando AllocTransType [71] = 2 (Cancel)  |
| 796                           | AllocCancelReplaceReason | CxlRplcRsn | N   | 99 = Other                   | Int          | Presente cuando AllocTransType [71] = 2 (Cancel)  |
| 793                           | SecondaryAllocationID    | ID2        | N   |                              | String       | Identificador único del traspaso asignado por la Cámara   |
| 794                           | AllocReportType          | RptType    | S   | 15 = Give-up<br>16 = Take-up | Int          |   |
| 87                            | AllocStatus              | Stat       | S   | 9 = Claimed                  | Int          |   |
| 72                            | RefAllocID               | RefID      | N   |                              | String       | Presente cuando AllocTransType [71] = 2 (Cancel)  |
| 54                            | Side                     | Side       | S   | 1 = Buy<br>2 = Sell          | Char         | Indica si la Operación a transferir es compradora o vendedora   |
| 53                            | Quantity                 | Qty        | S   |                              | Qty          | Volumen de la asignación/traspaso   |
| 6                             | AvgPx                    | AvgPx      | S   |                              | Price        | Precio de la Operación  |
| 75                            | TradeDate                | TrdDt      | S   |                              | LocalMktDate | En asignaciones simples: Fecha de Contratación<br>En asignaciones múltiples: Fecha Teórica de Liquidación |

| TAG                                      | NOMBRE               | FIXML        | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|--|----------------------|--------------|-----|--|---------------|---|
| 64                                       | SettlDate            | SettlDt      | N   |  | LocalMktDate  | Fecha Teórica de Liquidación  |
| 381                                      | GrossTradeAmt        | GrossTrdAmt  | N   |  | Amt           | Importe efectivo de la asignación/traspaso  |
| 715                                      | ClearingBusinessDate | BizDt        | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión  |
| 716*                                     | SettlSessID          | SetSesID     | N   | ITD = Intradía<br>EOD = Fin de sesión              | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión   |
| <b>CTRAFTRADES / AllocRpt / Hdr</b>      |                      |              |     |  |               |   |
| 35                                       | MsgType              | MsgTyp       | S   | AS   | String        | Identifica el tipo de mensaje   |
| 49                                       | SenderComplD         | SID          | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"   |
| 56                                       | TargetComplD         | TID          | S   |  | String        | Contiene "???"  |
| 50                                       | SenderSubID          | SSub         | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC  |
| 52                                       | SendingTime          | Snt          | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero  |
| <b>CTRAFTRADES / AllocRpt / OrdAlloc</b> |                      |              |     |  |               |   |
| →11                                      | ClOrdID              | ClOrdID      | N   | [N/A]  | String        | Bloque OrdAlloc enviado por el cliente<br>(1 time)  |
| →198                                     | SecondaryOrderID     | ClOrdID2     | N   |  | String        | Identificador único de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación                                 |
| → 586*                                   | OrigOrdModTime       | OrigOrdModTm | N   |  | UTCTimestamp  | Fecha y hora de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación  |
| → 1*                                     | Account              | Acct         | N   |  | String        | Código de cliente introducido en la orden<br>Si es una Operación procedente de una orden, contiene la Referencia asignada en la orden |
| → 58*                                    | Text                 | Txt          | N   |  | String        | Si es una Asignación de Cuenta Diaria o un Traspaso, contiene la Referencia de la Operación previa                                    |

| TAG   | NOMBRE           | FIXML     | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|---|------------------|-----------|-----|--|---------|--|
| à 581*                                      | AccountType      | AcctTyp   | N   | 1 - AOTC<br>3 - MTCH<br>4 - DEAL                   | Int     | Indicador de capacidad   |
| <b>CTRAFTRADES /AllocRpt/ AllExc</b>        |                  |           |     |  |         | No está presente cuando OrdAllocGrp informado  |
|   |                  |           |     |  |         | (n times)  |
| →32   | LastQty          | LastQty   | N   |  | Qty     | Volumen de la Operación  |
| 31  | LastPx           | LastPx    | S   |  | Price   | Precio de la Operación   |
| →<br>1003                                   | TradeID          | TrdID     | N   |  | String  | Identificador de registro de la ECC de la nueva Operación<br>Sólo está presente cuando AllocStatus [87] = 9 (Claimed)  |
| →<br>1126*                                  | OrigTradeID      | OrigTrdID | N   |  | String  | Identificador de registro de la ECC de la Operación previa<br>Sólo está presente cuando el mensaje va destinado a los usuarios del Miembro que solicitó el Traspaso  |
| 1300*                                       | MarketSegmentID  | MktSegID  | N   | Ver Tabla 5 del documento "Tablas de Codificación" | String  | Código de Segmento de Negociación  |
| 880*  | TrdMatchID       | MtchID    | N   |  | String  | Número de registro de negociación de la Operación inicial  |
| <b>CTRAFTRADES /AllocRpt/ AllExc/ Stip*</b> |                  |           |     |  |         |  |
| →→<br>233*                                  | StipulationType  | Typ       | N   | TOPEM<br>QTYM<br>MEMM                              | String  |  |
| →→<br>234*                                  | StipulationValue | Val       | N   |  | String  | Si StipulationType [233] = TOPEM, contiene el código de la ejecución en la plataforma de negociación<br>Si StipulationType [233] = QTYM, contiene el volumen de la ejecución en la plataforma de negociación |

| TAG   | NOMBRE           | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS  | FORMATO    | DESCRIPCIÓN  |
|---|------------------|-------|-----|--|------------|--|
|   |                  |       |     |  |            | Si StipulationType [233] = MEMM, contiene el código de miembro de la ejecución en la plataforma de negociación               |
| <b>CTRAFTRADES /AllocRpt/ AllExc/ MiscFees*</b> |                  |       |     |  |            | (1 time)   |
| →→ 137*   | MiscFeeAmt       | Amt   | N   |  | Amt        | Corretaje de la Operación inicial  |
| →→ 139*   | MiscFeeType      | Typ   | N   | 12 = Agent   | String     |  |
| <b>CTRAFTRADES /AllocRpt/ Instrmt</b>           |                  |       |     |  |            |  |
| 55  | Symbol           | Sym   | N   | [N/A]<br>o código de valor                               | String(5)  |  |
| 48  | SecurityID       | ID    | N   |  | String(12) | Código ISIN  |
| 22  | SecurityIDSource | Src   | N   | 4 = ISIN number  | String     |  |
| <b>CTRAFTRADES /AllocRpt/ Pty</b>               |                  |       |     |  |            | (n times)  |
| → 448   | PartyID          | ID    | N   |  | String     | Si PartyRole[452]=12, contiene el usuario que inició la solicitud<br><br>Si PartyRole[452]=95, contiene el código de Miembro |
| → 447   | PartyIDSource    | Src   | N   | D = Proprietary/<br>Custom code                          | Char       |  |
| → 452   | PartyRole        | R     | N   | 12 = Executing<br>Trader<br>95 = Give-up<br>Trading Firm | Int        | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID   |
| <b>CTRAFTRADES /AllocRpt/ Alloc</b>             |                  |       |     |  |            | (1 time)   |
| → 79  | AllocAccount     | Acct  | N   |  | String     | Cuenta de Posición Destino   |
| → 80  | AllocQty         | Qty   | N   |  | Qty        | Volumen de la asignación/traspaso. Debe ser igual al campo Quantity  |

## 7.2 Asignaciones Externas (Miembro Origen)

| <b>CGIVEOUT.sc</b> |   |
|--------------------|---|
| Grupo              | Designación de la Cuenta de Posición  |
| Descripción        | Estado de las Asignaciones Externas en que se participa como Miembro Origen del segmento de RV. |
| Destinatarios      | Miembro Origen  |
| Privacidad         | Contiene datos privados   |
| Timing             | Disponible a fin de sesión.   |

| TAG                        | NOMBRE            | FIXML      | REQ | VALORES VÁLIDOS  | FORMATO      | DESCRIPCIÓN   |
|----------------------------|-------------------|------------|-----|--|--------------|---|
| <b>CGIVEOUT / AllocRpt</b> |                   |            |     |  | (n times)    |   |
| 755                        | AllocReportID     | RptID      | S   |  | String       | Identificador único para cada mensaje Allocation Report   |
| 70                         | AllocID           | ID         | N   |  | String(30)   | Identificador del mensaje Allocation Instruction relacionado  |
| 71                         | AllocTransType    | TransTyp   | S   | 0 = New<br>2 = Cancel  | Char         |   |
| 795                        | AllocReportRefID  | RptRefID   | N   |  | String       | Presente cuando AllocTransType [71] = 2 (Cancel)  |
| 796                        | AllocCancelReason | CxlRplcRsn | N   | 99 = Other   | Int          | Presente cuando AllocTransType [71] = 2 (Cancel)  |
| 793                        | SecondaryAllocID  | ID2        | N   |  | String       | Identificador único del traspaso asignado por la Cámara   |
| 794                        | AllocReportType   | RptTyp     | S   | 15 = Give-up<br>16 = Take-up   | Int          |   |
| 87                         | AllocStatus       | Stat       | S   | 5 = Rejected by intermediary<br>6 = Allocation pending<br>9 = Claimed<br>12 = Cancelled<br>13 = Pending take-up approval | Int          |   |
| 72                         | RefAllocID        | RefID      | N   |  | String       | Presente cuando AllocTransType [71] = 2 (Cancel)  |
| 54                         | Side              | Side       | S   | 1 = Buy<br>2 = Sell  | Char         | Indica si la Operación a transferir es compradora o vendedora   |
| 53                         | Quantity          | Qty        | S   |  | Qty          | Volumen de la Asignación Externa  |
| 6                          | AvgPx             | AvgPx      | S   |  | Price        | Precio de la Operación  |
| 75                         | TradeDate         | TrdDt      | S   |  | LocalMktDate | En asignaciones simples: Fecha de Contratación<br>En asignaciones múltiples: Fecha Teórica de Liquidación |
| 64                         | SettleDate        | SettleDt   | N   |  | LocalMktDate | Fecha Teórica de Liquidación  |

| TAG                                   | NOMBRE               | FIXML        | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|---------------------------------------|----------------------|--------------|-----|--|---------------|---|
| 381                                   | GrossTradeAmt        | GrossTrdAmt  | N   |  | Amt           | Importe efectivo de la Asignación Externa   |
| 715                                   | ClearingBusinessDate | BizDt        | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión  |
| 716*                                  | SettlSessID          | SetSesID     | N   | ITD = Intradía<br>EOD = Fin de sesión              | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión   |
| <b>CGIVEOUT / AllocRpt / Hdr</b>      |                      |              |     |  |               |   |
| 35                                    | MsgType              | MsgTyp       | S   | AS   | String        | Identifica el tipo de mensaje   |
| 49                                    | SenderCompID         | SID          | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"                                   |
| 56                                    | TargetCompID         | TID          | S   |  | String        | Contiene "????"   |
| 50                                    | SenderSubID          | SSub         | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC  |
| 52                                    | SendingTime          | Snt          | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero  |
| <b>CGIVEOUT / AllocRpt / OrdAlloc</b> |                      |              |     |  |               |   |
| →11                                   | ClOrdID              | ClOrdID      | N   | [N/A]  | String        | Bloque OrdAlloc enviado por el cliente<br>(1 time)  |
| →198                                  | SecondaryOrderID     | ClOrdID2     | N   |  | String        | Identificador único de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación |
| → 586*                                | OrigOrdModTime       | OrigOrdModTm | N   |  | UTCTimestamp  | Fecha y hora de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación        |
| → 1*                                  | Account              | Acct         | N   |  | String        | Código de cliente introducido en la orden   |
| → 58*                                 | Text                 | Txt          | N   |  | String        | Si es una Operación procedente de una orden, contiene la Referencia asignada en la orden              |
| → 581*                                | AccountType          | AcctTyp      | N   | 1 - AOTC<br>3 - MTCH<br>4 - DEAL                   | Int           | Si es una Asignación de Cuenta Diaria o un Traspaso, contiene la Referencia de la Operación previa    |

| TAG  | NOMBRE           | FIXML     | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|--|------------------|-----------|-----|--|---------|--|
| <b>CGIVEOUT /AllocRpt/ AllExc</b>            |                  |           |     |  |         | No está presente cuando OrdAllocGrp informado<br>(n times)   |
| →32  | LastQty          | LastQty   | N   |  | Qty     | Volumen de la Operación  |
| 31   | LastPx           | LastPx    | S   |  | Price   | Precio de la Operación   |
| →<br>1003                                    | TradelID         | TrdID     | N   |  | String  | Identificador de registro de la ECC de la nueva Operación<br>Sólo está presente cuando AllocStatus [87] = 9 (Claimed)  |
| →<br>1126*                                   | OrigTradelID     | OrigTrdID | N   |  | String  | Identificador de registro de la ECC de la Operación previa<br>Sólo está presente cuando el mensaje va destinado a los usuarios del Miembro que solicitó el traspaso  |
| 1300*  | MarketSegmentID  | MktSegID  | N   | Ver Tabla 5 del documento "Tablas de Codificación" | String  | Código de Segmento de Negociación  |
| 880*   | TrdMatchID       | MtchID    | N   |  | String  | Número de registro de negociación de la Operación inicial  |
| <b>CGIVEOUT /AllocRpt/ AllExc/ Stip*</b>     |                  |           |     |  |         |  |
| →→ 233*                                      | StipulationType  | Typ       | N   | TOPEM<br>QTYM<br>MEMM                              | String  |  |
| →→ 234*                                      | StipulationValue | Val       | N   |  | String  | Si StipulationType [233] = TOPEM, contiene el código de la ejecución en la plataforma de negociación<br>Si StipulationType [233] = QTYM, contiene el volumen de la ejecución en la plataforma de negociación<br>Si StipulationType [233] = MEMM, contiene el código de miembro de la ejecución en la plataforma de negociación |
| <b>CGIVEOUT /AllocRpt/ AllExc/ MiscFees*</b> |                  |           |     |  |         | (1 time)   |

| TAG                                | NOMBRE           | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS                              | FORMATO    | DESCRIPCIÓN  |
|------------------------------------|------------------|-------|-----|--|------------|--|
| à→ 137*                            | MiscFeeAmt       | Amt   | N   |  | Amt        | Corretaje de la Operación inicial  |
| →→ 139*                            | MiscFeeType      | Typ   | N   | 12 = Agent                                   | String     |  |
| <b>CGIVEOUT /AllocRpt/ Instrmt</b> |                  |       |     |  |            |  |
| 55                                 | Symbol           | Sym   | N   | [N/A]<br>o código de valor                   | String(5)  |  |
| 48                                 | SecurityID       | ID    | N   |  | String(12) | Código ISIN  |
| 22                                 | SecurityIDSource | Src   | N   | 4 = ISIN number                              | String     |  |
| <b>CGIVEOUT /AllocRpt/ Pty</b>     |                  |       |     |  |            | (n times)  |
|                                    |                  |       |     |  |            | Si PartyRole[452]=12, contiene el usuario que inició la solicitud  |
|                                    |                  |       |     |  |            | Si PartyRole[452]=16, contiene el código de la plataforma  |
|                                    |                  |       |     |  |            | Si PartyRole[452]=36, contiene el usuario del Miembro Destino que realizó la aceptación o rechazo de la Asignación |
| →<br>448                           | PartyID          | ID    | N   |  | String     | Si PartyRole[452]=95, contiene el Miembro Origen   |
|                                    |                  |       |     |  |            | Si PartyRole[452]=96, contiene el Miembro Destino  |
|                                    |                  |       |     |  |            | Si PartyRole[452]=98, contiene el Miembro Compensador de la Cuenta de Posición de la Operación a traspasar         |
| →<br>447                           | PartyIDSource    | Src   | N   | D = Proprietary/<br>Custom code              | Char       |  |
|                                    |                  |       |     | 12 = Executing Trader                        |            |  |
|                                    |                  |       |     | 16 = Executing System (Código de plataforma) |            |  |
|                                    |                  |       |     | 36 = Clearing Broker Trader                  |            |  |
| →<br>452                           | PartyRole        | R     | N   | 95 = Give-up Trading Firm                    | Int        | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID   |
|                                    |                  |       |     | 96= Take-up Trading Firm                     |            |  |
|                                    |                  |       |     | 98 = Take-up Clearing Firm                   |            |  |

| TAG                              | NOMBRE | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|----------------------------------|--------|-------|-----|-----------------|---------|--|
|                                  |        |       |     |                 |         | <p>El valor 12 está presente en los mensajes destinados a los usuarios del Miembro que realizó la solicitud de traspaso, así como a los usuarios del Miembro Destino de la Asignación si es el caso, informándoles del usuario que inició la solicitud</p> <p>El valor 36, cuando esté presente, informa del usuario del Miembro Destino que realizó la aceptación o rechazo de una Asignación</p> <p>El valor 95 está presente en los mensajes destinados al Miembro Origen y al Miembro Destino de una Asignación informándoles del Miembro Origen</p> <p>El valor 96 está presente en todos los mensajes relacionados con Asignación Externa, informando del Miembro Destino</p> <p>El valor 98 está presente en los mensajes destinados al Miembro Destino cuando el mensaje contiene una cuenta de posición en el campo AllocAccount [79], informándole del Miembro Compensador de dicha cuenta. Este valor también está presente en los mensajes enviados al Miembro Compensador</p> |
| <b>CGIVEOUT /AllocRpt/ Alloc</b> |        |       |     |                 |         | (1 time)   |

| TAG       | NOMBRE        | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|-----------|---------------|----------|-----|-----------------|---------|---|
| à<br>79   | AllocAccount  | Acct     | N   |                 | String  | Cuenta de Posición Destino<br><br>En una Asignación Externa sólo se informa de este campo cuando se recibe el mensaje como Destino o Compensador (nunca como Origen). En cualquier otro caso contiene "[N/A]" |
| →<br>80   | AllocQty      | Qty      | N   |                 | Qty     | Volumen de la Asignación Externa. Debe ser igual al campo Quantity  |
| →<br>1729 | FirmMnemonic  | FirmMnem | N   |                 | String  | Cuando está presente, informa del Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm) o del Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Destino (Take-up Trading Firm)    |
| →<br>161  | AllocText     | Txt      | N   |                 | String  | Cuando está presente, informa de la Referencia de Asignación  |
| →<br>1732 | FirmAllocText | FirmTxt  | N   |                 | String  | Cuando está presente, informa de la Referencia de Asignación asignada por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm) para uso interno   |

### 7.3 Asignaciones Externas (Miembro Destino)

| CGIVEIN.sc    |   |
|---------------|---|
| Grupo         | Designación de la Cuenta de Posición  |
| Descripción   | Información de las Asignaciones Externas en que se participa como Miembro Destino del segmento de RV. |
| Destinatarios | Miembro Destino   |
| Privacidad    | Contiene datos privados   |
| Timing        | Disponible a fin de sesión  |

| TAG                       | NOMBRE        | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|---------------------------|---------------|-------|-----|-----------------|---------|---|
| <b>CGIVEIN / AllocRpt</b> |               |       |     |                 |         | (n times)   |
| 755                       | AllocReportID | RptID | S   |                 | String  | Identificador único para cada mensaje Allocation Report |

| TAG  | NOMBRE               | FIXML       | REQ | VALORES VÁLIDOS  | FORMATO      | DESCRIPCIÓN   |
|------|----------------------|-------------|-----|--|--------------|---|
| 70   | AllocID              | ID          | N   |  | String(30)   | Identificador del mensaje Allocation Instruction relacionado  |
| 71   | AllocTransType       | TransTyp    | S   | 0 = New<br>2 = Cancel  | Char         |   |
| 795  | AllocReportRefID     | RptRefID    | N   |  | String       | Presente cuando AllocTransType [71] = 2 (Cancel)  |
| 796  | AllocCancelReason    | CxlRplcRsn  | N   | 99 = Other   | Int          | Presente cuando AllocTransType [71] = 2 (Cancel)  |
| 793  | SecondaryAllocID     | ID2         | N   |  | String       | Identificador único del traspaso asignado por la Cámara   |
| 794  | AllocReportType      | RptTyp      | S   | 15 = Give-up<br>16 = Take-up   | Int          |   |
| 87   | AllocStatus          | Stat        | S   | 5 = Rejected by intermediary<br>6 = Allocation pending<br>9 = Claimed<br>12 = Cancelled<br>13 = Pending take-up approval | Int          |   |
| 72   | RefAllocID           | RefID       | N   |  | String       | Presente cuando AllocTransType [71] = 2 (Cancel)  |
| 54   | Side                 | Side        | S   | 1 = Buy<br>2 = Sell  | Char         | Indica si la Operación a transferir es compradora o vendedora   |
| 53   | Quantity             | Qty         | S   |  | Qty          | Volumen de la Asignación Externa  |
| 6    | AvgPx                | AvgPx       | S   |  | Price        | Precio de la Operación  |
| 75   | TradeDate            | TrdDt       | S   |  | LocalMktDate | En asignaciones simples: Fecha de Contratación<br>En asignaciones múltiples: Fecha Teórica de Liquidación |
| 64   | SettlDate            | SettlDt     | N   |  | LocalMktDate | Fecha Teórica de Liquidación  |
| 381  | GrossTradeAmt        | GrossTrdAmt | N   |  | Amt          | Importe efectivo de la Asignación Externa   |
| 715  | ClearingBusinessDate | BizDt       | S   |  | LocalMktDate | Fecha de la sesión  |
| 716* | SettlSessID          | SetSesID    | N   | ITD = Intradía<br>EOD = Fin de sesión  | String       | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión   |

**CGIVEIN / AllocRpt / Hdr**

| TAG                                | NOMBRE           | FIXML        | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|------------------------------------|------------------|--------------|-----|--|---------------|---|
| 35                                 | MsgType          | MsgTyp       | S   | AS   | String        | Identifica el tipo de mensaje   |
| 49                                 | SenderCompID     | SID          | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"                                   |
| 56                                 | TargetCompID     | TID          | S   |  | String        | Contiene "????"   |
| 50                                 | SenderSubID      | SSub         | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC  |
| 52                                 | SendingTime      | Snt          | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero  |
| <b>CGIVEIN /AllocRpt/ OrdAlloc</b> |                  |              |     |  |               |   |
| →11                                | ClOrdID          | ClOrdID      | N   | [N/A]  | String        |   |
| →198                               | SecondaryOrderID | ClOrdID2     | N   |  | String        | Identificador único de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación |
| → 586*                             | OrigOrdModTime   | OrigOrdModTm | N   |  | UTCTimestamp  | Fecha y hora de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación        |
| → 1*                               | Account          | Acct         | N   |  | String        | Código de cliente introducido en la orden   |
| → 58*                              | Text             | Txt          | N   |  | String        | Si es una Operación procedente de una orden, contiene la Referencia asignada en la orden              |
| → 581*                             | AccountType      | AcctTyp      | N   | 1 – AOTC<br>3 – MTCH<br>4 – DEAL                   | Int           | Si es una Asignación de Cuenta Diaria o un Traspaso, contiene la Referencia de la Operación previa    |
| <b>CGIVEIN /AllocRpt/ AllExc</b>   |                  |              |     |  |               |   |
| →32                                | LastQty          | LastQty      | N   |  | Qty           | Indicador de capacidad  |
| 31                                 | LastPx           | LastPx       | S   |  | Price         | No está presente cuando OrdAllocGrp informado<br>(n times)  |
| →32                                | LastQty          | LastQty      | N   |  | Qty           | Volumen de la Operación   |
| 31                                 | LastPx           | LastPx       | S   |  | Price         | Precio de la Operación  |

| TAG   | NOMBRE           | FIXML     | REQ | VALORES VÁLIDOS  | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|---|------------------|-----------|-----|--|---------|--|
| à<br>1003                                   | TradelD          | TrdID     | N   |  | String  | Identificador de registro de la ECC de la nueva Operación<br>Sólo está presente cuando AllocStatus [87] = 9 (Claimed)  |
| →<br>1126*                                  | OrigTradelD      | OrigTrdID | N   |  | String  | Identificador de registro de la ECC de la Operación previa<br>Sólo está presente cuando el mensaje va destinado a los usuarios del Miembro que solicitó el traspaso  |
| 1300*                                       | MarketSegmentID  | MktSegID  | N   | Ver Tabla 5 del documento "Tablas de Codificación"   | String  | Código de Segmento de Negociación  |
| 880*  | TrdMatchID       | MtchID    | N   |  | String  | Número de registro de negociación de la Operación inicial  |
| <b>CGIVEIN /AllocRpt/ AllExc/ Stip*</b>     |                  |           |     |  |         |  |
| →→ 233*                                     | StipulationType  | Typ       | N   | TOPEM = Código de la ejecución<br>QTYM = Volumen de la ejecución<br>MEMM = Código del Miembro de la plataforma | String  |  |
| →→ 234*                                     | StipulationValue | Val       | N   |  | String  | Si StipulationType [233] = TOPEM, contiene el código de la ejecución en la plataforma de negociación<br>Si StipulationType [233] = QTYM, contiene el volumen de la ejecución en la plataforma de negociación<br>Si StipulationType [233] = MEMM, contiene el código de miembro de la ejecución en la plataforma de negociación |
| <b>CGIVEIN /AllocRpt/ AllExc/ MiscFees*</b> |                  |           |     |  |         |  |
| →→ 137*                                     | MiscFeeAmt       | Amt       | N   |  | Amt     | (1 time)<br>Corretaje de la Operación inicial  |
| →→ 139*                                     | MiscFeeType      | Typ       | N   | 12 = Agent   | String  |  |

| TAG                               | NOMBRE           | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS   | FORMATO    | DESCRIPCIÓN  |
|-----------------------------------|------------------|-------|-----|---|------------|--|
| <b>CGIVEIN /AllocRpt/ Instrmt</b> |                  |       |     |   |            |  |
| 55                                | Symbol           | Sym   | N   | [N/A]<br>o código de valor  | String(5)  |  |
| 48                                | SecurityID       | ID    | N   |   | String(12) | Código ISIN  |
| 22                                | SecurityIDSource | Src   | N   | 4 = ISIN number   | String     |  |
| <b>CGIVEIN /AllocRpt/ Pty</b>     |                  |       |     |   |            | (n times)  |
|                                   |                  |       |     |   |            | Si PartyRole[452]=11, contiene el código del usuario de la plataforma  |
|                                   |                  |       |     |   |            | Si PartyRole[452]=13, contiene el código del Miembro de la plataforma  |
|                                   |                  |       |     |   |            | Si PartyRole[452]=16, contiene el código de la plataforma  |
|                                   |                  |       |     |   |            | Si PartyRole[452]=12, contiene el usuario que inició la solicitud  |
| →<br>448                          | PartyID          | ID    | N   |   | String     | Si PartyRole[452]=36, contiene el usuario del Miembro Destino que realizó la aceptación o rechazo de la Asignación |
|                                   |                  |       |     |   |            | Si PartyRole[452]=95, contiene el Miembro Origen   |
|                                   |                  |       |     |   |            | Si PartyRole[452]=96, contiene el Miembro Destino  |
|                                   |                  |       |     |   |            | Si PartyRole[452]=98, contiene el Miembro Compensador de la Cuenta de Posición.                                    |
| →<br>447                          | PartyIDSource    | Src   | N   | D = Proprietary/<br>Custom code<br>11 = Order<br>Origination Trader | Char       |  |
| →<br>452                          | PartyRole        | R     | N   | 12 = Executing Trader<br>13 = Order<br>Origination Firm             | Int        | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID   |

| TAG | NOMBRE | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS                              | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|-----|--------|-------|-----|--|---------|---|
|     |        |       |     | 16 = Executing System (Código de plataforma) |         | El valor 11 está presente en los mensajes destinados al Miembro Destino, cuando OrdAllocGrp informado, informándole del código del usuario de la plataforma   |
|     |        |       |     | 36 = Clearing Broker Trader                  |         | El valor 13 está presente en los mensajes destinados al Miembro Destino, cuando OrdAllocGrp informado, informándole del código del Miembro de la plataforma   |
|     |        |       |     | 95 = Give-up Trading Firm                    |         | El valor 16 está presente en los mensajes destinados al Miembro Destino, cuando OrdAllocGrp informado, informándole del código de la plataforma   |
|     |        |       |     | 96= Take-up Trading Firm                     |         | El valor 12 está presente en los mensajes destinados a los usuarios del Miembro que realizó la solicitud de traspaso, así como a los usuarios del Miembro Destino de la Asignación si es el caso, informándoles del usuario que inició la solicitud |
|     |        |       |     | 98 = Take-up Clearing Firm                   |         | El valor 36, cuando esté presente, informa del usuario del Miembro Destino que realizó la aceptación o rechazo de una Asignación  |
|     |        |       |     |  |         | El valor 95 está presente en los mensajes destinados al Miembro Origen y al Miembro Destino de una Asignación informándoles del Miembro Origen  |

| TAG                             | NOMBRE       | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|---------------------------------|--------------|----------|-----|-----------------|---------|---|
|                                 |              |          |     |                 |         | El valor 96 está presente en todos los mensajes relacionados con Asignación Externa, informando del Miembro Destino   |
|                                 |              |          |     |                 |         | El valor 98 está presente en los mensajes destinados al Miembro Destino cuando el mensaje contiene una cuenta de posición en el campo AllocAccount [79], informándole del Miembro Compensador de dicha cuenta. Este valor también está presente en los mensajes enviados al Miembro Compensador |
| <b>CGIVEIN /AllocRpt/ Alloc</b> |              |          |     |                 |         | (1 time)  |
|                                 |              |          |     |                 |         | Cuenta de Posición Destino  |
| →<br>79                         | AllocAccount | Acct     | N   |                 | String  | En una Asignación Externa sólo se informa de este campo cuando se recibe el mensaje como Destino o Compensador (nunca como Origen). En cualquier otro caso contiene "[N/A]"   |
| →<br>80                         | AllocQty     | Qty      | N   |                 | Qty     | Volumen de la Asignación Externa. Debe ser igual al campo Quantity  |
| →<br>1729                       | FirmMnemonic | FirmMnem | N   |                 | String  | Cuando está presente, informa del Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm) o Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Destino (Take-up Trading Firm)  |
| →<br>161                        | AllocText    | Txt      | N   |                 | String  | Cuando está presente, informa de la Referencia de Asignación  |

| TAG       | NOMBRE            | FIXML   | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|-----------|-------------------|---------|-----|-----------------|---------|---|
| à<br>1732 | Firm<br>AllocText | FirmTxt | N   |                 | String  | Cuando está presente, informa de la Referencia de Asignación asignada por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm) para uso interno |

#### 7.4 Asignaciones Externas (Compensador de Miembro Destino)

| CGIVEINCLM.sc |   |
|---------------|---|
| Grupo         | Designación de la Cuenta de Posición  |
| Descripción   | Información de las Asignaciones Externas en que se participa como Compensador del Miembro Destino del segmento de RV. |
| Destinatarios | Miembro Compensador   |
| Privacidad    | Contiene datos privados   |
| Timing        | Disponible a fin de sesión.   |

| TAG                          | NOMBRE            | FIXML      | REQ | VALORES VÁLIDOS   | FORMATO    | DESCRIPCIÓN  |
|------------------------------|-------------------|------------|-----|---|------------|--|
| <b>CGIVEINCLM / AllocRpt</b> |                   |            |     |   |            | (n time)   |
| 755                          | AllocReportID     | RptID      | S   |   | String     | Identificador único para cada mensaje Allocation Report      |
| 70                           | AllocID           | ID         | N   |   | String(30) | Identificador del mensaje Allocation Instruction relacionado |
| 71                           | AllocTransType    | TransTyp   | S   | 0 = New<br>2 = Cancel   | Char       |  |
| 795                          | AllocReportRefID  | RptRefID   | N   |   | String     | Presente cuando AllocTransType [71] = 2 (Cancel)             |
| 796                          | AllocCancelReason | CxlRplcRsn | N   | 99 = Other  | Int        | Presente cuando AllocTransType [71] = 2 (Cancel)             |
| 793                          | SecondaryAllocID  | ID2        | N   |   | String     | Identificador único del traspaso asignado por la Cámara      |
| 794                          | AllocReportType   | RptTyp     | S   | 15 = Give-up<br>16 = Take-up  | Int        |  |
| 87                           | AllocStatus       | Stat       | S   | 5 = Rejected by intermediary<br>6 = Allocation pending<br>9 = Claimed<br>12 = Cancelled | Int        |  |

| TAG                                     | NOMBRE               | FIXML       | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|---|----------------------|-------------|-----|--|---------------|---|
|   |                      |             |     | 13 = Pending take-up approval                      |               |   |
| 72                                      | RefAllocID           | RefID       | N   |  | String        | Presente cuando AllocTransType [71] = 2 (Cancel)  |
| 54                                      | Side                 | Side        | S   | 1 = Buy<br>2 = Sell                                | Char          | Indica si la Operación a transferir es compradora o vendedora   |
| 53                                      | Quantity             | Qty         | S   |  | Qty           | Volumen de la Asignación Externa  |
| 6                                       | AvgPx                | AvgPx       | S   |  | Price         | Precio de la Operación  |
|   |                      |             |     |  |               | En asignaciones simples: Fecha de Contratación  |
| 75                                      | TradeDate            | TrdDt       | S   |  | LocalMktDate  | En asignaciones múltiples: Fecha Teórica de Liquidación   |
| 64                                      | SettIDate            | SettIDt     | N   |  | LocalMktDate  | Fecha Teórica de Liquidación  |
| 381                                     | GrossTradeAmt        | GrossTrdAmt | N   |  | Amt           | Importe efectivo de la Asignación Externa   |
| 715                                     | ClearingBusinessDate | BizDt       | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión  |
| 716*                                    | SettSessID           | SetSesID    | N   | ITD = Intradía<br>EOD = Fin de sesión              | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión   |
| <b>CGIVEINCLM / AllocRpt / Hdr</b>      |                      |             |     |  |               |   |
| 35                                      | MsgType              | MsgTyp      | S   | AS   | String        | Identifica el tipo de mensaje   |
| 49                                      | SenderCompID         | SID         | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"                                   |
| 56                                      | TargetCompID         | TID         | S   |  | String        | Contiene "????"   |
| 50                                      | SenderSubID          | SSub        | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC.   |
| 52                                      | SendingTime          | Snt         | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero  |
| <b>CGIVEINCLM / AllocRpt / OrdAlloc</b> |                      |             |     |  |               |   |
|   |                      |             |     |  |               | Bloque OrdAlloc enviado por el cliente  |
|   |                      |             |     |  |               | (1 time)  |
| →11                                     | ClOrdID              | ClOrdID     | N   | [N/A]  | String        |   |
| →198                                    | SecondaryOrderID     | ClOrdID2    | N   |  | String        | Identificador único de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación |

| TAG  | NOMBRE          | FIXML        | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO          | DESCRIPCIÓN   |
|--|-----------------|--------------|-----|--|------------------|---|
| à 586*                                     | OrigOrdModTime  | OrigOrdModTm | N   |  | UTCTimest<br>amp | Fecha y hora de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación  |
| → 1*                                       | Account         | Acct         | N   |  | String           | Código de cliente introducido en la orden<br>Si es una Operación procedente de una orden, contiene la Referencia asignada en la orden                               |
| → 58*                                      | Text            | Txt          | N   |  | String           | Si es una Asignación de Cuenta Diaria o un Traspaso, contiene la Referencia de la Operación previa  |
| → 581*                                     | AccountType     | AcctTyp      | N   | 1 - AOTC<br>3 - MTCH<br>4 - DEAL                   | Int              | Indicador de capacidad<br>No está presente cuando OrdAllocGrp informado<br>(n times)  |
| <b>CGIVEINCLM /AllocRpt/ AllExc</b>        |                 |              |     |  |                  |   |
| →32  | LastQty         | LastQty      | N   |  | Qty              | Volumen de la Operación   |
| 31   | LastPx          | LastPx       | S   |  | Price            | Precio de la Operación  |
| →<br>1003                                  | TradelID        | TrdID        | N   |  | String           | Identificador de registro de la ECC de la nueva Operación<br>Sólo está presente cuando AllocStatus [87] = 9 (Claimed)   |
| →<br>1126*                                 | OrigTradelID    | OrigTrdID    | N   |  | String           | Identificador de registro de la ECC de la Operación previa<br>Sólo está presente cuando el mensaje va destinado a los usuarios del Miembro que solicitó el traspaso |
| 1300*                                      | MarketSegmentID | MktSegID     | N   | Ver Tabla 5 del documento "Tablas de Codificación" | String           | Código de Segmento de Negociación   |
| 880*                                       | TrdMatchID      | MtchID       | N   |  | String           | Número de registro de negociación de la Operación inicial.  |
| <b>CGIVEINCLM /AllocRpt/ AllExc/ Stip*</b> |                 |              |     |  |                  |   |
| →→ 233*                                    | StipulationType | Typ          | N   | TOPEM<br>QTYM                                      | String           |   |

| TAG  | NOMBRE           | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS            | FORMATO    | DESCRIPCIÓN   |
|--|------------------|-------|-----|----------------------------|------------|---|
|  |                  |       |     | MEMM                       |            |   |
| →→ 234*  | StipulationValue | Val   | N   |                            | String     | <p>Si StipulationType [233] = TOPEM, contiene el código de la ejecución en la plataforma de negociación.</p> <p>Si StipulationType [233] = QTYM, contiene el volumen de la ejecución en la plataforma de negociación.</p> <p>Si StipulationType [233] = MEMM, contiene el código de miembro de la ejecución en la plataforma de negociación.</p>  |
| <b>CGIVEINCLM /AllocRpt/ AllExc/ MiscFees*</b> |                  |       |     |                            |            | (1 time)  |
| →→ 137*  | MiscFeeAmt       | Amt   | N   |                            | Amt        | Corretaje de la Operación inicial   |
| →→ 139*  | MiscFeeType      | Typ   | N   | 12 = Agent                 | String     |   |
| <b>CGIVEINCLM /AllocRpt/ Instrmt</b>           |                  |       |     |                            |            |   |
| 55   | Symbol           | Sym   | N   | [N/A]<br>o código de valor | String(5)  |   |
| 48   | SecurityID       | ID    | N   |                            | String(12) | Código ISIN   |
| 22   | SecurityIDSource | Src   | N   | 4 = ISIN number            | String     |   |
| <b>CGIVEINCLM /AllocRpt/ Pty</b>               |                  |       |     |                            |            | (n times)   |
| →<br>448                                       | PartyID          | ID    | N   |                            | String     | <p>Si PartyRole[452]=11, contiene el código del usuario de la plataforma</p> <p>Si PartyRole[452]=13, contiene el código del Miembro de la plataforma</p> <p>Si PartyRole[452]=16, contiene el código de la plataforma</p> <p>Si PartyRole[452]=12, contiene el usuario que inició la solicitud</p> <p>Si PartyRole[452]=36, contiene el usuario del Miembro Destino que realizó la aceptación o rechazo de la Asignación</p> |

| TAG      | NOMBRE        | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS  | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|----------|---------------|-------|-----|--|---------|--|
|          |               |       |     |  |         | <p>Si PartyRole[452]=95, contiene el Miembro Origen</p> <p>Si PartyRole[452]=96, contiene el Miembro Destino</p> <p>Si PartyRole[452]=98, contiene el Miembro Compensador de la Cuenta de Posición.</p>  |
| à<br>447 | PartyIDSource | Src   | N   | D = Proprietary/<br>Custom code  | Char    | <p>Indica el rol que toma el código especificado en PartyID</p> <p>El valor 11 está presente en los mensajes destinados al Miembro Destino, cuando OrdAllocGrp informado, informándole del código del usuario de la plataforma</p> <p>El valor 12 está presente en los mensajes destinados a los usuarios del Miembro que realizó la solicitud de traspaso, así como a los usuarios del Miembro Destino de la Asignación si es el caso, informándoles del usuario que inició la solicitud</p> <p>El valor 13 está presente en los mensajes destinados al Miembro Destino, cuando OrdAllocGrp informado, informándole del código del Miembro de la plataforma</p> <p>El valor 36, cuando esté presente, informa del usuario del Miembro Destino que realizó la aceptación o rechazo de una Asignación</p> |
| →<br>452 | PartyRole     | R     | N   | <p>11 = Order Origination Trader</p> <p>12 = Executing Trader</p> <p>13 = Order Origination Firm</p> <p>16 = Executing System (Código de plataforma)</p> <p>36 = Clearing Broker Trader</p> <p>95 = Give-up Trading Firm</p> <p>96= Take-up Trading Firm</p> <p>98 = Take-up Clearing Firm</p> | Int     |  |

| TAG                                | NOMBRE       | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|------------------------------------|--------------|-------|-----|-----------------|---------|---|
|                                    |              |       |     |                 |         | <p>El valor 95 está presente en los mensajes destinados al Miembro Origen y al Miembro Destino de una Asignación informándoles del Miembro Origen</p> <p>El valor 96 está presente en todos los mensajes relacionados con Asignación Externa, informando del Miembro Destino</p> <p>El valor 98 está presente en los mensajes destinados al Miembro Destino cuando el mensaje contiene una cuenta de posición en el campo AllocAccount [79], informándole del Miembro Compensador de dicha cuenta. Este valor también está presente en los mensajes enviados al Miembro Compensador</p> |
| <b>CGIVEINCLM /AllocRpt/ Alloc</b> |              |       |     |                 |         | (1 time)  |
| →<br>79                            | AllocAccount | Acct  | N   |                 | String  | <p>Cuenta de Posición Destino</p> <p>En una Asignación Externa sólo se informa de este campo cuando se recibe el mensaje como Destino o Compensador (nunca como Origen). En cualquier otro caso contiene "[N/A]"</p>  |
| →<br>80                            | AllocQty     | Qty   | N   |                 | Qty     | Volumen de la Asignación Externa. Debe ser igual al campo Quantity  |

| TAG       | NOMBRE            | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|-----------|-------------------|----------|-----|-----------------|---------|--|
| à<br>1729 | FirmMnemonic      | FirmMnem | N   |                 | String  | Cuando está presente, informa del Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm) del Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Destino (Take-up Trading Firm) |
| →<br>161  | AllocText         | Txt      | N   |                 | String  | Cuando está presente, informa de la Referencia de Asignación   |
| →<br>1732 | Firm<br>AllocText | FirmTxt  | N   |                 | String  | Cuando está presente, informa de la Referencia de Asignación asignada por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm) para uso interno  |

## 8 Rentención y Liberación de Operaciones

### 8.1 Retenciones/liberaciones realizadas

| <b>CHOLDRELEASE.sc</b> |   |
|------------------------|---|
| Grupo                  | Gestión de Operaciones para la Liquidación                                  |
| Descripción            | Retenciones / liberaciones realizadas durante la sesión del segmento de RV. |
| Destinatarios          | Entidad Participante que realiza las retenciones / liberaciones             |
| Privacidad             | Contiene datos privados   |
| Timing                 | Disponible a fin de sesión.   |

| TAG                                  | NOMBRE               | FIXML       | REQ | VALORES VÁLIDOS                       | FORMATO      | DESCRIPCIÓN  |
|--------------------------------------|----------------------|-------------|-----|---------------------------------------|--------------|--|
| <b>CHOLDRELEASE / AllocRpt</b>       |                      |             |     |                                       |              | (n times)  |
| 755                                  | AllocReportID        | RptID       | S   |                                       | String       | Identificador único para cada mensaje Allocation Report      |
| 70                                   | AllocID              | ID          | N   |                                       | String(30)   | Identificador del mensaje Allocation Instruction relacionado |
| 71                                   | AllocTransType       | TransTyp    | S   | 0 = New                               | Char         |  |
| 793                                  | SecondaryAllocID     | ID2         | N   |                                       | String       | Identificador único de la acción de Retención o Liberación   |
| 794                                  | AllocReportType      | RptTyp      | S   | 15 = Retener o Liberar una Operación  | Int          | Ver StipulationType [233] = RL                               |
| 87                                   | AllocStatus          | Stat        | S   | 9 = Claimed                           | Int          |  |
| 54                                   | Side                 | Side        | S   | 2 = Sell                              | Char         | La Operación a retener siempre es de venta                   |
| 53                                   | Quantity             | Qty         | S   |                                       | Qty          | Número de Valores retenidos/liberados                        |
| 6                                    | AvgPx                | AvgPx       | S   |                                       | Price        | Precio de la Operación                                       |
| 75                                   | TradeDate            | TrdDt       | S   |                                       | LocalMktDate | Fecha de Contratación  |
| 64                                   | SettleDate           | SettleDt    | N   |                                       | LocalMktDate | Fecha Teórica de Liquidación                                 |
| 381                                  | GrossTradeAmt        | GrossTrdAmt | N   |                                       | Amt          | Importe efectivo de la retención/liberación                  |
| 715                                  | ClearingBusinessDate | BizDt       | S   |                                       | LocalMktDate | Fecha de la sesión   |
| 716*                                 | SettleSessionID      | SetSesID    | N   | ITD = Intradía<br>EOD = Fin de sesión | String       | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión        |
| <b>CHOLDRELEASE / AllocRpt / Hdr</b> |                      |             |     |                                       |              |  |
| 35                                   | MsgType              | MsgTyp      | S   | AS                                    | String       | Identifica el tipo de mensaje                                |

| TAG                                    | NOMBRE           | FIXML   | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|--|------------------|---------|-----|--|---------------|---|
| 49                                     | SenderCompID     | SID     | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"   |
| 56                                     | TargetCompID     | TID     | S   |  | String        | Contiene "????"   |
| 50                                     | SenderSubID      | SSub    | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC  |
| 52                                     | SendingTime      | Snt     | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero  |
| <b>CHOLDRELEASE /AllocRpt/ AllExc</b>  |                  |         |     |  |               | (1 time)  |
| →32                                    | LastQty          | LastQty | N   |  | Qty           | Volumen de la Operación   |
| 31                                     | LastPx           | LastPx  | S   |  | Price         | Precio de la Operación  |
| →1003                                  | TradelID         | TrdID   | N   |  | String        | Identificador de registro de la ECC de la Operación a retener/liberar   |
| <b>CHOLDRELEASE /AllocRpt/ Instrmt</b> |                  |         |     |  |               |   |
| 55                                     | Symbol           | Sym     | N   | [N/A] o código de valor                            | String(5)     |   |
| 48                                     | SecurityID       | ID      | N   |  | String(12)    | Código ISIN   |
| 22                                     | SecurityIDSource | Src     | N   | 4 = ISIN number                                    | String        |   |
| <b>CHOLDRELEASE /AllocRpt/ Pty</b>     |                  |         |     |  |               | (n times)   |
|  |                  |         |     |  |               | Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC   |
|  |                  |         |     |  |               | Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC   |
| →448                                   | PartyID          | ID      | N   |  | String        | Si PartyRole[452]=38, contiene la Cuenta de Posición<br><br>Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante<br><br>Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación |
| →447                                   | PartyIDSource    | Src     | N   | D = Proprietary/<br>Custom code                    | Char          |   |
| →452                                   | PartyRole        | R       | N   | 1 = Executing Firm<br>4 = Clearing Firm            | Int           | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID.   |

| TAG                                  | NOMBRE           | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS  | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|--------------------------------------|------------------|-------|-----|--|---------|--|
|                                      |                  |       |     | 38 = Position Account<br>90 = Settlement Firm<br>91 = Settlement account |         |  |
| <b>CHOLDRELEASE /AllocRpt/ Stip</b>  |                  |       |     |  |         | (1 time)   |
| → 233                                | StipulationType  | Typ   | N   | RL = Retención / Liberación de Valores                                   | String  |  |
| → 234                                | StipulationValue | Val   | N   |  | String  | Los Valores posibles son:<br>• RO = Retención Operación<br>• LO = Liberación Operación |
| <b>CHOLDRELEASE /AllocRpt/ Alloc</b> |                  |       |     |  |         | (1 time)   |
| → 80                                 | AllocQty         | Qty   | N   |  | Qty     | Número de Valores retenidos/liberados. Debe ser igual al campo Quantity                |

## 8.2 Operaciones Retenidas

| <b>CHELDTRADES.sc</b> |   |
|-----------------------|---|
| Grupo                 | Gestión de Operaciones para la Liquidación  |
| Descripción           | Información de las Operaciones retenidas total o parcialmente del segmento de RV. |
| Destinatarios         | Entidad Participante, Miembro, Miembro Compensador                                |
| Privacidad            | Contiene datos privados   |
| Timing                | Disponible a fin de sesión.   |

| TAG                             | NOMBRE           | FIXML     | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|---------------------------------|------------------|-----------|-----|--|---------|---|
| <b>CHELDTRADES / TrdCaptRpt</b> |                  |           |     |  |         | (n times)   |
| 1003                            | TradeID          | TrdID     | N   |  | String  | Identificador de registro de la ECC. Este campo siempre está presente en el mensaje |
| 1040                            | SecondaryTradeID | TrdID2    | N   |  | String  | Contiene el identificador de registro de la ECC de la Operación inicial             |
| 828                             | TrdType          | TrdTyp    | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | Int     | Tipo de Operación FIX. Este valor es usado conjuntamente con TrdSubType [829]       |
| 829                             | TrdSubType       | TrdSubTyp | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | Int     | Este valor es usado conjuntamente con TrdType [828]                                 |

| TAG                                   | NOMBRE               | FIXML       | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO      | DESCRIPCIÓN  |
|---------------------------------------|----------------------|-------------|-----|--|--------------|--|
| 1126                                  | OrigTradelID         | OrigTrdID   | N   |  | String       | Contiene el identificador de registro de la ECC de la Operación previa   |
| 150                                   | ExecType             | ExecTyp     | N   | F = Trade  | Char         |  |
| 820                                   | TradelinkID          | LinkID      | N   |  | String       | Referencia original primaria de la Operación asignada por la ECC   |
| 880                                   | TrdMatchID           | MtchID      | N   |  | String       | Número de registro de negociación de la Operación inicial<br>Coincide con el campo TrdMatchID del mensaje Execution Report |
| 17                                    | ExecID               | ExecID      | N   |  | String       | Referencia original secundaria de la Operación asignada por la ECC   |
| 1300                                  | MarketSegmentID      | MktSegID    | N   | Ver Tabla 5 del documento "Tablas de Codificación" | String       | Código de Segmento de Negociación  |
| 32                                    | LastQty              | LastQty     | S   | >= 0, sin decimales                                | Qty          | Volumen de la Operación  |
| 151*                                  | LeavesQty            | LeavesQty   | N   |  | Qty          | Volumen vivo de la Operación   |
| 31                                    | LastPx               | LastPx      | S   |  | Price        | Precio de la Operación   |
| 15                                    | Currency             | Ccy         | N   |  | Currency     | Código de divisa. Expresada según estándar ISO 4217  |
| 75                                    | TradeDate            | TrdDt       | N   |  | LocalMktDate | Fecha de Contratación  |
| 60                                    | TransactTime         | TxnTm       | N   |  | UTCTimestamp | Fecha y hora, en formato UTC, en que se realizó la transacción.  |
| 64                                    | SettleDate           | SettleDt    | N   |  | LocalMktDate | Fecha Teórica de Liquidación   |
| 381                                   | GrossTradeAmt        | GrossTrdAmt | N   |  | Amt          | Importe Efectivo de la Operación   |
| 5681*                                 | ExchangeTradeType    | ExchTrdTyp  | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | String       | Tipo de Operación de la ECC  |
| 715                                   | ClearingBusinessDate | BizDt       | S   |  | LocalMktDate | Fecha de la sesión   |
| 716                                   | SettleSessID         | SetSesID    | N   | ITD = Intradía<br>EOD = Fin de sesión              | String       | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión  |
| <b>CHELDTRADES / TrdCaptRpt / Hdr</b> |                      |             |     |  |              |  |
| 35                                    | MsgType              | MsgTyp      | S   | AE   | String       | Identifica el tipo de mensaje  |
| 49                                    | SenderCompID         | SID         | S   |  | String       | Identificador de la entidad que envía el mensaje   |

| TAG   | NOMBRE              | FIXML   | REQ | VALORES VÁLIDOS  | FORMATO       | DESCRIPCIÓN  |
|---|---------------------|---------|-----|--|---------------|--|
|   |                     |         |     |  |               | Contiene "BMCL"  |
| 56  | TargetComp ID       | TID     | S   |  | String        | Contiene "????"  |
| 50  | SenderSubID         | SSub    | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"   | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC   |
| 52  | SendingTime         | Snt     | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero   |
| <b>CHELDTRADES /TrdCaptRpt/ Instrmt</b>           |                     |         |     |  |               |  |
| 55  | Symbol              | Sym     | N   | [N/A] o código de valor  | String(5)     |  |
| 48  | SecurityID          | ID      | N   |  | String(12)    | Código ISIN.   |
| 22  | SecurityIDSource    | Src     | N   | 4 = ISIN number  | String        |  |
| <b>CHELDTRADES /TrdCaptRpt/ Amt</b> (n times)     |                     |         |     |  |               |  |
| → 708   | PosAmt              | Amt     | N   |  | Amt           |  |
| → 1585  | PosAmtReason        | Rsn     | N   | 1000 = Importe Efectivo vivo de la Operación<br>1001 = Importe Efectivo de Valores retenidos | Int           |  |
| <b>CHELDTRADES /TrdCaptRpt/ TrdRegTS</b> (1 time) |                     |         |     |  |               |  |
| → 769   | TrdRegTimestamp     | TS      | N   |  | UTCTimestamp  | Día y hora de la Operación inicial en el Sistema de Negociación  |
| → 770   | TrdRegTimestampType | Typ     | N   | 3 = Time Out   | Int           |  |
| <b>CHELDTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide</b> (1 time)  |                     |         |     |  |               |  |
| → 54  | Side                | Side    | S   | 2 = Sell   | Char          | Siempre 1 ya que sólo se incluye la parte compradora o vendedora, según corresponda al destinatario del mensaje<br>Signo de la Operación |
| → 1   | Account             | Acct    | N   |  | String        | Código de cliente introducido en la orden  |
| → 581   | AccountType         | AcctTyp | N   | 1 - AOTC<br>3 - MTCH<br>4 - DEAL   | Int           | Indicador de capacidad   |
| → 77  | PositionEffect      | PosEfct | N   | "O" = Open"  |               |  |

| TAG   | NOMBRE          | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS                 | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|---|-----------------|-------|-----|---------------------------------|---------|---|
|   |                 |       |     |                                 |         | Si es una Operación procedente de una orden, contiene la Referencia asignada en la orden            |
| à 58  | Text            | Txt   | N   |                                 | String  | Si es una Asignación de Cuenta Diaria o un traspaso, contiene la Referencia de la Operación previa. |
| <b>CHELDTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ Pty</b>  |                 |       |     |                                 |         | (n times)   |
|   |                 |       |     |                                 |         | Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC                                       |
|   |                 |       |     |                                 |         | Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC                           |
| →→<br>448                                     | PartyID         | ID    | N   |                                 | String  | Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV  |
|   |                 |       |     |                                 |         | Si PartyRole[452]=38, contiene la Cuenta de Posición  |
|   |                 |       |     |                                 |         | Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante                                 |
|   |                 |       |     |                                 |         | Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación                                |
| →→<br>447                                     | PartyIDSource   | Src   | N   | D = Proprietary/<br>Custom code | Char    |   |
|   |                 |       |     | 1 = Executing Firm              |         |   |
|   |                 |       |     | 4 = Clearing Firm               |         |   |
|   |                 |       |     | 10 = CSD Code                   |         |   |
| →→<br>452                                     | PartyRole       | R     | N   | 38 = Position<br>Account        | Int     | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID.   |
|   |                 |       |     | 90 = Settlement<br>Firm         |         |   |
|   |                 |       |     | 91 = Settlement<br>account      |         |   |
| <b>CHELDTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ Stip</b> |                 |       |     |                                 |         | (n times)   |
| →→ 233  | StipulationType | Typ   | N   | TOPEM<br>QTYM<br>AMTM<br>NDAYSL | String  |   |

| TAG  | NOMBRE           | FIXML          | REQ | VALORES VÁLIDOS    | FORMATO      | DESCRIPCIÓN  |
|--|------------------|----------------|-----|--------------------|--------------|--|
| à→ 234   | StipulationValue | Val            | N   |                    | String       | <p>Para Operaciones de compraventa:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Si StipulationType [233] = TOPEM, contiene el código de la ejecución en la plataforma de negociación</li> <li>• Si StipulationType [233] = QTYM, contiene el volumen de la ejecución en la plataforma de negociación</li> <li>• Si StipulationType [233] = AMTM, contiene el importe efectivo de la ejecución en la plataforma de negociación</li> <li>• Si StipulationType [233] = NDAYS, contiene el número de días late</li> </ul> |
| <b>CHELDTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ TrdRptOrdDetl</b> |                  |                |     |                    |              | (1 time)   |
| →→ 198   | SecondaryOrderID | OrdID2         | N   |                    | String       | Identificador único de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación  |
| →→ 586   | OrigOrderModTime | OrigOrderModTm | N   |                    | UTCTimestamp | Fecha y hora de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación   |
| <b>CHELDTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ Qty</b>           |                  |                |     |                    |              | (n times)  |
| →→ 703   | PosType          | Typ            | N   | RCV                | String       | RCV indica los Valores retenidos por la Entidad Liquidadora  |
| →→ 705   | ShortQty         | Short          | N   | > 0, sin decimales | Qty          |  |

## 9 Comisiones

### 9.1 Comisiones Miembro Compensador

| CMONTHLYFEES.sc |  |
|-----------------|--|
| Grupo           | Comisiones   |
| Descripción     | Información de las comisiones a nivel de miembro compensador |
| Destinatarios   | Miembro Compensador del segmento de RV Y RF.                 |
| Privacidad      | Contiene datos privados                                      |
| Timing          | Estático, sólo está disponible al cierre de sesión           |

| TAG                                    | NOMBRE                 | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN  |
|--|------------------------|----------|-----|--|---------------|--|
| <b>CMONTHLYFEES / AcctSumRpt</b>       |                        |          |     |  | (n times)     |  |
| 1699                                   | AccountSummaryReportID | RptID    | S   |  | String        | Identificador único para cada mensaje Account Summary Report   |
| 715                                    | ClearingBusinessDate   | BizDt    | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión   |
| 716                                    | SettlementID           | SetSesID | N   | EOD = Fin de sesión                                | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión  |
| 15                                     | Currency               | Ccy      | N   |  | Currency      | Código de divisa en la que están expresados los importes de este mensaje. Expresada según estándar ISO 4217                                |
| <b>CMONTHLYFEES / AcctSumRpt / Hdr</b> |                        |          |     |  |               |  |
| 35                                     | MsgType                | MsgTyp   | S   | CQ   | String        | Identifica el tipo de mensaje  |
| 49                                     | SenderCompanyID        | SID      | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"  |
| 56                                     | TargetCompanyID        | TID      | S   |  | String        | Contiene "????"  |
| 50                                     | SenderSubID            | SSub     | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC.  |
| 52                                     | SendingTime            | Snt      | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero   |
| <b>CMONTHLYFEES /AcctSumRpt/ Pty</b>   |                        |          |     |  | (n times)     |  |
| →<br>448                               | PartyID                | ID       | N   |  | String        | Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC<br>Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC |

| TAG                                     | NOMBRE         | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS  | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|---|----------------|-------|-----|--|---------|--|
| →<br>447                                | PartyIDSource  | Src   | N   | D = Proprietary/<br>Custom code  | Char    | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID   |
| →<br>452                                | PartyRole      | R     | N   | 1 = Executing Firm<br>4 = Clearing Firm<br>38 = Position<br>Account  | Int     | Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador<br>Si PartyRole[452]=38, contiene el código de la Cuenta de Posición  |
| <b>CMONTHLYFEES /AcctSumRpt/ PayCol</b> |                |       |     |  |         | Movimientos de efectivo (n times)  |
| →1708                                   | PayCollectType | Typ   | N   | Facturable para el segmento RV:<br>20<br>21<br>22<br>24<br>25<br>Facturable para el segmento RF:<br>31<br>32<br>33<br>34<br>36<br>Ver Tabla 11 del documento "Tablas de Codificación"<br>Informativo: TT | String  | Depende del valor de PayCollectType [1708]:<br>20: Número de miembros para los que actúa como miembro compensador<br>21: Número de transacciones facturables del mes (teniendo en cuenta cap)<br>22: Número de cuentas de Posición facturables<br>24: Número de instrucciones de liquidación<br>25: Número de GUIs.<br>TT: Número de transacciones del mes |
| →53*                                    | Quantity       | Qty   | N   |  | Qty     |  |

| TAG    | NOMBRE                    | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO | DESCRIPCIÓN                  |
|--------|---------------------------|----------|-----|--|---------|------------------------------|
| → 1711 | CollectAmount             | PayAmt   | N   |  | Amt     | Importe de la comisión       |
| →1712  | PayCollectMarketSegmentID | MktSegID | N   | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String  | Código de Segmento de la ECC |
| →1713  | PayCollectMarketID        | MktID    | N   | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación" | String  | Código de la ECC             |

## 9.2 Comisiones Colateral

| CCOLLATERALFEES.co |   |
|--------------------|---|
| Grupo              | Comisiones  |
| Descripción        | Detalle del cálculo de la remuneración del colateral en efectivo y la tarifa sobre el colateral en valores. |
| Destinatarios      | Miembro, Miembro Compensador  |
| Privacidad         | Contiene datos privados   |
| Timing             | Estático, sólo está disponible al cierre de sesión  |

| TAG                                    | NOMBRE               | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|--|----------------------|----------|-----|--|---------------|---|
| <b>CCOLLATERALFEES / CollRpt</b>       |                      |          |     |  | (n times)     |   |
| 908                                    | CollRptID            | RptID    | S   |  | String        | Identificador único para cada mensaje Collateral Report   |
| 910                                    | CollStatus           | Stat     | S   | 3 = Assigned (Accepted)                            |               |   |
| 15                                     | Currency             | Ccy      | N   |  | Currency      | Código de divisa en la que están expresados los importes de este mensaje. Expresada según estándar ISO 4217 |
| 715                                    | ClearingBusinessDate | BizDt    | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión  |
| 716                                    | SettlSessionID       | SetSesID | N   | EOD = Fin de sesión                                | String        | Indica que es un fichero de final de sesión   |
| <b>CCOLLATERALFEES / CollRpt / Hdr</b> |                      |          |     |  |               |   |
| 35                                     | MsgType              | MsgTyp   | S   | BA   | String        | Identifica el tipo de mensaje   |
| 49                                     | SenderCompID         | SID      | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"   |
| 56                                     | TargetCompID         | TID      | S   |  | String        | Contiene "????"   |
| 50                                     | SenderSubID          | SSub     | S*  | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Código de la ECC  |
| 52                                     | SendingTime          | Snt      | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero  |
| <b>CCOLLATERALFEES / CollRpt/ Pty</b>  |                      |          |     |  |               | (n times)   |

| TAG  | NOMBRE           | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS   | FORMATO    | DESCRIPCIÓN   |
|--|------------------|----------|-----|---|------------|---|
| → 448  | PartyID          | ID       | N   |   | String     | <p>Si PartyRole[452]=49, contiene el código del Miembro al que pertenece la Cuenta de Colateral</p> <p>Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC</p> <p>Si PartyRole[452]=101, contiene la Cuenta de Colateral</p> <p>Si PartyRole[452]=22, contiene el código de Segmento de la ECC</p> <p>Si PartyRole[452]= 112, contiene el origen del colateral. Cuando el colateral sea de la propia cuenta se mostrará la misma cuenta de colateral. Cuando sea de una cuenta buffer, se mostrará el código de la cuenta buffer.</p> |
| → 447  | PartyIDSource    | Src      | N   | D = Proprietary/ Custom code  | Char       |   |
| → 452  | PartyRole        | R        | N   | 49 = Collateral Firm (código de Miembro de la ECC)<br>4 = Clearing Firm<br>101 = Collateral Account<br>22 = Segmento<br>112 = Collateral Source Account | Int        | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID.   |
| <b>CCOLLATERALFEES /CollRpt/ Instrmt</b>       |                  |          |     |   |            |   |
| 55   | Symbol           | Sym      | N   | [N/A] o código del activo   | String(5)  |   |
| 48   | SecurityID       | ID       | N   |   | String(12) | Código del activo entregado.  |
| 22   | SecurityIDSource | Src      | N   | 4 = ISIN number   | String     |   |
| 543  | InstrRegistry    | Rgstry   | N   | Ver Tabla 13, para colateral en valores, o Tabla 18, para efectivo del documento "Tablas de Codificación".  | String     | Código del Depositario Central del activo en el que está constituida la Garantía o del Banco en el que está depositado el efectivo.   |
| <b>CCOLLATERALFEES /CollRpt/ Instrmt/ Evnt</b> |                  |          |     |   |            |   |
| →865   | EventType        | EventTyp | N   | 204 = Nominal   |            |   |
| →868   | EventText        | Txt      | N   |   | String     | Contiene el valor nominal del colateral total asignado a la cuenta (n times)  |
| <b>CCOLLATERALFEES /CollRpt/ Stip</b>          |                  |          |     |   |            |   |
| → 233  | StipulationType  | Typ      | N   | MARGIN_INST<br>CCY_REINVESTMENT_IND<br>ACC_REINVESTMENT_IND   | String     |   |

| TAG   | NOMBRE           | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS   | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|-------|------------------|-------|-----|---|---------|--|
|       |                  |       |     | SPREAD<br>ADD_ON_SPREAD<br>REF_RATE_NAME<br>REF_RATE<br>CASH_RATE<br>TREASURY_FEE_AMT<br>NON_CASH_COL_FEE<br>NON_CASH_COL_FEE_AMT |         |  |
|       |                  |       |     |   |         | Si StipulationType [233] = MARGIN_INST indica el modo de materialización de Garantías. Ver Tabla 12 del documento "Tablas de Codificación"   |
|       |                  |       |     |   |         | Si StipulationType [233] = CCY_REINVESTMENT_IND Indica si es posible o no optar por reinvertir el colateral en efectivo depositado en la divisa y CSD_Code de este registro. Valores posibles:<br>"S"=Yes<br>"N"=No  |
|       |                  |       |     |   |         | Si StipulationType [233] = ACC_REINVESTMENT_IND Indica si el miembro compensador ha optado por reinvertir o no el colateral en efectivo depositado en la cuenta colateral correspondiente, cuando sea posible. Valores posibles:<br>"S"=Yes<br>"N"=No  |
| → 234 | StipulationValue | Val   | N   |   | String  | Si StipulationType [233] = SPREAD indica el Spread aplicado al cálculo de la remuneración del colateral en efectivo, expresado en puntos básicos.<br>Si StipulationType [233] = ADD_ON_SPREAD indica el Spread add-on aplicado al cálculo de la remuneración del colateral en efectivo, expresado en puntos básicos.<br>Si StipulationType [233] = REF_RATE_NAME indica el nombre del índice de referencia para el cálculo de la remuneración del colateral en efectivo. |

| TAG | NOMBRE | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|-----|--------|-------|-----|-----------------|---------|---|
|     |        |       |     |                 |         | <p>Si StipulationType [233] = REF_RATE indica el valor del índice de referencia utilizado para el cálculo de la remuneración del colateral en efectivo.</p> <p>Si StipulationType [233] = CASH_RATE indica la Tasa utilizada para el cálculo de la remuneración del colateral en efectivo. (Reference Rate + Spread + Spread add-on).</p> <p>Si StipulationType [233] = TREASURY_FEE_AMT indica el Importe de remuneración del colateral depositado en efectivo.</p> <p>Si StipulationType [233] = NON_CASH_COL_FEE indica la Tarifa sobre el colateral en valores, expresado en puntos básicos</p> <p>Si StipulationType [233] = NON_CASH_COL_FEE_AMT indica el Importe de la tarifa sobre el colateral en valores, expresada en la divisa del activo.</p> |

## 10 Garantías Depositadas

### 10.1 Detalle de Garantías Depositadas

|               | CPLEDGES.cc  |
|---------------|--|
| Grupo         | Garantías Depositadas  |
| Descripción   | Valoración de los activos depositados en la Cuenta de Colateral como Garantía en la fecha de la sesión, detalladas por activo del segmento de RV y RF. |
| Destinatarios | Miembro, Miembro Compensador   |
| Privacidad    | Contiene datos privados  |
| Timing        | Disponible a inicio y fin de sesión. Dinámico: pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros   |

| TAG                             | NOMBRE               | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN  |
|---------------------------------|----------------------|----------|-----|--|---------------|--|
| <b>CPLEDGES / CollRpt</b>       |                      |          |     |  | (n times)     |  |
| 908                             | CollRptID            | RptID    | S   |  | String        | Identificador único para cada mensaje Collateral Report  |
| 910                             | CollStatus           | Stat     | S   | 3 = Assigned (Accepted)                            |               |  |
| 15                              | Currency             | Ccy      | N   |  | Currency      | Código de divisa en la que están expresados los importes de este mensaje está expresado el importe efectivo. Expresada según estándar ISO 4217 |
| 715                             | ClearingBusinessDate | BizDt    | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión   |
| 716                             | SettSessID           | SetSesID | N   | ITD = Intradía EOD = Fin de sesión                 | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión  |
| <b>CPLEDGES / CollRpt / Hdr</b> |                      |          |     |  |               |  |
| 35                              | MsgType              | MsgTyp   | S   | BA   | String        | Identifica el tipo de mensaje  |
| 49                              | SenderCompID         | SID      | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"  |
| 56                              | TargetCompID         | TID      | S   |  | String        | Contiene "????"  |
| 50                              | SenderSubID          | SSub     | S*  | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Código de la ECC   |
| 52                              | SendingTime          | Snt      | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero   |
| <b>CPLEDGES / CollRpt / Pty</b> |                      |          |     |  | (n times)     |  |

| TAG                                     | NOMBRE               | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS  | FORMATO    | DESCRIPCIÓN   |
|---|----------------------|----------|-----|--|------------|---|
| à 448                                   | PartyID              | ID       | N   |  | String     | Si PartyRole[452]=49, contiene el código del Miembro al que pertenece la Cuenta de Colateral<br>Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC<br>Si PartyRole[452]=101, contiene la Cuenta de Colateral   |
| → 447                                   | PartyIDSour<br>ce    | Src      | N   | D = Proprietary/<br>Custom code  | Char       |   |
| → 452                                   | PartyRole            | R        | N   | 49 = Collateral Firm<br>(código de Miembro de la ECC)<br>4 = Clearing Firm<br>101 = Collateral Account     | Int        | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID<br>Si PartyRole[452]= 49, contiene el código de Miembro al que pertenece la Cuenta de Colateral. Cuando está presente, la información se da a nivel de Miembro No Compensador<br>Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador<br>Si PartyRole[452]= 101, contiene el código de la Cuenta de Colateral<br>Cuando está presente, la información se da a nivel de Cuenta de Colateral |
| <b>CPLEDGES /CollRpt/ Instrmt</b>       |                      |          |     |  |            |   |
| 55                                      | Symbol               | Sym      | N   | [N/A]<br>o código del activo entregado   | String(5)  |   |
| 48                                      | SecurityID           | ID       | N   |  | String(12) | Código ISIN   |
| 22                                      | SecurityIDSo<br>urce | Src      | N   | 4 = ISIN number  | String     |   |
| 543                                     | InstrRegistry        | Rgstry   | N   | Ver Tabla 13, para colateral en valores, o Tabla 18, para efectivo del documento "Tablas de Codificación". | String     | Código del Depositario Central del activo en el que está constituida la Garantía o del Banco en el que está depositado el efectivo.   |
| <b>CPLEDGES /CollRpt/ Instrmt/ Evnt</b> |                      |          |     |  |            |   |
| →865                                    | EventType            | EventTyp | N   | 204 = Nominal  |            | (1 time)  |

| TAG                            | NOMBRE           | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS   | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|--------------------------------|------------------|-------|-----|---|---------|---|
| à868                           | EventText        | Txt   | N   |   | String  | Valor nominal del activo entregado<br>En caso de acciones es el número de títulos   |
| <b>CPLEDGES /CollRpt/ Stip</b> |                  |       |     |   |         | (n times)   |
| →233                           | StipulationType  | Typ   | N   | MARGIN_INST<br>ASSET_TYPE<br>HAIRCUT<br>ASSET_PRICE<br>ASSET_VALUE<br>NOMINAL_CURRENCY<br>EXCHANGE_RATE | String  | Si StipulationType [233] = MARGIN_INST indica el modo de materialización de Garantías. Ver Tabla 12 del documento "Tablas de Codificación"<br>Si StipulationType [233] = ASSET_TYPE indica el tipo de activo entregado. Ver Tabla 14 del documento "Tablas de Codificación"<br>Si StipulationType [233] = HAIRCUT indica el coeficiente que se aplica al precio en la valoración del activo (en tanto por ciento) |
| → 234                          | StipulationValue | Val   | N   |   | String  | Si StipulationType [233] = ASSET_PRICE indica el precio del activo al cierre. Para los bonos y obligaciones incluye cupón corrido<br>Si StipulationType [233] = ASSET_VALUE indica el valor del activo: (Nominal * precio * haircut) / Tipo de cambio.<br>Si StipulationType [233] = NOMINAL_CURRENCY indica la divisa en la que está expresado el Nominal. Expresada según estándar ISO 4217                     |

| TAG | NOMBRE | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|-----|--------|-------|-----|-----------------|---------|--|
|     |        |       |     |                 |         | Si StipulationType [233] = EXCHANGE_RATE indica el Tipo de cambio aplicable. |

## 10.2 Previsión del colateral asignado a cada cuenta de colateral para la siguiente sesión

| CALLOCAS.cd   |   |
|---------------|---|
| Grupo         | Garantías Depositadas   |
| Descripción   | Previsión del colateral asignado a cada cuenta de colateral incluyendo los movimientos de colateral en efectivo consecuencia de la liquidación multilateral que resulte del cierre de la sesión actual. |
| Destinatarios | Miembro, Miembro Compensador  |
| Privacidad    | Contiene datos privados   |
| Timing        | Estático, sólo está disponible al cierre de sesión  |

| TAG                             | NOMBRE               | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                    | FORMATO      | DESCRIPCIÓN  |
|---------------------------------|----------------------|----------|-----|------------------------------------|--------------|--|
| <b>CALLOCAS / CollRpt</b>       |                      |          |     |                                    | (n times)    |  |
| 908                             | CollRptID            | RptID    | S   |                                    | String       | Identificador único para cada mensaje Collateral Report  |
| 910                             | CollStatus           | Stat     | S   | 3 = Assigned (Accepted)            |              |  |
| 15                              | Currency             | Ccy      | N   |                                    | Currency     | Código de divisa en la que están expresados los importes de este mensaje está expresado el importe efectivo. Expresada según estándar ISO 4217 |
| 715                             | ClearingBusinessDate | BizDt    | S   |                                    | LocalMktDate | Fecha de la sesión   |
| 716                             | SettlSessID          | SetSesID | N   | ITD = Intradía EOD = Fin de sesión | String       | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión  |
| 64                              | SettlDate            | SettlDt  | N   |                                    | String       | Fecha valor de los asignados (siguiente día hábil a la fecha sesión).  |
| <b>CALLOCAS / CollRpt / Hdr</b> |                      |          |     |                                    |              |  |
| 35                              | MsgType              | MsgTyp   | S   | BA                                 | String       | Identifica el tipo de mensaje  |
| 49                              | SenderCompID         | SID      | S   |                                    | String       | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"  |
| 56                              | TargetCompID         | TID      | S   |                                    | String       | Contiene "????"  |

| TAG                               | NOMBRE        | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS                                       | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|-----------------------------------|---------------|-------|-----|---|---------------|---|
| 50                                | SenderSubID   | SSub  | S*  | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"    | String        | Código de la ECC  |
| 52                                | SendingTime   | Snt   | S   |   | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero  |
| <b>CALLOCAS /CollRpt/ Pty</b>     |               |       |     |   |               | (n times)   |
|                                   |               |       |     |   |               | Si PartyRole[452]=49, contiene el código del Miembro al que pertenece la Cuenta de Colateral  |
|                                   |               |       |     |   |               | Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC   |
|                                   |               |       |     |   |               | Si PartyRole[452]=101, contiene la Cuenta de Colateral  |
| →<br>448                          | PartyID       | ID    | N   |   | String        | Si PartyRole[452]=22, contiene el código de Segmento de la ECC  |
|                                   |               |       |     |   |               | Si PartyRole[452]= 112, contiene el origen del colateral. Cuando el colateral sea de la propia cuenta se mostrará la misma cuenta de colateral. Cuando sea de una cuenta buffer, se mostrará el código de la cuenta buffer. |
| →<br>447                          | PartyIDSource | Src   | N   | D = Proprietary/<br>Custom code                       | Char          |   |
|                                   |               |       |     | 49 = Collateral Firm<br>(código de Miembro de la ECC) |               |   |
|                                   |               |       |     | 4 = Clearing Firm                                     |               |   |
| →<br>452                          | PartyRole     | R     | N   | 101 = Collateral<br>Account                           | Int           | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID.   |
|                                   |               |       |     | 22 = Segmento   |               |   |
|                                   |               |       |     | 112 = Collateral Source<br>Account                    |               |   |
| <b>CALLOCAS /CollRpt/ Instrmt</b> |               |       |     |   |               |   |
| 55                                | Symbol        | Sym   | N   | [N/A]<br>o código del activo                          | String(5)     |   |

| TAG                                     | NOMBRE           | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS   | FORMATO    | DESCRIPCIÓN  |
|---|------------------|----------|-----|---|------------|--|
| 48                                      | SecurityID       | ID       | N   |   | String(12) | Código del activo entregado.   |
| 22                                      | SecurityIDSource | Src      | N   | 4 = ISIN number   | String     |  |
| 543                                     | InstrRegistry    | Rgstry   | N   | Ver Tabla 13, para colateral en valores, o Tabla 18, para efectivo del documento "Tablas de Codificación".                              | String     | Código del Depositario Central del activo en el que está constituida la Garantía o del Banco en el que está depositado el efectivo.  |
| <b>CALLOCAS /CollRpt/ Instrmt/ Evnt</b> |                  |          |     |   |            | (n times)  |
| →865                                    | EventType        | EventTyp | N   | 204 = Nominal<br>205 = Nominal Requerido<br>206 = Nominal en Exceso   |            | Si EventType = 204, contiene el valor nominal del colateral total asignado a la cuenta<br><br>Si EventType = 205, contiene el valor nominal del colateral requerido asignado a la cuenta<br><br>Si EventType = 206, contiene el valor nominal del colateral en exceso asignado a la cuenta.<br><br>En caso de acciones es el número de títulos |
| →868                                    | EventText        | Txt      | N   |   | String     |  |
| <b>CALLOCAS /CollRpt/ Stip</b>          |                  |          |     |   |            | (n times)  |
| →233                                    | StipulationType  | Typ      | N   | MARGIN_INST<br>ASSET_TYPE<br>HAIRCUT<br>ASSET_PRICE<br>ASSET_VALUE<br>ASSET_VALREQ<br>ASSET_VALEXC<br>NOMINAL_CURRENCY<br>EXCHANGE_RATE | String     |  |
| à 234                                   | StipulationValue | Val      | N   |   | String     | Si StipulationType [233] = MARGIN_INST indica el modo de materialización de Garantías. Ver Tabla 12 del documento "Tablas de Codificación"   |

| TAG | NOMBRE | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|-----|--------|-------|-----|-----------------|---------|--|
|     |        |       |     |                 |         | <p>Si StipulationType [233] = ASSET_TYPE indica el tipo de activo. Ver Tabla 14 del documento "Tablas de Codificación"</p> <p>Si StipulationType [233] = HAIRCUT indica el coeficiente que se aplica al precio en la valoración del activo (en tanto por ciento)</p> <p>Si StipulationType [233] = ASSET_PRICE indica el precio del activo al cierre. Para los bonos y obligaciones incluye cupón corrido</p> <p>Si StipulationType [233] = ASSET_VALUE indica la valoración del colateral total asignado a la cuenta <math>(\text{Nominal} * \text{precio} * \text{haircut}) / \text{Tipo de cambio}</math>.</p> <p>Si StipulationType [233] = ASSET_VALREQ indica la valoración del colateral requerido asignado a la cuenta <math>(\text{Nominal} * \text{precio} * \text{haircut}) / \text{Tipo de cambio}</math>.</p> <p>Si StipulationType [233] = ASSET_VALEXC indica la valoración del colateral en exceso asignado a la cuenta <math>(\text{Nominal} * \text{precio} * \text{haircut}) / \text{Tipo de cambio}</math>.</p> <p>Si StipulationType [233] = NOMINAL_CURRENCY indica la divisa en la que está expresado el Nominal. Expresada según estándar ISO 4217</p> <p>Si StipulationType [233] = EXCHANGE_RATE indica el Tipo de cambio aplicable.</p> |

### 10.3 Colateral asignado a cada cuenta de colateral

|               | CALLOCBS.cd   |
|---------------|---|
| Grupo         | Garantías Depositadas   |
| Descripción   | Distribución y valoración del colateral asignado a cada cuenta de colateral a cierre de sesión. |
| Destinatarios | Miembro, Miembro Compensador  |
| Privacidad    | Contiene datos privados   |
| Timing        | Estático, sólo está disponible al cierre de sesión  |

| TAG                             | NOMBRE               | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN  |
|---------------------------------|----------------------|----------|-----|--|---------------|--|
| <b>CALLOCBS / CollRpt</b>       |                      |          |     |  | (n times)     |  |
| 908                             | CollRptID            | RptID    | S   |  | String        | Identificador único para cada mensaje Collateral Report  |
| 910                             | CollStatus           | Stat     | S   | 3 = Assigned (Accepted)                            |               |  |
| 15                              | Currency             | Ccy      | N   |  | Currency      | Código de divisa en la que están expresados los importes de este mensaje está expresado el importe efectivo. Expresada según estándar ISO 4217 |
| 715                             | ClearingBusinessDate | BizDt    | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión   |
| 716                             | SettlSessID          | SetSesID | N   | ITD = Intradía EOD = Fin de sesión                 | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión  |
| 64                              | SettlDate            | SettlDt  | N   |  | String        | Fecha valor de los asignados (sesión en curso, ClearingBusinessDate).  |
| <b>CALLOCBS / CollRpt / Hdr</b> |                      |          |     |  |               |  |
| 35                              | MsgType              | MsgTyp   | S   | BA   | String        | Identifica el tipo de mensaje  |
| 49                              | SenderCompID         | SID      | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"  |
| 56                              | TargetCompID         | TID      | S   |  | String        | Contiene "????"  |
| 50                              | SenderSubID          | SSub     | S*  | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Código de la ECC   |
| 52                              | SendingTime          | Snt      | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero   |
| <b>CALLOCBS /CollRpt/ Pty</b>   |                      |          |     |  |               | (n times)  |

| TAG                               | NOMBRE           | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS   | FORMATO    | DESCRIPCIÓN   |
|-----------------------------------|------------------|-------|-----|---|------------|---|
|                                   |                  |       |     |   |            | Si PartyRole[452]=49, contiene el código del Miembro al que pertenece la Cuenta de Colateral  |
|                                   |                  |       |     |   |            | Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC   |
|                                   |                  |       |     |   |            | Si PartyRole[452]=101, contiene la Cuenta de Colateral  |
| →<br>448                          | PartyID          | ID    | N   |   | String     | Si PartyRole[452]=22, contiene el código de Segmento de la ECC<br><br>Si PartyRole[452]= 112, contiene el origen del colateral. Cuando el colateral sea de la propia cuenta se mostrará la misma cuenta de colateral. Cuando sea de una cuenta buffer, se mostrará el código de la cuenta buffer. |
| →<br>447                          | PartyIDSource    | Src   | N   | D = Proprietary/ Custom code  | Char       |   |
|                                   |                  |       |     | 49 = Collateral Firm (código de Miembro de la ECC)  |            |   |
| →<br>452                          | PartyRole        | R     | N   | 4 = Clearing Firm<br>101 = Collateral Account<br>22 = Segmento<br>112 = Collateral Source Account | Int        | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID.   |
| <b>CALLOCBS /CollRpt/ Instrmt</b> |                  |       |     |   |            |   |
| 55                                | Symbol           | Sym   | N   | [N/A] o código del activo   | String(5)  |   |
| 48                                | SecurityID       | ID    | N   |   | String(12) | Código del activo entregado.  |
| 22                                | SecurityIDSource | Src   | N   | 4 = ISIN number   | String     |   |

| TAG                                    | NOMBRE           | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS   | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|--|------------------|----------|-----|---|---------|--|
| 543                                    | InstrRegistry    | Rgstry   | N   | Ver Tabla 13, para colateral en valores, o Tabla 18, para efectivo del documento "Tablas de Codificación".                              | String  | Código del Depositario Central del activo en el que está constituida la Garantía o del Banco en el que está depositado el efectivo.        |
| <b>CALLOCBS /CollRpt/ Instrmt/ Evt</b> |                  |          |     |   |         | (n times)  |
| →865                                   | EventType        | EventTyp | N   | 204 = Nominal<br>205 = Nominal Requerido<br>206 = Nominal en Exceso   |         | Si EventType = 204, contiene el valor nominal del colateral total asignado a la cuenta   |
| →868                                   | EventText        | Txt      | N   |   | String  | Si EventType = 205, contiene el valor nominal del colateral requerido asignado a la cuenta   |
|  |                  |          |     |   |         | Si EventType = 206, contiene el valor nominal del colateral en exceso asignado a la cuenta.  |
|  |                  |          |     |   |         | En caso de acciones es el número de títulos  |
| <b>CALLOCBS /CollRpt/ Stip</b>         |                  |          |     |   |         | (n times)  |
| →233                                   | StipulationType  | Typ      | N   | MARGIN_INST<br>ASSET_TYPE<br>HAIRCUT<br>ASSET_PRICE<br>ASSET_VALUE<br>ASSET_VALREQ<br>ASSET_VALEXC<br>NOMINAL_CURRENCY<br>EXCHANGE_RATE | String  | Si StipulationType [233] = MARGIN_INST indica el modo de materialización de Garantías. Ver Tabla 12 del documento "Tablas de Codificación" |
| → 234                                  | StipulationValue | Val      | N   |   | String  | Si StipulationType [233] = ASSET_TYPE indica el tipo de activo. Ver Tabla 14 del documento "Tablas de Codificación"                        |

| TAG | NOMBRE | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|-----|--------|-------|-----|-----------------|---------|---|
|     |        |       |     |                 |         | <p>Si StipulationType [233] = HAIRCUT indica el coeficiente que se aplica al precio en la valoración del activo (en tanto por ciento)</p> <p>Si StipulationType [233] = ASSET_PRICE indica el precio del activo al cierre. Para los bonos y obligaciones incluye cupón corrido</p> <p>Si StipulationType [233] = ASSET_VALUE indica la valoración del colateral total asignado a la cuenta <math>(\text{Nominal} * \text{precio} * \text{haircut}) / \text{Tipo de cambio}</math>.</p> <p>Si StipulationType [233] = ASSET_VALREQ indica la valoración del colateral requerido asignado a la cuenta <math>(\text{Nominal} * \text{precio} * \text{haircut}) / \text{Tipo de cambio}</math>.</p> <p>Si StipulationType [233] = ASSET_VALEXC indica la valoración del colateral en exceso asignado a la cuenta <math>(\text{Nominal} * \text{precio} * \text{haircut}) / \text{Tipo de cambio}</math>.</p> <p>Si StipulationType [233] = NOMINAL_CURRENCY indica la divisa en la que está expresado el Nominal. Expresada según estándar ISO 4217</p> <p>Si StipulationType [233] = EXCHANGE_RATE indica el Tipo de cambio aplicable.</p> |

## 11 Resultados a nivel de Cuenta

### 11.1 Saldo neto y saldo agregado por Fecha Teórica de Liquidación

| <b>CBALANCEBYDATE.sc</b> |   |
|--------------------------|---|
| Grupo                    | Datos para Cálculo de Garantías   |
| Descripción              | <p>Información del saldo de compraventas por:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Cuenta de Posición, Valor, Fecha de Contratación y Fecha de Liquidación (sólo aquellas que tienen saldo) para RV, y</li> <li>- Cuenta de Posición, Valor y Fecha de Liquidación (sólo aquellas que tienen saldo) para RF.</li> </ul> <p>Para cuentas de posición netas se informa del saldo neto comprador o vendedor; para cuentas de posición brutas (para RV) se da el saldo agregado de compras y ventas. Información del saldo vendedor retenido para operaciones de RV. También se informa de la posición de Ajustes pendientes de liquidar por Eventos Corporativos, así como de las posiciones de efectivo pendientes de liquidar del segmento de RV y RF.</p> |
| Destinatarios            | Miembro, Miembro Compensador, Entidad Participante  |
| Privacidad               | Contiene datos privados   |
| Timing                   | Disponible durante la sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros en cualquier momento  |

| TAG                                  | NOMBRE               | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                       | FORMATO      | DESCRIPCIÓN  |
|--------------------------------------|----------------------|----------|-----|---------------------------------------|--------------|--|
| <b>CBALANCEBYDATE / PosRpt</b>       |                      |          |     |                                       |              | (n times)  |
| 721                                  | PosMaintRptID        | RptID    | S   |                                       | String       | Identificador único para cada mensaje Position Report                              |
| 715                                  | ClearingBusinessDate | BizDt    | S   |                                       | LocalMktDate | Fecha de la sesión   |
| →<br>64                              | SettlDate            | SettlDt  | N   |                                       | LocalMktDate | Fecha Teórica de Liquidación   |
| 716                                  | SettlSessID          | SetSesID | N   | ITD = Intradía<br>EOD = Fin de sesión | String       | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión                              |
| 15                                   | Currency             | Ccy      | N   |                                       | Currency     | Código de divisa<br>Expresada según estándar ISO 4217                              |
| 58                                   | Text                 | Txt      | N   |                                       | String       | Sólo para RF, contiene el Tipo de SFT:<br>B: Simultánea<br>R: Repo<br>N: No aplica |
| <b>CBALANCEBYDATE / PosRpt / Hdr</b> |                      |          |     |                                       |              |  |
| 35                                   | MsgType              | MsgTyp   | S   | AP                                    | String       | Identifica el tipo de mensaje  |
| 49                                   | SenderComPID         | SID      | S   |                                       | String       | Identificador de la entidad que envía el mensaje                                   |

| TAG                                    | NOMBRE        | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN  |
|--|---------------|-------|-----|--|---------------|--|
|  |               |       |     |  |               | Contiene "BMCL"  |
| 56                                     | TargetCompID  | TID   | S   |  | String        | Contiene "????"  |
| 50                                     | SenderSubID   | SSub  | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC                             |
| 52                                     | SendingTime   | Snt   | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero                                       |
| <b>CBALANCEBYDATE /PosRpt/ Pty</b>     |               |       |     |  |               | (n times)  |
|  |               |       |     |  |               | Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC        |
|  |               |       |     |  |               | Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador       |
|  |               |       |     |  |               | Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV                     |
| →<br>448                               | PartyID       | ID    | S   |  | String        | Si PartyRole[452]=38, contiene el código de la Cuenta de Posición    |
|  |               |       |     |  |               | Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante  |
|  |               |       |     |  |               | Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación |
| →<br>447                               | PartyIDSource | Src   | S   | D = Proprietary/<br>Custom code                    | Char          |  |
|  |               |       |     | 1 = Executing Firm                                 |               |  |
|  |               |       |     | 4 = Clearing Firm                                  |               |  |
|  |               |       |     | 10 = CSD code                                      |               |  |
| →<br>452                               | PartyRole     | R     | S   | 38 = Position<br>Account                           | Int           | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID             |
|  |               |       |     | 90 = Settlement<br>Firm                            |               |  |
|  |               |       |     | 91 = Settlement<br>account                         |               |  |
| <b>CBALANCEBYDATE /PosRpt/ Instrmt</b> |               |       |     |  |               |  |
| 55                                     | Symbol        | Sym   | N   | [N/A]<br>o código de valor                         | String(5)     |  |
| →1639*                                 | MarginClass   | Cls   | N   |  | String        | Grupo de compensación del activo.<br>Aplica al segmento de RF.       |

| TAG                                | NOMBRE           | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS                                | FORMATO    | DESCRIPCIÓN  |
|------------------------------------|------------------|-------|-----|--|------------|--|
| 48                                 | SecurityID       | ID    | N   |  | String(12) | Código ISIN  |
| 22                                 | SecurityIDSource | Src   | N   | 4 = ISIN number                                | String     |  |
| <b>CBALANCEBYDATE /PosRpt/ Qty</b> |                  |       |     |  |            | (n times)  |
|                                    |                  |       |     |  |            | NET indica la posición neta de compraventas pendiente de liquidar para cada fecha de liquidación.  |
|                                    |                  |       |     |  |            | GRS indica la posición bruta de compraventas pendiente de liquidar para cada fecha de liquidación Sólo aplica al Segmento de RV              |
|                                    |                  |       |     |  |            | RCV indica la posición retenida (short) para cada fecha de liquidación. Sólo aplica al Segmento de RV  |
| →<br>703                           | PosType          | Typ   | N   | NET<br>GRS<br>RCV<br>TRF<br>CAA<br>PNTN<br>DLV | String     | TRF indica la posición fallida para cada fecha de liquidación  |
|                                    |                  |       |     |  |            | CAA indica la posición debida a Ajustes por Eventos para cada fecha  |
|                                    |                  |       |     |  |            | PNTN indica la posición debida a operaciones especiales con fecha de contratación igual a la fecha de sesión. Sólo aplica al Segmento de RV. |
|                                    |                  |       |     |  |            | DLV indica la posición prevista por entrega en las fechas de vencimiento de futuros y opciones. Sólo aplica al Segmento de RV                |
| →<br>704                           | LongQty          | Long  | N   | >= 0, sin decimales                            | Qty        | Indica el número de Valores / Nominal que conforman el saldo de recepción de valores asociado al tipo indicado en el campo PosType [703]     |

| TAG                                | NOMBRE       | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS                                      | FORMATO     | DESCRIPCIÓN  |
|------------------------------------|--------------|-------|-----|--|-------------|--|
| à<br>705                           | ShortQty     | Short | N   | > 0, sin decimales                                   | Qty         | Indica el número de Valores / Nominal que conforman el saldo de entrega de valores asociado al tipo indicado en el campo PosType [703] |
| →<br>976                           | QuantityDate | QtyDt | N   |  | LocalMkDate | Fecha de Contratación<br>Sólo aplica al Segmento de RV   |
| <b>CBALANCEBYDATE /PosRpt/ Amt</b> |              |       |     |  |             | (n times)  |
| →<br>708                           | PosAmt       | Amt   | N   |  | Amt         | Puede ser negativo en función del resultado de la compensación en cuentas de Posición netas  |
| →<br>707                           | PosAmtType   | Typ   | N   | NET<br>GRS<br>RCV<br>TRF<br>CAA<br>PNTN<br>DLV<br>PA | String      | Mismos comentarios que para PosType[703] en grupo Qty<br><br>PA indica posiciones en efectivo pendientes de liquidar                   |

| TAG       | NOMBRE       | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS  | FORMATO      | DESCRIPCIÓN  |
|-----------|--------------|-------|-----|--|--------------|--|
|           |              |       |     | 1001 = Importe Efectivo de compras (posición asociada a LongQty)                             |              |  |
|           |              |       |     | 1002 = Importe Efectivo de ventas (posición asociada a ShortQty)                             |              |  |
|           |              |       |     | 1005 = Valor actual del efectivo de compras (posición asociada a LongQty)                    |              |  |
| à<br>1585 | PosAmtReason | Rsn   | N   | Aplica al segmento de RF   | Int          |  |
|           |              |       |     | 1006 = Valor actual del efectivo (posición asociada a ShortQty).<br>Aplica al segmento de RF |              |  |
|           |              |       |     | 1050 = Efectivos pendientes de liquidar  |              |  |
| → 75*     | TradeDate    | TrdDt | N   |  | LocalMktDate | Fecha de Contratación. Sólo aplica al Segmento de RV |

## 11.2 Detalle del cálculo de Garantía Diaria (Garantía por Posición)

| CMARGINCALC.sc |  |
|----------------|--|
| Grupo          | Resultados a nivel de Cuenta de Garantías  |
| Descripción    | Detalle del cálculo de Garantías a nivel de Cuenta de Garantías del segmento de RV y RF. |
| Destinatarios  | Miembro, Miembro Compensador   |
| Privacidad     | Contiene datos privados  |
| Timing         | Estático, sólo está disponible al cierre de sesión                                       |

| TAG                         | NOMBRE        | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO   | DESCRIPCIÓN   |
|-----------------------------|---------------|-------|-----|-----------------|-----------|---|
| <b>CMARGINCALC / PosRpt</b> |               |       |     |                 | (n times) |   |
| 721                         | PosMaintRptID | RptID | S   |                 | String    | Identificador único para cada mensaje Position Report |

| TAG                               | NOMBRE               | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|-----------------------------------|----------------------|----------|-----|--|---------------|---|
| 715                               | ClearingBusinessDate | BizDt    | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión  |
| 716                               | SettlSessionID       | SetSesID | N   | EOD = Fin de sesión                                | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión   |
| 730                               | SettlPrice           | SetPx    | S*  |  |               | Precio de cierre  |
| 15                                | Currency             | Ccy      | N   |  | Currency      | Código de divisa<br>Expresada según estándar ISO 4217   |
| <b>CMARGINCALC / PosRpt / Hdr</b> |                      |          |     |  |               |   |
| 35                                | MsgType              | MsgTyp   | S   | AP   | String        | Identifica el tipo de mensaje   |
| 49                                | SenderCompanyID      | SID      | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"   |
| 56                                | TargetCompanyID      | TID      | S   |  | String        | Contiene "????"   |
| 50                                | SenderSubID          | SSub     | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC  |
| 52                                | SendingTime          | Snt      | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero  |
| <b>CMARGINCALC /PosRpt/ Pty</b>   |                      |          |     |  |               |   |
| →<br>448                          | PartyID              | ID       | S   |  | String        | (n times)<br>Si PartyRole[452]= 15, contiene el código del Miembro de la Cuenta de Garantías<br>Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador<br>Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV<br>Si PartyRole[452]= 100, contiene el código de la Cuenta de Garantías<br>Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante<br>Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación |
| →<br>447                          | PartyIDSource        | Src      | S   | D = Proprietary/<br>Custom code                    | Char          |   |
| →<br>452                          | PartyRole            | R        | S   | 15 = Margin Firm<br>4 = Clearing Firm              | Int           | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID  |

| TAG                                 | NOMBRE            | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS  | FORMATO    | DESCRIPCIÓN  |
|-------------------------------------|-------------------|-------|-----|--|------------|--|
|                                     |                   |       |     | 10 = CSD Code  |            |  |
|                                     |                   |       |     | 100 = Margin Account                                     |            |  |
|                                     |                   |       |     | 90 = Settlement Firm                                     |            |  |
|                                     |                   |       |     | 91 = Settlement account                                  |            |  |
| <b>CMARGINCALC /PosRpt/ Instrmt</b> |                   |       |     |  |            |  |
| 55                                  | Symbol            | Sym   | N   | [N/A] o código de valor                                  | String(5)  |  |
| →1639*                              | MarginClass       | Clss  | N   |  | String     | Grupo de compensación del activo. Aplica al segmento de RF   |
| 48                                  | SecurityID        | ID    | N   |  | String(12) | Código ISIN  |
| 22                                  | SecurityID Source | Src   | N   | 4 = ISIN number  | String     |  |
| <b>CMARGINCALC /PosRpt/ Qty</b>     |                   |       |     |  |            | (n times)  |
|                                     |                   |       |     |  |            | Escenario o Concepto de riesgo aplicables al segmento de RV.   |
|                                     |                   |       |     |  |            | PIT indica escenario 1 por compraventas (incluyendo todas las operaciones pendientes de liquidar)  |
|                                     |                   |       |     |  |            | TA indica escenario 2 por compraventas (excluyendo las operaciones con fecha teórica de liquidación D y D+1)   |
| →703                                | PosType           | Typ   | N   | PIT<br>TA<br>ETR<br>TQ<br>RCV<br>TRF<br>CAA<br>IES<br>TB | String     | ETR indica escenario 3 por compraventas (excluyendo operaciones especiales con Fecha de Contratación igual a la Fecha de Sesión)   |
|                                     |                   |       |     |  |            | TQ indica escenario 4 por compraventas (excluyendo las operaciones con fecha teórica de liquidación d y D+1, así como las operaciones especiales con Fecha de Contratación igual a la Fecha de Sesión. |

| TAG | NOMBRE | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|-----|--------|-------|-----|-----------------|---------|---|
|     |        |       |     |                 |         | <p>RCV indica la posición retenida (short) para cada fecha de liquidación</p> <p>TRF indica la posición fallida</p> <p>CAA indica la posición debida a Ajustes</p> <p>IES indica la posición de Valores en compraventas netas en el peor escenario después de aplicar las compensaciones entre Valores.</p>   |
|     |        |       |     |                 |         | <p>Escenario o Concepto de riesgo para el segmento de Renta Fija:</p> <p>PIT indican escenario 1 del segmento de RF por compraventas (incluyendo todas las operaciones pendientes de liquidar)</p> <p>TB indica escenario 2 del segmento de RF por compraventas (excluyendo las operaciones con fecha teórica de liquidación D)</p> <p>TA indica escenario 3 del segmento de RF por compraventas (excluyendo las operaciones con fecha teórica de liquidación D y D+1).</p> <p>TRF indica la posición fallida.</p> <p>IES indica la posición de Valores en compraventas netas en el peor escenario después de aplicar las compensaciones entre Valores.</p> |

| TAG                             | NOMBRE       | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS   | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|---------------------------------|--------------|-------|-----|---|---------|--|
| à<br>704                        | LongQty      | Long  | N   | >= 0, sin decimales   | Qty     | Indica el número de Valores / Nominal que conforman el saldo de recepción de valores   |
| →<br>705                        | ShortQty     | Short | N   | > 0, sin decimales  | Qty     | Indica el número de Valores / Nominal que conforman el saldo de entrega de valores   |
| <b>CMARGINCALC /PosRpt/ Amt</b> |              |       |     |   |         | (n times)  |
| →<br>708                        | PosAmt       | Amt   | N   |   | Amt     | Puede ser negativo en función del resultado de la compensación en cuentas netas  |
| →<br>707                        | PosAmtType   | Typ   | N   | PIT<br>TA<br>ETR<br>TQ<br>RCV<br>TRF<br>CAA<br>IES<br>PA<br>TOT   | String  | Mismos comentarios que en campo PosType[703] del grupo Qty<br><br>PA indica posiciones en efectivo pendientes de liquidar<br><br>TOT incluirá las garantías totales por cuenta y valor   |
| →<br>1585                       | PosAmtReason | Rsn   | N   | 1001 = Importe Efectivo de compras (posición asociada a LongQty)<br>1002 = Importe Efectivo de ventas (posición asociada a ShortQty)<br>1003 = Valor de mercado compras<br>1004 = Valor de mercado ventas.<br>1005 = Valor actual del efectivo de compra. (posición asociada a LongQty)<br>1006 = Valor actual del efectivo de ventas (posición asociada a ShortQty)<br>1020: Initial Margin antes de compensar (cuentas netas)1021: Initial Margin final | Int     | Los Valores 1001 y 1002 se corresponden a los importes efectivos de las operaciones asociadas a los volúmenes especificados en LongQty y ShortQty<br><br>Los valores 1003 y 1004 se corresponden con las valoraciones de mercado asociadas a los volúmenes especificados en LongQty y ShortQty<br><br>Para el segmento de RV:<br><br>Los valores 1020, 1021, 1022 corresponden con Initial Margin y Variation Margin (VM = 1001-1002-1003+1004)<br><br>Para el segmento de RF: |

| TAG | NOMBRE | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS                     | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|-----|--------|-------|-----|-------------------------------------|---------|--|
|     |        |       |     | 1022 = Variation Margin             |         | Los Valores 1005 y 1006 se corresponden a los importes efectivos de las operaciones asociadas a los volúmenes especificados en LongQty y ShorQty<br><br>Los valores 1020, 1021, 1022 corresponden con Initial Margin y Variation Margin (VM = 1003-1004-1005+1006) |
|     |        |       |     | 1050: Posiciones Efectivo           |         |  |
|     |        |       |     | 1060: Garantía por Posición Exigida |         |  |

### 11.3 Garantías por Cuenta de Garantías

| CACCOUNTSETTL.sc |   |
|------------------|---|
| Grupo            | Resultados a nivel de Cuenta de Garantías   |
| Descripción      | Importes de Garantías por Posición por Cuenta de Garantías del segmento de RV y RF. |
| Destinatarios    | Miembro, Miembro Compensador  |
| Privacidad       | Contiene datos privados   |
| Timing           | Estático, sólo está disponible al cierre de sesión                                  |

| TAG                                     | NOMBRE                 | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS     | FORMATO      | DESCRIPCIÓN   |
|---|------------------------|----------|-----|---------------------|--------------|---|
| <b>CACCOUNTSETTL / AcctSumRpt</b>       |                        |          |     |                     | (n times)    |   |
| 1699                                    | AccountSummaryReportID | RptID    | S   |                     | String       | Identificador único para cada mensaje Account Summary Report  |
| 715                                     | ClearingBusinessDate   | BizDt    | S   |                     | LocalMktDate | Fecha de la sesión  |
| 716                                     | SettlSessionID         | SetSesID | N   | EOD = Fin de sesión | String       | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión   |
| 15                                      | Currency               | Ccy      | N   |                     | Currency     | Código de divisa en la que están expresados los importes de este mensaje. Expresada según estándar ISO 4217 |
| <b>CACCOUNTSETTL / AcctSumRpt / Hdr</b> |                        |          |     |                     |              |   |
| 35                                      | MsgType                | MsgTyp   | S   | CQ                  | String       | Identifica el tipo de mensaje   |
| 49                                      | SenderCompanyID        | SID      | S   |                     | String       | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"   |
| 56                                      | TargetCompanyID        | TID      | S   |                     | String       | Contiene "????"   |

| TAG                                      | NOMBRE                      | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS   | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|--|-----------------------------|----------|-----|---|---------------|---|
| 50                                       | SenderSubID                 | SSub     | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"            | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC  |
| 52                                       | SendingTime                 | Snt      | S   |   | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero  |
| <b>CAccountSettl /AcctSumRpt/ MgnAmt</b> |                             |          |     |   |               | Importes de Garantía (n times)  |
| →1645                                    | MarginAmt                   | Amt      | N   |   | Amt           | Importe Garantía  |
| →1644                                    | MarginAmtType               | Typ      | N   | 201   | Int           | 201 - Garantía por Posición   |
| →1714                                    | MarginAmountMarketSegmentID | MktSegID | N   | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"            | String        | Código de Segmento de la ECC  |
| →1715                                    | MarginAmountMarketID        | MktID    | N   | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"            | String        | Código de la ECC  |
| <b>CAccountSettl /AcctSumRpt/ Pty</b>    |                             |          |     |   |               | (n times)   |
|  |                             |          |     |   |               | Si PartyRole[452]= 15, contiene el código del Miembro al que pertenece la Cuenta de Garantías   |
| →448                                     | PartyID                     | ID       | N   |   | String        | Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC<br><br>Si PartyRole[452]= 100, contiene la Cuenta   |
| →447                                     | PartyIDSource               | Src      | N   | D = Proprietary/ Custom code                                  | Char          | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID  |
| →452                                     | PartyRole                   | R        | N   | 15 = Margin Firm<br>4 = Clearing Firm<br>100 = Margin Account | Int           | Si PartyRole[452]= 15, contiene el código de Miembro al que pertenece la Cuenta de Garantías<br><br>Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador<br><br>Si PartyRole[452]= 100 contiene el código de la Cuenta de Garantías |

## 11.4 Garantías por Cuenta de Colateral

| CACCOUNTSETTLCCP.cc |   |
|---------------------|---|
| Grupo               | Resultados a nivel de Cuenta de Colateral   |
| Descripción         | Importes de Garantías por Posición y Garantías Depositadas por Cuenta de Colateral en la ECC. |
| Destinatarios       | Miembro, Miembro Compensador  |
| Privacidad          | Contiene datos privados   |
| Timing              | Estático, sólo está disponible al cierre de sesión  |

| TAG   | NOMBRE                 | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|---|------------------------|----------|-----|--|---------------|---|
| <b>CACCOUNTSETTLCCP / AcctSumRpt</b>          |                        |          |     |  |               | (n times)   |
| 1699  | AccountSummaryReportID | RptID    | S   |  | String        | Identificador único para cada mensaje Account Summary Report  |
| 715   | ClearingBusinessDate   | BizDt    | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión  |
| 716   | SettlementID           | SetSesID | N   | EOD = Fin de sesión                                | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión   |
| 15  | Currency               | Ccy      | N   |  | Currency      | Código de divisa en la que están expresados los importes de este mensaje. Expresada según estándar ISO 4217 |
| <b>CACCOUNTSETTLCCP / AcctSumRpt / Hdr</b>    |                        |          |     |  |               |   |
| 35  | MessageType            | MsgTyp   | S   | CQ   | String        | Identifica el tipo de mensaje   |
| 49  | SenderCompanyID        | SID      | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"   |
| 56  | TargetCompanyID        | TID      | S   |  | String        | Contiene "????"   |
| 50  | SenderSubID            | SSub     | S*  | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Código de la ECC  |
| 52  | SendingTime            | Snt      | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero  |
| <b>CACCOUNTSETTLCCP / AcctSumRpt / MgnAmt</b> |                        |          |     |  |               | Importes de Garantía<br>(n times)   |
| →1645   | MarginAmount           | Amt      | N   |  | Amt           | Importe Garantía  |
| →1644   | MarginAmountType       | Typ      | N   | 201  | Int           | 201 - Garantía por Posición   |
| →1715   | MarginAmountMarketID   | MktID    | N   | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Código de la ECC  |
| <b>CACCOUNTSETTLCCP / AcctSumRpt / Pty</b>    |                        |          |     |  |               | (n times)   |

| TAG  | NOMBRE                   | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS   | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|--|--------------------------|-------|-----|---|---------|---|
| à 448  | PartyID                  | ID    | N   |   | String  | Si PartyRole[452]=49, contiene el código del Miembro al que pertenece la Cuenta de Colateral<br>Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC<br>Si PartyRole[452]=101, contiene la Cuenta de Colateral |
| → 447  | PartyIDSource            | Src   | N   | D = Proprietary/<br>Custom code                                       | Char    | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID  |
| → 452  | PartyRole                | R     | N   | 49 = Collateral Firm<br>4 = Clearing Firm<br>101 = Collateral Account | Int     | Si PartyRole[452]=49, contiene el código de Miembro al que pertenece la Cuenta de Colateral<br>Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador<br>Si PartyRole[452]=101 contiene el código de la Cuenta de Colateral |
| <b>CACCOUNTSETTLCCP /AcctSumRpt/ CollAmt</b> |                          |       |     |   |         | Garantías depositadas (n times)   |
| →1706  | CollateralType           | Typ   | S   | Ver Tabla 12 del documento "Tablas de Codificación"                   | String  | Tipo de Garantía Depositada   |
| →1704  | CurrentCollateralAmount  | Amt   | S   |   | Amt     | Importe de la Garantía Depositada   |
| →2093  | CollateralAmountMarketID | MktID | N   | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"                    | String  | Código de la ECC  |
| <b>CACCOUNTSETTLCCP /AcctSumRpt/ PayCol</b>  |                          |       |     |   |         | Movimientos de efectivo (n times)   |
| →1708  | PayCollectType           | Typ   | N   |   | String  | Tipo de importe del Movimiento de Efectivo<br>En este caso será el importe de las Garantías   |

| TAG   | NOMBRE             | FIXML  | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|-------|--------------------|--------|-----|--|---------|---|
| à1710 | PayAmount          | PayAmt | N   |  | Amt     | Diferencia entre la garantía exigida por posición y las garantías depositadas |
| →1713 | PayCollectMarketID | MktID  | N   | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación" | String  | Código de la ECC  |

## 11.5 Información de las Pruebas Retrospectivas

| <b>CBACKTESTING.sc</b> |   |
|------------------------|---|
| Grupo                  | Resultados a nivel de Cuenta de Garantías   |
| Descripción            | Importes por cuenta de Garantías de los resultados de pruebas retrospectivas de los segmentos de RV y RF. |
| Destinatarios          | Miembro, Miembro Compensador  |
| Privacidad             | Contiene datos privados   |
| Timing                 | Estático, sólo está disponible al cierre de sesión  |

| TAG                                     | NOMBRE                 | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|---|------------------------|----------|-----|--|---------------|---|
| <b>CBACKTESTING / AcctSumRpt</b>        |                        |          |     |  | (n times)     |   |
| 1699                                    | AccountSummaryReportID | RptID    | S   |  | String        | Identificador único para cada mensaje Account Summary Report  |
| 715                                     | ClearingBusinessDate   | BizDt    | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión  |
| 716                                     | SettlSessionID         | SetSesID | N   | EOD = Fin de sesión                                | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión   |
| 15                                      | Currency               | Ccy      | N   |  | Currency      | Código de divisa en la que están expresados los importes de este mensaje. Expresada según estándar ISO 4217 |
| <b>CBACKTESTING / AcctSumRpt / Hdr</b>  |                        |          |     |  |               |   |
| 35                                      | MsgType                | MsgTyp   | S   | CQ   | String        | Identifica el tipo de mensaje   |
| 49                                      | SenderCompanyID        | SID      | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"   |
| 56                                      | TargetCompanyID        | TID      | S   |  | String        | Contiene "????"   |
| 50                                      | SenderSubID            | SSub     | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC  |
| 52                                      | SendingTime            | Snt      | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero  |
| <b>CBACKTESTING /AcctSumRpt/ MgnAmt</b> |                        |          |     |  |               | Importes de Garantía  |

| TAG                                  | NOMBRE                      | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO | DESCRIPCIÓN<br>(n times)   |
|--------------------------------------|-----------------------------|----------|-----|--|---------|--|
| à1645                                | MarginAmount                | Amt      | N   |  | Amt     | Importe asociado a MarginAmtType[1644]   |
| →1644                                | MarginAmtType               | Typ      | N   | 301<br>302<br>303<br>304<br>305<br>306             | Int     | 301: Valor actual de la posición: valor de la posición de la sesión que se está analizando al precio de cierre de la sesión actual.<br>302: Initial Margin de la sesión que se está analizando.<br>303: Máxima Pérdida<br>304: Pérdida no cubierta por el Initial Margin<br>305: Pérdida a 1 día<br>306: Pérdida a 2 días. |
| →1714                                | MarginAmountMarketSegmentID | MktSegID | N   | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String  | Código de Segmento de la ECC   |
| →1715                                | MarginAmountMarketID        | MktID    | N   | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación" | String  | Código de la ECC   |
| <b>CBACKTESTING /AcctSumRpt/ Pty</b> |                             |          |     |  |         | (n times)  |
| →448                                 | PartyID                     | ID       | N   |  | String  | Si PartyRole[452]= 15, contiene el código de Miembro al que pertenece la Cuenta de Garantías<br><br>Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador<br><br>Si PartyRole[452]= 100, contiene el código de la Cuenta de Garantías   |
| →447                                 | PartyIDSource               | Src      | N   | D = Proprietary/<br>Custom code                    | Char    | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID<br><br>15 = Margin Firm<br>4 = Clearing Firm  |
| →452                                 | PartyRole                   | R        | N   | 100 = Margin Account                               | Int     | Si PartyRole[452]= 15, contiene el código de Miembro al que pertenece la Cuenta de Garantías<br><br>Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador   |

| TAG | NOMBRE | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|-----|--------|-------|-----|-----------------|---------|--|
|     |        |       |     |                 |         | Si PartyRole[452]= 100, contiene el código de la Cuenta de Garantías |

## 11.6 Información de las Pruebas de Resistencia

| CSTRESSTESTING.sc |   |
|-------------------|---|
| Grupo             | Resultados a nivel de Cuenta de Garantías   |
| Descripción       | Importes por cuenta de Garantías de los resultados de pruebas de resistencia del segmento de RV y RF. |
| Destinatarios     | Miembro, Miembro Compensador  |
| Privacidad        | Contiene datos privados   |
| Timing            | Estático, sólo está disponible al cierre de sesión  |

| TAG                                       | NOMBRE                 | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|---|------------------------|----------|-----|--|---------------|---|
| <b>CSTRESSTESTING / AcctSumRpt</b>        |                        |          |     |  | (n times)     |   |
| 1699                                      | AccountSummaryReportID | RptID    | S   |  | String        | Identificador único para cada mensaje Account Summary Report  |
| 715                                       | ClearingBusinessDate   | BizDt    | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión  |
| 716                                       | SettlementID           | SetSesID | N   | EOD = Fin de sesión                                | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión   |
| 15  | Currency               | Ccy      | N   |  | Currency      | Código de divisa en la que están expresados los importes de este mensaje. Expresada según estándar ISO 4217   |
| <b>CSTRESSTESTING / AcctSumRpt / Hdr</b>  |                        |          |     |  |               |   |
| 35  | MsgType                | MsgTyp   | S   | CQ   | String        | Identifica el tipo de mensaje   |
| 49  | SenderCompanyID        | SID      | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"   |
| 56  | TargetCompanyID        | TID      | S   |  | String        | Contiene "????"   |
| 50  | SenderSubID            | SSub     | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC  |
| 52  | SendingTime            | Snt      | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero  |
| <b>CSTRESSTESTING /AcctSumRpt/ MgnAmt</b> |                        |          |     |  |               | Importes de Garantía (n times)  |
| →1645                                     | MarginAmt              | Amt      | N   |  | Amt           | Importe asociado a MarginAmtType[1644]  |
| →1644                                     | MarginAmtType          | Typ      | N   | 311<br>312<br>313<br>314                           | Int           | 311: Peor escenario del Miembro Compensador<br>312: Garantía exigida con parámetros peor escenario<br>313: Garantía por posición<br>314: Riesgo en situación de Stress Test |

| TAG                                    | NOMBRE                      | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS   | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|--|-----------------------------|----------|-----|---|---------|--|
| à1714                                  | MarginAmountMarketSegmentID | MktSegID | N   | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"            | String  | Código de Segmento de la ECC   |
| →1715                                  | MarginAmountMarketID        | MktID    | N   | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"            | String  | Código de la ECC   |
| <b>CSTRESSTESTING /AcctSumRpt/ Pty</b> |                             |          |     |   |         | (n times)  |
| →448                                   | PartyID                     | ID       | N   |   | String  | Si PartyRole[452]= 15, contiene el código de Miembro al que pertenece la Cuenta de Garantías<br>Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador<br>Si PartyRole[452]= 100, contiene el código de la Cuenta de Garantías |
| →447                                   | PartyIDSource               | Src      | N   | D = Proprietary/<br>Custom code                               | Char    | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID   |
| →452                                   | PartyRole                   | R        | N   | 15 = Margin Firm<br>4 = Clearing Firm<br>100 = Margin Account | Int     | Si PartyRole[452]= 15, contiene el código de Miembro al que pertenece la Cuenta de Garantías<br>Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador<br>Si PartyRole[452]= 100, contiene el código de la Cuenta de Garantías |

## 11.7 Detalle por cuenta de colateral de los Movimientos de efectivo

| <b>CCASHMOVBRKD.cc</b> |  |
|------------------------|--|
| Grupo                  | Resultados a nivel de Cuenta de Colateral  |
| Descripción            | Información del Movimiento de Efectivo a realizar en la liquidación multilateral por un Miembro Compensador desglosado por Negociador, Cuenta de Colateral, concepto y grupo de movimiento de efectivo. Incluye conceptos diarios y mensuales del segmento de RV y RF. |
| Destinatarios          | Miembro, Miembro Compensador   |
| Privacidad             | Contiene datos privados  |
| Timing                 | Estático, sólo está disponible al cierre de sesión   |

| TAG                              | NOMBRE | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO   | DESCRIPCIÓN |
|----------------------------------|--------|-------|-----|-----------------|-----------|-------------|
| <b>CCASHMOVBRKD / AcctSumRpt</b> |        |       |     |                 | (n times) |             |

| TAG                                    | NOMBRE                 | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS   | FORMATO       | DESCRIPCIÓN  |
|--|------------------------|----------|-----|---|---------------|--|
| 1699                                   | AccountSummaryReportID | RptID    | S   |   | String        | Identificador único para cada mensaje Account Summary Report   |
| 715                                    | ClearingBusinessDate   | BizDt    | S   |   | LocalMktDate  | Fecha de la sesión   |
| 716                                    | SettleSessionID        | SetSesID | N   | EOD = Fin de sesión   | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión  |
| 15                                     | Currency               | Ccy      | N   |   | Currency      | Código de divisa en la que están expresados los importes de este mensaje. Expresada según estándar ISO 4217  |
| <b>CCASHMOVBRKD / AcctSumRpt / Hdr</b> |                        |          |     |   |               |  |
| 35                                     | MsgType                | MsgTyp   | S   | CQ  | String        | Identifica el tipo de mensaje  |
| 49                                     | SenderCompanyID        | SID      | S   |   | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"  |
| 56                                     | TargetCompanyID        | TID      | S   |   | String        | Contiene "????"  |
| 50                                     | SenderSubID            | SSub     | S*  | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"                                | String        | Código de la ECC   |
| 52                                     | SendingTime            | Snt      | S   |   | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero   |
| <b>CCASHMOVBRKD / AcctSumRpt/ Pty</b>  |                        |          |     |   |               |  |
| →<br>448                               | PartyID                | ID       | N   |   | String        | (n times)<br>Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC<br>Si PartyRole[452]=49, contiene el código del Miembro al que pertenece la Cuenta de Colateral<br>Si PartyRole[452]=101, contiene la Cuenta de Colateral |
| →<br>447                               | PartyIDSource          | Src      | N   | D = Proprietary/<br>Custom code<br>4 = Clearing Firm                              | Char          |  |
| →<br>452                               | PartyRole              | R        | N   | 49 = Collateral Firm<br>(código de Miembro de la ECC)<br>101 = Collateral Account | Int           | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID   |

| TAG  | NOMBRE                     | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                     | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|--|----------------------------|----------|-----|---|---------|---|
| <b>CCASHMOVBRKD /AcctSumRpt/ PayCol</b>        |                            |          |     |   |         | Movimientos de efectivo (n times)                           |
| →1708  | PayCollect Type            | Typ      | N   | Ver Tabla 11 del documento "Tablas de Codificación" | String  | Tipo de importe del Movimiento de Efectivo                  |
| →1710  | PayAmount                  | PayAmt   | N   |   | Amt     | Importe del Movimiento de Efectivo                          |
| →1712  | PayCollect MarketSegmentID | MktSegID | N   | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"  | String  | Código de Segmento de la ECC                                |
| →1713  | PayCollect MarketID        | MktID    | N   | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"  | String  | Código de la ECC  |
| <b>CCASHMOVBRKD /AcctSumRpt/ PayCol/ Stip*</b> |                            |          |     |   |         |   |
| → 233*   | Stipulation Type           | Typ      | N   | CMGRP   | String  | "CMGRP"   |
| → 234*   | Stipulation Value          | Val      | N   |   | String  | Grupo de movimiento de efectivo asociado al Agente de Pagos |

## 11.8 Resumen agregado por cuenta de colateral de los Movimientos de efectivo

| <b>CCASHMOVCC.cc</b> |   |
|----------------------|---|
| Grupo                | Resultados a nivel de Cuenta de Colateral   |
| Descripción          | Información del Movimiento de Efectivo a realizar en la liquidación multilateral por un Miembro Compensador desglosado por Negociador, Cuenta de Colateral y grupo de movimiento de efectivo. |
| Destinatarios        | Miembro, Miembro Compensador  |
| Privacidad           | Contiene datos privados   |
| Timing               | Estático, sólo está disponible al cierre de sesión  |

| TAG                                  | NOMBRE                 | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS     | FORMATO      | DESCRIPCIÓN   |
|--------------------------------------|------------------------|----------|-----|---------------------|--------------|---|
| <b>CCASHMOVCC / AcctSumRpt</b>       |                        |          |     |                     | (n times)    |   |
| 1699                                 | AccountSummaryReportID | RptID    | S   |                     | String       | Identificador único para cada mensaje Account Summary Report  |
| 715                                  | ClearingBusinessDate   | BizDt    | S   |                     | LocalMktDate | Fecha de la sesión  |
| 716                                  | SettleSessionID        | SetSesID | N   | EOD = Fin de sesión | String       | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión   |
| 15                                   | Currency               | Ccy      | N   |                     | Currency     | Código de divisa en la que están expresados los importes de este mensaje. Expresada según estándar ISO 4217 |
| <b>CCASHMOVCC / AcctSumRpt / Hdr</b> |                        |          |     |                     |              |   |
| 35                                   | MsgType                | MsgTyp   | S   | CQ                  | String       | Identifica el tipo de mensaje   |

| TAG  | NOMBRE                    | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS  | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|--|---------------------------|----------|-----|--|---------------|---|
| 49   | SenderCompanyID           | SID      | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"   |
| 56   | TargetCompanyID           | TID      | S   |  | String        | Contiene "????"   |
| 50   | SenderSubID               | SSub     | S*  | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"                             | String        | Código de la ECC  |
| 52   | SendingTime               | Snt      | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero<br>(n times)   |
| <b>CCASHMOVCC /AcctSumRpt/ Pty</b>           |                           |          |     |  |               |   |
| → 448  | PartyID                   | ID       | N   |  | String        | Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC<br><br>Si PartyRole[452]=49, contiene el código del Miembro al que pertenece la Cuenta de Colateral<br><br>Si PartyRole[452]=101, contiene la Cuenta de Colateral |
| → 447  | PartyIDSource             | Src      | N   | D = Proprietary/<br>Custom code<br>4 = Clearing Firm                           | Char          |   |
| → 452  | PartyRole                 | R        | N   | 49 = Collateral Firm (código de Miembro de la ECC)<br>101 = Collateral Account | Int           | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID  |
| <b>CCASHMOVCC /AcctSumRpt/ PayCol</b>        |                           |          |     |  |               |   |
| →1710  | PayAmount                 | PayAmt   | N   |  | Amt           | Movimientos de efectivo (n times)<br>Importe del Movimiento de Efectivo   |
| →1712  | PayCollectMarketSegmentID | MktSegID | N   | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"                             | String        | Código de Segmento de la ECC  |
| →1713  | PayCollectMarketID        | MktID    | N   | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"                             | String        | Código de la ECC  |
| <b>CCASHMOVCC /AcctSumRpt/ PayCol/ Stip*</b> |                           |          |     |  |               |   |
| → 233*                                       | StipulationType           | Typ      | N   | CMGRP  | String        | "CMGRP"   |
| → 234*                                       | StipulationValue          | Val      | N   |  | String        | Grupo de movimiento de efectivo asociado al Agente de Pagos   |

## 11.9 Garantías por cuenta de garantías no asociadas a cuentas de posición

| CREQMARGM.sc  |   |
|---------------|---|
| Grupo         | Resultados a nivel de Cuenta de Garantías   |
| Descripción   | Importes por cuenta de garantías de las garantías exigidas no asociadas a cuentas de posición |
| Destinatarios | Miembro, Miembro Compensador  |
| Privacidad    | Contiene datos privados   |
| Timing        | Estático, sólo está disponible al cierre de sesión  |

| TAG                                  | NOMBRE                      | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|--------------------------------------|-----------------------------|----------|-----|--|---------------|---|
| <b>CREQMARGM / AcctSumRpt</b>        |                             |          |     |  |               | (n times)   |
| 1699                                 | AccountSummaryReportID      | RptID    | S   |  | String        | Identificador único para cada mensaje Account Summary Report  |
| 715                                  | ClearingBusinessDate        | BizDt    | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión  |
| 716                                  | SettlementID                | SetSesID | N   | EOD = Fin de sesión                                | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión   |
| 15                                   | Currency                    | Ccy      | N   |  | Currency      | Código de divisa en la que están expresados los importes de este mensaje. Expresada según estándar ISO 4217 |
| <b>CREQMARGM / AcctSumRpt / Hdr</b>  |                             |          |     |  |               |   |
| 35                                   | MessageType                 | MsgTyp   | S   | CQ   | String        | Identifica el tipo de mensaje   |
| 49                                   | SenderCompanyID             | SID      | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"   |
| 56                                   | TargetCompanyID             | TID      | S   |  | String        | Contiene "????"   |
| 50                                   | SenderSubID                 | SSub     | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC  |
| 52                                   | SendingTime                 | Snt      | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero  |
| <b>CREQMARGM /AcctSumRpt/ MgnAmt</b> |                             |          |     |  |               | Importes de Garantía<br>(n times)   |
| →1645                                | MarginAmount                | Amt      | N   |  | Amt           | Importe Garantía  |
| →1714                                | MarginAmountMarketSegmentID | MktSegID | N   | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Código de Segmento de la ECC  |
| →1715                                | MarginAmountMarketID        | MktID    | N   | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Código de la ECC  |

| TAG                                | NOMBRE        | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS   | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|------------------------------------|---------------|-------|-----|---|---------|--|
| <b>CREQMARGM / AcctSumRpt/ Pty</b> |               |       |     |   |         | (n times)  |
| →<br>448                           | PartyID       | ID    | N   |   | String  | Si PartyRole[452]= 15, contiene el código del Miembro al que pertenece la Cuenta de Garantías<br><br>Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC<br><br>Si PartyRole[452]= 100, contiene la Cuenta |
| →<br>447                           | PartyIDSource | Src   | N   | D = Proprietary/<br>Custom code                               | Char    | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID<br><br>Si PartyRole[452]= 15, contiene el código de Miembro al que pertenece la Cuenta de Garantías   |
| →<br>452                           | PartyRole     | R     | N   | 15 = Margin Firm<br>4 = Clearing Firm<br>100 = Margin Account | Int     | Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador<br><br>Si PartyRole[452]= 100 contiene el código de la Cuenta de Garantías  |

### 11.10 Garantías exigidas y colateral depositado por cuenta de colateral no asociadas a cuentas de posición

| <b>CREQMARGMCCP.cc</b> |   |
|------------------------|---|
| Grupo                  | Resultados a nivel de Cuenta de Colateral   |
| Descripción            | Importes por cuenta de colateral del colateral depositado y las garantías exigidas no asociadas a cuentas de posición |
| Destinatarios          | Miembro, Miembro Compensador  |
| Privacidad             | Contiene datos privados   |
| Timing                 | Estático, sólo está disponible al cierre de sesión  |

| TAG                              | NOMBRE                 | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO      | DESCRIPCIÓN  |
|----------------------------------|------------------------|-------|-----|-----------------|--------------|--|
| <b>CREQMARGMCCP / AcctSumRpt</b> |                        |       |     |                 |              | (n times)  |
| 1699                             | AccountSummaryReportID | RptID | S   |                 | String       | Identificador único para cada mensaje Account Summary Report |
| 715                              | ClearingBusinessDate   | BizDt | S   |                 | LocalMktDate | Fecha de la sesión   |

| TAG                                      | NOMBRE          | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS   | FORMATO       | DESCRIPCIÓN  |
|--|-----------------|----------|-----|---|---------------|--|
| 716                                      | SettlSessID     | SetSesID | N   | EOD = Fin de sesión                                     | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión  |
| 15                                       | Currency        | Ccy      | N   |   | Currency      | Código de divisa en la que están expresados los importes de este mensaje. Expresada según estándar ISO 4217  |
| <b>CREQMARGMCCP / AcctSumRpt / Hdr</b>   |                 |          |     |   |               |  |
| 35                                       | MsgType         | MsgTyp   | S   | CQ  | String        | Identifica el tipo de mensaje  |
| 49                                       | SenderCompanyID | SID      | S   |   | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"  |
| 56                                       | TargetCompanyID | TID      | S   |   | String        | Contiene "????"  |
| 50                                       | SenderSubID     | SSub     | S*  | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"      | String        | Código de la ECC   |
| 52                                       | SendingTime     | Snt      | S   |   | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero   |
| <b>CREQMARGMCCP / AcctSumRpt/ MgnAmt</b> |                 |          |     |   |               |  |
| →1645                                    | MarginAmount    | Amt      | N   |   | Amt           | Importes de Garantía<br>(n times)<br>Importe Garantía  |
| →1715                                    | MarginAmountID  | MktID    | N   | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"      | String        | Código de la ECC   |
| <b>CREQMARGMCCP / AcctSumRpt/ Pty</b>    |                 |          |     |   |               |  |
| →448                                     | PartyID         | ID       | N   |   | String        | (n times)<br>Si PartyRole[452]=49, contiene el código del Miembro al que pertenece la Cuenta de Colateral<br><br>Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC<br><br>Si PartyRole[452]=101, contiene la Cuenta de Colateral |
| →447                                     | PartyIDSource   | Src      | N   | D = Proprietary/<br>Custom code<br>49 = Collateral Firm | Char          |  |
| →452                                     | PartyRole       | R        | N   | 4 = Clearing Firm<br>101 = Collateral Account           | Int           | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID   |

| TAG                                      | NOMBRE                   | FIXML  | REQ | VALORES VÁLIDOS                                     | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|--|--------------------------|--------|-----|---|---------|--|
|  |                          |        |     |   |         | Si PartyRole[452]=49, contiene el código de Miembro al que pertenece la Cuenta de Colateral                    |
|  |                          |        |     |   |         | Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador   |
|  |                          |        |     |   |         | Si PartyRole[452]=101 contiene el código de la Cuenta de Colateral   |
| <b>CREQMARGMCCP /AcctSumRpt/ CollAmt</b> |                          |        |     |   |         | Garantías depositadas (n times)  |
| →1706                                    | CollateralType           | Typ    | S   | Ver Tabla 12 del documento "Tablas de Codificación" | String  | Tipo de Garantía Depositada  |
| →1704                                    | CurrentCollateralAmount  | Amt    | S   |   | Amt     | Importe de la Garantía Depositada  |
| →2093                                    | CollateralAmountMarketID | MktID  | N   | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"  | String  | Código de la ECC   |
| <b>CREQMARGMCCP /AcctSumRpt/ PayCol</b>  |                          |        |     |   |         | Movimientos de efectivo (n times)  |
| →1708                                    | PayCollectType           | Typ    | N   |   | String  | Tipo de importe del Movimiento de Efectivo   |
| →1710                                    | PayAmount                | PayAmt | N   |   | Amt     | En este caso será el importe de las Garantías Diferencia entre la garantía exigida y las garantías depositadas |
| →1713                                    | PayCollectMarketID       | MktID  | N   | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"  | String  | Código de la ECC   |

## 12 Resultados a nivel de Miembro Compensador

### 12.1 Garantías requeridas al Miembro Compensador a nivel de Contrapartida Central

| CMARGINSCLM.cc |  |
|----------------|--|
| Grupo          | Resultados a nivel de Miembro Compensador  |
| Descripción    | Garantías Exigidas y Depositadas, desglosadas en conceptos. Información de todos los tipos de Garantías de la ECC del segmento de RV y RF. |
| Destinatarios  | Miembro Compensador  |
| Privacidad     | Contiene datos privados  |
| Timing         | Estático, sólo está disponible al cierre de sesión   |

| TAG                                    | NOMBRE                 | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|--|------------------------|----------|-----|--|---------------|---|
| <b>CMARGINSCLM / AcctSumRpt</b>        |                        |          |     |  |               | (n times)   |
| 1699                                   | AccountSummaryReportID | RptID    | S   |  | String        | Identificador único para cada mensaje Account Summary Report  |
| 715                                    | ClearingBusinessDate   | BizDt    | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión  |
| 716                                    | SettlSessionID         | SetSesID | N   | EOD = Fin de sesión                                | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión   |
| 255*                                   | CreditRating           | CrdRtg   | N   |  | String        | Solvencia de la entidad   |
| 15                                     | Currency               | Ccy      | N   |  | Currency      | Código de divisa en la que están expresados los importes de este mensaje. Expresada según estándar ISO 4217 |
| <b>CMARGINSCLM / AcctSumRpt / Hdr</b>  |                        |          |     |  |               |   |
| 35                                     | MsgType                | MsgTyp   | S   | CQ   | String        | Identifica el tipo de mensaje   |
| 49                                     | SenderCompanyID        | SID      | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"   |
| 56                                     | TargetCompanyID        | TID      | S   |  | String        | Contiene "????"   |
| 50                                     | SenderSubID            | SSub     | S*  | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Código de la ECC  |
| 52                                     | SendingTime            | Snt      | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero  |
| <b>CMARGINSCLM /AcctSumRpt/ MgnAmt</b> |                        |          |     |  |               | Importes de Garantía exigidas   |
|  |                        |          |     |  |               | (n times)   |
| →1645                                  | MarginAmount           | Amt      | N   |  | Amt           | Importe Garantía exigida  |

| TAG  | NOMBRE                      | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                     | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|--|-----------------------------|----------|-----|---|---------|--|
| à1644  | MarginAmountType            | Typ      | N   | Ver Tabla 10 del documento "Tablas de Codificación" | Int     | Tipo de Garantía exigida   |
| →1714  | MarginAmountMarketSegmentID | MktSegID | N   | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"  | String  | Código de Segmento de la ECC   |
| →1715  | MarginAmountMarketID        | MktID    | N   | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"  | String  | Código de la ECC   |
| <b>CMARGINSCLM /AcctSumRpt/ MgnAmt/ Stip*</b>      |                             |          |     |   |         | (1 time)<br>Sólo aplica si MarginAmtType es 114.   |
| → 233*   | StipulationType             | Typ      | N   | CCD   | String  |  |
| → 234*   | StipulationValue            | Val      | N   |   | String  | Si StipulationType = CCD, Código Cliente Compensador Directo Patrocinado. Sólo aplica si MarginAmtType es 114. |
| <b>CMARGINSCLM /AcctSumRpt/ MgnAmt/ MgnAmtDet*</b> |                             |          |     |   |         | (n times)<br>Desglose para MarginType 106, 107, 115 o 116.   |
| →1645  | MarginAmount                | Amt      | S   |   | Amt     | Importe Garantía exigida   |
| → 448  | PartyID                     | ID       | S   |   | String  | Si PartyRole[452]=15, contiene el código del Miembro.  |
| → 447  | PartyIDSource               | Src      | S   | D = Proprietary/<br>Custom code                     | Char    |  |
| → 452  | PartyRole                   | R        | S   | 15 = Margin Firm                                    | Int     | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID   |
| <b>CMARGINSCLM /AcctSumRpt/ Pty</b>                |                             |          |     |   |         | (n times)  |
| → 448  | PartyID                     | ID       | N   |   | String  | Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC.                                     |
| → 447  | PartyIDSource               | Src      | N   | D = Proprietary/<br>Custom code                     | Char    |  |
| → 452  | PartyRole                   | R        | N   | 4 = Clearing Firm                                   | Int     | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID   |
| <b>CMARGINSCLM /AcctSumRpt/ CollAmt</b>            |                             |          |     |   |         | Garantías depositadas<br>(n times)   |

| TAG  | NOMBRE                   | FIXML  | REQ | VALORES VÁLIDOS                                     | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|--|--------------------------|--------|-----|---|---------|---|
| à1706  | CollateralType           | Typ    | S   | Ver Tabla 12 del documento "Tablas de Codificación" | String  | Tipo de Garantía Depositada.<br>Si no se incluye, el bloque informa del importe total.  |
| →1704  | CurrentCollateralAmount  | Amt    | S   |   | Amt     | Importe de la Garantía Depositada   |
| →2093  | CollateralAmountMarketID | MktID  | N   | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"  | String  | Código de la ECC  |
| <b>CMARGINSCLM /AcctSumRpt/ CollAmt/ Stip*</b> |                          |        |     |   |         | Desglose de garantías depositadas según el CollateralType<br>(n times)  |
| → 233*   | StipulationType          | Typ    | N   | CLME<br>CADF<br>CAIE                                | String  | Si StipulationType=CLME:<br>Total del valor efectivo depositado como colateral en la cuenta de colateral buffer del Compensador.<br><br>Si StipulationType=CADF:<br>Total del valor efectivo depositado como colateral en cuentas de colateral que ajustan automático o por déficit y cubren el Default Fund.<br><br>Si StipulationType=CAIE:<br>Total del valor efectivo depositado como colateral cuentas de colateral que cubren garantías Individuales o Extraordinarias. |
| → 234*   | StipulationValue         | Val    | N   |   | String  |   |
| <b>CMARGINSCLM /AcctSumRpt/ PayCol</b>         |                          |        |     |   |         | Movimientos de efectivo<br>(1 time)   |
| →1708  | PayCollectType           | Typ    | N   |   | String  | Tipo de importe del Movimiento de Efectivo<br><br>En este caso será el importe de las Garantías   |
| →1710  | PayAmount                | PayAmt | N   |   | Amt     | Importe del Movimiento de Efectivo  |

| TAG   | NOMBRE                 | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS  | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|---|------------------------|-------|-----|--|---------|---|
| à1713   | PayCollect<br>MarketID | MktID | N   | Ver Tabla 6 del<br>documento "Tablas<br>de Codificación" | String  | Código de la ECC  |
| <b>CMARGINSCLM /AcctSumRpt/ PayCol/ Stip*</b> |                        |       |     |  |         | Desglose de movimientos<br>de efectivo<br><br>(n times)   |
| → 233*  | Stipulation<br>Type    | Typ   | N   | CLME<br>CADF<br>CAIE                                     | String  | Si StipulationType=CLME:<br>Movimiento de efectivo de<br>efectivo en la cuenta de<br>colateral buffer del<br>Compensador.<br><br>Si StipulationType=CADF:<br>Movimiento de efectivo en<br>cuentas de colateral que<br>ajustan automático o por<br>déficit y cubren el Default<br>Fund.<br><br>Si StipulationType=CAIE:<br>Movimiento de efectivo en<br>cuentas de colateral que y<br>cubren garantías<br>Individuales o<br>Extraordinarias. |
| → 234*  | Stipulation<br>Value   | Val   | N   |  | String  |   |
| <b>CMARGINSCLM /AcctSumRpt/ Stip*</b>         |                        |       |     |  |         | (n times)   |
| → 233*  | Stipulation<br>Type    | Typ   | N   | EQTY   | String  | Si StipulationType = EQTY,<br>Recursos Propios de la<br>Entidad   |
| → 234*  | Stipulation<br>Value   | Val   | N   |  | String  | Datos de riesgo   |
| <b>CMARGINSCLM /AcctSumRpt/ RiskLmtTyp*</b>   |                        |       |     |  |         | (n times)   |
| →1530*  | RiskLimitT<br>ype      | Typ   | N   |  | String  | RiskLimitType:<br>100 = Consumo de Límite<br>de Riesgo Intradía<br>resultante a fin de sesión<br><br>101 = Límite de Riesgo<br>Intradía resultante para la<br>siguiente sesión<br><br>102 = Garantía Individual<br>para Nuevas Operaciones  |

| TAG     | NOMBRE                      | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|---------|-----------------------------|----------|-----|--|---------|--|
|         |                             |          |     |  |         | 103 = Sobrante de Garantías por Posición de la Cuenta de Colateral disponible para el Compensador en el Stress Test de la Garantía Colectiva |
|         |                             |          |     |  |         | 104 = Riesgo Stress Test del Compensador   |
|         |                             |          |     |  |         | 105 = Importe de la garantía exigible por LRI  |
|         |                             |          |     |  |         | 106 = Crédito que concede la ECC sobre el importe exigible por LRI   |
|         |                             |          |     |  |         | 107 = Importe de la garantía exigible por LMC  |
|         |                             |          |     |  |         | 108 = Crédito que concede la ECC sobre el importe exigible por LMC   |
|         |                             |          |     |  |         | 109 = Límite de Riesgo Intradía resultante a fin de sesión   |
| à 1531* | RiskLimitAmount             | Amt      | N   |  | Amt     |  |
| →1714*  | MarginAmountMarketSegmentID | MktSegID | N   | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String  | Código del Segmento de la ECC  |
| →1715*  | MarginAmountMarketID        | MktID    | N   | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación" | String  | Código de la ECC   |

## 12.2 Movimientos de efectivo para el Miembro Compensador a nivel de Contrapartida Central

| CCASHMOVCLM.cc |  |
|----------------|--|
| Grupo          | Resultados a nivel de Miembro Compensador  |
| Descripción    | Información del Movimiento de Efectivo a realizar en la liquidación multilateral por un Miembro Compensador desglosado por Negociador y concepto. Incluye conceptos diarios y mensuales del segmento de RV y RF. |
| Destinatarios  | Miembro, Miembro Compensador   |
| Privacidad     | Contiene datos privados  |
| Timing         | Estático, sólo está disponible al cierre de sesión   |

| TAG                                    | NOMBRE                 | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS  | FORMATO       | DESCRIPCIÓN  |
|--|------------------------|----------|-----|--|---------------|--|
| <b>CCASHMOVCLM / AcctSumRpt</b>        |                        |          |     |  |               | (n times)  |
| 1699                                   | AccountSummaryReportID | RptID    | S   |  | String        | Identificador único para cada mensaje Account Summary Report   |
| 715                                    | ClearingBusinessDate   | BizDt    | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión   |
| 716                                    | SettleSessionID        | SetSesID | N   | EOD = Fin de sesión  | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión  |
| 15                                     | Currency               | Ccy      | N   |  | Currency      | Código de divisa en la que están expresados los importes de este mensaje. Expresada según estándar ISO 4217                                |
| <b>CCASHMOVCLM / AcctSumRpt / Hdr</b>  |                        |          |     |  |               |  |
| 35                                     | MsgType                | MsgTyp   | S   | CQ   | String        | Identifica el tipo de mensaje  |
| 49                                     | SenderCompanyID        | SID      | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"  |
| 56                                     | TargetCompanyID        | TID      | S   |  | String        | Contiene "????"  |
| 50                                     | SenderSubID            | SSub     | S*  | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"                       | String        | Código de la ECC   |
| 52                                     | SendingTime            | Snt      | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero   |
| <b>CCASHMOVCLM /AcctSumRpt/ Pty</b>    |                        |          |     |  |               | (n times)  |
| →<br>448                               | PartyID                | ID       | N   |  | String        | Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC<br>Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC |
| →<br>447                               | PartyIDSource          | Src      | N   | D = Proprietary/<br>Custom code  | Char          | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID   |
| →<br>452                               | PartyRole              | R        | N   | 1 = Executing Firm<br>(código de Miembro de la ECC)<br>4 = Clearing Firm | Int           | Si PartyRole[452]=1, contiene el código de Miembro de la ECC<br>Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador             |
| <b>CCASHMOVCLM /AcctSumRpt/ PayCol</b> |                        |          |     |  |               | Movimientos de efectivo  |

| TAG   | NOMBRE                     | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                     | FORMATO | DESCRIPCIÓN<br>(n times)                                    |
|---|----------------------------|----------|-----|---|---------|---|
| à1708   | PayCollect Type            | Typ      | N   | Ver Tabla 11 del documento "Tablas de Codificación" | String  | Tipo de importe del Movimiento de Efectivo                  |
| →1710   | PayAmount                  | PayAmt   | N   |   | Amt     | Importe del Movimiento de Efectivo                          |
| →1712   | PayCollect MarketSegmentID | MktSegID | N   | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"  | String  | Código de Segmento de la ECC                                |
| →1713   | PayCollect MarketID        | MktID    | N   | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"  | String  | Código de la ECC  |
| <b>CCASHMOVCLM /AcctSumRpt/ PayCol/ Stip*</b> |                            |          |     |   |         |   |
| → 233*  | Stipulation Type           | Typ      | N   | CMGRP   | String  | "CMGRP"   |
| → 234*  | Stipulation Value          | Val      | N   |   | String  | Grupo de movimiento de efectivo asociado al Agente de Pagos |

## 13 Resultados a nivel de Agente de Pagos

### 13.1 Movimientos de efectivo para el Agente de Pagos a nivel de Contrapartida Central

| CCASHMOVTREAS.cc |  |
|------------------|--|
| Grupo            | Resultados a nivel de Agente de Pagos  |
| Descripción      | Movimientos de efectivo a realizar por el Agente de Pagos del segmento de RV y RF. |
| Destinatarios    | Agente de Pagos, Miembro Compensador   |
| Privacidad       | Contiene datos privados  |
| Timing           | Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.                                |

| TAG                                     | NOMBRE                 | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN  |
|---|------------------------|----------|-----|--|---------------|--|
| <b>CCASHMOVTREAS / AcctSumRpt</b>       |                        |          |     |  | (n times)     |  |
| 1699                                    | AccountSummaryReportID | RptID    | S   |  | String        | Identificador único para cada mensaje Account Summary Report   |
| 715                                     | ClearingBusinessDate   | BizDt    | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión   |
| 716                                     | SettlSessionID         | SetSesID | N   | EOD = Fin de sesión                                | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión  |
| 15                                      | Currency               | Ccy      | N   |  | Currency      | Código de divisa en la que están expresados los importes de este mensaje. Expresada según estándar ISO 4217                    |
| <b>CCASHMOVTREAS / AcctSumRpt / Hdr</b> |                        |          |     |  |               |  |
| 35                                      | MsgType                | MsgTyp   | S   | CQ   | String        | Identifica el tipo de mensaje  |
| 49                                      | SenderCompanyID        | SID      | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"  |
| 56                                      | TargetCompanyID        | TID      | S   |  | String        | Contiene "????"  |
| 50                                      | SenderSubID            | SSub     | S*  | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Código de la ECC   |
| 52                                      | SendingTime            | Snt      | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero   |
| <b>CCASHMOVTREAS /AcctSumRpt/ Pty</b>   |                        |          |     |  | (n times)     |  |
| →<br>448                                | PartyID                | ID       | N   |  | String        | Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC<br>Si PartyRole[452]=30, contiene el Agente de Pagos |

| TAG  | NOMBRE                    | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|--|---------------------------|----------|-----|--|---------|--|
| → 447  | PartyIDSource             | Src      | N   | D = Proprietary/<br>Custom code                    | Char    | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID   |
| → 452  | PartyRole                 | R        | N   | 4 = Clearing Firm<br>30 = Payment Agent            | Int     | Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador<br>Si PartyRole[452]=30, contiene el código del Agente de Pagos |
| <b>CCASHMOVTREAS /AcctSumRpt/ PayCol</b>         |                           |          |     |  |         | Movimientos de efectivo (n times)  |
| →1710  | PayAmount                 | PayAmt   | N   |  | Amt     | Importe del Movimiento de Efectivo   |
| →1712  | PayCollectMarketSegmentID | MktSegID | N   | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String  | Código de Segmento de la ECC   |
| →1713  | PayCollectMarketID        | MktID    | N   | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación" | String  | Código de la ECC   |
| <b>CCASHMOVTREAS /AcctSumRpt/ PayCol / Stip*</b> |                           |          |     |  |         |  |
| → 233*   | StipulationType           | Typ      | N   | CMGRP  | String  | "CMGRP"  |
| → 234*   | StipulationValue          | Val      | N   |  | String  | Grupo de movimiento de efectivo asociado al Agente de Pagos  |

## 14 Compensación e Instrucciones de Liquidación

### 14.1 Instrucciones a liquidar en la siguiente sesión

| <b>CSETTLINSTNEXT.sc</b> |  |
|--------------------------|--|
| Grupo                    | Información de Liquidaciones y Fallidos  |
| Descripción              | Instrucciones generadas hoy tras el neteo que se enviarán a liquidar en la siguiente sesión del segmento de RV y RF. |
| Destinatarios            | Miembro, Miembro Compensador, Entidad Participante   |
| Privacidad               | Contiene datos privados  |
| Timing                   | Estático, sólo está disponible al cierre de sesión   |

| TAG                                | NOMBRE               | FIXML       | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO      | DESCRIPCIÓN   |
|------------------------------------|----------------------|-------------|-----|--|--------------|---|
| <b>CSETTLINSTNEXT / TrdCaptRpt</b> |                      |             |     |  | (n times)    |   |
| 1003                               | TradeID              | TrdID       | N   |  | String       | Identificador de registro de la ECC. Este campo siempre está presente en el mensaje   |
| 828                                | TrdType              | TrdTyp      | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | Int          | Tipo de Operación FIX. Este valor es usado conjuntamente con TrdSubType [829]   |
| 829                                | TrdSubType           | TrdSubTyp   | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | Int          | Este valor es usado conjuntamente con TrdType [828]   |
| 32                                 | LastQty              | LastQty     | S   | >= 0, sin decimales                                | Qty          | Volumen//Nominal de títulos de la Instrucción   |
| 31                                 | LastPx               | LastPx      | S   |  | Price        | Precio de la Operación. Para RF se mostrará en %  |
| 15                                 | Currency             | Ccy         | N   |  | Currency     | Código de divisa. Expresada según estándar ISO 4217   |
| 60                                 | TransactTime         | TxnTm       | N   |  | UTCTimestamp | Fecha y hora, en formato UTC, en que se realizó la transacción  |
| 64                                 | SettlDate            | SettlDt     | N   |  | LocalMktDate | Fecha Teórica de Liquidación  |
| 381                                | GrossTradeAmt        | GrossTrdAmt | N   |  | Amt          | Importe Efectivo de la Instrucción<br>Puede ser negativo en función del resultado de la compensación en cuentas de Posición netas |
| 5681*                              | ExchangeTradeType    | ExchTrdTyp  | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | String       | Tipo de Operación de la ECC   |
| 715                                | ClearingBusinessDate | BizDt       | S   |  | LocalMktDate | Fecha de la sesión  |

| TAG   | NOMBRE           | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|---|------------------|----------|-----|--|---------------|---|
| 716   | SettlSessID      | SetSesID | N   | EOD = Fin de sesión                                | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión   |
| <b>CSETTLINSTNEXT / TrdCaptRpt / Hdr</b>        |                  |          |     |  |               |   |
| 35  | MsgType          | MsgTyp   | S   | AE   | String        | Identifica el tipo de mensaje   |
| 49  | SenderCompID     | SID      | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"   |
| 56  | TargetCompID     | TID      | S   |  | String        | Contiene "????"   |
| 50  | SenderSubID      | SSub     | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC  |
| 52  | SendingTime      | Snt      | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero  |
| <b>CSETTLINSTNEXT /TrdCaptRpt/ Instrmt</b>      |                  |          |     |  |               |   |
| 55  | Symbol           | Sym      | N   | [N/A]<br>o código de valor                         | String(5)     |   |
| 48  | SecurityID       | ID       | N   |  | String(12)    | Código ISIN   |
| 22  | SecurityIDSource | Src      | N   | 4 = ISIN number                                    | String        |   |
| <b>CSETTLINSTNEXT /TrdCaptRpt/ RptSide</b>      |                  |          |     |  |               |   |
|   |                  |          |     |  |               | (1 time)  |
|   |                  |          |     |  |               | Siempre 1 ya que sólo se incluye la parte compradora o vendedora, según corresponda al destinatario del mensaje |
| → 54  | Side             | Side     | S   | 1 = Buy<br>2 = Sell                                | Char          | Signo de la posición de Valores   |
| → 77  | PositionEffect   | PosEfct  | N   | "O" = Open<br>"                                    |               |   |
| <b>CSETTLINSTNEXT /TrdCaptRpt/ RptSide/ Pty</b> |                  |          |     |  |               |   |
|   |                  |          |     |  |               | (n times)   |
|   |                  |          |     |  |               | Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC   |
|   |                  |          |     |  |               | Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC                                       |
| →→<br>448                                       | PartyID          | ID       | N   |  | String        | Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV<br>Si PartyRole[452]=38, contiene la Cuenta de posición        |

| TAG  | NOMBRE               | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS   | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|--|----------------------|-------|-----|---|---------|--|
|  |                      |       |     |   |         | Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante  |
|  |                      |       |     |   |         | Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación   |
| à→<br>447  | PartyIDSour<br>ce    | Src   | N   | D = Proprietary/<br>Custom code<br><br>1 = Executing Firm<br><br>4 = Clearing Firm<br><br>10 = CSD Code | Char    |  |
| →→<br>452  | PartyRole            | R     | N   | 38 = Position<br>Account<br><br>90 = Settlement<br>Firm<br><br>91 = Settlement<br>account               | Int     | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID   |
| <b>CSETTLINSTNEXT /TrdCaptRpt/ RptSide/ Stip</b> |                      |       |     |   |         | (n times)  |
| →→ 233   | StipulationT<br>ype  | Typ   | N   | CLIQ<br>ILIQDCV<br>TINST  | String  |  |
| →→ 234   | StipulationV<br>alue | Val   | N   |   | String  | <p>Para Instrucciones de Liquidación:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Si StipulationType [233] = CLIQ, contiene el número de la ventana de agregación en la que se envía la Instrucción a liquidar</li> <li>• Si StipulationType [233] = ILIQDCV, contiene el identificador de la Instrucción Liquidación en el DCV</li> <li>• Si StipulationType [233] = TINST, contiene el Tipo Instrucción: <ul style="list-style-type: none"> <li>* DVP = Entrega contra pago</li> <li>* RVP = Recepción contra pago</li> <li>* DWP = Entrega con pago</li> <li>* DFP = Entrega libre de pago</li> <li>* RFP = Recepción libre de pago</li> </ul> </li> </ul> |

| TAG | NOMBRE | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|-----|--------|-------|-----|-----------------|---------|---|
|     |        |       |     |                 |         | * PWD = Pago / cobro sin entrega de Valores                 |
|     |        |       |     |                 |         | * ROC = Instrucciones de pago sin entrega con efectivo cero |
|     |        |       |     |                 |         | * RWP = Recepción con pago                                  |

## 14.2 Nuevas Instrucciones generadas por liberación

| CSETTLINSTREL.sc |   |
|------------------|---|
| Grupo            | Información de Liquidaciones y Fallidos   |
| Descripción      | Instrucciones generadas durante la sesión como consecuencia de la liberación de Operaciones que hubiesen sido previamente retenidas. Las Instrucciones generadas se enviarán a liquidar en la próxima ventana de agregación disponible. Sólo aplica al segmento de RV |
| Destinatarios    | Miembro, Miembro Compensador, Entidad Participante  |
| Privacidad       | Contiene datos privados   |
| Timing           | Disponible durante la sesión. Dinámico, el contenido difiere de una a otra ventana de agregación.   |

| TAG                               | NOMBRE       | FIXML     | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO      | DESCRIPCIÓN   |
|-----------------------------------|--------------|-----------|-----|--|--------------|---|
| <b>CSETTLINSTREL / TrdCaptRpt</b> |              |           |     |  |              | (n times)   |
| 1003                              | TradeID      | TrdID     | N   |  | String       | Identificador de registro de la ECC. Este campo siempre está presente en el mensaje |
| 828                               | TrdType      | TrdTyp    | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | Int          | Tipo de Operación FIX. Este valor es usado conjuntamente con TrdSubType [829]       |
| 829                               | TrdSubType   | TrdSubTyp | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | Int          | Este valor es usado conjuntamente con TrdType [828]                                 |
| 32                                | LastQty      | LastQty   | S   | >= 0, sin decimales                                | Qty          | Volumen de títulos de la Instrucción  |
| 31                                | LastPx       | LastPx    | S   |  | Price        | Precio de la Operación.   |
| 15                                | Currency     | Ccy       | N   |  | Currency     | Código de divisa. Expresada según estándar ISO 4217                                 |
| 60                                | TransactTime | TxnTm     | N   |  | UTCTimestamp | Fecha y hora, en formato UTC, en que se realizó la transacción                      |
| 64                                | SettlDate    | SettlDt   | N   |  | LocalMktDate | Fecha Teórica de Liquidación  |

| TAG   | NOMBRE               | FIXML       | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN  |
|---|----------------------|-------------|-----|--|---------------|--|
| 381   | GrossTradeAmt        | GrossTrdAmt | N   |  | Amt           | Importe Efectivo de la Instrucción   |
| 5681*   | ExchangeTradeType    | ExchTrdTyp  | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Tipo de Operación de la ECC  |
| 715   | ClearingBusinessDate | BizDt       | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión   |
| 716   | SettlSessID          | SetSesID    | N   | ITD = Intradía<br>EOD = Fin de sesión              | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión                      |
| <b>CSETTLINSTREL / TrdCaptRpt / Hdr</b>           |                      |             |     |  |               |  |
| 35  | MsgType              | MsgTyp      | S   | AE   | String        | Identifica el tipo de mensaje  |
| 49  | SenderCompID         | SID         | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"        |
| 56  | TargetCompID         | TID         | S   |  | String        | Contiene "????"  |
| 50  | SenderSubID          | SSub        | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC                                   |
| 52  | SendingTime          | Snt         | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero   |
| <b>CSETTLINSTREL / TrdCaptRpt / Instrmt</b>       |                      |             |     |  |               |  |
| 55  | Symbol               | Sym         | N   | [N/A]<br>o código de valor                         | String(5)     |  |
| 48  | SecurityID           | ID          | N   |  | String(12)    | Código ISIN  |
| 22  | SecurityIDSource     | Src         | N   | 4 = ISIN number                                    | String        | (1 time)   |
| <b>CSETTLINSTREL / TrdCaptRpt / RptSide</b>       |                      |             |     |  |               |  |
| → 54  | Side                 | Side        | S   | 1 = Buy<br>2 = Sell                                | Char          | Signo de la posición de Valores  |
| → 77  | PositionEffect       | PosEfct     | N   | "O" = Open   |               |  |
| <b>CSETTLINSTREL / TrdCaptRpt / RptSide / Pty</b> |                      |             |     |  |               |  |
| →→ 448  | PartyID              | ID          | N   |  | String        | (n times)<br>Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC |

| TAG   | NOMBRE           | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS   | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|---|------------------|-------|-----|---|---------|---|
|   |                  |       |     |   |         | <p>Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC</p> <p>Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV</p> <p>Si PartyRole[452]=38, contiene la cuenta de posición</p> <p>Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante</p> <p>Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación</p> |
| à→<br>447                                       | PartyIDSource    | Src   | N   | D = Proprietary/<br>Custom code<br><br>1 = Executing Firm<br><br>4 = Clearing Firm<br><br>10 = CSD Code | Char    |   |
| →→<br>452                                       | PartyRole        | R     | N   | 38 = Position<br>Account<br><br>90 = Settlement<br>Firm<br><br>91 = Settlement<br>account               | Int     | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID.   |
| <b>CSETTLINSTREL /TrdCaptRpt/ RptSide/ Stip</b> |                  |       |     |   |         | (n times)   |
| →→ 233  | StipulationType  | Typ   | N   | CLIQ<br>ILIQDCV<br>TINST  | String  |   |
| →→ 234  | StipulationValue | Val   | N   |   | String  | <p>Para Instrucciones de Liquidación:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Si StipulationType [233] = CLIQ, contiene el número de la ventana de agregación en la que se envía la Instrucción a liquidar</li> <li>Si StipulationType [233] = ILIQDCV, contiene el identificador de la Instrucción Liquidación en el DCV</li> </ul>                     |

| TAG | NOMBRE | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|-----|--------|-------|-----|-----------------|---------|--|
|     |        |       |     |                 |         | <ul style="list-style-type: none"> <li>• Si StipulationType [233] = TINST, contiene el Tipo Instrucción:</li> <li>* RVP = Recepción contra pago</li> </ul> |

### 14.3 Detalle de Operaciones de cada Instrucción de Liquidación

| CSETTLINSTDET.sc |   |
|------------------|---|
| Grupo            | Información de Liquidaciones y Fallidos   |
| Descripción      | Relación de las Operaciones incluidas en cada Instrucción de Liquidación del segmento de RV y RF.                                   |
| Destinatarios    | Miembro, Miembro Compensador, Entidad Participante  |
| Privacidad       | Contiene datos privados   |
| Timing           | Disponible durante la sesión. Dinámico, pueden añadirse nuevos registros en cualquier momento. No se modifican o eliminan registros |

| TAG                                  | NOMBRE FIX        | NOMBRE FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO      | DESCRIPCIÓN  |
|--------------------------------------|-------------------|--------------|-----|--|--------------|--|
| <b>CSETTLINSTDET / RgstInstrctns</b> |                   |              |     |  |              | (n times)  |
| 513                                  | RegistID          | ID           | S   |  | String (30)  | Identificador único para cada mensaje Registration Instructions  |
| 514                                  | RegistTransType   | TransTyp     | S   | 0 = New  | Char         |  |
| 1003*                                | TradeID           | TrdID        | N   |  | String       | Identificador de registro en la ECC de la Instrucción de Liquidación   |
| 828*                                 | TrdType           | TrdTyp       | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | Int          | Tipo de Operación FIX de la Instrucción de Liquidación. Este valor es usado conjuntamente con TrdSubType [829]                                 |
| 829*                                 | TrdSubType        | TrdSubTyp    | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | Int          | Este valor es usado conjuntamente con TrdType [828]  |
| 5681*                                | ExchangeTradeType | ExchTrdTyp   | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | String       | Tipo de Operación de la ECC de la Instrucción de Liquidación   |
| 54*                                  | Side              | Side         | N   | 1 = Buy<br>2 = Sell                                | Char         | Signo de la posición de los valores  |
| 32*                                  | LastQty           | LastQty      | S   | >= 0, sin decimales                                | Qty          | Volumen/Nominal de la Instrucción de Liquidación   |
| 381*                                 | GrossTradeAmount  | GrossTrdAmt  | N   |  | Amt          | Importe Efectivo de la Instrucción de Liquidación. Puede ser negativo en función del resultado de la compensación en cuentas de Posición netas |
| 64*                                  | SettlDate         | SettlDt      | N   |  | LocalMktDate | Fecha Teórica de Liquidación   |

| TAG   | NOMBRE FIX           | NOMBRE FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS  | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|---|----------------------|--------------|-----|--|---------------|---|
| 715   | ClearingBusinessDate | BizDt        | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión  |
| 716*  | SettlSessID          | SetSesID     | N   | ITD = Intradía<br>EOD = Fin de sesión                                    | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión   |
| <b>CSETTLINSTDET / RgstInstrctns / Hdr</b>    |                      |              |     |  |               |   |
| 35  | MsgType              | MsgTyp       | S   | o  | String        | Identifica el tipo de mensaje   |
| 49  | SenderCompID         | SID          | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"   |
| 56  | TargetCompID         | TID          | S   |  | String        | Contiene "????"   |
| 50  | SenderSubID          | SSub         | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"                       | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC  |
| 52  | SendingTime          | Snt          | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero  |
| <b>CSETTLINSTDET /RgstInstrctns / Pty</b>     |                      |              |     |  |               |   |
|   |                      |              |     |  |               | (n times)   |
|   |                      |              |     |  |               | Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC   |
|   |                      |              |     |  |               | Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC   |
| → 448   | PartyID              | ID           | S*  |  | String        | Si PartyRole[452]=38, contiene la cuenta de posición<br>Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante<br>Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación |
| → 447   | PartyIDSource        | Src          | S   | D = Proprietary / Custom code<br>1 = Executing Firm<br>4 = Clearing Firm | String        |   |
| → 452   | PartyRole            | R            | S   | 38 = Position Account<br>90 = Settlement Firm<br>91 = Settlement account | Int           | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID  |
| <b>CSETTLINSTDET /RgstInstrctns/ Pty/ Sub</b> |                      |              |     |  |               |   |
|   |                      |              |     |  |               | (1 time)  |

| TAG   | NOMBRE FIX       | NOMBRE FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS                               | FORMATO    | DESCRIPCIÓN  |
|---|------------------|--------------|-----|---|------------|--|
| →→<br>523   | PartySubID       | ID           | S*  | TRD = Información de detalle de una Operación | String     |  |
| →→ 803  | PartySubIDType   | Typ          | S   |   | Int        | Este campo es requerido por el estándar.   |
| <b>CSETTLINSTDET /RgstInstrctns/ Instrmt*</b>         |                  |              |     |   |            |  |
| 55*   | Symbol           | Sym          | N   | [N/A]<br>o código de valor                    | String(5)  |  |
| 48*   | SecurityID       | ID           | N   |   | String(12) | Código ISIN  |
| 22*   | SecurityIDSource | Src          | N   | 4 = ISIN number                               | String     |  |
| <b>CSETTLINSTDET /RgstInstrctns/ Stip*</b>            |                  |              |     |   |            | (n times)  |
| →<br>233*   | StipulationType  | Typ          | N   | CLIQ<br>TINST                                 | String     |  |
|   |                  |              |     |   |            | Si StipulationType [233] = CLIQ, contiene el número de la ventana de agregación en la que se envía la Instrucción a liquidar   |
|   |                  |              |     |   |            | Si StipulationType [233] = TINST, contiene el tipo de la Instrucción de Liquidación:   |
|   |                  |              |     |   |            | <ul style="list-style-type: none"> <li>• DVP = Entrega contra pago</li> <li>• RVP = Recepción contra pago</li> <li>• DWP = Entrega con pago</li> <li>• DFP = Entrega libre de pago</li> <li>• RFP = Recepción libre de pago</li> <li>• PWD = Pago / cobro sin entrega de Valores</li> <li>• ROC = Instrucciones de pago sin entrega con efectivo cero</li> <li>• RWP = Recepción con pago</li> </ul> |
| → 234*  | StipulationValue | Val          | N   |   | String     |  |
| <b>CSETTLINSTDET /RgstInstrctns/ ReltdTrd *</b>       |                  |              |     |   |            | (n times)  |
| →<br>1856*  | RelatedTradeID   | ID           | N   |   | String     | Identificador de registro en la ECC de la Operación incluida en la Instrucción de Liquidación  |
| <b>CSETTLINSTDET /RgstInstrctns/ ReltdTrd*/ Stip*</b> |                  |              |     |   |            | (n times)  |

| TAG       | NOMBRE FIX       | NOMBRE FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS                                  | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|-----------|------------------|--------------|-----|--|---------|--|
| →<br>233* | StipulationType  | Typ          | N   | TRTYP<br>TRSUBT<br>EXTT<br>SIDE<br>LASTQ<br>GRTA | String  | <p>Si StipulationValue[233] =TRTYP, contiene el tipo de Operación FIX de la Operación incluida en la Instrucción de Liquidación</p> <p>Si StipulationValue[233] =TRSUBT, contiene el subtipo de Operación FIX de la Operación incluida en la Instrucción de Liquidación</p> <p>Si StipulationValue[233] =EXTT, contiene el tipo de Operación de la ECC de la Operación incluida en la Instrucción de Liquidación</p> |
| à 234*    | StipulationValue | Val          | N   |  | String  | <p>Si StipulationValue[233] =SIDE, contiene el Signo de la Operación incluida en la Instrucción de Liquidación</p> <p>Si StipulationValue[233] =LASTQ, contiene el volumen de la Operación incluida en la Instrucción de Liquidación</p> <p>Si StipulationValue[233] =GRTA, contiene el importe Efectivo de la Operación incluida en la Instrucción de Liquidación</p>   |

## 15 Información de Liquidaciones y Fallidos

### 15.1 Instrucciones liquidadas en la sesión

| <b>CSETTLEDINST.sc</b> |  |
|------------------------|--|
| Grupo                  | Información de Liquidaciones y Fallidos  |
| Descripción            | Instrucciones de cualquier Fecha Teórica de Liquidación y tipo (Compraventas o Ajustes) que han sido parcial o totalmente liquidadas en la sesión del segmento de RV y RF. |
| Destinatarios          | Miembro, Miembro Compensador, Entidad Participante   |
| Privacidad             | Contiene datos privados  |
| Timing                 | Disponible durante la sesión. Dinámico, varía durante la sesión  |

| TAG                              | NOMBRE        | FIXML       | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO      | DESCRIPCIÓN  |
|----------------------------------|---------------|-------------|-----|--|--------------|--|
| <b>CSETTLEDINST / TrdCaptRpt</b> |               |             |     |  | (n times)    |  |
| 1003                             | TradeID       | TrdID       | N   |  | String       | Identificador de registro de la ECC. Este campo siempre está presente en el mensaje  |
| 828                              | TrdType       | TrdTyp      | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | Int          | Tipo de Operación FIX. Este valor es usado conjuntamente con TrdSubType [829]  |
| 829                              | TrdSubType    | TrdSubTyp   | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | Int          | Este valor es usado conjuntamente con TrdType [828]  |
| 32                               | LastQty       | LastQty     | S   | >= 0, sin decimales                                | Qty          | Volumen//Nominal de la Instrucción   |
| 151*                             | LeavesQty     | LeavesQty   | N   |  | Qty          | Volumen / Nominal vivo de la Instrucción   |
| 31                               | LastPx        | LastPx      | S   |  | Price        | Precio medio de la Instrucción<br>Para RF se mostrará en %   |
| 15                               | Currency      | Ccy         | N   |  | Currency     | Código de divisa. Expresada según estándar ISO 4217  |
| 60                               | TransactTime  | TxnTm       | N   |  | UTCTimestamp | Fecha y hora, en formato UTC, en que se realizó la transacción.  |
| 64                               | SettlDate     | SettlDt     | N   |  | LocalMktDate | Fecha Teórica de Liquidación   |
| 381                              | GrossTradeAmt | GrossTrdAmt | N   |  | Amt          | Importe Efectivo de la Instrucción<br><br>En caso de compraventas, puede ser negativo en función del resultado de la compensación en cuentas de Posición netas |

| TAG   | NOMBRE               | FIXML      | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN  |
|---|----------------------|------------|-----|--|---------------|--|
| 5681*   | ExchangeTradeType    | ExchTrdTyp | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Tipo de Operación de la ECC  |
| 715   | ClearingBusinessDate | BizDt      | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión   |
| 716   | SettlSessID          | SetSesID   | N   | ITD = Intradía<br>EOD = Fin de sesión              | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión  |
| <b>CSETTLEDINST / TrdCaptRpt / Hdr</b>        |                      |            |     |  |               |  |
| 35  | MsgType              | MsgTyp     | S   | AE   | String        | Identifica el tipo de mensaje  |
| 49  | SenderCompID         | SID        | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"  |
| 56  | TargetCompID         | TID        | S   |  | String        | Contiene "????"  |
| 50  | SenderSubID          | SSub       | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC   |
| 52  | SendingTime          | Snt        | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero   |
| <b>CSETTLEDINST /TrdCaptRpt/ Instrmt</b>      |                      |            |     |  |               |  |
| 55  | Symbol               | Sym        | N   | [N/A]<br>o código de valor                         | String(5)     |  |
| 48  | SecurityID           | ID         | N   |  | String(12)    | Código ISIN  |
| 22  | SecurityIDSource     | Src        | N   | 4 = ISIN number                                    | String        |  |
| <b>CSETTLEDINST /TrdCaptRpt/ Amt</b>          |                      |            |     |  |               | (n times)  |
| → 708   | PosAmt               | Amt        | N   |  | Amt           |  |
| → 1585  | PosAmtReason         | Rsn        | N   | 1000 = Importe Efectivo vivo de la Operación       | Int           | Es el importe efectivo pendiente de liquidar en caso de liquidación parcial<br><br>(1 time)<br><br>Siempre 1 ya que sólo se incluye la parte compradora o vendedora, según corresponda al destinatario del mensaje |
| <b>CSETTLEDINST /TrdCaptRpt/ RptSide</b>      |                      |            |     |  |               |  |
| → 54  | Side                 | Side       | S   | 1 = Buy<br>2 = Sell                                | Char          | Signo de la posición de Valores  |
| → 77  | PositionEffect       | PosEfct    | N   | "O" = Open   |               |  |
| <b>CSETTLEDINST /TrdCaptRpt/ RptSide/ Pty</b> |                      |            |     |  |               | (n times)  |

| TAG  | NOMBRE               | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS   | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|--|----------------------|-------|-----|---|---------|--|
| à→<br>448                                      | PartyID              | ID    | N   |   | String  | Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC  |
|  |                      |       |     |   |         | Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC  |
|  |                      |       |     |   |         | Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV   |
|  |                      |       |     |   |         | Si PartyRole[452]=38, contiene la Cuenta de Posición   |
|  |                      |       |     |   |         | Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante  |
|  |                      |       |     |   |         | Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación   |
| →→<br>447                                      | PartyIDSour<br>ce    | Src   | N   | D = Proprietary/<br>Custom code<br><br>1 = Executing Firm<br><br>4 = Clearing Firm<br><br>10 = CSD Code | Char    |  |
| →→<br>452                                      | PartyRole            | R     | N   | 38 = Position<br>Account<br><br>90 = Settlement<br>Firm<br><br>91 = Settlement<br>account               | Int     | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID   |
| <b>CSETTLEDINST /TrdCaptRpt/ RptSide/ Stip</b> |                      |       |     |   |         | (n times)  |
| →→ 233   | StipulationT<br>ype  | Typ   | N   | CLIQ<br>ILIQDCV<br>TINST<br>ICORPDCV  | String  |  |
| →→ 234   | StipulationV<br>alue | Val   | N   |   | String  | Para Instrucciones de Liquidación:<br>• Si StipulationType [233] = CLIQ, contiene el número de la ventana de agregación en la que se envía la Instrucción a liquidar |

| TAG | NOMBRE | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|-----|--------|-------|-----|-----------------|---------|--|
|     |        |       |     |                 |         | <ul style="list-style-type: none"> <li>• Si StipulationType [233] = ILIQDCV, contiene el identificador de la Instrucción Liquidación en el DCV</li> <li>• Si StipulationType [233] = TINST, contiene el Tipo Instrucción:               <ul style="list-style-type: none"> <li>* DVP = Entrega contra pago</li> <li>* RVP = Recepción contra pago</li> <li>* DWP = Entrega con pago</li> <li>* DFP = Entrega libre de pago</li> <li>* RFP = Recepción libre de pago</li> <li>* PWD = Pago / cobro sin entrega de Valores</li> <li>* ROC = Instrucciones de pago sin entrega con efectivo cero</li> <li>* RWP = Recepción con pago</li> </ul> </li> </ul> <p>Para Eventos Corporativos:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Si StipulationType [233] = ICORPDCV, contiene el identificador del Evento en el DCV</li> </ul> |

## 15.2 Instrucciones pendientes de liquidar

| CPENDINGINST.sc |   |
|-----------------|---|
| Grupo           | Información de Liquidaciones y Fallidos   |
| Descripción     | Instrucciones que todavía no han liquidado totalmente en la sesión. Este fichero al final de la sesión recoge las Instrucciones fallidas de cualquier FTL sin tener en cuenta las Operaciones retenidas que quedan recogidas en 8.2 |
| Destinatarios   | Miembro, Miembro Compensador, Entidad Participante del segmento de RV y RF.   |
| Privacidad      | Contiene datos privados   |
| Timing          | Disponible a fin de sesión. Dinámico, varía durante la sesión   |

| TAG                                    | NOMBRE               | FIXML       | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO      | DESCRIPCIÓN   |
|--|----------------------|-------------|-----|--|--------------|---|
| <b>CPENDINGINST / TrdCaptRpt</b>       |                      |             |     |  | (n times)    |   |
| 1003                                   | TradeID              | TrdID       | N   |  | String       | Identificador de registro de la ECC. Este campo siempre está presente en el mensaje                                   |
| 828                                    | TrdType              | TrdTyp      | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | Int          | Tipo de Operación FIX. Este valor es usado conjuntamente con TrdSubType [829]   |
| 829                                    | TrdSubType           | TrdSubTyp   | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | Int          | Este valor es usado conjuntamente con TrdType [828]   |
| 32                                     | LastQty              | LastQty     | S   | >= 0, sin decimales                                | Qty          | Volumen/Nominal de la Instrucción   |
| 151*                                   | LeavesQty            | LeavesQty   | N   |  | Qty          | Volumen / Nominal vivo de la Instrucción  |
| 31                                     | LastPx               | LastPx      | S   |  | Price        | Precio de la Instrucción que se describe. Para RF se mostrará en %  |
| 15                                     | Currency             | Ccy         | N   |  | Currency     | Código de divisa. Expresada según estándar ISO 4217   |
| 60                                     | TransactTime         | TxnTm       | N   |  | UTCTimestamp | Fecha y hora, en formato UTC, en que se realizó la transacción.   |
| 64                                     | SettlDate            | SettlDt     | N   |  | LocalMktDate | Fecha Teórica de Liquidación  |
| 381                                    | GrossTradeAmt        | GrossTrdAmt | N   |  | Amt          | Importe Efectivo de la Instrucción<br>Puede ser negativo en función del resultado de la compensación en cuentas netas |
| 5681*                                  | ExchangeTradeType    | ExchTrdTyp  | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | String       | Tipo de Operación de la ECC   |
| 715                                    | ClearingBusinessDate | BizDt       | S   |  | LocalMktDate | Fecha de la sesión  |
| 716                                    | SettlSessID          | SetSesID    | N   | ITD = Intradía<br>EOD = Fin de sesión              | String       | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión   |
| <b>CPENDINGINST / TrdCaptRpt / Hdr</b> |                      |             |     |  |              |   |
| 35                                     | MsgType              | MsgTyp      | S   | AE   | String       | Identifica el tipo de mensaje   |
| 49                                     | SenderCompID         | SID         | S   |  | String       | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"   |
| 56                                     | TargetCompID         | TID         | S   |  | String       | Contiene "????"   |

| TAG   | NOMBRE           | FIXML   | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|---|------------------|---------|-----|--|---------------|---|
| 50  | SenderSubID      | SSub    | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC  |
| 52  | SendingTime      | Snt     | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero  |
| <b>CPENDINGINST /TrdCaptRpt/ Instrmt</b>      |                  |         |     |  |               |   |
| 55  | Symbol           | Sym     | N   | [N/A]<br>o código de valor                         | String(5)     |   |
| 48  | SecurityID       | ID      | N   |  | String(12)    | Código ISIN   |
| 22  | SecurityIDSource | Src     | N   | 4 = ISIN number                                    | String        |   |
| <b>CPENDINGINST /TrdCaptRpt/ Amt</b>          |                  |         |     |  |               | (n times)   |
| →<br>708                                      | PosAmt           | Amt     | N   |  | Amt           |   |
| →<br>1585                                     | PosAmtReason     | Rsn     | N   | 1000 = Importe Efectivo vivo de la Operación       | Int           | Es el importe efectivo pendiente de liquidar total o parcialmente<br>(1 time)                                   |
| <b>CPENDINGINST /TrdCaptRpt/ RptSide</b>      |                  |         |     |  |               | Siempre 1 ya que sólo se incluye la parte compradora o vendedora, según corresponda al destinatario del mensaje |
| → 54  | Side             | Side    | S   | 1 = Buy<br>2 = Sell                                | Char          | Signo de la posición de Valores   |
| → 77  | PositionEffect   | PosEfct | N   | "O" = Open   |               |   |
| <b>CPENDINGINST /TrdCaptRpt/ RptSide/ Pty</b> |                  |         |     |  |               | (n times)   |
|   |                  |         |     |  |               | Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC   |
|   |                  |         |     |  |               | Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC                                       |
|   |                  |         |     |  |               | Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV  |
| →→<br>448                                     | PartyID          | ID      | N   |  | String        | Si PartyRole[452]=38, contiene la cuenta de Posición  |
|   |                  |         |     |  |               | Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante   |
|   |                  |         |     |  |               | Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación  |

| TAG  | NOMBRE           | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS   | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|--|------------------|-------|-----|---|---------|---|
| à→<br>447                                      | PartyIDSource    | Src   | N   | D = Proprietary/<br>Custom code                         | Char    |   |
|  |                  |       |     | 1 = Executing Firm                                      |         |   |
|  |                  |       |     | 4 = Clearing Firm                                       |         |   |
|  |                  |       |     | 10 = CSD Code   |         |   |
| →→<br>452                                      | PartyRole        | R     | N   | 38 = Position<br>Account                                | Int     | Indica el rol que toma el<br>código especificado en<br>PartyID  |
|  |                  |       |     | 90 = Settlement Firm                                    |         |   |
|  |                  |       |     | 91 = Settlement<br>account                              |         |   |
| <b>CPENDINGINST /TrdCaptRpt/ RptSide/ Stip</b> |                  |       |     |   |         | (n times)   |
| →→ 233   | StipulationType  | Typ   | N   | CLIQ<br>ILIQDCV<br>TINST<br>ICORPCV<br>BUYIND<br>NDAYSL | String  |   |
|  |                  |       |     |   |         | Para Instrucciones de<br>Liquidación:   |
|  |                  |       |     |   |         | <ul style="list-style-type: none"> <li>• Si StipulationType [233] = CLIQ, contiene el número de la ventana de agregación en la que se envía la Instrucción a liquidar</li> <li>• Si StipulationType [233] = ILIQDCV, contiene el identificador de la Instrucción Liquidación en el DCV</li> <li>• Si StipulationType [233] = TINST, contiene el Tipo Instrucción: <ul style="list-style-type: none"> <li>* DVP = Entrega contra pago</li> <li>* RVP = Recepción contra pago</li> <li>* DWP = Entrega con pago</li> <li>* DFP = Entrega libre de pago</li> <li>* RFP = Recepción libre de pago</li> <li>* PWD = Pago / cobro sin entrega de Valores</li> </ul> </li> </ul> |
| →→ 234   | StipulationValue | Val   | N   |   | String  |   |

| TAG | NOMBRE | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|-----|--------|-------|-----|-----------------|---------|---|
|     |        |       |     |                 |         | <ul style="list-style-type: none"> <li>* ROC = Instrucciones de pago sin entrega con efectivo cero</li> <li>* RWP = Recepción con pago</li> <li>• Si StipulationType [233] = BUYIND, contiene la fecha de recompra</li> <li>• Si StipulationType [233] = NDAYS, contiene el número de días fallida</li> </ul> <p>Para Eventos Corporativos:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Si StipulationType [233] = ICORPDCV, contiene el identificador del Evento en el DCV</li> </ul> |

### 15.3 Liquidación de Fallidos por Recompra

| CFAILBUYIN.sc |   |
|---------------|---|
| Grupo         | Información de Liquidaciones y Fallidos   |
| Descripción   | Información de los Fallidos liquidados por Recompra en la sesión del segmento de RV y RF. |
| Destinatarios | Miembro, Miembro Compensador, Entidad Participante  |
| Privacidad    | Contiene datos privados   |
| Timing        | Estático, sólo está disponible al cierre de sesión  |

| TAG                            | NOMBRE      | FIXML     | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO   | DESCRIPCIÓN   |
|--------------------------------|-------------|-----------|-----|--|-----------|---|
| <b>CFAILBUYIN / TrdCaptRpt</b> |             |           |     |  | (n times) |   |
| 1003                           | TradeID     | TrdID     | N   |  | String    | Identificador de registro de la ECC. Este campo siempre está presente en el mensaje   |
| 828                            | TrdType     | TrdTyp    | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | Int       | Tipo de Operación FIX. Este valor es usado conjuntamente con TrdSubType [829]         |
| 829                            | TrdSubType  | TrdSubTyp | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | Int       | Este valor es usado conjuntamente con TrdType [828]                                   |
| 1126                           | OrigTradeID | OrigTrdID | N   |  | String    | Contiene el identificador de registro de la ECC de la Instrucción fallida que liquida |

| TAG                                    | NOMBRE               | FIXML       | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN  |
|--|----------------------|-------------|-----|--|---------------|--|
| 32                                     | LastQty              | LastQty     | S   | >= 0, sin decimales                                | Qty           | Volumen/Nominal de la Operación de Recompra                          |
| 151*                                   | LeavesQty            | LeavesQty   | N   |  | Qty           | Volumen/Nominal vivo de la Operación                                 |
| 31                                     | LastPx               | LastPx      | S   |  | Price         | Precio medio de la Instrucción que liquida. Para RF se mostrará en % |
| 15                                     | Currency             | Ccy         | N   |  | Currency      | Código de divisa. Expresada según estándar ISO 4217                  |
| 60                                     | TransactTime         | TxnTm       | N   |  | UTCTimestamp  | Fecha y hora, en formato UTC, de la operación                        |
| 64                                     | SettlDate            | SettlDt     | N   |  | LocalMktDate  | Fecha Teórica de Liquidación de la operación                         |
| 381                                    | GrossTradeAmt        | GrossTrdAmt | N   |  | Amt           | Importe Efectivo de la recompra                                      |
| 5681*                                  | ExchangeTradeType    | ExchTrdTyp  | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Tipo de Operación de la ECC  |
| 715                                    | ClearingBusinessDate | BizDt       | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión   |
| 716                                    | SettlSessID          | SetSesID    | N   | EOD = Fin de sesión                                | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión                |
| <b>CFAILBUYIN / TrdCaptRpt / Hdr</b>   |                      |             |     |  |               |  |
| 35                                     | MsgType              | MsgTyp      | S   | AE   | String        | Identifica el tipo de mensaje  |
| 49                                     | SenderCompID         | SID         | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"  |
| 56                                     | TargetCompID         | TID         | S   |  | String        | Contiene "????"  |
| 50                                     | SenderSubID          | SSub        | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC                             |
| 52                                     | SendingTime          | Snt         | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero                                       |
| <b>CFAILBUYIN /TrdCaptRpt/ Instrmt</b> |                      |             |     |  |               |  |
| 55                                     | Symbol               | Sym         | N   | [N/A]<br>o código de valor                         | String(5)     |  |
| 48                                     | SecurityID           | ID          | N   |  | String(12)    | Código ISIN  |
| 22                                     | SecurityIDSource     | Src         | N   | 4 = ISIN number                                    | String        |  |
| <b>CFAILBUYIN /TrdCaptRpt/ RptSide</b> |                      |             |     |  |               | (1 time)   |

| TAG  | NOMBRE          | FIXML   | REQ | VALORES VÁLIDOS   | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|--|-----------------|---------|-----|---|---------|---|
|  |                 |         |     |   |         | Siempre 1 ya que sólo se incluye la parte compradora o vendedora, según corresponda al destinatario del mensaje.  |
| à 54   | Side            | Side    | S   | 1 = Buy<br>2 = Sell   | Char    | Signo de la posición de Valores   |
| → 77   | PositionEffect  | PosEfct | N   | "O" = Open  |         |   |
| <b>CFAILBUYIN /TrdCaptRpt/ RptSide/ Pty</b>  |                 |         |     |   |         | (n times)   |
|  |                 |         |     |   |         | Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC   |
|  |                 |         |     |   |         | Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC   |
| →→ 448                                       | PartyID         | ID      | N   |   | String  | Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV<br>Si PartyRole[452]=38, contiene la cuenta de Posición<br>Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante<br>Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación |
| →→ 447                                       | PartyIDSource   | Src     | N   | D = Proprietary/<br>Custom code<br>1 = Executing Firm<br>4 = Clearing Firm<br>10 = CSD Code | Char    |   |
| →→ 452                                       | PartyRole       | R       | N   | 38 = Position Account<br>90 = Settlement Firm<br>91 = Settlement account                    | Int     | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID  |
| <b>CFAILBUYIN /TrdCaptRpt/ RptSide/ Stip</b> |                 |         |     |   |         | (n times)   |
| →→ 233                                       | StipulationType | Typ     | N   | CLIQ<br>ILIQDCV<br>TINST<br>QTYM<br>AMTM  | String  |   |

| TAG    | NOMBRE           | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS | FORMATO | DESCRIPCIÓN  |
|--------|------------------|-------|-----|-----------------|---------|--|
| à→ 234 | StipulationValue | Val   | N   |                 | String  | <p>Para Instrucciones de Liquidación:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Si StipulationType [233] = CLIQ, contiene el número de la ventana de agregación en la que se envía la Instrucción a liquidar</li> <li>• Si StipulationType [233] = ILIQDCV, contiene el identificador de la Instrucción Liquidación en el DCV</li> <li>• Si StipulationType [233] = TINST, contiene el Tipo Instrucción: <ul style="list-style-type: none"> <li>* DVP = Entrega contra pago</li> <li>* RVP = Recepción contra pago</li> <li>* PWD = Pago / cobro sin entrega de Valores</li> </ul> </li> <li>• Si StipulationType [233] = QTYM, contiene el número de Valores / Nominal de la Instrucción fallida que liquida</li> <li>• Si StipulationType [233] = AMTM, contiene el importe efectivo de la Instrucción fallida que liquida</li> </ul> |

## 15.4 Liquidación de Fallidos en Efectivo

| CFAILCASHSETTL.sc |  |
|-------------------|--|
| Grupo             | Información de Liquidaciones y Fallidos  |
| Descripción       | Información de los Fallidos liquidados en efectivo en la sesión del segmento de RV y RF. |
| Destinatarios     | Miembro, Miembro Compensador, Entidad Participante                                       |
| Privacidad        | Contiene datos privados  |
| Timing            | Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.                                      |

| TAG                                      | NOMBRE               | FIXML       | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO      | DESCRIPCIÓN   |
|--|----------------------|-------------|-----|--|--------------|---|
| <b>CFAILCASHSETTL / TrdCaptRpt</b>       |                      |             |     |  | (n times)    |   |
| 1003                                     | TradeID              | TrdID       | N   |  | String       | Identificador de registro de la ECC. Este campo siempre está presente en el mensaje |
| 828                                      | TrdType              | TrdTyp      | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | Int          | Tipo de Operación FIX. Este valor es usado conjuntamente con TrdSubType [829]       |
| 829                                      | TrdSubType           | TrdSubTyp   | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | Int          | Este valor es usado conjuntamente con TrdType [828]                                 |
| 1126                                     | OrigTradeID          | OrigTrdID   | N   |  | String       | Contiene el identificador de registro de la ECC de la Instrucción que liquida       |
| 32                                       | LastQty              | LastQty     | S   | >= 0, sin decimales                                | Qty          | Volumen/Nominal de la Operación   |
| 31                                       | LastPx               | LastPx      | S   |  | Price        | Precio para el cálculo de la compensación. Para RF se mostrará en %                 |
| 15                                       | Currency             | Ccy         | N   |  | Currency     | Código de divisa. Expresada según estándar ISO 4217                                 |
| 60                                       | TransactTime         | TxnTm       | N   |  | UTCTimestamp | Fecha y hora, en formato UTC, en que se realizó la transacción.                     |
| 64                                       | SettleDate           | SettleDt    | N   |  | LocalMktDate | Fecha de liquidación del efectivo   |
| 381                                      | GrossTradeAmt        | GrossTrdAmt | N   |  | Amt          | Importe compensación en efectivo  |
| 5681*                                    | ExchangeTradeType    | ExchTrdTyp  | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | String       | Tipo de Operación de la ECC   |
| 715                                      | ClearingBusinessDate | BizDt       | S   |  | LocalMktDate | Fecha de la sesión  |
| 716                                      | SettleSessionID      | SetSesID    | N   | EOD = Fin de sesión                                | String       | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión                               |
| <b>CFAILCASHSETTL / TrdCaptRpt / Hdr</b> |                      |             |     |  |              |   |
| 35                                       | MsgType              | MsgTyp      | S   | AE   | String       | Identifica el tipo de mensaje   |
| 49                                       | SenderCompID         | SID         | S   |  | String       | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"                 |
| 56                                       | TargetCompID         | TID         | S   |  | String       | Contiene "????"   |
| 50                                       | SenderSubID          | SSub        | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String       | Contiene el código de Segmento de la ECC  |

| TAG   | NOMBRE           | FIXML   | REQ | VALORES VÁLIDOS                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|---|------------------|---------|-----|------------------------------------|---------------|---|
| 52  | SendingTime      | Snt     | S   |                                    | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero  |
| <b>CFAILCASHSETTL /TrdCaptRpt/ Instrmt</b>      |                  |         |     |                                    |               |   |
| 55  | Symbol           | Sym     | N   | [N/A] o código de valor            | String(5)     |   |
| 48  | SecurityID       | ID      | N   |                                    | String(12)    | Código ISIN   |
| 22  | SecurityIDSource | Src     | N   | 4 = ISIN number                    | String        | (1 time)  |
| <b>CFAILCASHSETTL /TrdCaptRpt/ RptSide</b>      |                  |         |     |                                    |               |   |
| → 54  | Side             | Side    | S   | 1 = Buy<br>2 = Sell                | Char          | Si es 1 es efectivo a pagar y si es 2 es efectivo a recibir               |
| → 77  | PositionEffect   | PosEfct | N   | "O" = Open                         |               |   |
| <b>CFAILCASHSETTL /TrdCaptRpt/ RptSide/ Pty</b> |                  |         |     |                                    |               |   |
|   |                  |         |     |                                    |               | (n times)   |
|   |                  |         |     |                                    |               | Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC             |
|   |                  |         |     |                                    |               | Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC |
|   |                  |         |     |                                    |               | Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV                          |
| →→ 448  | PartyID          | ID      | N   |                                    | String        | Si PartyRole[452]=38, contiene la cuenta de Posición                      |
|   |                  |         |     |                                    |               | Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante       |
|   |                  |         |     |                                    |               | Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación      |
| →→ 447  | PartyIDSource    | Src     | N   | D = Proprietary/<br>Custom code    | Char          |   |
|   |                  |         |     |                                    |               | 1 = Executing Firm  |
| →→ 452  | PartyRole        | R       | N   | 4 = Clearing Firm<br>10 = CSD Code | Int           | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID                  |

| TAG  | NOMBRE           | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS  | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|--|------------------|-------|-----|--|---------|---|
|  |                  |       |     | 38 = Position Account<br>90 = Settlement Firm<br>91 = Settlement account |         |   |
| <b>CFAILCASHSETTL /TrdCaptRpt/ RptSide/ Stip</b> |                  |       |     |  |         | (n times)   |
| →→ 233   | StipulationType  | Typ   | N   | CLIQ<br>ILIQDCV<br>TINST<br>QTYM<br>AMTM                                 | String  |   |
|  |                  |       |     |  |         | Para Instrucciones de Liquidación: <ul style="list-style-type: none"> <li>• Si StipulationType [233] = CLIQ, contiene el número de la ventana de agregación en la que se envía la Instrucción a liquidar</li> <li>• Si StipulationType [233] = ILIQDCV, contiene el identificador de la Instrucción Liquidación en el DCV</li> <li>• Si StipulationType [233] = TINST, contiene el Tipo Instrucción: <ul style="list-style-type: none"> <li>* PWD = Pago / cobro sin entrega de Valores</li> </ul> </li> <li>• Si StipulationType [233] = QTYM, contiene el número de Valores / Nominal de la Instrucción fallida que liquida</li> <li>• Si StipulationType [233] = AMTM, contiene el importe efectivo de la Instrucción fallida que liquida</li> </ul> |
| →→ 234   | StipulationValue | Val   | N   |  | String  |   |

## 15.5 Penalizaciones DCV

| <b>CFAILPENALTIES.sc</b> |  |
|--------------------------|--|
| Grupo                    | Información de Liquidaciones y Fallidos  |
| Descripción              | Información mensual de las penalizaciones resultantes de los Fallidos de liquidación del segmento de RV y RF recibidas del DCV |

**CFAILPENALTIES.sc**

|               |   |
|---------------|---|
| Destinatarios | Miembro, Miembro Compensador, Entidad Participante  |
| Privacidad    | Contiene datos privados                             |
| Timing        | Estático, sólo está disponible al cierre de sesión. |

| TAG  | NOMBRE               | FIXML     | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|--|----------------------|-----------|-----|--|---------------|---|
| <b>CFAILPENALTIES / TrdCaptRpt</b>           |                      |           |     |  |               | (n times)   |
| 1003   | TradeID              | TrdID     | N   |  | String        | Campo no incluido   |
| 1126   | OrigTradeID          | OrigTrdID | N   |  | String        | Campo no incluido   |
| 32   | LastQty              | LastQty   | N   | >= 0, sin decimales                                | Qty           | Campo no incluido   |
| 151*   | LeavesQty            | LeavesQty | N   |  | Qty           | Campo no incluido   |
| 31   | LastPx               | LastPx    | N   |  | Price         | Campo no incluido   |
| 15   | Currency             | Ccy       | N   |  | Currency      | Código de divisa. Expresada según estándar ISO 4217                       |
| 64   | SettlDate            | SettlDt   | N   |  | LocalMktDate  | Fecha del último día del mes de cómputo de penalizaciones                 |
| 715  | ClearingBusinessDate | BizDt     | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión  |
| 716  | SettlSessID          | SetSesID  | N   | EOD = Fin de sesión                                | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión                     |
| <b>CFAILPENALTIES / TrdCaptRpt / Hdr</b>     |                      |           |     |  |               |   |
| 35   | MsgType              | MsgTyp    | S   | AE   | String        | Identifica el tipo de mensaje   |
| 49   | SenderCompID         | SID       | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"       |
| 56   | TargetCompID         | TID       | S   |  | String        | Contiene "????"   |
| 50   | SenderSubID          | SSub      | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC                                  |
| 52   | SendingTime          | Snt       | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero  |
| <b>CFAILPENALTIES / TrdCaptRpt / Instrmt</b> |                      |           |     |  |               |   |
| 55   | Symbol               | Sym       | N   | [N/A]<br>o código de valor                         | String(5)     | Campo no incluido   |
| 48   | SecurityID           | ID        | N   |  | String(12)    | Campo no incluido   |
| 22   | SecurityIDSource     | Src       | N   | 4 = ISIN number                                    | String        | Campo no incluido   |
| <b>CFAILPENALTIES / TrdCaptRpt / Amt</b>     |                      |           |     |  |               |   |
| →<br>2097                                    | PositionFXRate       | FxRt      | N   |  | Float         | Campo no incluido   |
| →<br>708                                     | PosAmt               | Amt       | N   |  | Amt           | Importe penalización:<br>Si es positivo = abono<br>Si es negativo = cargo |

| TAG   | NOMBRE        | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS   | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|---|---------------|-------|-----|---|---------|---|
| à<br>1585                                       | PosAmtReason  | Rsn   | N   | 2002  | Int     | 2002 = penalización mensual DCV   |
| <b>CFAILPENALTIES /TrdCaptRpt/ RptSide</b>      |               |       |     |   |         |   |
| → 54  | Side          | Side  | N   | 1 = Buy<br>2 = Sell   | Char    | Campo no incluido   |
| <b>CFAILPENALTIES /TrdCaptRpt/ RptSide/ Pty</b> |               |       |     |   |         |   |
|   |               |       |     |   |         | (n times)   |
|   |               |       |     |   |         | Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC             |
|   |               |       |     |   |         | Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC |
|   |               |       |     |   |         | Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV                          |
| →→<br>448                                       | PartyID       | ID    | N   |   | String  | Si PartyRole[452]=38, contiene la cuenta de Posición                      |
|   |               |       |     |   |         | Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante       |
|   |               |       |     |   |         | Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación      |
| →→<br>447                                       | PartyIDSource | Src   | N   | D = Proprietary/<br>Custom code<br>1 = Executing Firm<br>4 = Clearing Firm<br>10 = CSD Code | Char    |   |
| →→<br>452                                       | PartyRole     | R     | N   | 38 = Position Account<br>90 = Settlement Firm<br>91 = Settlement account                    | Int     | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID                  |

## 15.6 Comisiones por fallidos

| <b>CFAILFEES.sc</b> |  |
|---------------------|--|
| Grupo               | Información de Liquidaciones y Fallidos  |
| Descripción         | Información de los costes administrativos por fallido y por recompra resultantes de los Fallidos de liquidación del segmento de RV y RF. |
| Destinatarios       | Miembro, Miembro Compensador, Entidad Participante   |
| Privacidad          | Contiene datos privados  |

**CFAILFEES.sc**

Timing Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

| TAG                                   | NOMBRE               | FIXML     | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|---------------------------------------|----------------------|-----------|-----|--|---------------|---|
| <b>CFAILFEES / TrdCaptRpt</b>         |                      |           |     |  | (n times)     |   |
| 1003                                  | TradeID              | TrdID     | N   |  | String        | Identificador de registro de la ECC.  |
| 1126                                  | OrigTradeID          | OrigTrdID | N   |  | String        | Contiene el identificador de registro de la ECC de la Instrucción que liquida |
| 32                                    | LastQty              | LastQty   | N   | >= 0, sin decimales                                | Qty           | Volumen/Nominal de la Operación   |
| 151*                                  | LeavesQty            | LeavesQty | N   |  | Qty           | Volumen/Nominal al que aplica la penalización.                                |
| 31                                    | LastPx               | LastPx    | S   |  | Price         | Precio para el cálculo de la compensación.<br>Para RF se mostrará en %        |
| 15                                    | Currency             | Ccy       | N   |  | Currency      | Código de divisa. Expresada según estándar ISO 4217                           |
| 64                                    | SettlDate            | SettlDt   | N   |  | LocalMktDate  | Fecha Teórica de Liquidación  |
| 715                                   | ClearingBusinessDate | BizDt     | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión  |
| 716                                   | SettlSessID          | SetSesID  | N   | EOD = Fin de sesión                                | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión                         |
| <b>CFAILFEES / TrdCaptRpt / Hdr</b>   |                      |           |     |  |               |   |
| 35                                    | MsgType              | MsgTyp    | S   | AE   | String        | Identifica el tipo de mensaje   |
| 49                                    | SenderCompID         | SID       | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"           |
| 56                                    | TargetCompID         | TID       | S   |  | String        | Contiene "????"   |
| 50                                    | SenderSubID          | SSub      | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC                                      |
| 52                                    | SendingTime          | Snt       | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero  |
| <b>CFAILFEES /TrdCaptRpt/ Instrmt</b> |                      |           |     |  |               |   |
| 55                                    | Symbol               | Sym       | N   | [N/A]<br>o código de valor                         | String(5)     |   |
| 48                                    | SecurityID           | ID        | N   |  | String(12)    | Código ISIN   |
| 22                                    | SecurityIDSource     | Src       | N   | 4 = ISIN number                                    | String        |   |
| <b>CFAILFEES /TrdCaptRpt/ Amt</b>     |                      |           |     |  |               |   |

| TAG  | NOMBRE             | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS  | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|--|--------------------|-------|-----|--|---------|---|
| →<br>2097                                  | PositionFXR<br>ate | FxRt  | N   |  | Float   | Porcentaje aplicable en la penalización diaria  |
| →<br>708                                   | PosAmt             | Amt   | N   |  | Amt     | Importe   |
| →<br>1585                                  | PosAmtReas<br>on   | Rsn   | N   | 2001<br>2003   | Int     | 2001 = coste administrativo por recompra o liquidación en efectivo<br>2003 = coste administrativo por fallido (1 time)  |
| <b>CFAILFEES /TrdCaptRpt/ RptSide</b>      |                    |       |     |  |         | Siempre 1 ya que sólo se incluye la parte compradora o vendedora, según corresponda al destinatario del mensaje   |
| → 54                                       | Side               | Side  | N   | 1 = Buy<br>2 = Sell  | Char    | Signo de la Operación   |
| <b>CFAILFEES /TrdCaptRpt/ RptSide/ Pty</b> |                    |       |     |  |         | (n times)   |
| →→<br>448                                  | PartyID            | ID    | N   |  | String  | Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC<br>Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC<br>Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV<br>Si PartyRole[452]=38, contiene la cuenta de Posición<br>Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante<br>Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación |
| →→<br>447                                  | PartyIDSour<br>ce  | Src   | N   | D = Proprietary/<br>Custom code<br>1 = Executing Firm<br>4 = Clearing Firm | Char    |   |
| →→<br>452                                  | PartyRole          | R     | N   | 10 = CSD Code<br>38 = Position<br>Account<br>90 = Settlement Firm          | Int     | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID  |

| TAG | NOMBRE | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS            | FORMATO | DESCRIPCIÓN |
|-----|--------|-------|-----|----------------------------|---------|-------------|
|     |        |       |     | 91 = Settlement<br>account |         |             |

## 16 Información de Eventos

### 16.1 Instrucciones generadas sobre Fallidos por Eventos Corporativos

| <b>CFAILSADJUST.sc</b> |   |
|------------------------|---|
| Grupo                  | Información de Eventos  |
| Descripción            | Información de las Instrucciones generadas o canceladas por Eventos Corporativos del segmento de RV y RF. |
| Destinatarios          | Miembro, Miembro Compensador, Entidad Participante  |
| Privacidad             | Contiene datos privados   |
| Timing                 | Estático, sólo está disponible al cierre de sesión  |

| TAG                              | NOMBRE            | FIXML       | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO      | DESCRIPCIÓN  |
|----------------------------------|-------------------|-------------|-----|--|--------------|--|
| <b>CFAILSADJUST / TrdCaptRpt</b> |                   |             |     |  | (n times)    |  |
| 1003                             | TradelID          | TrdID       | N   |  | String       | Identificador de registro de la ECC. Este campo siempre está presente en el mensaje              |
| 828                              | TrdType           | TrdTyp      | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | Int          | Tipo de Operación FIX. Este valor es usado conjuntamente con TrdSubType [829]                    |
| 829                              | TrdSubType        | TrdSubTyp   | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | Int          | Este valor es usado conjuntamente con TrdType [828]  |
| 1126                             | OrigTradelID      | OrigTrdID   | N   |  | String       | Este campo contiene el identificador de registro de la ECC de la Instrucción fallida que cancela |
| 32                               | LastQty           | LastQty     | S   | >= 0, sin decimales                                | Qty          | Volumen/Nominal de la Operación  |
| 151*                             | LeavesQty         | LeavesQty   | N   |  | Qty          | Volumen/Nominal vivo de la Operación   |
| 31                               | LastPx            | LastPx      | S   |  | Price        | Precio de la Operación que se describe. Para RF se mostrará en %                                 |
| 15                               | Currency          | Ccy         | N   |  | Currency     | Código de divisa. Expresada según estándar ISO 4217  |
| 60                               | TransactTime      | TxnTm       | N   |  | UTCTimestamp | Fecha y hora, en formato UTC, en que se realizó la transacción                                   |
| 64                               | SettlDate         | SettlDt     | N   |  | LocalMktDate | Fecha Teórica de Liquidación   |
| 381                              | GrossTradeAmt     | GrossTrdAmt | N   |  | Amt          | Importe Efectivo de la Instrucción   |
| 5681*                            | ExchangeTradeType | ExchTrdType | N   | Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación" | String       | Tipo de Operación de la ECC  |

| TAG   | NOMBRE               | FIXML    | REQ | VALORES VÁLIDOS                                    | FORMATO       | DESCRIPCIÓN   |
|---|----------------------|----------|-----|--|---------------|---|
| 715   | ClearingBusinessDate | BizDt    | S   |  | LocalMktDate  | Fecha de la sesión  |
| 716   | SettlSessionID       | SetSesID | N   | EOD = Fin de sesión                                | String        | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión   |
| <b>CFAILSADJUST / TrdCaptRpt / Hdr</b>        |                      |          |     |  |               |   |
| 35  | MsgType              | MsgTyp   | S   | AE   | String        | Identifica el tipo de mensaje   |
| 49  | SenderCompanyID      | SID      | S   |  | String        | Identificador de la entidad que envía el mensaje<br>Contiene "BMCL"   |
| 56  | TargetCompanyID      | TID      | S   |  | String        | Contiene "????"   |
| 50  | SenderSubID          | SSub     | S*  | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String        | Contiene el código de Segmento de la ECC  |
| 52  | SendingTime          | Snt      | S   |  | UTC Timestamp | Hora de generación del fichero  |
| <b>CFAILSADJUST /TrdCaptRpt/ Instrmt</b>      |                      |          |     |  |               |   |
| 55  | Symbol               | Sym      | N   | [N/A]<br>o código de valor                         | String(5)     |   |
| 48  | SecurityID           | ID       | N   |  | String(12)    | Código ISIN   |
| 22  | SecurityID Source    | Src      | N   | 4 = ISIN number                                    | String        |   |
| <b>CFAILSADJUST /TrdCaptRpt/ RptSide</b>      |                      |          |     |  |               |   |
|   |                      |          |     |  |               | (1 time)  |
|   |                      |          |     |  |               | Siempre 1 ya que sólo se incluye la parte compradora o vendedora, según corresponda al destinatario del mensaje                   |
| → 54  | Side                 | Side     | S   | 1 = Buy<br>2 = Sell                                | Char          | Signo de la posición de Valores   |
| → 77  | PositionEffect       | PosEfct  | N   | "O" = Open<br>"C" = Close                          |               | Indica si la Operación abre o cierra posición   |
| <b>CFAILSADJUST /TrdCaptRpt/ RptSide/ Pty</b> |                      |          |     |  |               |   |
|   |                      |          |     |  |               | (n times)   |
|   |                      |          |     |  |               | Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC   |
| →→<br>448                                     | PartyID              | ID       | N   |  | String        | Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC<br><br>Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV |

| TAG  | NOMBRE               | FIXML | REQ | VALORES VÁLIDOS                 | FORMATO | DESCRIPCIÓN   |
|--|----------------------|-------|-----|---------------------------------|---------|---|
|  |                      |       |     |                                 |         | Si PartyRole[452]=38, contiene la Cuenta de Posición  |
|  |                      |       |     |                                 |         | Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante   |
|  |                      |       |     |                                 |         | Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación  |
| à→<br>447                                      | PartyIDSource        | Src   | N   | D = Proprietary/<br>Custom code | Char    |   |
|  |                      |       |     | 1 = Executing Firm              |         |   |
|  |                      |       |     | 4 = Clearing Firm               |         |   |
|  |                      |       |     | 10 = CSD Code                   |         |   |
| →→<br>452                                      | PartyRole            | R     | N   | 38 = Position<br>Account        | Int     | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID  |
|  |                      |       |     | 90 = Settlement Firm            |         |   |
|  |                      |       |     | 91 = Settlement<br>account      |         |   |
| <b>CFAILSADJUST /TrdCaptRpt/ RptSide/ Stip</b> |                      |       |     |                                 |         | (n times)   |
| →→ 233   | Stipulation<br>Type  | Typ   | N   | ICORPDCV                        | String  |   |
| →→ 234   | Stipulation<br>Value | Val   | N   |                                 | String  | <ul style="list-style-type: none"> <li>Si StipulationType [233] = ICORPDCV, contiene el identificador del Evento en el DCV</li> </ul> |

## Apéndice A Información adicional

### A.1 Campos de Usuario

En la siguiente tabla se presentan los campos de usuario usados en los mensajes de este manual:

| TAG  | NOMBRE            | FORMATO | DESCRIPCIÓN                 |
|------|-------------------|---------|-----------------------------|
| 5681 | ExchangeTradeType | String  | Tipo de Operación de la ECC |



Tramontana, 2 bis  
28231 Las Rozas (Madrid)  
[www.bmeclearing.es](http://www.bmeclearing.es)



---

Plaza de la Lealtad,1  
Palacio de la Bolsa  
28014 Madrid  
[www.bolsasymercados.es](http://www.bolsasymercados.es)

