



Segmentos de Renta Variable y Renta Fija

Interfaz FIXML / 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
21 de noviembre de 2014	1.2	Change Requests octubre 2014	BME Clearing IT
23 de marzo de 2015	1.3	Change Requests marzo 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. Otros cambios por implantación T2S.	BME Clearing IT
1 de diciembre de 2017	1.9	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 la nueva estructura de cuentas.	BME Clearing IT
12 de julio de 2018	1.12	Mensajes CH, CJ se dan a nivel de cuenta de colateral.	BME Clearing IT
5 de noviembre de 2018	1.13	Mensaje CQ a nivel de Miembro Compensador: se añade el Grupo de Movimientos de Efectivo.	BME Clearing IT
15 de marzo de 2019	1.14	Mensaje CQ a nivel de Miembro Compensador: no se informa del Agente de Pagos.	BME Clearing IT
15 de febrero de 2020	1.17	Cambios en mensajes 'y', 'AE' y 'AP', para el segmento de Renta Fija.	BME Clearing IT
1 de marzo de 2021	1.19	Cambio en mensaje 'AE' para el segmento de Renta Fija.	BME Clearing IT
11 de noviembre de 2022	1.24	Cambio en mensaje 'BA'.	BME Clearing IT

Modificaciones realizadas en la última revisión

Principales cambios respecto a la documentación v1.19 publicada el 1 de marzo de 2021:

- Cambio en mensaje 'BA': nuevos valores para los campos StipulationType[233] y StipulationType[234].

Tabla de Contenidos

1. INTRODUCCIÓN	1
1.1 Ámbito de este manual	1
1.2 Información pública e información privada	1
1.3 Organización del manual	2
1.4 Formato de las tablas de definición de mensajes	3
1.5 Documentos relacionados	3
2. DECISIONES DE IMPLEMENTACIÓN	4
2.1 Descripción	4
2.2 Campos ignorados	4
2.3 Campos no soportados	4
2.4 Longitud del tipo String	4
2.5 Máxima longitud de mensaje	4
3. CONVENCIONES GENERALES EN LOS MENSAJES DE APLICACIÓN	5
3.1 Identificación de operaciones	5
3.2 Bloque Parties	5
3.3 Formato de Error (Campo Text)	7
3.4 Sincronización a nivel de aplicación	7
4. MENSAJES GENÉRICOS DEL NIVEL DE APLICACIÓN	8
4.1 Rechazo de mensajes de aplicación	8
4.2 Lista de mensajes	8
4.3 Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0	8
4.4 Definición de mensajes	8
5. INFORMACIÓN GENERAL	10
5.1 Introducción	10
5.2 Información General: Valores	10
5.3 Información General: Precios de los Valores	11
5.4 Definición de mensajes	12

6. SEGUIMIENTO DE LA OPERATIVA	19
6.1 Introducción	19
6.2 Obtención de la información	19
6.3 Información por Miembro Negociador y/o Compensador y/o Entidad Participante	19
6.4 Lista de mensajes	19
6.5 Flujo de mensajes	20
6.6 Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0	20
6.7 Campo TransferReason del mensaje Trade Capture Report	20
6.8 Definición de mensajes	21
7. ASIGNACIÓN DE OPERACIONES	32
7.1 Introducción	32
7.2 Asignación Interna de Cuenta y Traspaso	32
7.3 Asignación Externa (Miembro Origen – Give-up Trading Firm)	32
7.4 Aceptación/rechazo de una Asignación Externa (Miembro Destino – Take-up Trading Firm)	33
7.5 Aceptación/rechazo de una Asignación Externa (Compensador de la Cuenta Destino – Take-up Clearing Firm)	33
7.6 Explicación detallada sobre algunos campos relevantes de los mensajes Allocation Instruction y Allocation Report	34
7.7 Seguimiento de operaciones mediante los mensajes Trade Capture Report	35
7.8 Lista de mensajes	36
7.9 Flujo de mensajes	36
7.10 Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0	40
7.11 Definición de mensajes	40
8. INFORMACIÓN DE SUPERVISIÓN	52
8.1 Introducción	52
8.2 Lista de mensajes	52
8.3 Flujo de mensajes	52
8.4 Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0	52
8.5 Definición de mensajes	53
9. GESTIÓN DE REFERENCIAS Y FILTROS DE ASIGNACIÓN EXTERNA	54

9.1	Introducción	54	
9.2	Campo RegistID	54	
9.3	Mantenimiento de Referencias de Asignación Externa por Miembro Origen	55	
9.4	Mantenimiento de Referencias de Asignación Externa por Miembro Destino	59	
9.5	Mantenimiento de Filtros de aceptación de Asignación Externa por Miembro Destino	64	
9.6	Mantenimiento de Filtros de aceptación de Asignación Externa por Miembro Compensador de Miembro Destino	69	
	9.6.5.1.Registration Instructions (Msg Type = o)		70
	9.6.5.2.Registration Instructions Response (Msg Type = p)		72
9.7	Módulo de Parametrización por Miembro Origen	75	
	9.7.5.1.Registration Instructions (Msg Type = o)		76
	9.7.5.2.Registration Instructions Response (Msg Type = p)		78
10.	GARANTÍAS Y MOVIMIENTOS DE EFECTIVO		82
10.1	Introducción	82	
10.2	Account Summary Report	82	
10.3	Margin Requirement Report	82	
10.4	Collateral Report	82	
10.5	Lista de mensajes	83	
10.6	Flujo de mensajes	83	
10.7	Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0	84	
10.8	Definición de mensajes	85	
11.	RETENCIÓN / LIBERACIÓN DE VALORES		102
11.1	Introducción	102	
11.2	Retención / Liberación de valores	102	
11.3	Información por Miembro Negociador y/o Compensador y/o Entidad Participante	102	
11.4	Lista de mensajes	102	
11.5	Flujo de mensajes	103	
11.6	Definición de mensajes	104	
12.	COMPENSACIÓN E INSTRUCCIONES DE LIQUIDACION		109
12.1	Introducción	109	
12.2	Compensación y generación de Instrucciones de Liquidación	109	

12.3	Información por Miembro Negociador y/o Compensador y/o Entidad Participante	109
12.4	Lista de mensajes	110
12.5	Flujo de mensajes	111
13.	LIQUIDACIONES Y FALLIDOS	112
13.1	Introducción	112
13.2	Liquidación de Instrucciones	112
13.3	Procedimiento de Recompra (Buy-in)	112
13.4	Liquidación en Efectivo	112
13.5	Información por Miembro Negociador y/o Compensador y/o Entidad Participante	112
13.6	Lista de mensajes	113
13.7	Flujo de mensajes	113
14.	EVENTOS CORPORATIVOS	115
14.1	Introducción	115
14.2	Información de Eventos Corporativos	115
14.3	Información por Miembro Negociador y/o Compensador y/o Entidad Participante	115
14.4	Lista de mensajes	115
14.5	Flujo de mensajes	115
APÉNDICE A	CAMPOS DE USUARIO	
117		

1. Introducción

1.1 Ámbito de este manual

Este documento contiene la definición de la interfaz ofrecida por BME CLEARING para el desarrollo de aplicaciones relacionadas con el ámbito de la ECC. Dicha interfaz está basada en el estándar FIX Protocol (Financial Information eXchange), en su versión 5.0 (FIXML 5.0 SP2 Extension Pack 178). Para una información detallada del estándar, consúltese el documento de referencia 1 (ver 1.5) o la página www.fixprotocol.org.

La interfaz sigue, tanto como es posible, las especificaciones de FIX 5.0. En la mayoría de los casos la estructura y semántica de los mensajes es idéntica al estándar.

En algunos casos se han realizado extensiones del protocolo, por ejemplo para cubrir funcionalidades que no han sido consideradas por el estándar. Dichas extensiones están claramente detalladas en el documento.

En otros casos el estándar es ambiguo, o indica que los detalles deben ser acordados mutuamente entre las partes. En estos casos el manual contiene una descripción detallada que elimina las posibles ambigüedades.

Todas las acotaciones y adaptaciones del estándar se han llevado a cabo siguiendo las recomendaciones especificadas por el propio estándar.

Para evitar posibles duplicidades como fuente de información, este documento no incluye explicaciones de aquellos aspectos que cumplen exactamente con el estándar. Para cualquier tema que no esté explícitamente detallado en este manual, debe considerarse la documentación del estándar como fuente de información.

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.

El propósito de este documento es el de definir el funcionamiento del interfaz FIXML de la ECC para los segmentos de Renta Variable y Renta Fija.

1.2 Información pública e información privada

Las funcionalidades cubiertas por el interfaz FIXML de la ECC se agrupan en información pública e información privada.

En la siguiente tabla se presentan las funciones públicas y los mensajes relacionados.

Función pública	Mensajes relacionados	Msg Type
Información General	Security List	y
	Market Data - Snapshot / Full Refresh	W

En la siguiente tabla se presentan las funciones privadas y los mensajes relacionados.

Función Privada	Mensajes relacionados	Msg Type
Seguimiento de la operativa	Trade Capture Report	AE
	Position Report	AP
Asignación de Operaciones	Allocation Instruction	J
	Allocation Report	AS
	Trade Capture Report	AE

Función Privada	Mensajes relacionados	Msg Type
Información de Supervisión	News	B
Gestión de Referencias, Filtros y Módulo de Parametrización para Asignación de Cuenta	Registration Instructions	o
	Registration Instructions Response	p
Garantías y Movimientos de Efectivo	Account Summary Report	CQ
	Margin Requirement Inquiry	CH
	Margin Requirement Report	CJ
	Collateral Report	BA
Retención / Liberación de Valores	Allocation Instruction	J
	Allocation Report	AS
Generación de Instrucciones de Liquidación	Trade Capture Report	AE
Comunicación de Eventos Corporativos	Trade Capture Report	AE

1.3 Organización del manual

El presente manual está organizado en dos partes diferenciadas. En la primera parte, formada por los primeros cuatro capítulos, se describen aspectos genéricos de esta interfaz.

Éste, el primer capítulo, describe el ámbito del documento, presenta la estructura del mismo e introduce los documentos relacionados.

En el capítulo 2 "Decisiones de Implementación", se presentan aquellas acotaciones o restricciones derivadas de la implementación del protocolo que define este manual.

El capítulo 3 "Convenciones generales en los mensajes de aplicación" describe con detalle aspectos concretos que afectan a la mayoría de mensajes descritos en este manual.

Dado su contenido genérico, que afecta a todos los mensajes, se recomienda una lectura previa de los capítulos 2 y 3 antes de pasar al resto de capítulos.

La segunda parte del manual, formada por el resto de capítulos, describe las diferentes funcionalidades soportadas por el interfaz FIXML de la ECC. En cada uno de estos capítulos se trata una funcionalidad concreta, describiendo aquellos aspectos particulares que son de interés.

En cada uno de estos capítulos están presentes, entre otros, los siguientes apartados:

- **Introducción.** Presenta una breve descripción de la funcionalidad abordada en el capítulo.
- **Lista de mensajes.** Relaciona los diferentes mensajes que implementan la funcionalidad tratada en el capítulo.
- **Flujo de mensajes.** Describe los diferentes escenarios de intercambio de mensajes que se pueden dar. Incluye los correspondientes diagramas de flujo de mensajes.

- **Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0.** Detalla las acotaciones y adaptaciones del protocolo estándar para adaptarlo a sus requerimientos.
- **Definición de mensajes.** Contiene una tabla para cada mensaje del capítulo, que describe de forma detallada los campos que lo conforman.

Finalmente, y a modo de apéndice, se presenta una tabla donde se describen los campos de usuario de FIX usados en el protocolo.

1.4 Formato de las tablas de definición de mensajes

Tal y como se explica en el apartado anterior, en los capítulos en que sea necesario se incluye una tabla por cada mensaje, 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
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 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. Para más información sobre el tipo String consúltese 2.4
Descripción	Descripción del campo en el contexto del mensaje

1.5 Documentos relacionados

#	Título	Autor	Versión
1	Financial Information Exchange Protocol (FIX) 5.0 Service Pack 3: EP178 enhancing FIX 5.0 SP2	FIX Committee	25 abril 2013
2	Financial Information Exchange Protocol (FIX) 5.0 Service Pack 2	FIX Committee	Abril 2009
3	ECC de Instrumentos de Renta Variable V3.0	BME CLEARING	3 diciembre 2013

2. Decisiones de Implementación

2.1 Descripción

En este capítulo se presentan las decisiones de implementación tomadas por BME CLEARING. Aquí se detallan aquellos aspectos que el estándar deja abiertos y que han sido definidos en esta implementación.

2.2 Campos ignorados

En algunos casos, el contenido de ciertos campos de los mensajes de entrada puede ser ignorado por el interfaz. Cuando éste es el caso, está claramente explicitado en la descripción del campo.

2.3 Campos no soportados

Los campos que no están soportados en un mensaje no se han incluido en la descripción del mismo.

Los mensajes enviados al interfaz no deben contener campos no soportados. Los mensajes enviados por el interfaz nunca contienen campos no soportados.

Ningún campo requerido ha sido declarado no soportado.

2.4 Longitud del tipo String

El estándar FIX no impone ninguna restricción de longitud máxima sobre el tipo String. En esta implementación la longitud máxima es de 255 caracteres.

En algunos campos se ha fijado una longitud máxima inferior a este valor. En estos casos el tipo se presenta como String(n), donde "n" es el número máximo de caracteres del campo. En ciertos casos "n" indica la longitud exacta del campo, en dicho caso será explícitamente mencionado en la columna de valores válidos.

2.5 Máxima longitud de mensaje

La longitud máxima de los mensajes enviados o recibidos por el interfaz es de 32000 bytes.

3. Convenciones generales en los mensajes de aplicación

3.1 Identificación de operaciones

3.1.1 TrdMatchID [880]

El campo TrdMatch contiene el número de registro de negociación. Este es el código asignado por la plataforma de negociación a la Operación referenciada en el mensaje. El período en que se garantiza la unicidad de este campo viene determinada por cada plataforma. En el caso de SIBE SMART es un número único para cada fecha de sesión.

3.1.2 TradeID

El campo TradeID contiene el identificador de registro de la ECC. Este es el código asignado por el sistema central de BME CLEARING a la Operación referenciada en el mensaje.

Cada Operación del sistema de negociación tiene su correspondiente Operación en el sistema de Cámara, sin embargo algunos tipos de operaciones son específicos del sistema de Cámara, como las Operaciones de Asignación, Operaciones de Traspaso, etc.

Los campos OrigTradeID y SecondaryTradeID también contienen un identificador de registro de la ECC y son usados para referirse a la Operación previa e inicial respectivamente.

El identificador del registro de la ECC tiene el formato AAMMDDNnnnnnnOSC, formado con la siguiente codificación:

- **AAMMDD.** Corresponde a la fecha de registro
- **Nnnnnnn.** Número secuencial único por fecha de registro
- **O.** Corresponde al código de Operación de la ECC
- **S.** Sentido de la Operación (Compra/Venta)
- **C.** Apertura / Cierre

3.2 Bloque Parties

El bloque Parties es usado en varios mensajes de aplicación para identificar a las partes que intervienen en la transacción.

En la definición detallada de los mensajes que contienen este bloque, se incorpora el bloque tal y como se muestra a continuación. La lista de valores posibles está restringida según las características particulares del mensaje.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
/xxx/ Pty						(n times)
→ 448	PartyID	ID	N		String	Código de Miembro asignado por BME CLEARING
→ 447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	Indica la codificación seguida en el campo PartyID. Siempre se usa codificación propia de BME CLEARING
→ 452	PartyRole	R	N		Int	Indica el rol que toma la parte referenciada en el campo PartyID

En los mensajes de este manual se usan varios roles. La interpretación del campo PartyID depende del valor PartyRole tal y como se explica a continuación:

- **1 (Executing Firm).** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con el código de Miembro de la ECC
- **4 (Clearing Firm).** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con el código de Miembro que actúa como Compensador de la cuenta de la que se está tratando
- **10 (CSD Code).** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con el código del DCV
- **11 (Order Origination Trader).** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con el código de usuario de la plataforma
- **12 (Executing Trader).** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con el usuario que solicitó el Traspaso o Asignación de Cuenta al que se refiere en el mensaje o en el Módulo de Parametrización
- **13 (Order Origination Firm).** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con el código del Miembro de la plataforma
- **16 (Executing System).** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con el código de la plataforma de negociación
- **21 (Clearing Organization).** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con el código de la ECC
- **30 (Payment Agent).** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con el usuario del Agente de Pagos para Movimientos de Efectivo
- **36 (Clearing Broker Trader).** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con el usuario del Miembro Destino que aceptó o rechazó la Asignación de Cuenta
- **38 (Position Account).** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con el titular de la cuenta

- **45 (CCV del vendedor / comprador).** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con el CCV del vendedor / comprador
- **90 (Settlement Firm).** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con el código de la Entidad Participante
- **91 (Settlement Account).** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con el código de la Cuenta de Liquidación
- **95 (Give-up Trading Firm).** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con el código de Miembro Origen de la Asignación de Cuenta que se está tratando
- **96 (Take-up Trading Firm).** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con el código de Miembro Destino de la Asignación de Cuenta que se está tratando
- **97 (Give-up Clearing Firm).** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con el código de Miembro que actúa como Compensador del origen de la Asignación de Cuenta que se está tratando
- **98 (Take-up Clearing Firm).** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con el código de Miembro que actúa como Compensador del destino de la Asignación de Cuenta que se está tratando

3.3 Formato de Error (Campo Text)

El campo Text es usado en varios mensajes para incluir la descripción de un error. En esos casos el formato del campo es:

`%MFsXXXXXX-Texto descriptivo`

Donde **s** indica la severidad del error (I: information, W: warning, E: Error), **XXXXXX** es el código de error, al cual le sigue un texto explicativo. El texto "%MF" es fijo.

3.4 Sincronización a nivel de aplicación

Cuando un cliente inicia una sesión FIXML (mensaje Logon aceptado), recibe un conjunto de información relacionada con la sesión actual foma no solicitada. Estos mensajes son:

- Registration Instructions Response (Gestión de Referencias y Filtros de Asignación Externa y Módulo de Parametrización que estén vigentes)
- Allocation Report (peticiones de asignación externa de cuenta que estén pendientes de aceptación / rechazo)

4. Mensajes Genéricos del Nivel de Aplicación

4.1 Rechazo de mensajes de aplicación

Cuando el interfaz recibe un mensaje erróneo, puede usar el mensaje genérico Business Message Reject.

4.2 Lista de mensajes

Mensaje	Descripción
Business Message Reject (MsgType = j)	Rechazo de mensaje a nivel de aplicación

4.3 Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0

No se han realizado acotaciones ni adaptaciones en los mensajes incluidos en este capítulo.

4.4 Definición de mensajes

4.4.1 Contenido del bloque Header

El bloque Header está incluido en todos los mensajes descritos en este documento. El detalle de dicho bloque se puede encontrar en cada uno de dichos mensajes.

A destacar dos funcionalidades que se implementan:

- En mensajes enviados por las entidades a la ECC, se puede dar el caso de que un único emisor pueda enviar mensajería en nombre de varios Miembros, siempre y cuando esté autorizado para ello. El bloque Header incluye campos que permiten informar tanto del emisor de los mensajes como del Miembro en nombre del cual envía cada mensaje. En concreto:
 - Los campos SenderCompID [49] y SenderSubID [50] informan del código de entidad y usuario emisores del mensaje.
 - El campo OnBehalfOfCompID [115] informa del código de Miembro en nombre de quien el emisor ha enviado el mensaje.
- Un mensaje generado por la ECC puede tener varios destinatarios:
 - En este caso, el campo TargetCompID [56] contendrá varios códigos de entidad separados por comas (,).

4.4.2 Business Message Reject (MsgType = j)

Mensaje enviado por el interfaz cuando recibe un mensaje erróneo.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
BusinessMessageReject/ BizMsgRej						
372	RefMsgType	RefMsgTyp	S	.	String	MsgType del mensaje rechazado
379	BusinessRejectRefID	BizRejRefID	N		String	Identificador del mensaje rechazado

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
380	Business RejectReason	BizRejRsn	S	0 = Other 3 = Unsupported Message Type 5 = Rejected by Gate	Int	Motivo de rechazo
58	Text	Txt	N		String	Texto explicativo
/BizMsgRej/ Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	j	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompanyId	SID	S	BMCL	String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompanyId	TID	S		String	Identificador de la entidad a la que va destinado el mensaje
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tablas 1 y 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código asignado al Segmento de la ECC con el que se estableció la conexión o el código de la ECC
57	TargetSubID	TSub	N		String	Contiene el código de usuario al que va destinado
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de envío del mensaje

5. Información General

5.1 Introducción

Bajo el concepto de información general se agrupan varias funcionalidades relacionadas con la información pública. Esta información se clasifica en dos grupos:

- **Información de valores.** Definición de los valores
- **Precios de los valores.** Precio de Cierre

Cada uno de estos grupos es tratado en un apartado independiente de este capítulo. En el apartado 5.4 se detalla el formato de los mensajes correspondientes.

5.2 Información General: Valores

5.2.1 Descripción

Esta funcionalidad permite obtener la información de los valores que se pueden registrar en la ECC.

5.2.2 Recepción de la definición de Valores

La información de definición de Valores se recibe mediante los mensajes Security List.

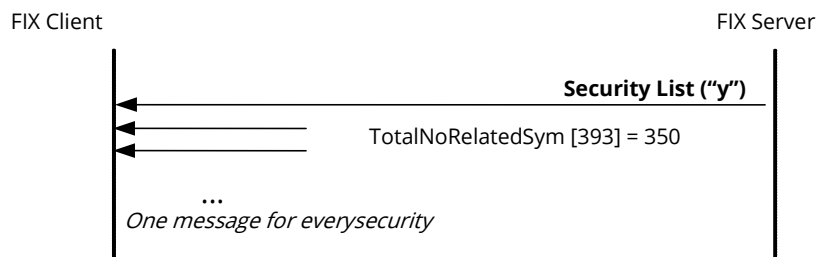
5.2.3 Lista de mensajes

Mensaje	Descripción
Security List (Msg Type = y)	Enviado por el servidor para informar de la definición de Valores a inicio de día

5.2.4 Flujo de mensajes

Recepción de la definición de valores

Se reciben mensajes Security List que se corresponden con la definición de Valores.



5.2.5 Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0

No se han realizado acotaciones ni adaptaciones en los mensajes incluidos en este capítulo.

5.3 Información General: Precios de los Valores

5.3.1 Descripción

Esta funcionalidad permite recibir la información relacionada con los precios de cierre de los Valores.

5.3.2 Recepción de información

El interfaz devuelve la información solicitada mediante mensajes Market Data Snapshot Full Refresh. Cada vez que se produce un cambio se recibe, por cada Valor, un nuevo mensaje Market Data Snapshot Full Refresh. Para todos los campos, si no se recibe información para un determinado campo, se deberá considerar que éste no ha variado desde la última actualización.

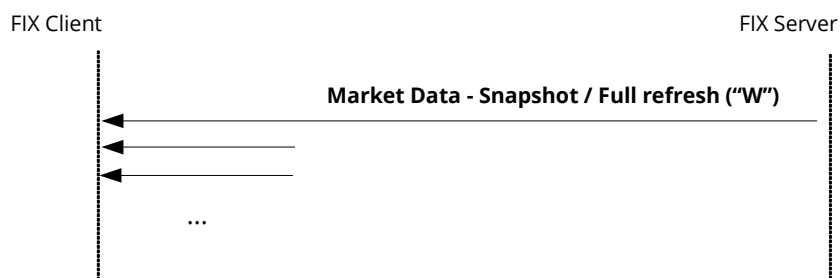
5.3.3 Lista de mensajes

Mensaje	Descripción
Market Data Snapshot Full Refresh (Msg Type = W)	Enviado por el servidor para devolver información de precios de cierre

5.3.4 Flujo de mensajes

Recepción de la información de precios

Se recibe un mensaje Market Data Snapshot Full Refresh cada vez que se produce un cambio en un Valor.



5.3.5 Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0

No se han realizado acotaciones ni adaptaciones en los mensajes incluidos en este capítulo.

5.4 Definición de mensajes

5.4.1 Security List (Msg Type = y)

Mensaje enviado por el servidor para informar de la definición de valores a inicio de día.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
Security List/ SecList/						
/SecList/ Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	y	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCom pID	SID	S	BMCL	String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCom pID	TID	S	"????"	String	Identificador de la entidad a la que va destinado el mensaje "????" indica que el mensaje tiene como destinatarios a todas las entidades
50	SenderSubl D	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código asignado al Segmento de la ECC con el que se estableció la conexión
52	SendingTim e	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de envío del mensaje
/SecList/ Secl						
→15	Currency	Ccy	N		Currency	Código de divisa. Expresada según estándar ISO 4217
→58	Text	Txt	N		String	Descripción del valor
/SecList/ Secl/ Instrmt						
→55	Symbol	Sym	N	[N/A] o código de valor	String(5)	
→48	SecurityID	ID	N		String(12)	Código ISIN
→22	SecurityIDS ource	Src	N	4 = ISIN number	String	
→1151	SecurityGro up	SecGrp	N	Ver Tabla 2 del documento "Tablas de Codificación"	String	Grupo de valores
→167	SecurityTyp e	SecTyp	N	Ver Tabla 3 del documento "Tablas de Codificación"	String	Tipo de producto
→200	MaturityMo nthYear	MMY	N	AAAAMM	Month- Year	Vencimiento del valor
→541	MaturityDat e	MatDt	N		LocalMktD ate	Fecha de vencimiento

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
→225	IssueDate	Issued	N		UTCDate	Fecha de emisión del valor
→202	StrikePrice	StrkPx	N		Price	Precio de ejercicio Sólo para activos de Renta Variable
→968	StrikeValue	StrkValu	N		Float	Unidad de contratación. Número de acciones equivalentes a cada valor Sólo para activos de Renta Variable
→206	OptAttribute	OptAt	N	A = Americano E = Europeo B = Bermudas O = Otros	Char	Estilo del ejercicio Sólo para activos de Renta Variable
→231	ContractMultiplier	Mult	N		Float	Indica el factor multiplicativo para convertir unidades de precio a unidades monetarias Sólo para activos de Renta Variable
→201	PutOrCall	PutCall	N	0 - Put 1 - Call	Int	Indica si el valor es call o put Sólo para activos de Renta Variable
→106	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. Sólo para activos de Renta Fija.
→874	InterestAccrualDate	IntAcrl	N		LocalMktDate	Fecha en la que el activo empieza a devengar cupón. Sólo para activos de Renta Fija.
→1639*	MarginClasses	Clss	N		String	Grupo de compensación del activo. 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). Sólo para activos de Renta Fija.
→470	CountryOfIssue	IssuCtry	N		String	Jurisdicción del Emisor (código de país según estándar ISO 3166). Sólo para activos de Renta Fija.
/SecList/ SecL/ Instrmt/ AID						(n times)

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
→→45 5	SecurityAltID	AltID	N		String(22)	Nombre corto del valor
→→45 6	SecurityAltIDSource	AltIDSrc	N	8 = Exchange Symbol	String	
/SecList/ SecL/ Instrmt/ Evt						(n times)
				100 = Barrera (turbo warrants) / Barrera inferior (Inlines). Sólo para activos de RV		
				101 = Último día de negociación		
				104 = Barrera superior (inlines) Sólo para activos de RV		
				105 = Barrera inferior activación (turbo pro) Sólo para activos de RV	Int	
→→86 5	EventType	EventTyp	N	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		

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
				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		
→→86 6	EventDate	Dt	N		LocalMktDate	Último día de negociación, cuando EventType = 101
						Precio barrera del warrant (turbowarrants) o Precio barrera inferior del warrant inline, cuando EventType = 100
						Precio barrera superior del warrant inline cuando EventType = 104
→→86 7	EventPx	Px	N		Price	Precio barrera inferior del warrant para la activación del turbo pro cuando EventType = 105
						Precio barrera superior para la activación del turbo pro cuando EventType = 106
						Precio barrera del bonus warrant cuando EventType = 122
→→86 8	EventText	Txt	N		String	Si EventType = 114, contiene el número de decimales en el precio del valor
						Si EventType = 120,

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
						<p>contiene el Código del Sistema de Liquidación (DCV, misma codificación que para PartyRole[452]=10)</p> <p>Segmento de Renta Fija:</p> <p>Si EventType [865] = 201, contiene el nº de cupones al año</p> <p>Si EventType [865] = 215, contiene el método de cálculo del c.corrido: 1 = Actual/Actual 2 = Actual/360 3 = Actual/365</p> <p>Si EventType [865] = 216, contiene el índice base</p> <p>Si EventType [865] = 217 contiene la calidad del colateral: 'INVG'-Grado de inversión 'NIVG'-Grado de especulación 'NOTR'-Sin Rating 'NOAP' - No aplica</p> <p>Si EventType [865] = 218 contiene el LEI emisor</p> <p>Si EventType [865] = 219 contiene el tipo de colateral: 'GOVS' - Deuda Soberana 'SUNS' - Deuda Supranacional 'FIDE' - Deuda Entidades Financieras 'NFID' - Deuda Corporativa 'SEPR' - Productos Titulizados 'MEQU' - Principales índices RV 'OEUQ' - Otros índices RV 'OTHR' - Otros Activos 'NA' - No aplica</p>
/SecList/ Secl/ Undly						(n times)
→→31 1	Underlying Symbol	Sym	N		String(5)	Símbolo del valor que actúa como subyacente
→→30 9	Underlying SecurityID	ID	N		String	Código ISIN del valor subyacente

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
→→30 5	Underlying SecurityIDSource	Src	N	4 = ISIN number	String	
→→31 8	Underlying Currency	Ccy	N		Currency	Código de divisa en que se expresa el subyacente y el strike. Expresada según estándar ISO 4217

5.4.2 Market Data Snapshot Full Refresh (Msg Type = W)

Usado por el interfaz para comunicar la información de precios.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
Market Data Snapshot Full Refresh / MktDataFull						
/MktDataFull/ Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	W	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S	BMCL	String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S	"????"	String	Identificador de la entidad a la que va destinado el mensaje "????" indica que el mensaje tiene como destinatarios a todas las entidades
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código asignado al Segmento de la ECC con el que se estableció la conexión
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de envío del mensaje
/MktDataFull/ Instrmt						
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	
/MktDataFull/ Full						(n times)
→269	MDEntryType	Typ	S	5 = Closing Price	Char	Tipo de información que contiene la presente entrada

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
						5: Para el precio de cierre (de la sesión actual o de la sesión anterior). Igual al precio de referencia para el segmento de Renta Fija
→270	MDEntryPx	Px	N		Price	Precio. Presente cuando MDEntryType = 5 En el caso en que no esté presente debe entenderse que el precio es 0
→286	OpenCloseSettleFlag	OpenCloseSettleFlag	N	1 = Session Open / Close / Settlement entry 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)
→158*	AccruedInterestRate	AccruedInterestRate	N		Percentage	Cupón corrido porcentaje. Sólo para activos de Renta Fija.

6. Seguimiento de la Operativa

6.1 Introducción

En este capítulo se describe la información proporcionada en relación a Operaciones registradas y saldos vivos.

6.2 Obtención de la información

BME CLEARING proporciona esta información separada en dos partes:

- Saldos por Cuenta de Posición, Valor, Fecha de Negociación (sólo RV) y Fecha de Liquidación, a inicio de sesión
- El conjunto de operaciones realizadas desde el principio de la sesión

El saldo a principio y a fin de día se informa mediante el mensaje Position Report. Sólo se suministra información en aquellas combinaciones de Cuenta de Posición / Valor / Fecha de Liquidación que tengan un saldo distinto de cero.

La información de las operaciones realizadas desde el inicio de día es reportada mediante mensajes Trade Capture Report.

6.3 Información por Miembro Negociador y/o Compensador y/o Entidad Participante

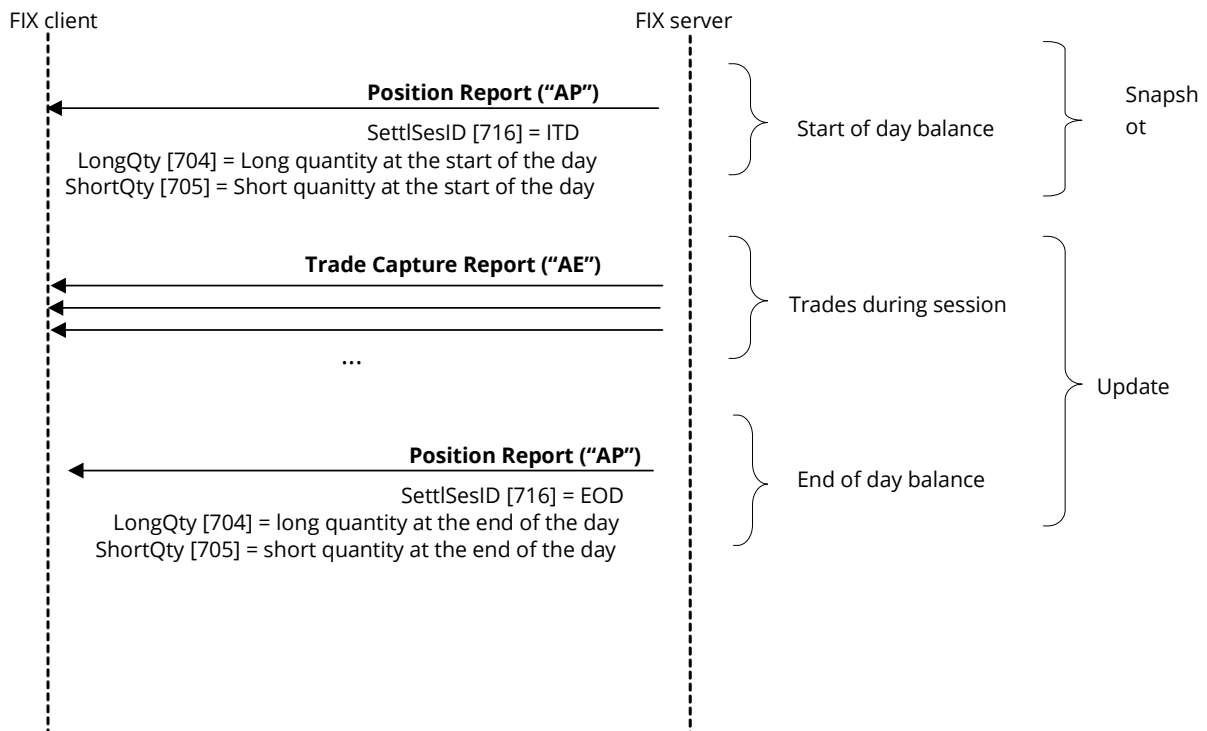
La información se envía a las entidades recogidas en el bloque Parties, concretamente en las definidas por PartyRole 4 (Clearing Firm: Miembro Compensador), PartyRole 1 (Executing Firm: Miembro Negociador) y PartyRole 90 (SettlementFirm: Entidad Participante).

6.4 Lista de mensajes

Mensaje	Descripción
Trade Capture Report (Msg Type = AE)	Información de una Operación registrada en la Cámara
Position Report (Msg Type = AP)	Información de los saldos vivos en la ECC para un Valor, Fecha de Negociación (sólo RV), Fecha de Liquidación y Cuenta de Posición

6.5 Flujo de mensajes

Recepción de Operaciones y saldos



6.6 Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0

- Se han añadido los campos LeavesQty [151], FirmMnemonic [1729] y AllocText [161] al mensaje Trade Capture Report.
- Se ha añadido el campo de usuario ExchangeTradeType [5681] al mensaje Trade Capture Report.
- Se ha movido el bloque Qty del mensaje Trade Capture Report, de manera que ahora está dentro del bloque RptSide.
- Se ha añadido el campo TradeDate [75] al bloque PositionAmountDate del mensaje Position Report.

6.7 Campo TransferReason del mensaje Trade Capture Report

Cuando las ejecuciones procedentes de mercado llevan información de asignación interna o externa, puede suceder que dicha asignación no se pueda realizar.

En este caso, el Trade Capture Report contendrá información en el campo TransferReason [830]:

- Si la cuenta de la ECC viene informada y no es una cuenta vigente: el campo contendrá "ERRA" + la cuenta informada en la ejecución.
- Si la cuenta no viene informada pero se indica un nemotécnico y éste no existe: el campo contendrá "ERRN" + el nemotécnico informado en la ejecución.

- Si ni la cuenta ni el nemotécnico vienen informadas pero se indica miembro destino (y referencia) y el miembro destino no existe: el campo contendrá "ERRD" + el miembro destino informado en la ejecución.

6.8 Definición de mensajes

6.8.1 Trade Capture Report (Msg Type = AE)

Mensaje que contiene los datos de una Operación de Cámara.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
Trade Capture Report/ TrdCaptRpt						
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
487	TradeReportTransType	TransType	N	0 = New 2 = Replace	Char	Indica si el mensaje contiene una nueva operación o está actualizando datos de una operación ya existente.
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	Si se trata de una operación de Neteo / Agregación contiene el Identificador de Registro de la ECC (TradeID [1003]) de la Instrucción de Liquidación.
880	TrdMatchID	MtchID	N		String	Para el segmento de Renta Fija: Se informa de la referencia común de las operaciones que vincula la ida y vuelta del repo. Número de registro de negociación de la Operación inicial.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
						Coincide con el campo TrdMatchID del mensaje Execution Report. Sólo aplica al Segmento de Renta Variable
17	ExecID	ExecID	N		String	Referencia original secundaria de la Operación
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 / importe nominal de la Operación
151*	LeavesQty	LeavesQty	N		Qty	Volumen / importe nominal vivo de la Operación
31	LastPx	LastPx	S		Price	Precio de la Operación cuando se trata de una compraventa
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 en la ECC
64	SettleDate	SettleDt	N		LocalMktDate	Fecha Teórica de Liquidación
381	GrossTradeAmt	GrossTrdAmt	N		Amt	Importe Efectivo de la transacción 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
830	TransferReason	TrnsfrRsn	N		String	Información adicional del registro de la Operación
/TrdCaptRpt/ Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	AE	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S	BMCL	String	Identificador de la entidad que envía el mensaje. Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Identificador(es) de la(s) entidad(es) a la(s) que va destinado el mensaje Los códigos de entidad van separados por comas (,)
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código asignado al Segmento de la ECC con el que se estableció la conexión

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de envío del mensaje
/TrdCaptRpt/ Instrmt						
55	Symbol	Sym	N	[N/A] o código de valor	String(5)	
48	SecurityID	ID	N		String(12)	Código ISIN
22	SecurityDSrc	Src	N	4 = ISIN number	String	
/TrdCaptRpt/ Amt						(n times)
→ 708	PosAmt	Amt	N		Amt	Si PosAmtReason[1585]=1000, puede ser negativo en función del resultado de la compensación en cuentas netas
						Si PosAmtReason[1585]=1001, se refiere al Importe Efectivo de valores retenidos por la Entidad Liquidadora
				1000 = Importe Efectivo vivo de la Operación		
→ 1585	PosAmtReason	Rsn	N	1001 = Importe Efectivo de Valores retenidos Sólo aplica al Segmento de Renta Variable	Int	
/TrdCaptRpt/ TrdRegTS						(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	
/TrdCaptRpt/ RptSide						(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 2 = Sell	Char	Signo de la posición de Valores
→ 1	Account	Acct	N		String	Código de cliente introducido en la orden Sólo aplica al Segmento de Renta Variable
→ 581	AccountType	AcctType	N	Antes de MIFID-II:	Int	Indicador de capacidad

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
				1 = Ajena 3 = Propia 7 = Especialista		Sólo aplica al Segmento de Renta Variable
				A partir de MIFID-II: 1 – AOTC 3 – MTCH 4 – DEAL		
→ 77	PositionEffect	PosEfct	N	"O" = Open "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 Renta Variable.
→ 58	Text	Txt	N		String	Si es una Asignación Interna de Cuenta o un Traspaso, contiene la Referencia de la Operación previa. Sólo aplica al Segmento de Renta Variable.
/TrdCaptRpt/ RptSide/ Pty						(n veces)
						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 Si PartyRole[452]=11, contiene el código del usuario de la plataforma
→→ 448	PartyID	ID	N		String	Si PartyRole[452]=13, contiene el código del Miembro de la plataforma Si PartyRole[452]=16, contiene el código de plataforma de negociación Si PartyRole[452]=38, contiene el código de la Cuenta de Posición asociada con la Operación Si PartyRole [452] = 45, • Si Side [54] = 1 (Buy), contiene el CCV del comprador

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
						<ul style="list-style-type: none"> • Si Side [54] = 2 (Sell), contiene el CCV del vendedor <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>
→→ 447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code 1 = Executing Firm 4 = Clearing Firm 10 = CSD Code 11 = Order Origination Trader 13 = Order Origination Firm	Char	
→→ 452	PartyRole	R	N	16 = Executing System (Código de plataforma) 38 = Position Account 45 = CCV del vendedor / comprador 90 = Settlement Firm 91 = Settlement account	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID.
/TrdCaptRpt/ RptSide/ Stip						(n times)
→→ 233	StipulationType	Typ	N	CLIQ ILIQDCV TINST ICORPDCV TOPEM QTYM AMTM UTI SFTTYPE	String	

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
				FINTRATE UTIPRIOR		
→→ 234	StipulationValue	Val	N		String	<p>Para Instrucciones de Liquidación:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Si StipulationType [233] = CLIQ, contiene el número de Ventana de Agregación en el que se envía la Instrucción a liquidar • Si StipulationType [233] = ILIQDCV, contiene el identificador de la Instrucción Liquidación en el DCV • Si StipulationType [233] = TINST, contiene el Tipo Instrucción: <ul style="list-style-type: none"> * DVP = Entrega contra pago * RVP = Recepción contra pago * DWP = Entrega con pago * DFP = Entrega libre de pago * RFP = Recepción libre de pago * PWD = Pago / cobro sin entrega de valores * ROC = Instrucciones de pago sin entrega con efectivo cero * RWP = Recepción con pago <p>Para Eventos Corporativos:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Si StipulationType [233] = ICORPDCV, contiene el identificador del Evento en el DCV <p>Para Operaciones de compraventa:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Si StipulationType [233] = TOPEM, contiene el código de operación de la ejecución en la plataforma de negociación • Si StipulationType [233] = QTYM, contiene el volumen / importe nominal de la ejecución en la plataforma de negociación

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
						<ul style="list-style-type: none"> Si StipulationType [233] = AMTM, contiene el importe efectivo de la ejecución en la plataforma de negociación
						<p>Sólo para Renta Fija:</p> <ul style="list-style-type: none"> Si StipulationType [233] = UTI, contiene el UTI de la operación Si StipulationType [233] = SFTTYPE, contiene el Tipo de SFT: <ul style="list-style-type: none"> B: Simultánea R: Repo N: No aplica Si StipulationType [233] = FINRATE, contiene el tipo de interés fijo. Si StipulationType [233] = UTIPRIOR, contiene el UTI PRIOR de la operación.
/TrdCaptRpt/ RptSide/ MiscFees						(1 time)
→→ 137	MiscFee Amt	Amt	N		Amt	Corretaje de la Operación Sólo aplica al Segmento de Renta Variable
→→ 139	MiscFee Type	Typ	N	12 = Agent	String	
/TrdCaptRpt/ RptSide/ TrdRptOrdDetl						(1 time)
						Sólo aplica al Segmento de Renta Variable
→→ 198	SecondaryOrderID	OrdID2	N		String	Identificador único formado por la concatenación de la fecha de la orden y el número de la orden de la Operación inicial tal y como se asignó por la plataforma de negociación.
→→ 586	OrigOrdModTime	OrigOrdModTm	N		UTCTimestamp	Fecha y hora de la orden de la Operación inicial 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
/TrdCaptRpt/ RptSide/ Qty						(n times)

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
→→ 703	PosType	Typ	N	RCV = Received Quantity	String	RCV indica los valores retenidos por la Entidad Liquidadora. Sólo aplica al Segmento de Renta Variable
→→ 705	ShortQty	Short	N	>= 0, sin decimales	Qty	

6.8.2 Position Report (Msg Type = AP)

Mensaje que informa del saldo vivo para una Cuenta de Posición, Valor, Fecha de Negociación (sólo RV) y Fecha de Liquidación.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
Position Report/ PosRpt						
721	PosMaint RptID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Position Report de una sesión
715	Clearing Business Date	BizDt	S		LocalMktDate	El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta, está presente por requerimiento del estándar
716	SettlSesl D	SetSesID	N	ITD = Intradía EOD = Fin de sesión	String	Identifica el estado de la sesión El valor ITD se refiere al inicio de la sesión
15	Currency	Ccy	N		Currency	Código de divisa Expresada según estándar ISO 4217
64	SettlDate	SettlDt	N		LocalMktDate	Fecha Teórica de Liquidación
58	Text	Txt	N		String	Sólo para RF, contiene el Tipo de SFT: B: Simultánea R: Repo N: No aplica
/PosRpt/ Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	AP	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderC ompID	SID	S	BMCL	String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCo mpID	TID	S		String	Identificador(es) de la(s) entidad(es) a la(s) que va destinado el mensaje Los códigos de entidad van separados por comas (,)
50	SenderS ubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código asignado al Segmento de la ECC con el que se estableció la conexión
52	Sending Time	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de envío del mensaje
/PosRpt/ Pty						
						(n times)

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
						Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC
						Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV
→ 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
→ 447	PartyIDSource	Src	S	D = Proprietary/ Custom code	Char	
				1 = Executing Firm		
				4 = Clearing Firm		
				10 = CSD Code		
→ 452	PartyRole	R	S	38 = Position Account	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
				90 = Settlement Firm		
				91 = Settlement account		
/PosRpt/ Instrmt						
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 Renta Fija.
48	SecurityID	ID	N		String(12)	Código ISIN
22	SecurityIDSource	Src	N	4 = ISIN number	String	
/PosRpt/ Qty						
				NET		(n times) NET indica la posición neta de compraventas pendiente de liquidar para cada fecha
				GRS		GRS indica la posición bruta de compraventas pendiente de liquidar para cada fecha. Sólo aplica al Segmento de Renta Variable.
→ 703	PosType	Typ	N	RCV	String	
				TRF		
				CAA		
				PNTN		

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
				DLV		<p>RCV indica la posición retenida (short) para cada fecha. Sólo aplica al Segmento de Renta Variable.</p> <p>TRF indica la posición fallida para cada fecha</p> <p>CAA indica la posición debida a Ajustes por Eventos para cada fecha</p> <p>PNTN indica la posición debida a operaciones especiales con fecha de contratación igual a la fecha de sesión. Sólo aplica al Segmento de Renta Variable.</p> <p>DLV indica la posición prevista por entrega en las fechas de vencimiento de futuros y opciones. Sólo aplica al Segmento de Renta Variable.</p>
→ 704	LongQty	Long	N	>= 0, sin decimales	Qty	Indica el número de valores que conforman el saldo de recepción de valores
→ 705	ShortQty	Short	N	> 0, sin decimales	Qty	Indica el número de valores que conforman el saldo de entrega de valores
→ 976	Quantity Date	QtyDt	N		LocalMktDate	Fecha de Contratación Sólo aplica al Segmento de Renta Variable
/PosRpt/ Amt						(n times)
→ 708	PosAmt	Amt	N		Amt	Puede ser negativo en función del resultado de la compensación en cuentas netas
→ 707	PosAmtType	Typ	N	NET GRS RCV TRF CAA PNTN DLV PA	String	Mismos comentarios que para PosType[703] en grupo Qty PA indica posiciones en efectivo pendientes de liquidar
→ 1585	PosAmtReason	Rsn	N	1001 = Importe Efectivo de compras (posición asociada a LongQty)	Int	

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
				1002 = Importe Efectivo de ventas (posición asociada a ShortQty)		
				1005 = Valor actual del efectivo de compras (posición asociada a LongQty)		
				Aplica al segmento de Renta Fija		
				1006 = Valor actual del efectivo de ventas (posición asociada a ShortQty).		
				Aplica al segmento de Renta Fija		
				1050 = Efectivos pendientes de liquidar		
→75*	TradeDate	TrdDt	N		LocalMktDate	Fecha de Contratación. Sólo aplica al Segmento de Renta Variable.

7. Asignación de Operaciones

7.1 Introducción

En este capítulo se cubren las funcionalidades asociadas con el Traspaso, total o parcial, de una Operación de una cuenta a otra.

BME CLEARING clasifica esta operativa según el tipo de las cuentas de origen y destino.

Término BME CLEARING	Origen	Destino
Asignación Interna de Cuenta	Cuenta Diaria	Cuenta ordinaria (mismo Miembro)
Traspaso	Cuenta ordinaria	Cuenta ordinaria (mismo Miembro)
Asignación Externa de Cuenta	Cuenta Diaria u ordinaria	Otro Miembro

BME CLEARING sólo permite el Traspaso de órdenes ya ejecutadas, es decir de operaciones.

En los siguientes apartados se describen las particularidades de las diferentes operativas.

Este capítulo sólo aplica al segmento de Renta Variable.

7.2 Asignación Interna de Cuenta y Traspaso

Desde el punto de vista de la interfaz FIX, una Asignación Interna de Cuenta y un Traspaso funcionan del mismo modo. La única diferencia es el tipo de la Cuenta Origen, y este atributo está implícito en la cuenta y por tanto no hay que especificarlo en el mensaje.

La solicitud se realiza mediante el mensaje Allocation Instruction, indicando los datos de la Operación a transferir y la Cuenta Destino.

Si hay errores, el interfaz informa de los mismos, al usuario que la realizó, mediante el mensaje Business Message Reject.

Cuando la solicitud es aceptada y realizada todos los usuarios del Miembro reciben un mensaje Allocation Report con los datos del Traspaso realizado.

7.3 Asignación Externa (Miembro Origen – Give-up Trading Firm)

La operativa de Asignación Externa siempre es iniciada por el Miembro al que pertenece la cuenta asociada a la Operación que se va a transferir. En este documento, dicha figura es referida como Miembro Origen.

El Miembro Origen puede solicitar la realización de una Asignación Externa mediante el mensaje Allocation Instruction. Dicho mensaje debe contener los datos de la Operación a transferir, el Miembro Destino y una Referencia para el Miembro Destino.

Antes de que la Asignación Externa sea aceptada por el Miembro Destino, cualquier usuario del Miembro Origen puede cancelar la solicitud con un nuevo mensaje Allocation Instruction.

Si hay errores, el interfaz informa de los mismos al usuario que la realizó, mediante el mensaje Business Message Reject.

Por otro lado, el interfaz informa a todos los usuarios del Miembro Origen, incluido el que inició la actuación, de los datos de la Asignación y los diferentes estados por los que va pasando mediante mensajes Allocation Report.

7.4 Aceptación/rechazo de una Asignación Externa (Miembro Destino – Take-up Trading Firm)

Al receptor de la Operación que se va a transferir se le conoce como Miembro Destino y es seleccionado por el Miembro Origen a través de su mensaje de solicitud.

Una vez la solicitud de Asignación Externa es procesada por los sistemas centrales, ésta puede ser aceptada automáticamente o quedar pendiente de aceptación por parte del Miembro Destino.

El hecho de que una Asignación Externa sea aceptada de forma automática dependerá de la normativa de la Cámara y los posibles Filtros que el Miembro Destino tenga configurados.

En el caso de que la Asignación Externa quede pendiente de aceptación, el interfaz envía un mensaje Allocation Report a todos los usuarios del Miembro Destino informando de los datos de la Asignación y solicitando la aceptación o rechazo de la misma. Si el Miembro Destino tiene definida una Cuenta Destino para la Referencia introducida en el mensaje de solicitud, ésta cuenta estará presente en el mensaje.

La aceptación o rechazo de una Asignación Externa se realiza con un mensaje Allocation Instruction. En caso de aceptación, en dicho mensaje debe indicarse la Cuenta Destino de la Asignación, independientemente de si se recibió información de la cuenta asociada a la Referencia.

Si el Miembro Destino es Compensador de la cuenta que ha elegido como destino, su aceptación es suficiente para la realización de la Asignación. Si el Miembro Destino no es Compensador de dicha cuenta, será necesaria la aceptación del Miembro Compensador para la realización de la Asignación.

Si es necesaria la aceptación por parte del Miembro Compensador de la Cuenta Destino, una vez éste se ha pronunciado, el interfaz envía un mensaje Allocation Report informando del estado en que queda la Asignación.

En caso de que el Miembro Compensador rechace la Asignación, ésta vuelve a quedar pendiente del Miembro Destino, que puede optar por rechazarla definitivamente o volver a especificar una cuenta. Ambas actuaciones se llevan a cabo con el mensaje Allocation Instruction tal y como se ha descrito previamente en este mismo apartado.

7.5 Aceptación/rechazo de una Asignación Externa (Compensador de la Cuenta Destino – Take-up Clearing Firm)

Cuando el Miembro Destino de una Asignación Externa no es Compensador de su operativa, será necesaria la aceptación del Miembro Compensador de la Cuenta Destino para que se realice la Asignación.

Al igual que sucede en el caso del Miembro Destino, esta aceptación puede ser realizada de forma automática por los sistemas centrales de BME CLEARING a partir de los posibles Filtros que el Miembro Compensador tenga definidos.

Cuando una Asignación queda pendiente de la aceptación por parte del Miembro Compensador de la Cuenta Destino, el interfaz envía un mensaje Allocation Report a todos los usuarios de este Miembro, informando de los datos de la Asignación y solicitando la aceptación o rechazo de la misma. Esta aceptación o rechazo se realiza con un mensaje Allocation Instruction.

Cuando la Asignación es rechazada por el Miembro Compensador, ésta queda pendiente de actuación por parte del Miembro Destino. El Miembro Compensador sólo volverá a recibir un mensaje relacionado con esta Asignación cuando el Miembro Destino opte por volver a seleccionar una cuenta que también sea compensada por él.

7.6 Explicación detallada sobre algunos campos relevantes de los mensajes Allocation Instruction y Allocation Report

7.6.1 Identificadores utilizados en los mensajes Allocation Instruction y Allocation Report

El campo AllocID [70]:

- Lo asigna el usuario en cada mensaje Allocation Instruction
- Tiene una longitud máxima de 10 caracteres
- Permite relacionar la petición con los mensajes Allocation Report de notificación de estado de Traspasos o Asignaciones Externas

El campo SecondaryAllocID [793]:

- Es un identificador único para cada Traspaso realizado en BME CLEARING, sea éste una Asignación Interna de Cuenta o una Asignación Externa, o un Traspaso propiamente dicho
- Tiene una longitud máxima de 10 caracteres
- Este campo está presente en los mensajes Allocation Report que las aplicaciones cliente reciben informando del estado de un Traspaso. Asimismo debe informarse, en el mensaje Allocation Instruction de Asignación Externa de aceptación / rechazo enviado por Miembro Destino y/o su Miembro Compensador. También debe utilizarse en el mensaje Allocation Instruction de Asignación Externa de cancelación enviado por el Miembro Origen
- De este modo todos los mensajes relacionados con una misma Asignación Externa contendrán el mismo valor en este campo, independientemente del papel que tome el receptor. Por ello, este valor permite identificar de forma unívoca la Asignación frente a la Cámara y el resto de participantes.

El campo AllocReportID [755]:

- Contiene el identificador de cada uno de los estados por los que pasa la petición de asignación, generado por la ECC, en los mensajes Allocation Report
- Tiene una longitud máxima de 9 caracteres

El campo RefAllocID [72]:

- Debe contener el valor del campo AllocReportID [755] en el mensaje Allocation Instruction de Asignación Externa de aceptación / rechazo enviado por Miembro Destino y/o su Miembro Compensador. De forma análoga, también debe utilizarse en el mensaje Allocation Instruction de Asignación Externa de cancelación enviado por el Miembro Origen
- Tiene una longitud máxima de 9 caracteres

En resumen, desde la óptica de los distintos mensajes enviados y recibidos, tendríamos:

- Mensaje Allocation Instruction enviado por Miembro Origen:
 - El campo AllocID [70] lo asigna el usuario. Tamaño máximo 10 caracteres

- Mensaje Allocation Report enviado a Miembro Origen:
 - El campo AllocID [70] contiene el mismo valor enviado en el mensaje Allocation Instruction. Tamaño máximo 10 caracteres
 - El campo SecondaryAllocID [793] contiene el identificador único de la petición de asignación, generado por la ECC. Tamaño máximo 10 caracteres
 - El campo AllocReportID [755] contiene el identificador de cada uno de los estados por los que pasa la petición de asignación, generado por la ECC. Tamaño máximo 9 caracteres

El Miembro Origen liga el campo AllocID [70] del mensaje Allocation Instruction de la solicitud con el campo AllocID [70] del Allocation Report de respuesta. Además, hace el seguimiento de todos los estados por los que pasa la solicitud con el campo SecondaryAllocID [793] (en cada estado va cambiando el AllocReportID [755]).

- Mensaje Allocation Report enviado a Miembro Destino y a su Miembro Compensador, si es el caso:
 - El campo SecondaryAllocID [793] contiene el identificador único de la petición de asignación, generado por la ECC. Tamaño máximo 10 caracteres
 - El campo AllocReportID [755] contiene el identificador de cada uno de los estados por los que pasa la petición de asignación, generado por la ECC. Tamaño máximo 9 caracteres
- Mensaje Allocation Instruction de cancelación de la asignación enviado por miembro origen, o de aceptación / rechazo enviado por Miembro Destino y/o su Miembro Compensador, si es el caso:
 - El campo AllocID [70] lo asigna el usuario. Tamaño máximo 10 caracteres
 - El campo SecondaryAllocID [793] contiene el mismo valor recibido en el mensaje Allocation Report. Tamaño máximo 10 caracteres
 - El campo RefAllocID [72] contiene el mismo valor del campo AllocReportID [755] recibido en el mensaje Allocation Report. Tamaño máximo 9 caracteres

El Miembro Destino y/o su Miembro Compensador reciben un mensaje Allocation Report inicial que contiene el identificador único de la petición de asignación en el campo SecondaryAllocID [793]. A partir de ahí, hacen el seguimiento de todos los estados por los que pasa la solicitud con el campo SecondaryAllocID [793] (en cada estado va cambiando el campo AllocReportID [755]).

7.7 Seguimiento de operaciones mediante los mensajes Trade Capture Report

En BME CLEARING, la operativa de traspasar, total o parcialmente, una Operación de una cuenta a otra se lleva a cabo mediante la realización de dos nuevas operaciones. La primera es sobre la Cuenta Origen y con signo opuesto a la Operación original. La segunda es sobre la Cuenta Destino y con el mismo signo que la Operación original. El volumen de ambas operaciones es el número de valores que se transfieren de la Operación original.

Una vez realizado el proceso de Traspaso, sea éste una Asignación Interna de cuenta, un Traspaso o una Asignación Externa, los usuarios recibirán los mensajes Trade Capture Report de la Operación u operaciones correspondientes.

En el caso de que la Operación provenga de una Asignación Interna de cuenta, un Traspaso o una Asignación Externa, el mensaje Trade Capture Report contiene una serie de campos relevantes para la reconciliación de la información y el seguimiento de operaciones:

- **PositionEffect.** Indica si la Operación abre o cierra posición. De las operaciones derivadas de un Traspaso, la realizada sobre la Cuenta Origen contendrá "C" (Close), y la realizada sobre la Cuenta Destino "O" (Open).
- **OrigTradeID.** Contiene el identificador de registro de la ECC de la Operación previa.
- **TradeID.** Contiene el identificador de registro de la ECC de la nueva Operación. Este mismo campo se encuentra en los mensajes Allocation Report relacionados que informan de la aceptación.
- **SecondaryTradeID.** Contiene el identificador de registro de la ECC de la Operación inicial.

7.8 Lista de mensajes

Mensaje	Descripción
Allocation Instruction (Msg Type = J)	Solicitud de un Traspaso, una Asignación Interna de cuenta o una Asignación Externa. También se utiliza para aceptar o rechazar una Asignación Externa
Allocation Report (Msg Type = AS)	Informe del estado de un Traspaso, una Asignación Interna de cuenta o una Asignación Externa
Trade Capture Report (Msg Type = AE)	Informe de ejecución de una Operación. Enviado a los clientes implicados

7.9 Flujo de mensajes

En este apartado se usará el término "Asignación" para referirnos tanto a la Asignación Interna de cuenta como al Traspaso propiamente dicho, puesto que el flujo de mensajes en ambos casos es idéntico.

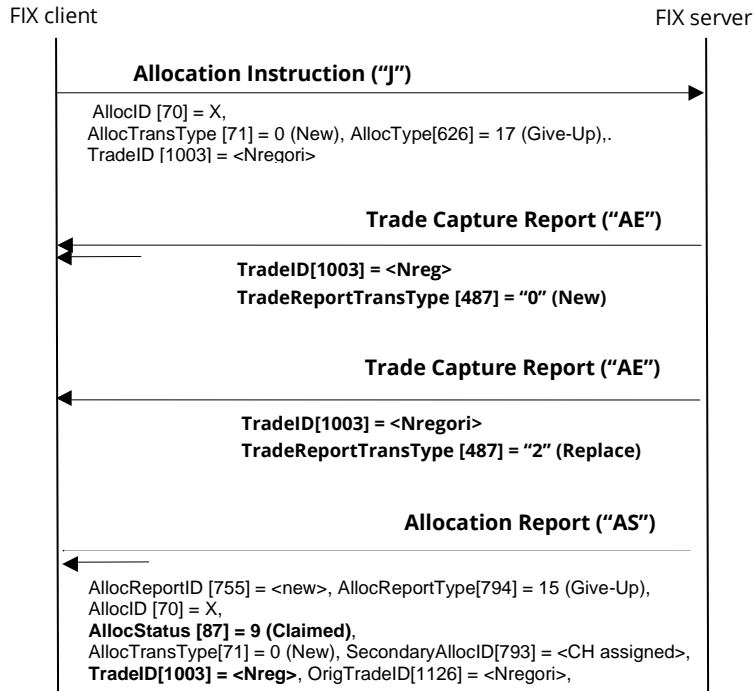
En los diagramas presentes en este apartado el uso de dos flechas indica que el mensaje va dirigido a todos los usuarios del Miembro en cuestión.

Cuando la asignación es aceptada en su totalidad, se genera un mensaje Trade Capture Report de actualización de la operación original.

Solicitud de Asignación aceptada

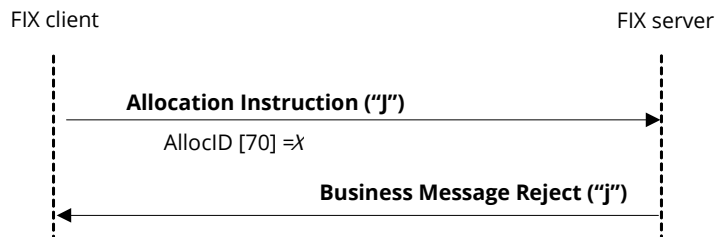
El cliente envía la solicitud mediante un mensaje Allocation Instruction. Cuando la Asignación ha sido realizada, se envía un mensaje Allocation Report a todas las aplicaciones cliente del Miembro para informar de los datos de la solicitud.

Además, se envía un mensaje Trade Capture Report por cada Operación que se derive de la Asignación realizada.

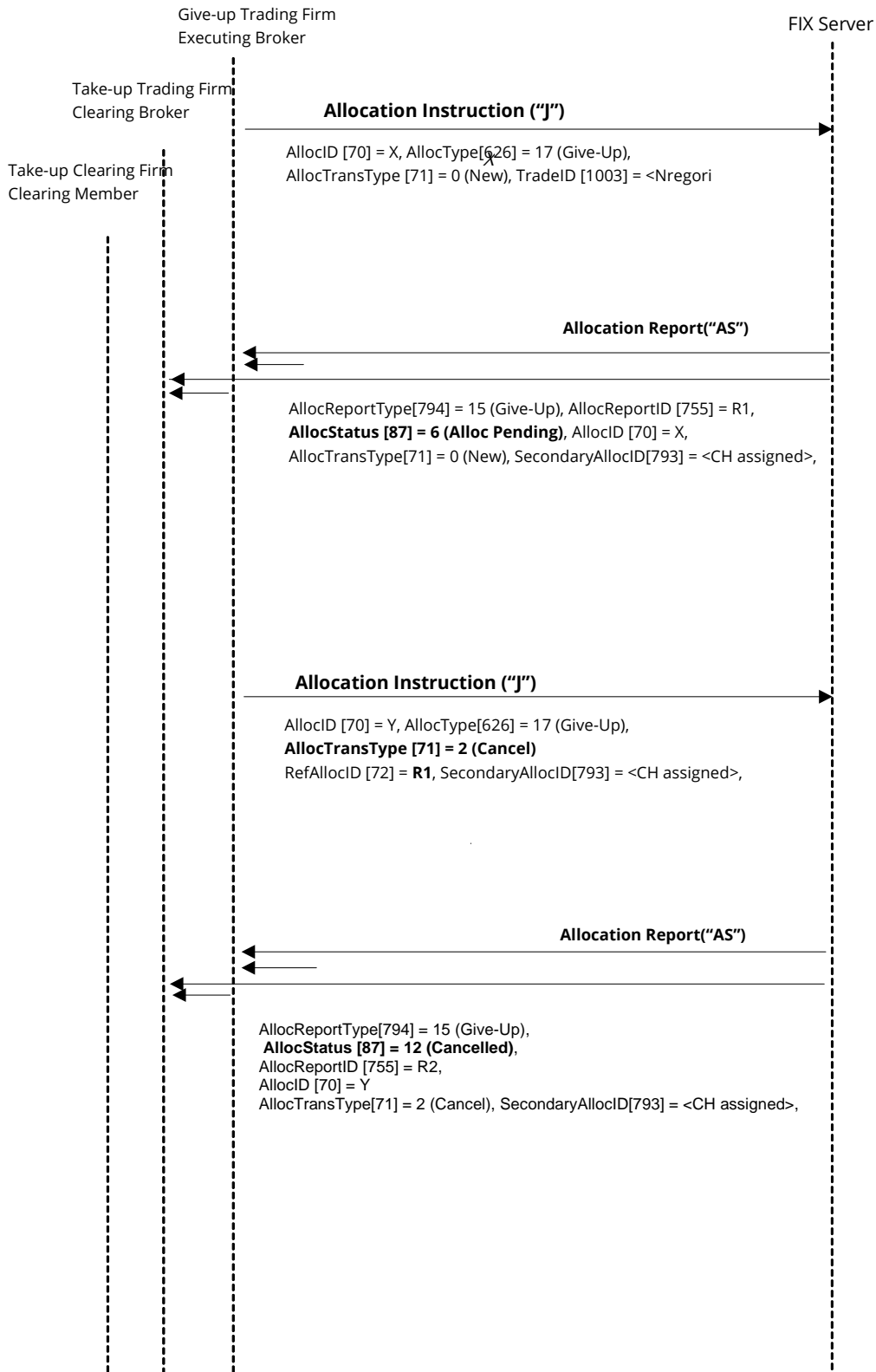


Solicitud de Asignación rechazada

El cliente envía la solicitud mediante un mensaje Allocation Instruction. El mensaje es rechazado con un mensaje Business Message Reject



Cancelación de la Asignación Externa por parte del Miembro Origen



7.10 Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0

- Se ha añadido el campo OrigTradeID [1126] al mensaje Allocation Report.
- Se han añadido los campos MarketSegmentID [1300] y TrdMatchID [880], al bloque AllExc (ExecAllocGrp) del mensaje Allocation Report.
- Se ha añadido el bloque Stip (Stipulations) al bloque AllExc (ExecAllocGrp) en el mensaje Allocation Report.
- Se ha añadido el bloque MiscFees (MiscFeesGrp) al bloque AllExc (ExecAllocGrp) en los mensajes Allocation Instruction y Allocation Report.
- Se han añadido los campos Account [1], Text [58] y AccountType [581], al bloque OrdAlloc (OrdAllocGrp) del mensaje Allocation Report.

7.11 Definición de mensajes

7.11.1 Allocation Instruction (Msg Type = J)

Mensaje enviado por el cliente para solicitar un Traspaso, una Asignación Interna de cuenta, iniciar, aceptar o rechazar una petición de Asignación Externa.

En la descripción de los campos de este mensaje se usará el término “traspaso” para referirse tanto a la Asignación Interna de cuenta, la Asignación Externa o el Traspaso propiamente dicho.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
Allocation Instruction/ AllocInstrctn						
70	AllocID	ID	S		String(10)	Identificador único para cada mensaje Allocation Instruction
						Indica si el mensaje es de solicitud de Traspaso o cancelación
71	AllocTransType	TransTyp	S	0 = New 2 = Cancel	Char	La cancelación sólo puede realizarse sobre una Asignación Externa que esté pendiente de aceptación por parte del destino
626	AllocType	Typ	S	17 = Iniciar o Cancelar una Asignación Externa, solicitar un Traspaso o una Asignación Interna	Int	

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
				18 = Aceptar una Asignación Externa por parte del Take-up Trading Firm		
				19 = Rechazar una Asignación Externa por parte del Take-up Trading Firm		
				10 = Rechazar una Asignación Externa por parte del Take-up Clearing Firm		
				25 = Aceptar una Asignación Externa por parte del Take-up Clearing Firm		
793	SecondaryAllocID	ID2	N		String(10)	Identificador único del Traspaso asignado por la Cámara Requerido si AllocTransType [71] = 2 (Cancel) o AllocType [626] distinto de 17
72	RefAllocID	RefID	N		String(9)	Identificador de la Asignación Externa a cancelar, aceptar o rechazar. Debe corresponderse con el campo AllocReportID [755] recibido en el mensaje Allocation Report. Requerido si AllocTransType [71] = 2 (Cancel) o AllocType [626] distinto de 17.
796	AllocCancelReplaceReason	CxIRplcReason	N	99 = Other	Int	Ignorado por el interfaz
54	Side	Side	S	1 = Buy 2 = Sell	Char	Signo de todas las operaciones a asignar. Ignorado si AllocType [626] distinto de 17.
53	Quantity	Qty	S		Qty	Ignorado por el interfaz

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
75	TradeDate	TrdDt	S		LocalMktDate	Fecha Teórica de Liquidación. Ignorado si AllocType [626] distinto de 17.
/AllocInstrctn/ Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	J	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje
56	TargetCompID	TID	S	BMCL	String	Identificador de la entidad a la que va destinado el mensaje Debe contener "BMCL"
115	OnBehalfOfCompID	OBID	N		String	Código de la entidad en nombre de la cual se envía el mensaje. Si se omite se asume que es el SenderCompID
50	SenderSubID	SSub	S*		String	Debe contener el código de usuario con el que se inició la sesión FIX
57	TargetSubID	TSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Debe contener el código de Segmento de la ECC con el que se estableció la conexión
52	Sending Time	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de envío del mensaje
/AllocInstrctn/ OrdAlloc						
						Indica que se van a asignar todas las operaciones de esta orden En este caso no se puede usar el bloque <AllExc> (1 time)
→198	SecondaryOrderID	OrdID2	N		String	Identificador único formado por la concatenación de la fecha de la orden y el número de la orden de la Operación inicial tal y como se asignó por la plataforma de negociación. Requerido excepto cuando OrdAllocGrp informado o AllocTransType [71] = 2 (Cancel)
/AllocInstrctn/ AllExc						
						Deben ser siempre para operaciones sobre el mismo valor, misma fecha teórica de liquidación y mismo signo (n times)
→1003	TradeID	TrdID	N		String	Identificador de registro de la ECC de la Operación a traspasar
/AllocInstrctn/ AllExc/ MiscFees*						
						(1 time)

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
→→ 137*	MiscFee Amt	Amt	N		Amt	Corretaje de la Operación a traspasar
→→ 139*	MiscFee Type	Typ	N	12 = Agent	String	
/AllocInstrctn/ Instrmt						
55	Symbol	Sym	N	[N/A]	String	(n times)
/AllocInstrctn/ Pty						
→ 448	PartyID	ID	N		String	Si PartyRole[452]=96, contiene el Miembro Destino (sólo en asignaciones externas)
→ 447	PartyIDS ource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	
→ 452	PartyRol e	R	N	96= Take-up Trading Firm	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
/AllocInstrctn/ Alloc						
Requerido excepto cuando AllocTransType [71] = 2 (Cancel)						
(1 time)						
Cuenta de Posición Destino						
→ 79	AllocAcc ount	Acct	N		String	Ignorado por el interfaz cuando AllocType [626] = 10, 19 o 25. También se ignora cuando AllocType [626] = 17 para iniciar o cancelar una Asignación Externa
Cantidad total de valores a asignar.						
En asignaciones múltiples, debe corresponder a la suma de volúmenes vivos de las operaciones a asignar.						
→ 80	AllocQty	Qty	N		Qty	En asignaciones simples se admite una asignación parcial, por lo que podría tener un valor menor o igual al volumen vivo de la operación.
→ 1729	FirmMne monic	FirmMnem	N		String(10)	Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm) o el Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Destino (Take-up Trading Firm)
→ 161	AllocText	Txt	N		String(18)	Referencia de Asignación Externa

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
→ 1732	Firm AllocText	FirmTxt	N		String(18)	Referencia de Asignación asignada por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm) para uso interno

7.11.2 Allocation Report (Msg Type = AS)

Mensaje usado por el interfaz para notificar el estado de una Asignación Interna de cuenta, Traspaso o Asignación Externa. En la descripción de los campos de este mensaje se usará el término “traspaso” para referirse tanto a la Asignación Interna de cuenta, la Asignación Externa o el Traspaso propiamente dicho.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
Allocation Report/ AllocRpt						
755	AllocReportID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Allocation Report de una sesión
70	AllocID	ID	N		String	Identificador del mensaje Allocation Instruction relacionado
71	AllocTransType	TransType	S	0 = New 2 = Cancel	Char	
796	AllocCancelReason	CxlRplcReason	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	RptType	S	15 = Give-up 16 = Take-up 5 = Rejected by intermediary 6 = Allocation pending	Int	
87	AllocStatus	Stat	S	9 = Claimed 12 = Cancelled 13 = Pending take-up approval	Int	Para más información, ver “7.9 - Flujo de mensajes”
54	Side	Side	S	1 = Buy 2 = Sell	Char	Indica si la Operación a transferir es compradora o vendedora

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
53	Quantity	Qty	S		Qty	Volumen total de la Asignación/Traspaso Precio de la Operación.
6	AvgPx	AvgPx	S		Price	Contiene 0 en una asignación múltiple
75	TradeDate	TrdDt	S		LocalMktDate	Fecha Teórica de Liquidación
381	GrossTradeAmt	GrossTrdAmt	N		Amt	Importe efectivo total de la Asignación/Traspaso
/AllocRpt/ Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	AS	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S	BMCL	String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Identificador(es) de la(s) entidad(es) a la(s) que va destinado el mensaje Los códigos de entidad van separados por comas (,)
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código asignado al Segmento de la ECC con el que se estableció la conexión
52	Sending Time	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de envío del mensaje
<p>Bloque OrdAlloc con los datos de la orden:</p> <ul style="list-style-type: none"> en caso de asignaciones múltiples, a partir de una orden en caso de asignación simple, con los datos de la orden asociadas a la operación de AllExc 						
/AllocRpt/ OrdAlloc						
(1 time)						

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
→198	SecondaryOrderID	OrdID2	N		String	Identificador único formado por la concatenación de la fecha de la orden y el número de la orden de la Operación inicial tal y como se asignó por la plataforma de negociación.
→ 1*	Account	Acct	N		String	Código de cliente introducido en la orden. No informado en asignaciones múltiples
→ 58*	Text	Txt	N		String	Si es una Operación procedente de una orden, contiene la Referencia asignada en la orden Si es una Operación bilateral, es la Referencia asignada por el introductor Si es una Asignación de Cuenta o un Traspaso, contiene la Referencia de la Operación previa No informado en asignaciones múltiples
→ 581*	Account Type	AcctTyp	N	Antes de MIFID-II: 1 = Ajena 3 = Propia 7 = Especialista A partir de MIFID-II: 1 - AOTC 3 - MTCH 4 - DEAL	Int	Indicador de capacidad. No informado en asignaciones múltiples
/AllocRpt/ AllExc						No está presente en caso de asignaciones múltiples a partir de una orden (n times)
→32	LastQty	LastQty	N		Qty	Volumen de la Operación
→31	LastPx	LastPx	N		Price	Precio de la Operación

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
→ 1003	TradeID	TrdID	N		String	Identificador de registro de la ECC de la nueva Operación Sólo está presente cuando AllocStatus [87] = 9 (Claimed).
→ 1126*	OrigTradeID	OrigTrdID	N		String	Identificador de registro de la ECC de la Operación a transferir
1300*	MarketSegmentID	MktSegID	N	Ver Tabla 5 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de Segmento de Negociación
880*	TradeMatchID	MtchID	N		String	Número de registro de negociación de la Operación inicial
/AllocRpt/ AllExc/ Stip*						
→→ 233*	StipulationType	Typ	N	TOPEM QTYM MEMM	String	Si StipulationType [233] = TOPEM, contiene el código de operación de la ejecución en la plataforma de negociación Si StipulationType [233] = QTYM, contiene el volumen de la ejecución en la plataforma de negociación Si StipulationType [233] = MEMM, contiene el código de miembro de la ejecución en la plataforma de negociación
→→ 234*	StipulationValue	Val	N		String	(1 time)
/AllocRpt/ AllExc/ MiscFees*						
→→ 137*	MiscFeeAmt	Amt	N		Amt	Corretaje de la Operación inicial
→→ 139*	MiscFeeType	Typ	N	12 = Agent	String	
/AllocRpt/ Instrmt						
55	Symbol	Sym	N	[N/A]	String(5)	

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos o código de valor	Formato	Descripción
48	SecurityID	ID	N		String(12)	Código ISIN
22	SecurityIDSource	Src	N	4 = ISIN number	String	
/AllocRpt/ Pty						(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
→ 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.
→ 447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	
→ 452	PartyRole	R	N	11 = Order Origination Trader	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
				12 = Executing Trader		El valor 11 está presente en los mensajes destinados al Miembro Destino, cuando OrdAllocGrp informado, informándole del código del usuario de la plataforma
				13 = Order Origination Firm		El valor 13 está presente en los mensajes destinados al Miembro Destino, cuando OrdAllocGrp informado, informándole del código del Miembro de la plataforma
				16 = Executing System (Código de plataforma)		El valor 16 está presente en los mensajes destinados al Miembro Destino, cuando OrdAllocGrp informado, informándole del código de la plataforma
				36 = Clearing Broker Trader		El valor 16 está presente en los mensajes destinados al Miembro Destino, cuando OrdAllocGrp informado, informándole del código de la plataforma
				95 = Give-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
				96= Take-up Trading Firm		El valor 36, cuando esté presente, informa del usuario del Miembro Destino que realizó la aceptación o rechazo de una Asignación
				98 = Take-up Clearing Firm		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 en el campo AllocAccount [79], informándole del Miembro Compensador de dicha cuenta. Este valor también está presente en los mensajes enviados al Miembro Compensador
/AllocRpt/ Alloc						(1 time)
						Cuenta de Posición destino
→ 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 no se informará este campo
→ 80	AllocQty	Qty	N		Qty	Volumen de la Asignación/Traspaso
→ 1729	FirmMnemonic	FirmMnemonic	N		String	Cuando está presente, informa del Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm) o el Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Destino (Take-up Trading Firm)
→ 161	AllocText	Txt	N		String	Cuando está presente, informa de la Referencia de Asignación

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
→ 1732	Firm 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. Información de Supervisión

8.1 Introducción

En este capítulo se describe la funcionalidad de difusión de información del supervisor de la Cámara, basada en el mensaje News.

La información transferida es un texto de formato libre.

No existe ningún mecanismo para verificar si un mensaje ha sido entregado a sus destinatarios.

Al establecer una conexión de comunicación, si el cliente continúa la sesión FIX recibe todos los mensajes News que tenía pendientes desde el momento de la desconexión. Cuando el cliente opta por iniciar una nueva sesión FIX, recibe todos los mensajes News, destinados a él, que se han generado desde el inicio de sesión.

8.2 Lista de mensajes

Mensaje	Descripción
News (Msg Type = B)	Usado para recibir mensajes de texto del supervisor de la Cámara

8.3 Flujo de mensajes

Recepción de mensaje



8.4 Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0

Sólo se permiten una línea de hasta 78 caracteres por mensaje.

8.5 Definición de mensajes

8.5.1 News (Msg Type = B)

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
News/ News						
61	Urgency	Urgency	N	0 = Normal 1 = Flash 2 = Background	Char	El valor por defecto es 0
148	Headline	Headline	S	Ver Tabla 16 del documento "Tablas de Codificación"	String	Encabezado del mensaje. Código identificativo del tipo de información
/News/ Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	B	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderC ompID	SID	S	BMCL	String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCo mpID	TID	S		String	Identificador(es) de la(s) entidad(es) a la(s) que va destinado el mensaje Los códigos de entidad van separados por comas (,) "????" indica que el mensaje tiene como destinatarios a todas las entidades
50	SenderS ubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código asignado al Segmento de la ECC con el que se estableció la conexión
52	Sending Time	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de envío del mensaje
/News/ TxtLn						
→58	Text	Txt	S		String(78)	Número de líneas del texto. Sólo se permite una línea (1 time) Una línea de texto

9. Gestión de Referencias y Filtros de Asignación Externa

9.1 Introducción

La funcionalidad de gestión de Referencias y Filtros de Asignación Externa agrupa varias funciones. Desde el punto de vista del cliente FIX, éstas son las siguientes:

- Mantenimiento de Referencias de Asignación por Miembro Origen
- Mantenimiento de Referencias de Asignación por Miembro Destino
- Mantenimiento de Filtros de Asignación por Miembro Destino
- Mantenimiento de Filtros de Asignación por Miembro Compensador
- Módulo de Parametrización por Miembro Origen

Cada una de estas funciones se trata en un apartado separado dentro de este capítulo. Para cada función se describe el método de uso, la lista de mensajes relacionados, los flujos de mensajes, las adiciones o acotaciones aplicadas en esta implementación y la descripción detallada de los mensajes.

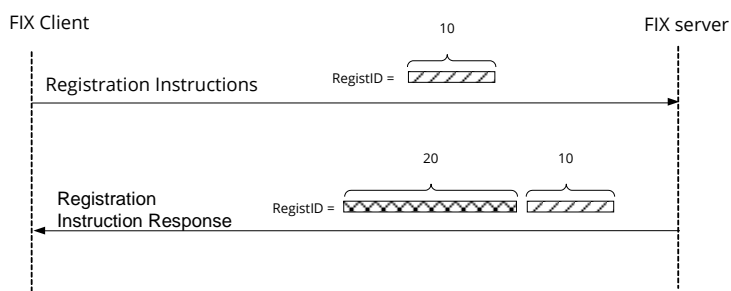
Este capítulo sólo aplica al segmento de Renta Variable.

9.2 Campo RegistID

El campo RegistID, presente en una solicitud iniciada con un mensaje Registration Instructions, es el identificador que permite relacionar la petición con los mensajes Registration Instructions Response de respuesta.

El campo RegistID asignado por el cliente debe ser de 10 caracteres de longitud. Si la longitud fuese inferior, el interfaz completa con espacios por detrás hasta llegar a dicha longitud.

El campo RegistID asignado en el mensaje de respuesta por el interfaz es de 30 caracteres de longitud, siendo las 10 últimas posiciones las correspondientes con el valor asignado por la aplicación cliente a RegistID en el mensaje original:



Un usuario que quiera modificar o cancelar cualquiera de las funcionalidades descritas al principio de este capítulo (una Referencia, un Filtro de Asignación Externa, ...), debe usar este identificador en el campo RegistRefID del mensaje Registration Instructions de solicitud.

9.3 Mantenimiento de Referencias de Asignación Externa por Miembro Origen

9.3.1 Descripción

El cliente FIX usa esta funcionalidad para realizar el mantenimiento de las Referencias que el Miembro Origen utiliza en la solicitud de Asignación Externa.

Estas Referencias son comunes para todos los usuarios del Miembro y pueden ser modificadas en tiempo real.

En la solicitud de Asignación, el Miembro Origen debe indicar una Referencia que sirva al Miembro Destino para identificar únicamente (junto con el código de Miembro Origen) el origen de la Asignación. Es la "Referencia de Asignación Externa".

Los Miembros Origen y Destino deben ponerse de acuerdo para establecer esta Referencia común a ambos.

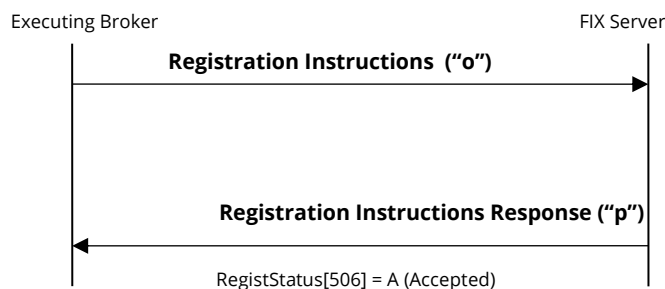
Por otro lado, a fin de facilitar el envío de la Asignación y la gestión interna, se puede crear una **Referencia Mnemotécnica** y una Referencia interna, que son códigos que define el Miembro Origen y que no requieren acuerdo con el Miembro Destino.

9.3.2 Lista de mensajes

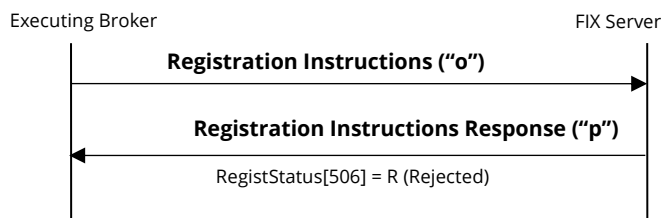
Mensaje	Descripción
9.3.5.1.Registration Instructions (Msg Type = o)	Usado por el cliente para solicitar el mantenimiento de Referencias de Asignación por Miembro Origen
9.3.5.2.Registration Instructions Response (Msg Type = p)	Enviado por BME CLEARING para confirmar o rechazar el mantenimiento de Referencias de Asignación por Miembro Origen

9.3.3 Flujo de mensajes

Solicitud correcta



Solicitud errónea



9.3.4 Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0

- En el mensaje Registration Instructions, el bloque Parties ha pasado a ser requerido.
- Se han añadido los campos FirmMnemonic [1729], AllocText[161] y Firm AllocText[1732] a los mensajes Registration Instructions y Registration Instructions Response.

9.3.5 Definición de mensajes

9.3.5.1. Registration Instructions (Msg Type = o)

Mensaje enviado por el cliente para gestionar las Referencias de Asignación Externa.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
Registration Instructions/ RgstInstrctns						
513	RegistID	ID	S		String (10)	Identificador del mensaje Registration Instructions asignado por el cliente
514	RegistTransType	TransTyp	S	0 = New 1 = Replace 2 = Cancel	Char	
508	RegistRefID	RefID	N		String (30)	Identificador del mensaje Registration Instructions que es reemplazado o cancelado por este mensaje. Requerido cuando RegistTransType = 1 ó 2
/RgstInstrctns/ Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	o	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje
56	TargetCompID	TID	S	BMCL	String	Identificador de la entidad a la que va destinado el mensaje Debe contener "BMCL"
115	OnBehalfOfCompID	OBID	N		String	Código de la entidad en nombre de la cual se envía el mensaje. Si se omite se asume que es el SenderCompID
50	SenderSubID	SSub	S*		String	Debe contener el código de usuario con el que se inició la sesión FIX
57	TargetSubID	TSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Debe contener el código de Segmento de la ECC con el que se estableció la conexión

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
52	Sending Time	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de envío del mensaje
/RgstInstrctns/ Pty						
→ 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.
/RgstInstrctns/ Pty/ Sub						
→→ 523	PartySubID	ID	S*	GOR = Give-out references	String	(1 time)
→→ 803	PartySubIDType	Typ	N		Int	
/RgstInstrctns/ Alloc*						
→1729*	FirmMnemonic	FirmMnemonic	S*		String(10)	Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm) o el Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Destino (Take-up Trading Firm)
→161*	AllocText	Txt	S*		String(18)	Referencia de Asignación Externa
→1732*	FirmAllocText	FirmTxt	N		String(18)	Referencia de Asignación definida por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm) para uso interno

9.3.5.2.Registration Instructions Response (Msg Type = p)

Mensaje usado por el interfaz para indicar el estado de la petición iniciada con un mensaje Registration Instructions.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
Registration Instructions/ RgstInstrctnsRsp						
513	RegistID	ID	S		String (30)	Identificador único del mensaje Registration Instructions asignado por el interfaz
514	RegistTransType	TransTyp	S	0 = New 1 = Replace 2 = Cancel	Char	

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
508	RegistRefID	RefID	N		String (30)	Identificador del mensaje Registration Instructions que es reemplazado o cancelado por este mensaje. Presente cuando RegistTransType = 1 ó 2
506	RegistStatus	RegStat	S	A = Accepted R = Rejected	Char	Estado de la petición del mensaje Registration Instructions. En caso de rechazo (valor "R"), el campo RegistRejReasonText [496] contiene un texto explicativo
496	RegistRejReasonText	Dtls	N		String	Cuando RegistStatus = "R", contiene una descripción específica del motivo de rechazo
/RgstInstrctnsRsp/ Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	p	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S	BMCL	String	Identificador de la entidad que envía el mensaje. Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Identificador(es) de la(s) entidad(es) a la(s) que va destinado el mensaje Los códigos de entidad van separados por comas (,)
50	SenderSubID	SSub	N	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código asignado al Segmento de la ECC con el que se estableció la conexión
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de envío del mensaje (n times)
/RgstInstrctnsRsp/ Pty						
→ 448	PartyID	ID	N		String	Si PartyRole[452]=96, contiene el Miembro Destino de la Asignación
→ 447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary / Custom code	String	
→ 452	PartyRole	R	N	96= Take-up Trading Firm	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
/RgstInstrctnsRsp/ Pty/ Sub						(1 time)
→→ 523	PartySub ID	ID	N	GOR = Give-out references	String	
→→ 803	PartySub IDType	Typ	N		Int	El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta
/RgstInstrctnsRsp/ Alloc*						(1 time)
→1729 *	FirmMne monic	FirmMne m	N		String(10)	Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm) o el Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Destino (Take-up Trading Firm)
→161*	AllocText	Txt	N		String(18)	Referencia de Asignación Externa
→1732 *	Firm AllocText	FirmTxt	N		String(18)	Referencia de Asignación definida por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm) para uso interno

9.4 Mantenimiento de Referencias de Asignación Externa por Miembro Destino

9.4.1 Descripción

El cliente FIX usa esta funcionalidad para realizar el mantenimiento de las Referencias que el Miembro Destino utiliza en la aceptación de Asignación Externa.

Estas Referencias son comunes para todos los usuarios del Miembro y pueden ser modificadas en tiempo real.

En la solicitud de Asignación Externa, el Miembro Origen debe indicar una Referencia que sirva al Miembro Destino para identificar únicamente (junto con el código de Miembro Origen) el origen de la Asignación Externa. Es la "Referencia de Asignación Externa".

Los Miembros Origen y Destino deben ponerse de acuerdo para establecer esta Referencia común a ambos.

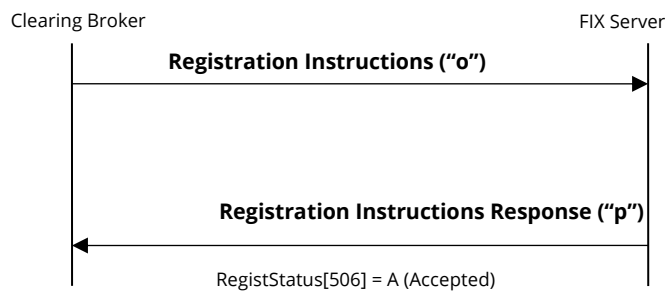
Por otro lado, a fin de facilitar la aceptación de la Asignación, se puede crear una Referencia Mnemotécnica que es un código que define el Miembro Destino y que no requiere de acuerdo con el Miembro Origen.

9.4.2 Lista de mensajes

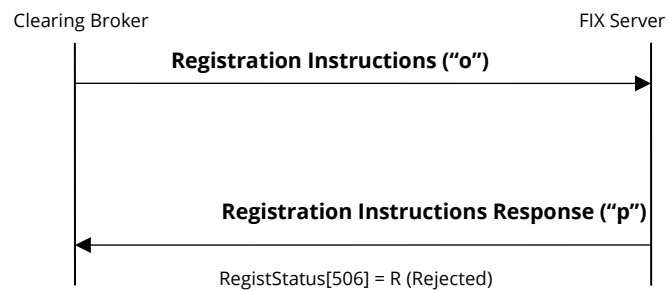
Mensaje	Descripción
9.4.5.1.Registration Instructions (Msg Type = o)	Usado por el cliente para solicitar el Mantenimiento de Referencias de Asignación por Miembro Destino
9.4.5.2.Registration Instructions Response (Msg Type = p)	Enviado por BME CLEARING para confirmar o rechazar el Mantenimiento de Referencias de Asignación por Miembro Destino

9.4.3 Flujo de mensajes

Solicitud correcta



Solicitud errónea



9.4.4 Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0

- En el mensaje Registration Instructions, el bloque Parties ha pasado a ser requerido.
- Se han añadido los campos FirmMnemonic [1729] y AllocText[161] a los mensajes Registration Instructions y Registration Instructions Response.

9.4.5 Definición de mensajes

9.4.5.1.Registration Instructions (Msg Type = o)

Mensaje enviado por el cliente para gestionar las Referencias de Asignación Externa.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
Registration Instructions/ RgstInstrctns						
513	RegistID	ID	S		String (10)	Identificador del mensaje Registration Instructions asignado por el cliente
514	RegistTransType	TransTyp	S	0 = New 1 = Replace 2 = Cancel	Char	
508	RegistRefID	RefID	N		String (30)	Identificador del mensaje Registration Instructions que es reemplazado o cancelado por este mensaje. Requerido cuando RegistTransType = 1 ó 2
/RgstInstrctns/ Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	o	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje
56	TargetCompID	TID	S	BMCL	String	Identificador de la entidad a la que va destinado el mensaje Debe contener "BMCL"
115	OnBehalfOfCompID	OBID	N		String	Código de la entidad en nombre de la cual se envía el mensaje. Si se omite se asume que es el SenderCompID
50	SenderSubID	SSub	S*		String	Debe contener el código de usuario con el que se inició la sesión FIX
57	TargetSubID	TSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Debe contener el código de Segmento de la ECC con el que se estableció la conexión
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de envío del mensaje
/RgstInstrctns/ Pty						
→ 448	PartyID	ID	S*		String	(n times) Si PartyRole[452]=38, Cuenta de Posición Destino en la que debe registrarse la Asignación en caso de ser aceptada Si PartyRole[452]=95, Miembro Origen de la Asignación

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
→ 447	PartyIDSource	Src	S*	D = Proprietary / Custom code	String	
→ 452	PartyRole	R	S*	38 = Position Account 95 = Give-up Trading Firm	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
/RgstInstrctns/ Pty/ Sub						(1 time)
→→ 523	PartySubID	ID	S*	GIR = Give-in references	String	
→→ 803	PartySubIDType	Typ	N		Int	
/RgstInstrctns/ Alloc*						(1 time)
→1729*	FirmMnemonic	FirmMnemonic	S*		String(10)	Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm) o el Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Destino (Take-up Trading Firm)
→161*	AllocText	Txt	S*		String(18)	Referencia de Asignación Externa

9.4.5.2.Registration Instructions Response (Msg Type = p)

Mensaje usado por el interfaz para indicar el estado de la petición iniciada con un mensaje Registration Instructions.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
Registration Instructions/ RgstInstrctnsRsp						
513	RegistID	ID	S		String (30)	Identificador único del mensaje Registration Instructions asignado por el interfaz
514	RegistTransType	TransTyp	S	0 = New 1 = Replace 2 = Cancel	Char	
508	RegistRefID	RefID	N		String (30)	Identificador del mensaje Registration Instructions que es reemplazado o cancelado por este mensaje. Presente cuando RegistTransType = 1 ó 2
506	RegistStatus	RegStat	S	A = Accepted R = Rejected	Char	Estado de la petición del mensaje Registration Instructions

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
						En caso de rechazo (valor "R"), el campo RegistRejReasonText [496] contiene un texto explicativo
496	RegistRejReasonText	Dtls	N		String	Cuando RegistStatus = "R", contiene una descripción específica del motivo de rechazo
/RgstInstrctnsRsp/ Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	p	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S	BMCL	String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Identificador(es) de la(s) entidad(es) a la(s) que va destinado el mensaje Los códigos de entidad van separados por comas (,)
50	SenderSubID	SSub	N	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código asignado al Segmento de la ECC con el que se estableció la conexión
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de envío del mensaje
/RgstInstrctnsRsp/ Pty						
→ 448	PartyID	ID	N		String	(n times) Si PartyRole[452]=38, Cuenta de Posición destino en la que debe registrarse la Asignación en caso de ser aceptada Si PartyRole[452]=95, Miembro Origen de la Asignación
→ 447	PartySource	Src	N	D = Proprietary / Custom code	String	
→ 452	PartyRole	R	N	38 = Position Account 95 = Give-up Trading Firm	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
/RgstInstrctnsRsp/ Pty/ Sub						
						(1 time)

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
→→ 523	PartySub ID	ID	N	GIR = Give-in references	String	
→→ 803	PartySub IDType	Typ	N		Int	El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta
/RgstInstrctnsRsp/ Alloc*						(1 time)
→1729 *	FirmMne monic	FirmMne m	N		String(10)	Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm) o el Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Destino (Take-up Trading Firm)
→161*	AllocText	Txt	N		String(18)	Referencia de Asignación Externa

9.5 Mantenimiento de Filtros de aceptación de Asignación Externa por Miembro Destino

9.5.1 Descripción

El cliente FIX usa esta funcionalidad para que el Miembro Destino de la Asignación pueda configurar Filtros que permitan la aceptación automática de las peticiones de Asignación.

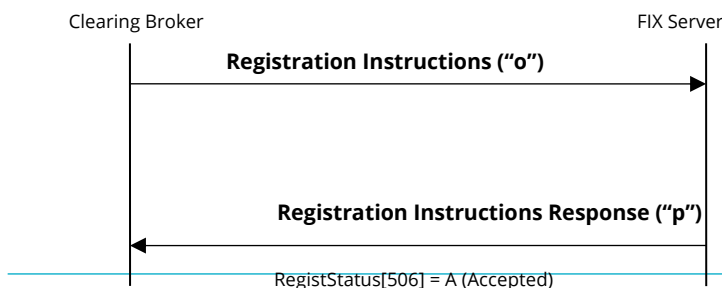
La aceptación puede automatizarse mediante unos Filtros definidos por los Miembros Destino y/o Compensador del Miembro Destino, quedando pendiente de aceptación o rechazo manual todo aquello que no supere dichos Filtros.

9.5.2 Lista de mensajes

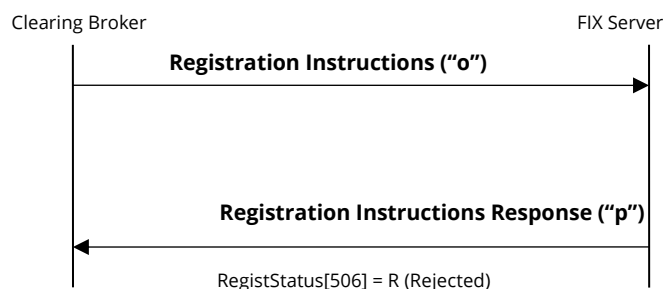
Mensaje	Descripción
9.5.5.1.Registration Instructions (Msg Type = o)	Usado por el cliente para solicitar el mantenimiento de Filtros de aceptación de Asignación por Miembro Destino
9.5.5.2.Registration Instructions Response (Msg Type = p)	Enviado por BME CLEARING para confirmar o rechazar el mantenimiento de Filtros de aceptación de Asignación por Miembro Destino

9.5.3 Flujo de mensajes

Solicitud correcta



Solicitud errónea



9.5.4 Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0

- En el mensaje Registration Instructions, el bloque Parties ha pasado a ser requerido.
- Se ha añadido el campo AllocText[161] a los mensajes Registration Instructions y Registration Instructions Response.

9.5.5 Definición de mensajes

9.5.5.1. Registration Instructions (Msg Type = o)

Mensaje enviado por el cliente para gestionar los Filtros de aceptación de Asignación Externa por Miembro Destino.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
Registration Instructions/ RgstInstrctns						
513	RegistID	ID	S		String (10)	Identificador del mensaje Registration Instructions asignado por el cliente
514	RegistTransType	TransTyp	S	0 = New 1 = Replace 2 = Cancel	Char	
508	RegistRefID	RefID	N		String (30)	Identificador del mensaje Registration Instructions que es reemplazado o cancelado por este mensaje. Requerido cuando RegistTransType = 1 ó 2
/RgstInstrctns/ Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	o	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje
56	TargetCompID	TID	S	BMCL	String	Identificador de la entidad a la que va destinado el mensaje Debe contener "BMCL"

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
115	OnBehalfOfCompID	OBID	N		String	Código de la entidad en nombre de la cual se envía el mensaje. Si se omite se asume que es el SenderCompID
50	SenderSubID	SSub	S*		String	Debe contener el código de usuario con el que se inició la sesión FIX
57	TargetSubID	TSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Debe contener el código de Segmento de la ECC con el que se estableció la conexión
52	Sending Time	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de envío del mensaje
/RgstInstrctns/ Pty						(n times)
						Si PartyRole[452]=95, contiene el Miembro Origen de la Asignación
→ 448	PartyID	ID	S*		String	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)
→ 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
/RgstInstrctns/ Pty/ Sub						(1 time)
→→ 523	PartySubID	ID	S*	GIF = Give-in filters	String	
→→ 803	PartySubIDType	Typ	N		Int	
/RgstInstrctns/ Stip*						(n times)
→ 233*	StipulationType	Typ	S	TAL SAL	String	Si StipulationType = TAL, es el importe efectivo máximo para una Asignación que será aceptado automáticamente para ese Miembro Origen de la Asignación y Referencia de Asignación
→ 234*	StipulationValue	Val	S	[N/A] o un valor numérico >=0, 12 posiciones máximo, sin decimales	String	Si StipulationType = SAL,

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
						es el importe efectivo acumulado máximo por sesión de asignaciones que serán aceptados automáticamente para ese Miembro Origen de la Asignación y Referencia de Asignación
						Se informará a [N/A] cuando se desee que el filtro sea totalmente abierto, esto es, no haya un importe máximo específico a comprobar
/RgstInstrctns/ Alloc*						(1 time)
						Referencia de Asignación Externa.
						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	S*		String(18)	

9.5.5.2.Registration Instructions Response (Msg Type = p)

Mensaje usado por el interfaz para indicar el estado de la petición iniciada con un mensaje Registration Instructions.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
Registration Instructions/ RgstInstrctnsRsp						
513	RegistID	ID	S		String (30)	Identificador único del mensaje Registration Instructions asignado por el interfaz
514	RegistTransType	TransTyp	S	0 = New 1 = Replace 2 = Cancel	Char	
508	RegistRefID	RefID	N		String (30)	Identificador del mensaje Registration Instructions que es reemplazado o cancelado por este mensaje. Presente cuando RegistTransType = 1 ó 2

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
						Estado de la petición del mensaje Registration Instructions
506	RegistStatus	RegStat	S	A = Accepted R = Rejected	Char	En caso de rechazo (valor "R"), el campo RegistRejReasonText [496] contiene un texto explicativo
496	RegistRejReasonText	Dtls	N		String	Cuando RegistStatus = "R", contiene una descripción específica del motivo de rechazo
/RgstInstrctnsRsp/ Hdr						
35	MsgType	MsgType	S	p	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S	BMCL	String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Identificador(es) de la(s) entidad(es) a la(s) que va destinado el mensaje Los códigos de entidad van separados por comas (,)
50	SenderSubID	SSub	N	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código asignado al Segmento de la ECC con el que se estableció la conexión
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de envío del mensaje
/RgstInstrctnsRsp/ Pty						
→ 448	PartyID	ID	N		String	(n times) Si PartyRole[452]=95, contiene el Miembro Origen de la Asignación
→ 447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary / Custom code	String	
→ 452	PartyRole	R	N	95 = Give-up Trading Firm	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
/RgstInstrctnsRsp/ Pty/ Sub						
→→ 523	PartySubID	ID	N	GIF = Give-in filters	String	(1 time)

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
→→ 803	PartySubIDType	Typ	N		Int	El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta
/RgstInstrctnsRsp/ Stip*						(n times)
→ 233*	StipulationType	Typ	N	TAL SAL	String	Si StipulationType = TAL, es el importe efectivo máximo para una Asignación que será aceptado automáticamente para ese Miembro Origen de la Asignación y Referencia de Asignación Si StipulationType = SAL, es el importe efectivo acumulado máximo de asignaciones por sesión que será aceptado automáticamente para ese Miembro Origen de la Asignación y Referencia de Asignación
→ 234*	StipulationValue	Val	N		String	El valor [N/A] indica que el filtro es totalmente abierto, esto es, no hay un importe máximo específico a comprobar
/RgstInstrctnsRsp/ Alloc*						(1 time)
→ 161*	AllocText	Txt	N		String(18)	Referencia de Asignación Externa El valor comodín "?" significa "todo"

9.6 Mantenimiento de Filtros de aceptación de Asignación Externa por Miembro Compensador de Miembro Destino

9.6.1 Descripción

El cliente FIX usa esta funcionalidad para que el Miembro Compensador del Miembro Destino de la Asignación pueda configurar Filtros que permitan la aceptación automática de las peticiones de Asignación

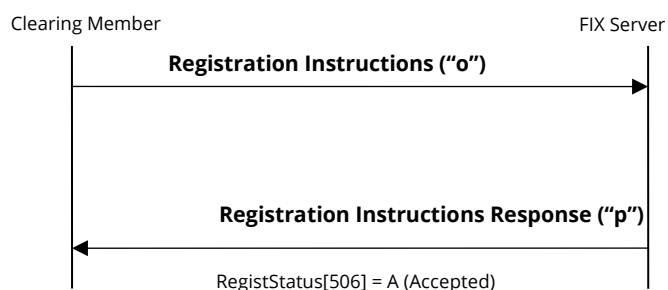
La aceptación de Asignación Externa puede automatizarse mediante unos Filtros definidos por los Miembros Destino y/o Compensador, quedando pendiente de aceptación o rechazo manual todo aquello que no supere dichos Filtros.

9.6.2 Lista de mensajes

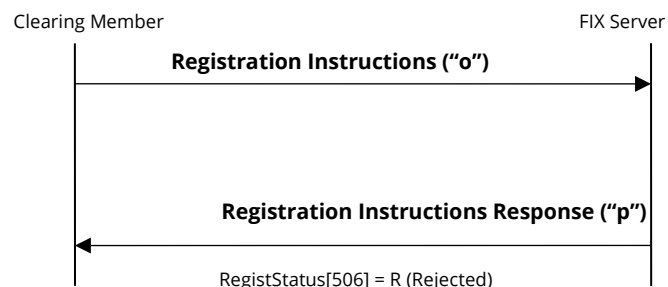
Mensaje	Descripción
9.6.5.1.Registration Instructions (Msg Type = o)	Usado por el cliente para solicitar el mantenimiento de Filtros de aceptación de Asignación Externa por Miembro Compensador
9.6.5.2.Registration Instructions Response (Msg Type = p)	Enviado por BME CLEARING para confirmar o rechazar el mantenimiento de Filtros de aceptación de Asignación Externa por Miembro Compensador

9.6.3 Flujo de mensajes

Solicitud correcta



Solicitud errónea



9.6.4 Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0

- En el mensaje Registration Instructions, el bloque Parties ha pasado a ser requerido.
- Se ha añadido el bloque Stipulations al mensaje Registration Instructions Response.

9.6.5 Definición de mensajes

9.6.5.1.Registration Instructions (Msg Type = o)

Mensaje enviado por el cliente para gestionar los Filtros de aceptación de Asignación Externa por el Miembro Compensador.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
Registration Instructions/ RgstInstrctns						
513	RegistID	ID	S		String (10)	Identificador del mensaje Registration Instructions asignado por el cliente
514	RegistTransType	TransTyp	S	0 = New 1 = Replace 2 = Cancel	Char	
508	RegistRefID	RefID	N		String (30)	Identificador del mensaje Registration Instructions que es reemplazado o cancelado por este mensaje. Requerido cuando RegistTransType = 1 ó 2
/RgstInstrctns/ Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	o	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje
56	TargetCompID	TID	S	BMCL	String	Identificador de la entidad a la que va destinado el mensaje. Debe contener "BMCL"
115	OnBehalfOfCompID	OBID	N		String	Código de la entidad en nombre de la cual se envía el mensaje. Si se omite se asume que es el SenderCompID
50	SenderSubID	SSub	S*		String	Debe contener el código de usuario con el que se inició la sesión FIX
57	TargetSubID	TSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Debe contener el código de Segmento de la ECC con el que se estableció la conexión
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de envío del mensaje
/RgstInstrctns/ Pty						
→ 448	PartyID	ID	S*		String	(n times) Si PartyRole[452]=38, contiene la Cuenta de Posición destino de la Asignación Si PartyRole[452]=96, contiene el Código de Miembro Destino de la Asignación

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
→ 447	PartyIDSource	Src	S*	D = Proprietary / Custom code	String	
→ 452	PartyRole	R	S*	38 = Position Account 96= Take-up Trading Firm	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID.
/RgstInstrctns/ Pty/ Sub						(1 time)
→→ 523	PartySubID	ID	S*	GIFCM = Give-in filters of clearing member	String	
→→ 803	PartySubIDType	Typ	N		Int	
/RgstInstrctns/ Stip*						(n times)
→ 233*	StipulationType	Typ	S	TAL SAL	String	Si StipulationType = TAL, es el importe efectivo máximo para una Asignación que será aceptado automáticamente para ese Miembro Destino de la Asignación y cuenta
→ 234*	StipulationValue	Val	S	[N/A] o un valor numérico >=0, 12 posiciones máximo, sin decimales	String	Si StipulationType = SAL, es el importe efectivo acumulado máximo de asignaciones por sesión que será aceptado automáticamente para ese Miembro Destino de la Asignación y cuenta Se informará a [N/A] cuando se desee que el filtro sea totalmente abierto, esto es, no haya un importe máximo específico a comprobar

9.6.5.2.Registration Instructions Response (Msg Type = p)

Mensaje usado por el interfaz para indicar el estado de la petición iniciada con un mensaje Registration Instructions.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
Registration Instructions/ RgstInstrctnsRsp						
513	RegistID	ID	S		String (30)	Identificador único del mensaje Registration Instructions asignado por el interfaz
514	RegistTransType	TransTyp	S	0 = New 1 = Replace 2 = Cancel	Char	
508	RegistRefID	RefID	N		String (30)	Identificador del mensaje Registration Instructions que es reemplazado o cancelado por este mensaje. Presente cuando RegistTransType = 1 ó 2
506	RegistStatus	RegStat	S	A = Accepted R = Rejected	Char	Estado de la petición del mensaje Registration Instructions En caso de rechazo (valor "R"), el campo RegistRejReasonText [496] contiene un texto explicativo
496	RegistRejReasonText	Dtls	N		String	Cuando RegistStatus = "R", contiene una descripción específica del motivo de rechazo
/RgstInstrctnsRsp/ Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	p	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S	BMCL	String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Identificador(es) de la(s) entidad(es) a la(s) que va destinado el mensaje Los códigos de entidad van separados por comas (,)
50	SenderSubID	SSub	N	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código asignado al Segmento de la ECC con el que se estableció la conexión
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de envío del mensaje

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
/RgstInstrctnsRsp/ Pty						(n times)
→ 448	PartyID	ID	N		String	Si PartyRole[452]=38, contiene la Cuenta de Posición Destino de la Asignación Si PartyRole[452]=96, contiene el Código de Miembro Destino de la Asignación
→ 447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary / Custom code	String	
→ 452	PartyRole	R	N	38 = Position Account 96= Take-up Trading Firm	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
/RgstInstrctnsRsp/ Pty/ Sub						(1 time)
→→ 523	PartySubID	ID	N	GIFCM = Give- in filters of clearing member	String	
→→ 803	PartySubIDType	Typ	N		Int	El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta
/RgstInstrctnsRsp/ Stip*						(n times)
→ 233*	StipulationType	Typ	N	TAL SAL	String	
→ 234*	StipulationValue	Val	N		String	Si StipulationType = TAL, es el importe efectivo máximo para una Asignación que será aceptado automáticamente para ese Miembro Destino de la Asignación y Cuenta Si StipulationType = SAL, es el importe efectivo acumulado máximo de asignaciones por sesión que será aceptado automáticamente para ese Miembro Destino de la Asignación y Cuenta

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
						El valor [N/A] indica que el filtro es totalmente abierto, esto es, no hay un importe máximo específico a comprobar

9.7 Módulo de Parametrización por Miembro Origen

9.7.1 Descripción

El cliente FIX usa esta funcionalidad para configurar el Módulo de Parametrización por Miembro Origen a partir de los datos introducidos en la orden.

Permite configurar, en el entorno de la ECC Renta Variable, el Mnemotécnico de Asignación (FirmMnemonic [1729]) o la Cuenta de Posición (PartyRole [452] = 38) a partir de la siguiente información del entorno de Negociación:

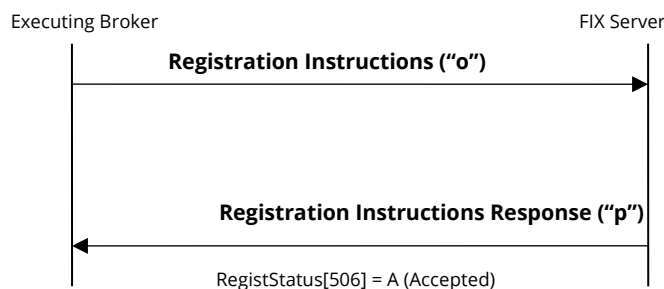
- Plataforma (una o todas) – Segmento de Negociación (uno o todos) – Usuario (uno o todos los usuarios del Miembro)
- Un determinado Indicador de Capacidad (AccountType [581]) y
 - a. Un código de cliente (campo Account [1]) o
 - b. Una Referencia externa (campo Text [58])

9.7.2 Lista de mensajes

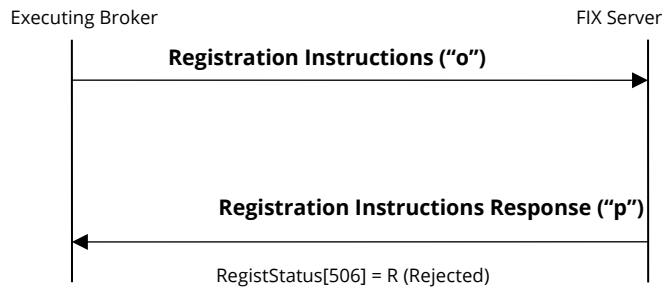
Mensaje	Descripción
9.7.5.1.Registration Instructions (Msg Type = o)	Usado por el cliente para solicitar el mantenimiento del Módulo de Parametrización por Miembro Origen
9.7.5.2.Registration Instructions Response (Msg Type = p)	Enviado por BME CLEARING para confirmar o rechazar el mantenimiento del Módulo de Parametrización por Miembro Origen

9.7.3 Flujo de mensajes

Solicitud correcta



Solicitud errónea



9.7.4 Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0

- En el mensaje Registration Instructions, el campo RegistAcctType [493] ha pasado a ser requerido.
- En el mensaje Registration Instructions, el bloque Parties ha pasado a ser requerido.
- Se han añadido los campos FirmMnemonic [1729], MarketSegmentID [1300] y Text[58] a los mensajes Registration Instructions y Registration Instructions Response.
- Se ha añadido el campo RegistAcctType [493] al mensaje Registration Instructions Response.
- Se ha añadido el bloque Stipulations a los mensajes Registration Instructions y Registration Instructions Response.

9.7.5 Definición de mensajes

9.7.5.1 Registration Instructions (Msg Type = o)

Mensaje enviado por el cliente para gestionar el Módulo de Parametrización por el Miembro Origen.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
Registration Instructions/ RqstInstrctns						
513	RegistID	ID	S		String (10)	Identificador del mensaje Registration Instructions asignado por el cliente
514	RegistTransType	TransTyp	S	0 = New 1 = Replace 2 = Cancel	Char	
508	RegistRefID	RefID	N		String (30)	Identificador del mensaje Registration Instructions que es reemplazado o cancelado por este mensaje. Requerido cuando RegistTransType = 1 ó 2
1	Account	Acct	N		String	Código de cliente introducido en la orden
493	RegistAcctType	AcctTyp	S*	Antes de MIFID-II: 1 = Ajena 3 = Propia	String	Indicador de capacidad

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
				7 = Especialista		
				A partir de MIFID-II: 1 – AOTC 3 – MTCH 4 – DEAL		
1300*	MarketSegmentID	MktSegID	N	Ver Tabla 5 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de Segmento de Negociación Debe informarse con "??" para referirse a todos los Segmentos de Negociación
58*	Text	Txt	N		String	Referencia externa: Referencia de la orden asignada por el usuario
/RgstInstrctns/ Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	o	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje
56	TargetCompID	TID	S	BMCL	String	Identificador de la entidad a la que va destinado el mensaje Debe contener "BMCL"
115	OnBehalfOfCompID	OBID	N		String	Código de la entidad en nombre de la cual se envía el mensaje. Si se omite se asume que es el SenderCompID
50	SenderSubID	SSub	S*		String	Debe contener el código de usuario con el que se inició la sesión FIX
57	TargetSubID	TSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Debe contener el código de Segmento de la ECC con el que se estableció la conexión
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de envío del mensaje
/RgstInstrctns / Pty						
						(n times) Si PartyRole[452]=11, contiene el código del Usuario Origen de la plataforma Si PartyRole[452]=13,
→ 448	PartyID	ID	S*		String	contiene el código del Miembro Origen en la plataforma Si Usuario Origen (PartyRole[452]=11) contiene "???", significa "para todos los usuarios del Miembro"

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
						Si PartyRole452]=38, contiene la Cuenta de Posición
→ 447	PartyIDSource	Src	S*	D = Proprietary / Custom code	String	
				11 = Order Origination Trader		
→ 452	PartyRole	R	S*	13 = Order Origination Firm	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
				38 = Position Account		
/RgstInstrctns/ Pty/ Sub						(1 time)
→→ 523	PartySubID	ID	S*	PAM = Parameterization module	String	
→→ 803	PartySubIDType	Typ	N		Int	
/RgstInstrctns/ Alloc*						(1 time)
→1729*	FirmMnemonic	FirmMnem	N		String(10)	Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm)
/RgstInstrctns/ Stip*						(n times)
→ 233*	StipulationType	Typ	N	PL	String	
→ 234*	StipulationValue	Val	N		String	Código de Plataforma Si contiene "????", significa "para todas las Plataformas"

9.7.5.2.Registration Instructions Response (Msg Type = p)

Mensaje usado por el interfaz para indicar el estado de la petición iniciada con un mensaje Registration Instructions.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
Registration Instructions/ RgstInstrctnsRsp						
513	RegistID	ID	S		String (30)	Identificador único del mensaje Registration Instructions asignado por el interfaz
514	RegistTransType	TransTyp	S	0 = New 1 = Replace 2 = Cancel	Char	

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
508	RegistRefID	RefID	N		String (30)	Identificador del mensaje Registration Instructions que es reemplazado o cancelado por este mensaje. Presente cuando RegistTransType = 1 ó 2
1	Account	Acct	N		String	Código de cliente introducido en la orden
506	RegistStatus	RegStat	S	A = Accepted R = Rejected	Char	Estado de la petición del mensaje Registration Instructions En caso de rechazo (valor "R"), el campo RegistRejReasonText [496] contiene un texto explicativo
496	RegistRejReasonText	Dtls	N		String	Cuando RegistStatus = "R", contiene una descripción específica del motivo de rechazo
493*	RegistAcctType	AcctTyp	N	Antes de MIFID-II: 1 = Ajena 3 = Propia 7 = Especialista A partir de MIFID-II: 1 - AOTC 3 - MTCH 4 - DEAL	String	Indicador de capacidad
1300*	MarketSegmentID	MktSegID	N	Ver Tabla 5 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de Segmento de Negociación Si está informado con "??" significa "para todos los segmentos de Negociación"
58*	Text	Txt	N		String	Referencia Externa: Referencia de la orden asignada por el usuario
/RgstInstrctnsRsp/ Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	p	String	Identifica el tipo de mensaje

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
49	SenderCompanyID	SID	S	BMCL	String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompanyID	TID	S		String	Identificador(es) de la(s) entidad(es) a la(s) que va destinado el mensaje Los códigos de entidad van separados por comas (,)
50	SenderSubID	SSub	N	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código asignado al Segmento de la ECC con el que se estableció la conexión
52	Sending Time	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de envío del mensaje
/RgstInstrctnsRsp/ Pty						(n times)
						Si PartyRole[452]=11, contiene el código del Usuario Origen de la plataforma Si PartyRole[452]=13, contiene el código del Miembro Origen en la plataforma
→ 448	PartyID	ID	N		String	Si Usuario Origen (PartyRole[452]=11) no está informado, significa "para todos los usuarios del Miembro" Si PartyRole[452]=38, contiene la Cuenta de Posición
→ 447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary / Custom code	String	
→ 452	PartyRole	R	N	11 = Order Origination Trader 13 = Order Origination Firm 38 = Position Account	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
/RgstInstrctnsRsp/ Pty/ Sub						(1 time)
→→ 523	PartySub ID	ID	N	PAM = Parameteriza tion module	String	
→→ 803	PartySub IDType	Typ	N		Int	El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta
/RgstInstrctnsRsp/ Alloc*						(1 time)
→1729 *	FirmMne monic	FirmMne m	N		String(10)	Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm)
/RgstInstrctnsRsp/ Stip*						(n times)
→ 233*	Stipulati onType	Typ	N	PL	String	
→ 234*	Stipulati onValue	Val	N		String	Código de Plataforma Si no está informado, significa "para todas las Plataformas"

10. Garantías y Movimientos de Efectivo

10.1 Introducción

Se proporcionan los siguientes tipos de información:

- a) Account Summary Report: Información de los movimientos de Garantías al final de la sesión, así como de otros Movimientos de Efectivo a realizar en el Sistema de Pagos
- b) Margin Requirement Report: Información de las Garantías durante la sesión
- c) Collateral Report: Detalle de las Garantías Depositadas

10.2 Account Summary Report

El Account Summary Report es generado por la ECC al final de la sesión.

Totaliza los importes de los movimientos de Garantías y otros importes diarios.

La información se envía a las entidades recogidas en el bloque Parties:

- a) Información a nivel de Cuenta de Garantías: PartyRole 4 (Clearing Firm: Miembro Compensador), PartyRole 15 (Margin Firm: Miembro al que pertenece la Cuenta de Garantías) y PartyRole 100 (Margin Account: Cuenta de Garantías).
- b) Información a nivel de Cuenta de Colateral: PartyRole 4 (Clearing Firm: Miembro Compensador), PartyRole 49 (Collateral Firm: Miembro al que pertenece la Cuenta de Colateral) y PartyRole 101 (Collateral Account: Cuenta de Colateral).
- c) Información a nivel de Cuenta de Miembro Compensador: PartyRole 4 (Clearing Firm: Miembro Compensador), y PartyRole 30 (Agente de Pagos).

10.3 Margin Requirement Report

El Margin Requirement Report es generado:

- a) Como respuesta a un Margin Requirement Inquiry del Miembro Compensador (Límite de Riesgo Intradía y Garantía por Posición por Cuenta)
- b) De forma no solicitada por el Miembro a iniciativa de la ECC (Garantías Extraordinarias por Margin Call)

Esta información puede ir a varios niveles (Compensador, Negociador o Cuenta) en función de cómo esté informado el bloque Parties.

10.4 Collateral Report

La ECC suministra información del detalle de las Garantías Depositadas (collateral).

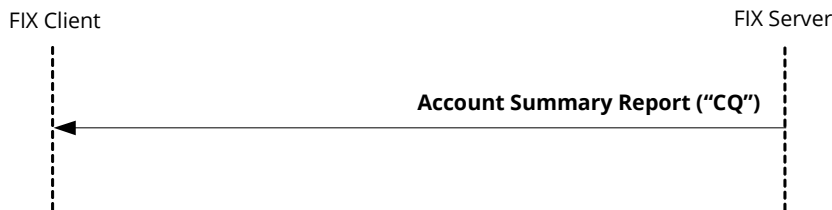
Esta información es a varios niveles (Compensador, Negociador o Cuenta) en función de cómo esté informado el bloque Parties.

10.5 Lista de mensajes

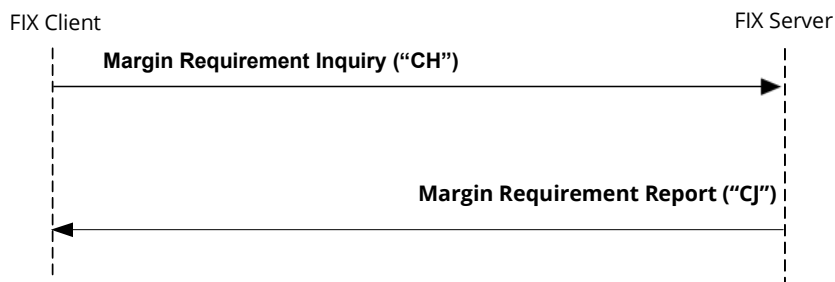
Mensaje	Descripción
Account Summary Report (MsgType = CQ)	Enviado por la ECC para informar de las Garantías y Movimientos de Efectivo a nivel Cuenta y nivel Miembro al final de la sesión
Margin Requirement Inquiry (Msg Type = CH)	Enviado por el Miembro Compensador para solicitar el Límite de Riesgo Intradía y Riesgo por Cuenta
Margin Requirement Report (Msg Type = CJ)	Enviado como respuesta a un Margin Requirement Inquiry del Miembro Compensador (Límite de Riesgo Intradía y Riesgo por Cuenta) y por la ECC (no solicitada por el Miembro, Garantías Extraordinarias por Margin Call)
Collateral Report (Msg Type = BA)	Enviado por la ECC para informar del detalle de las Garantías Depositadas

10.6 Flujo de mensajes

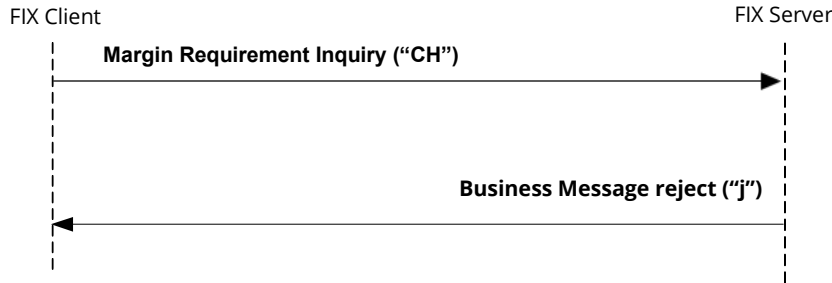
Información de las Garantías y Movimientos de Efectivo al final de la sesión



Información de las Garantías enviadas como respuesta a un Margin Requirement Inquiry del Miembro Compensador (Límite de Riesgo Intradía y Riesgo por Cuenta)



Rechazo enviado como respuesta a un Margin Requirement Inquiry del Miembro Compensador (Límite de Riesgo Intradía y Riesgo por Cuenta)



Información de las Garantías enviada por la ECC, (no solicitada por el Miembro, Garantías Extraordinarias por Margin Call)



Detalle de las Garantías Depositadas



10.7 Acotaciones y adaptaciones de FIX 5.0

- Se han añadido los tags MarginAmountMarketSegmentID [1714] y MarginAmountMarketID [1715] al bloque del mensaje Account Summary Report y al bloque MarginAmount del mensaje Margin Requirement Report.
- Se añade el tag CreditRating [255] al mensaje Account Summary Report.
- Se añaden los bloques Stipulations y Risk Limit Types al mensaje Account Summary Report.
- Se añade el bloque Risk Limit Types al mensaje Margin Requirement Report.

- Se añade el bloque Stipulation al componente MgnAmt del Account Summary Report.
- Se añade el bloque Stipulation al componente PayCol del Account Summary Report.

10.8 Definición de mensajes

10.8.1 Account Summary Report (Msg Type = CQ) a nivel de Cuenta de Garantías

Enviado por ECC para informar de Garantías y Movimientos de Efectivo a nivel de Cuenta de Garantías al final de la sesión.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
Account Summary Report/ AcctSumRpt						
1699	Account SummaryReportID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Account Summary Report de una sesión
715	Clearing Business Date	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
15	Currency	Ccy	N		Currency	Código de divisa en la que están expresados los importes de este mensaje. Expresada según estándar ISO 4217
/AcctSumRpt/ Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	CQ	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompanyID	SID	S	BMCL	String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompanyID	TID	S		String	Identificador(es) de la(s) entidad(es) a la(s) que va destinado el mensaje Los códigos de entidad van separados por comas (,)
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de Segmento de la Cámara
52	Sending Time	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de envío del mensaje

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
						Garantías exigidas (n times)
/AcctSumRpt/ MgnAmt						
→1645	MarginAmt	Amt	N		Amt	Importe Garantía
→1644	MarginAmtType	Typ	N	201 - Garantía por Posición por Cuenta	Int	Tipo de Garantía
→1714	MarginAmountMarketSegmentID	MktSegID	N	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de Segmento de la Cámara
→1715	MarginAmountMarketID	MktID	N	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC
						(n times)
/AcctSumRpt/ Pty						
						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 Si PartyRole[452]=100, contiene la Cuenta de Garantías
→ 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 4 = Clearing Firm 100 = Margin Account	Int	Si PartyRole[452]=15, contiene el código de Miembro al que pertenece la Cuenta de Garantías. Cuando está presente, la información se da a nivel de Miembro No Compensador Si PartyRole[452]=4,

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
						contiene el código de Miembro Compensador
						Si PartyRole[452]=100, contiene el código de la Cuenta de Garantías. Cuando está presente, la información se da a nivel de Cuenta

10.8.2 Account Summary Report (Msg Type = CQ) a nivel de Cuenta de Colateral

Enviado por ECC para informar de Garantías y Movimientos de Efectivo a nivel de Cuenta de Colateral al final de la sesión.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
Account Summary Report/ AcctSumRpt						
1699	Account SummaryReportID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Account Summary Report de una sesión
715	Clearing Business Date	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
15	Currency	Ccy	N		Currency	Código de divisa en la que están expresados los importes de este mensaje. Expresada según estándar ISO 4217
/AcctSumRpt/ Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	CQ	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S	BMCL	String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Identificador(es) de la(s) entidad(es) a la(s) que va destinado el mensaje Los códigos de entidad van separados por comas (,)

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	Sending Time	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de envío del mensaje
/AcctSumRpt/ MgnAmt						Garantías exigidas (n times)
→1645	MarginAmt	Amt	N		Amt	Importe Garantía
→1644	MarginAmtType	Typ	N	201 - Garantía por Posición por Cuenta	Int	Tipo de Garantía
→1715	MarginAmountMarketID	MktID	N	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC
/AcctSumRpt/ Pty						(n times)
						Si PartyRole[452]=49, contiene el código del Miembro al que pertenece la Cuenta de Collateral
→448	PartyID	ID	N		String	Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC Si PartyRole[452]=101, contiene la Cuenta de Collateral
→447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
→452	PartyRole	R	N	4 = Clearing Firm 101 = Collateral Account	Int	Si PartyRole[452]=49, contiene el código de Miembro al que pertenece la Cuenta de Collateral. Cuando está presente, la información se da a nivel de Miembro No Compensador

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
						Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador
						Si PartyRole[452]=101, contiene el código de la Cuenta de Collateral. Cuando está presente, la información se da a nivel de Cuenta
/AcctSumRpt/ CollAmt						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
/AcctSumRpt/ PayCol						Movimientos de efectivo (n times)
→1708	PayCollectType	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	PayCollectMarketSegmentID	MktSegID	N	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de Segmento de la Cámara
→1713	PayCollectMarketID	MktID	N	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC

10.8.3 Account Summary Report (Msg Type = CQ) a nivel de Miembro Compensador

Enviado por ECC para informar de Garantías y Movimientos de Efectivo a nivel de Miembro Compensador al final de la sesión.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
Account Summary Report/ AcctSumRpt						
1699	Account SummaryReportID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Account Summary Report de una sesión
715	Clearing Business Date	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
15	Currency	Ccy	N		Currency	Código de divisa en la que están expresados los importes de este mensaje. Expresada según estándar ISO 4217
255*	CreditRating	CrdRtg	N		String	Solvencia de la entidad
/AcctSumRpt/ Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	CQ	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S	BMCL	String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Identificador(es) de la(s) entidad(es) a la(s) que va destinado el mensaje Los códigos de entidad van separados por comas (,)
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC
52	Sending Time	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de envío del mensaje
/AcctSumRpt/ MgnAmt						
→1645	MarginAmount	Amt	N		Amt	Garantías exigidas (n times) Importe Garantía

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
→1644	MarginAmtType	Typ	N	Ver Tabla 10 del documento "Tablas de Codificación"	Int	Tipo de Garantía
→1714	MarginAmountMarketSegmentID	MktSegID	N	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de Segmento de la Cámara
→1715	MarginAmountMarketID	MktID	N	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC
/AcctSumRpt/ MgnAmt/ Stip*						(1 time)
→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.
/AcctSumRpt/ Pty						(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/ Custom code	Char	
→452	PartyRole	R	N	4 = Clearing Firm	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador Garantías Depositadas
/AcctSumRpt/ CollAmt						(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

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
→2093	Collatara IAmount MarketID	MktID	N	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC
						Movimientos de efectivo (n times)
/AcctSumRpt/ PayCol						
→1708	PayCollectType	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	PayCollectMarketSegmentID	MktSegID	N	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de Segmento de la Cámara
→1713	PayCollectMarketID	MktID	N	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC
/AcctSumRpt/ PayCol/ Stip*						
→233*	StipulationType	Typ	N	CMGRP	String	"CMGRP"
→234*	StipulationValue	Val	N		String	Grupo de movimiento de efectivo asociado al Agente de Pagos (n times)
/AcctSumRpt/ Stip*						
→233*	StipulationType	Typ	N	EQTY	String	
→234*	StipulationValue	Val	N		String	Si StipulationType = EQTY, Recursos Propios de la Entidad
						Datos de riesgo (n times)
/AcctSumRpt/ RiskLmtTyp*						
→1530*	RiskLimitType	Typ	N	100 101 102 103 104 105 106 107 108	String	100 = Consumo de Límite de Riesgo Intradía resultante a fin de sesión 101 = Límite de Riesgo Intradía resultante para la siguiente sesión 102 = Garantía Individual para Nuevas Operaciones

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
						103 = Sobrante de Garantías por Posición por Cuenta 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
→ 1531*	RiskLimitAmount	Amt	N		Amt	
→ 1714*	MarginAmountMarketSegmentID	MktSegID	N	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de Segmento de la Cámara
→ 1715*	MarginAmountMarketID	MktID	N	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC

10.8.4 Margin Requirement Inquiry (Msg Type = CH)

Enviado por el Clearing Member para solicitar el Límite de Riesgo Intradía y Riesgo por Cuenta.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
Margin Requirement Inquiry/ MgnReqmtInq						
1635	MarginReqmtInqID	ID	S		String (10)	Identificador de la solicitud
/MgnReqmtInq/ Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	CH	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.
56	TargetCompID	TID	S	BMCL	String	Identificador de la entidad a la que va destinado el mensaje Debe contener "BMCL"
115	OnBehalfOfCompID	OBID	N		String	Código de la entidad en nombre de la cual se envía el mensaje. Si se omite se asume que es el SenderCompID
50	SenderSubID	SSub	S*		String	Debe contener el código de usuario con el que se inició la sesión FIX
57	TargetSubID	TSub	S*	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Debe contener el código de la ECC (se seguirá admitiendo el código de Segmento de la ECC con el que se estableció la conexión, Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación")
52	Sending Time	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de envío del mensaje
/MgnReqmtInq/ MgnReqmtInqQual						Tipo de petición (1 time)
→1637	MarginReqmtInqQualifier	Qual	S	0 - Summary	Int	
/MgnReqmtInq/ Pty						(n times)
→448	PartyID	ID	N		String	Si PartyRole[452]= 49, contiene el código del Miembro de 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. Puede contener "-" para solicitar el riesgo de la Cuenta Propia del Miembro.
→447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	
→452	PartyRole	R	N	49 = Collateral Firm	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
				4 = Clearing Firm 101 = Collateral Account		Si PartyRole[452]= 49, contiene el código de Miembro de la Cuenta de Colateral. Cuando está presente, la información se da a nivel de Miembro No Compensador Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador Si PartyRole[452]= 101, contiene el código de la Cuenta de Colateral. Cuando está presente, la información se da a nivel de Cuenta.

10.8.5 Margin Requirement Report (Msg Type = CJ)

Enviado como respuesta a un Margin Requirement Inquiry del Miembro Compensador (Límite de Riesgo Intradía y Riesgo por Cuenta) y por la ECC (no solicitada por el Miembro, Garantías Extraordinarias por Margin Call)

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
Margin Requirement Report/ MgnReqmtRpt						
1642	MarginReqmtRptID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Margin Requirement Report de una sesión
1635	MarginReqmtInqID	ID	N		String	Identificador de la solicitud enviado por el cliente Presente cuando la solicitud es un mensaje Margin Requirement Inquiry
1638	MarginReqmtRptType	RptTyp	S	0 - Summary	String	Tipo de informe suministrado
15	Currency	Ccy	N		Currency	Código de divisa en la que están expresados los importes de este mensaje. Expresada según estándar ISO 4217
/MgnReqmtRpt/ Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	CJ	String	Identifica el tipo de mensaje

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
49	SenderCompID	SID	S	BMCL	String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Identificador(es) de la(s) entidad(es) a la(s) que va destinado el mensaje Los códigos de entidad van separados por comas (,)
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC
52	Sending Time	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de envío del mensaje
/MgnReqmtRpt/ Pty						(n times)
→ 448	PartyID	ID	N		String	Si PartyRole[452]= 49, contiene el código del Miembro de 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. Contiene "-" para la Cuenta Propia del Miembro.
→ 447	PartySource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
→ 452	PartyRole	R	N	4 = Clearing Firm 101 = Collateral Account	Int	Si PartyRole[452]= 49, contiene el código de Miembro de la Cuenta de Colateral. Cuando está presente, la información se da a nivel de Miembro No Compensador Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador Si PartyRole[452]= 101, contiene el código de la Cuenta de Colateral. Cuando está presente, la

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
						información se da a nivel de Cuenta.
	/MgnReqmtRpt/ MgnAmt					Importes de Riesgo o Garantía Exigida (a nivel de Compensador y Cuenta) (n times)
→1645	MarginAmt	Amt	N		Amt	Importe de Riesgo o Garantía Exigida Tipo de Garantía: 105 – Consumo de Límite de Riesgo Intradía 106 - Garantías Extraordinarias por Margin Call 201 - Riesgo por Cuenta 202 – Garantía exigida por Cuenta
→1644	MarginAmtType	Typ	N	105 106 201 202	Int	
→1715*	MarginAmountMarketID	MktID	N	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC
	/MgnReqmtRpt/ RiskLmtTyp*					Límite Riesgo por Compensador o Garantía Depositada por Cuenta (n times) 105 = Límite de Riesgo Intradía asignado 202 – Garantía depositada por Cuenta
→1530*	RiskLimitType	Typ	N	105 202	String	
→1531*	RiskLimitAmount	Amt	N		Amt	
→1715*	MarginAmountMarketID	MktID	N	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC

10.8.6 Collateral Report (Msg Type = BA)

Enviado por ECC para informar del detalle de las Garantías Depositadas.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
Collateral Report/ CollRpt						
908	CollRptID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Collateral Report de una sesión
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
/CollRpt/ Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	BA	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S	BMCL	String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Identificador(es) de la(s) entidad(es) a la(s) que va destinado el mensaje Los códigos de entidad van separados por comas (,)
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC
52	Sending Time	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de envío del mensaje (n times)
/CollRpt/ Pty						
→ 448	PartyID	ID	N		String	Si PartyRole[452]= 49, indica el código de Miembro al que pertenece la Cuenta de Colateral Si PartyRole[452]= 4, indica el código del Miembro Compensador de la ECC Si PartyRole[452]= 101, indica el código de la Cuenta
→ 447	PartySource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
→ 452	PartyRole	R	N	49 = Collateral Firm 4 = Clearing Firm 101 = Collateral Account	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID Si PartyRole[452]= 49, indica el código de Miembro al que pertenece la Cuenta de Colateral. Si PartyRole[452]=4, indica el código de Miembro Compensador Si PartyRole[452]= 101, indica el código de la Cuenta de Colateral. Collateral Report a nivel de Miembro Compensador: sólo se informará del Clearing Firm, PartyRole[452]=4. Collateral Report a nivel de Miembro al que pertenece la Cuenta de Colateral: se informará del Collateral Firm, PartyRole[452] = 49, y del Clearing Firm, PartyRole[452] = 4. Collateral Report a nivel de Cuenta de Colateral: se informará del Collateral Firm, PartyRole[452] = 49, del Clearing Firm, PartyRole[452] = 4 y del Collateral Account, PartyRole[452] = 101.
/CollRpt/ Instrmt						
55	Symbol	Sym	N	[N/A] o código del activo entregado	String(5)	
48	SecurityID	ID	N		String(12)	Código ISIN
22	SecurityDSrc	Src	N	4 = ISIN number	String	
543	InstrRegistry	Rgstry	N	Ver Tabla 13, para colateral en valores, o Tabla 18, para efectivo	String	Código del Depositario Central del activo en el que está constituida la Garantía o del Banco en el que está depositado el efectivo.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
				del documento "Tablas de Codificación".		
/CollRpt/ Instrmt/ Evnt						(n times)
→865	EventTy pe	EventTyp	N	204 = Nominal		
→868	EventTex t	Txt	N		String	Valor nominal del activo entregado. En caso de acciones es el número de títulos
/CollRpt/ Stip						(n times)
→233	Stipulati onType	Typ	N	MARGIN_INST ASSET_TYPE HAIRCUT ASSET_PRICE ASSET_VALU E NOMINAL_C URRENCY EXCHANGE_R ATE	String	
						Si StipulationType [233] = MARGIN_INST indica el modo de materialización de Garantías. Ver Tabla 12 del documento "Tablas de Codificación"
						Si StipulationType [233] = ASSET_TYPE indica el tipo de activo entregado. Ver Tabla 14 del documento "Tablas de Codificación"
→ 234	Stipulati onValue	Val	N		String	Si StipulationType [233] = HAIRCUT indica el coeficiente que se aplica al precio en la valoración del activo (en tanto por ciento)
						Si StipulationType [233] = ASSET_PRICE indica el precio del activo al cierre. Para los bonos y obligaciones incluye cupón corrido

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
						<p>Si StipulationType [233] = ASSET_VALUE indica el valor del activo: (Nominal * precio * haircut) / Tipo de cambio.</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. Retención / Liberación de Valores

11.1 Introducción

Antes de incorporar las ventas al proceso de liquidación, la Entidad Participante podrá retener aquellas ventas para las que no haya valores disponibles para entregar, e ir las liberando a medida que se disponga de los Valores.

Sólo se podrá retener el saldo neto vendedor de una Cuenta en neto o todas las operaciones de venta de las Cuentas en bruto.

La petición de Retención / Liberación de Valores la realiza la Entidad Participante (PartyRole [452] = 90 SettlementFirm).

La Retención / Liberación de valores se realiza a nivel de Operación.

Este capítulo sólo aplica al segmento de Renta Variable.

11.2 Retención / Liberación de valores

La Retención / Liberación de valores por Operación se efectúa a través del mensaje Allocation Instructions con AllocTransType [71] = 0 (New), AllocType [626] = 17, TradeID [1003] = Número de Operación a retener / liberar, StipulationType [233] = RL y StipulationValue [234] = RO (Retención de Operación) o StipulationValue [234] = LO (Liberación de Operación).

Si hay errores, el interfaz informa de los mismos, al usuario que la realizó, mediante el mensaje Business Message Reject.

Finalmente, el sistema central informa con un mensaje Allocation Report con AllocStatus [87] = 9 (Claimed).

Cuando la Retención / Liberación es aceptada en su totalidad, se genera un mensaje Trade Capture Report de actualización de la operación.

En caso de Liberación automática de valores, la ECC genera un mensaje Trade Capture Report de actualización de la operación.

11.3 Información por Miembro Negociador y/o Compensador y/o Entidad Participante

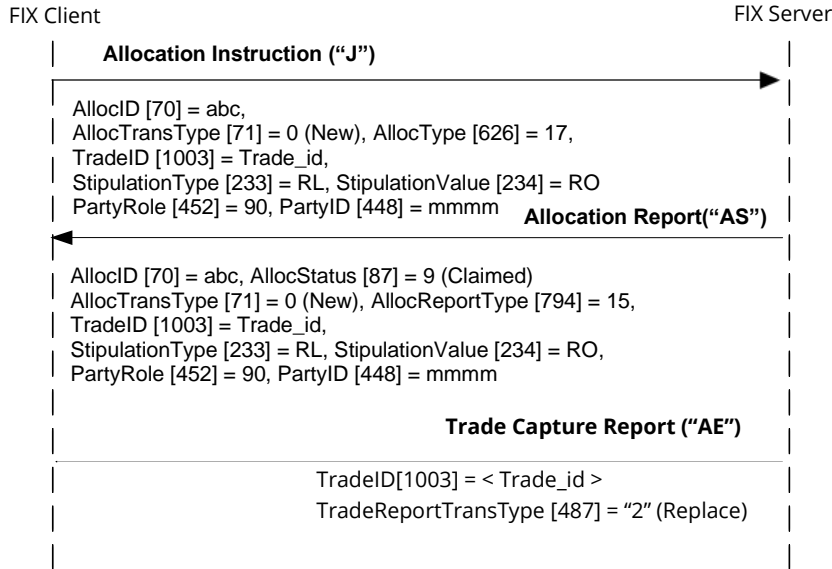
La información se envía a las entidades recogidas en el bloque Parties, concretamente en las definidas por PartyRole 4 (Clearing Firm: Miembro Compensador), PartyRole 1 (Executing Firm: Miembro Negociador) y PartyRole 90 (SettlementFirm: Entidad Participante).

11.4 Lista de mensajes

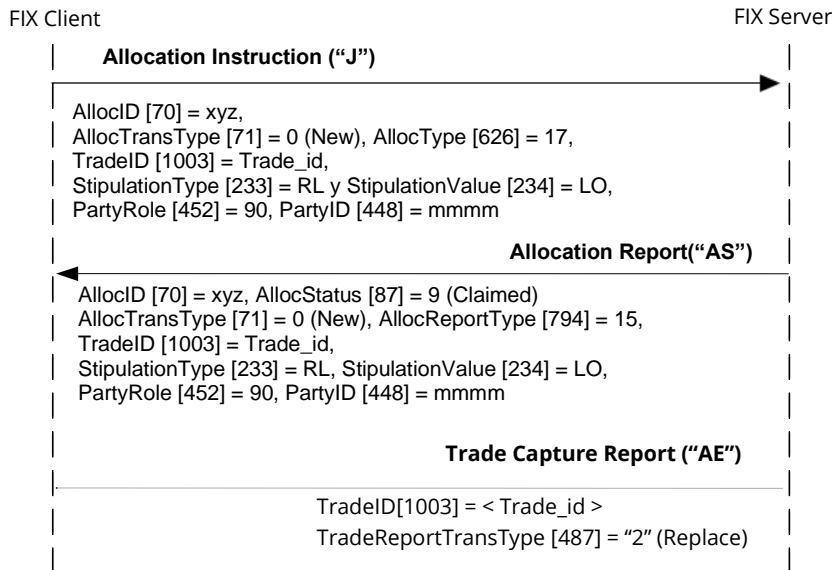
Mensaje	Descripción
Allocation Instruction (Msg Type = J)	Enviado por el cliente para informar de la Retención / Liberación de Valores
Allocation Report (Msg Type = AS)	Informe del estado de la Retención / Liberación de Valores

11.5 Flujo de mensajes

Retención de valores correcta

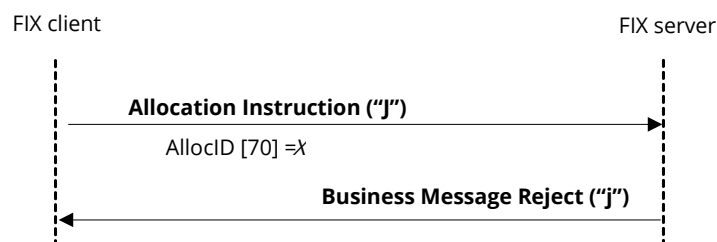


Liberación de valores correcta



Retención / Liberación de valores rechazada

El cliente envía la solicitud mediante un mensaje Allocation Instruction. El mensaje es rechazado con un mensaje Business Message Reject.



11.6 Definición de mensajes

11.6.1 Allocation Instruction (Msg Type = J)

Mensaje enviado por el cliente para solicitar la Retención o Liberación parcial o total de una Operación.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
Allocation Instruction/ AllocInstrctn						
70	AllocID	ID	S		String(10)	Identificador único para cada mensaje Allocation Instruction
71	AllocTransType	TransTyp	S	0 = New	Char	
626	AllocationType	Typ	S	17 = Retener o liberar una Operación	Int	Ver StipulationType [233] = RL
54	Side	Side	S	2 = Sell	Char	La Operación a retener siempre es vendedora
53	Quantity	Qty	S		Qty	Ignorado por el interfaz
75	TradeDate	TrdDt	S		LocalMktDate	Ignorado por el interfaz
/AllocInstrctn/ Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	J	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje
56	TargetCompID	TID	S	BMCL	String	Identificador de la entidad a la que va destinado el mensaje Debe contener "BMCL"
115	OnBehalfOfCompID	OBID	N		String	Código de la entidad en nombre de la cual se envía el mensaje. Si se omite se asume que es el SenderCompID
50	SenderSubID	SSub	S*		String	Debe contener el código de usuario con el que se inició la sesión FIX

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
57	TargetSubID	TSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Debe contener el código de Segmento de la ECC con el que se estableció la conexión
52	Sending Time	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de envío del mensaje
/AllocInstrctn/ AllExc						(1 time)
→ 1003	TradeID	TrdID	N		String	Identificador de registro de la ECC de la Operación a Retener o Liberar De uso obligado para la funcionalidad de Retención y Liberación
/AllocInstrctn/ Instrmt						
55	Symbol	Sym	N	[N/A]	String	
/AllocInstrctn/ Stip						(1 time)
→ 233	StipulationType	Typ	N	RL = Retención / Liberación de valores	String	De uso obligado para la funcionalidad de Retención y Liberación
→ 234	StipulationValue	Val	N		String	Los valores posibles son: RO = Retención Operación LO = Liberación Operación De uso obligado para la funcionalidad de Retención y Liberación
/AllocInstrctn/ Alloc						(1 time)
→ 80	AllocQty	Qty	N		Qty	Número de valores a retener / liberar De uso obligado para la funcionalidad de Retención y Liberación

11.6.2 Allocation Report (Msg Type = AS)

Mensaje usado para notificar el resultado de una Retención o Liberación de Valores.

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
Allocation Report/ AllocRpt						
755	AllocReportID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Allocation Report de una sesión

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
70	AllocID	ID	N		String	Identificador del mensaje Allocation Instruction relacionado
71	AllocTransType	TransTyp	S	0 = New	Char	
793	SecondaryAllocID	ID2	N		String	Identificador único del Traspaso asignado por la Cámara
794	AllocReportType	RptTyp	S	15 = Retener o liberar una Operación	Int	Ver StipulationType [233] = RL
87	AllocStatus	Stat	S	9 = Claimed	Int	Para más información, ver "11.5 - Flujo de mensajes"
54	Side	Side	S	2 = Sell	Char	La Operación a retener siempre es vendedora
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 Teórica de Liquidación
381	GrossTradeAmt	GrossTrdAmt	N		Amt	Importe Efectivo de la Retención/Liberación
/AllocRpt/ Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	AS	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S	BMCL	String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Identificador(es) de la(s) entidad(es) a la(s) que va destinado el mensaje Los códigos de entidad van separados por comas (,)

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código asignado al Segmento de la ECC con el que se estableció la conexión
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de envío del mensaje
/AllocRpt/ AllExc						(1 time)
→32	LastQty	LastQty	N		Qty	Volumen de la Operación
→31	LastPx	LastPx	N		Price	Precio de la Operación
→1003	TradeID	TrdID	N		String	Identificador de registro de la ECC de la Operación a retener/liberar
/AllocRpt/ Instrmt						
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	
/AllocRpt/ Pty						(n times)
→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]=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
→ 447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	
→ 452	PartyRole	R	N	1 = Executing Firm 4 = Clearing Firm 38 = Position Account 90 = Settlement Firm 91 = Settlement account	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
/AllocRpt/ Stip						(1 time)
→ 233	StipulationType	Typ	N	RL = Retención / Liberación de valores	String	
→ 234	StipulationValue	Val	N		String	Los valores posibles son: • RO = Retención Operación • LO = Liberación Operación
/AllocRpt/ Alloc						(1 time)
→ 80	AllocQty	Qty	N		Qty	Número de valores Retenidos / Liberados

12. Compensación e Instrucciones de Liquidación

12.1 Introducción

La ECC deberá generar las correspondientes Instrucciones de Liquidación de forma previa al ciclo nocturno o en cada Ventana de Agregación que establezca.

12.2 Compensación y generación de Instrucciones de Liquidación

Antes del primer ciclo de liquidación la ECC convertirá las Operaciones registradas en Instrucciones de Liquidación:

- En Cuentas brutas, agregará el saldo comprador por un lado y el saldo vendedor por otro, generando dos Instrucciones de Liquidación.
- En Cuentas netas calculará el saldo neto, generando una única Instrucción de Liquidación.
- Descontará el volumen retenido de las Operaciones, a la espera de su Liberación.

Por otro lado, antes del 2º y posteriores Ventanas de Agregación, la ECC realizará el mismo proceso partiendo de las operaciones que hayan sido liberadas desde la ventana anterior:

La agregación en Cuentas brutas o neteo en Cuentas netas se realizará teniendo en cuenta las operaciones de compraventa de la misma Cuenta de Posición, Valor, Fecha de Contratación y Fecha de Liquidación.

12.3 Información por Miembro Negociador y/o Compensador y/o Entidad Participante

La información se envía a las entidades recogidas en el bloque Parties, concretamente en las definidas por PartyRole 4 (Clearing Firm: Miembro Compensador), PartyRole 1 (Executing Firm: Miembro Negociador) y PartyRole 90 (SettlementFirm: Entidad Participante).

El funcionamiento es diferente en función del ciclo de liquidación:

- A final de una sesión D, para el 1er ciclo de D+1, la ECC enviará los siguientes mensajes:
 - Un mensaje de aviso (News) indicando el inicio del proceso de compensación (neteo o agregación, según el tipo de cuenta) correspondiente al 1er ciclo de liquidación de D+1.
 - Los mensajes relacionados con aquellas operaciones pendientes con fecha teórica de liquidación D+1 a consecuencia de dicho proceso. Es decir:
 - Los mensajes de operación (Trade Capture Report) correspondientes a las instrucciones generadas, que se enviarán a liquidar en el 1er ciclo de D+1.
 - Los mensajes de operación (Trade Capture Report) de cierre de las operaciones que queden retenidas parcialmente.
 - Los mensajes de operación (Trade Capture Report) correspondientes a las operaciones que queden retenidas total o parcialmente, a la espera de ser liberadas en D+1. En cuentas netas, el volumen retenido total de todas ellas será como máximo el saldo neto vendedor.

Las operaciones originales con fecha teórica de liquidación D+1 tenidas en cuenta en el

proceso de compensación quedan sustituidas por las informadas en este bloque. No se generan mensajes Trade Capture Report de actualización de las operaciones que hayan quedado totalmente incluidas en las instrucciones creadas al final de la sesión D.

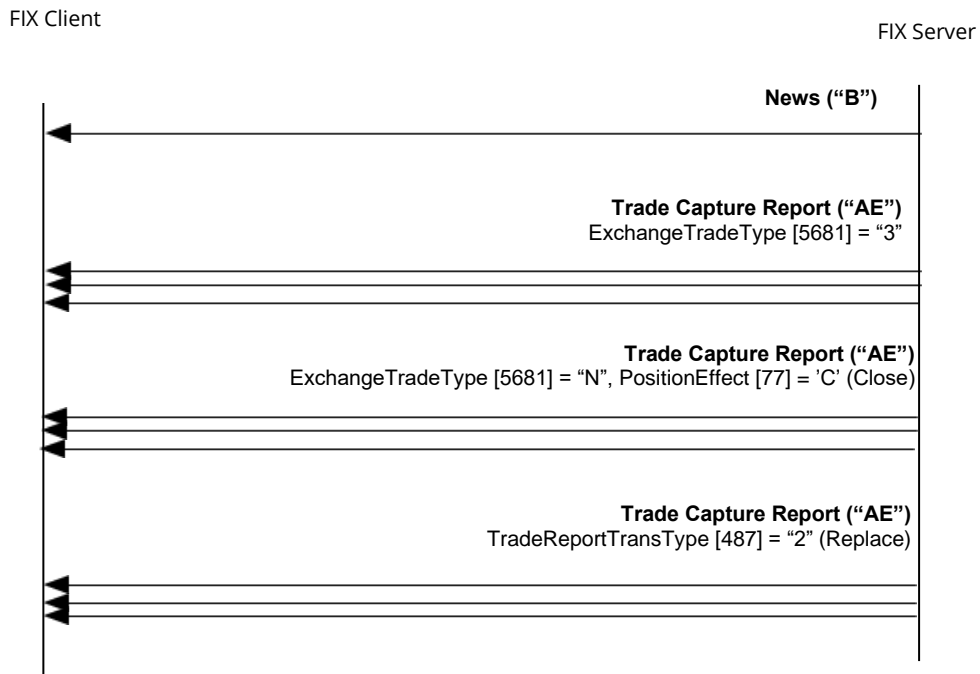
- Un mensaje de aviso (News) indicando el final del proceso de compensación (neteo o agregación, según el tipo de cuenta) correspondiente al 1er ciclo de liquidación de D+1.
- Durante la sesión D+1, para el 2º y posteriores Ventanas de Agregación de D+1, la ECC enviará los siguientes mensajes:
 - Un mensaje de aviso (News) indicando el inicio del proceso de compensación (neteo o agregación, según el tipo de cuenta) correspondiente a cada ciclo de liquidación de D+1.
 - Los mensajes de operación (Trade Capture Report) correspondientes a las nuevas instrucciones de liquidación generadas, que se enviarán a liquidar inmediatamente.
 - Los mensajes de operación (Trade Capture Report) correspondientes al cierre de las operaciones que han sido liberadas total o parcialmente desde la ventana anterior.
 - Los mensajes de operación (Trade Capture Report) correspondientes a la actualización del volumen y efectivo vivo de las operaciones que han sido liberadas total o parcialmente.
 - Un mensaje de aviso (News) indicando el final del proceso de compensación (neteo o agregación, según el tipo de cuenta) correspondiente a cada Ventana de Agregación de D+1.

12.4 Lista de mensajes

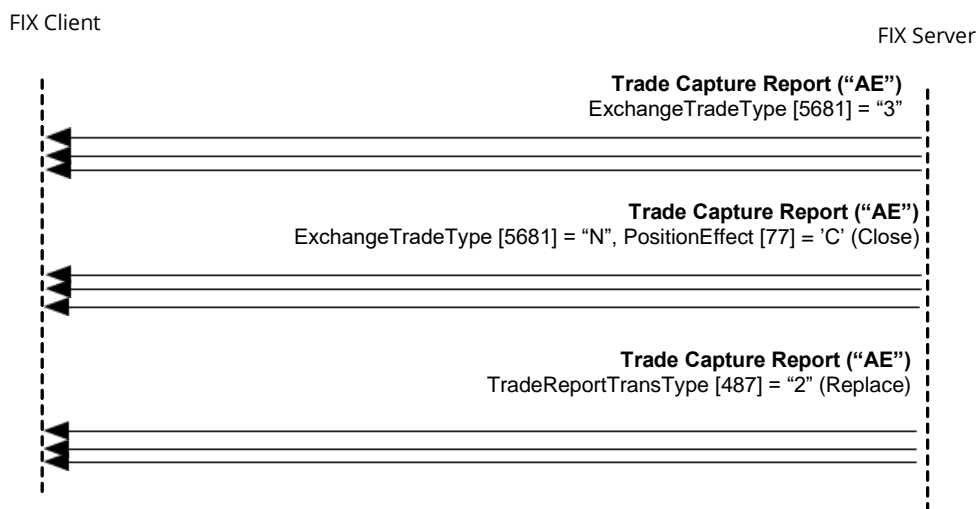
Mensaje	Descripción
Trade Capture Report (Msg Type = AE)	Información de las Operaciones de conversión de Operaciones en Instrucciones de Liquidación
News (Msg Type = B)	Aviso de inicio del proceso del proceso de compensación correspondiente al 1er ciclo de liquidación de D+1

12.5 Flujo de mensajes

Neteo en Cuentas Netas y Agregación en Cuentas Brutas y Generación de Instrucciones de Liquidación (1er ciclo)



Neteo en Cuentas Netas y Agregación en Cuentas Brutas y Generación de Instrucciones de Liquidación (2º ciclo y posteriores)



13. Liquidaciones y fallidos

13.1 Introducción

Durante la sesión de liquidación, la ECC informará de las Instrucciones liquidadas en el DCV. Para las Instrucciones no liquidadas, se intentará su liquidación en los días siguientes hasta la fecha en que se inicie el procedimiento de Recompra.

13.2 Liquidación de Instrucciones

Durante la sesión de liquidación, la ECC enviará la información de las Instrucciones que hayan sido liquidadas en el DCV:

- La ECC generará Operaciones referenciadas a las Instrucciones liquidadas, de modo que el saldo vivo para el cálculo de Garantías disminuya.
- Además, la ECC generará mensajes de Trade Capture Report para la actualización de las Instrucciones liquidadas.

13.3 Procedimiento de Recompra (Buy-in)

La gestión de recompras se realizará siguiendo el procedimiento indicado en las Circulares emitidas por BME Clearing que correspondan a esta temática.

La ECC generará mensajes de Trade Capture Report para la actualización de las Instrucciones liquidadas.

13.4 Liquidación en Efectivo

Si no es posible realizar la Recompra, se realizará una Liquidación en efectivo por importe de una compensación al comprador que no recibió.

- Se enviarán Instrucciones de efectivo al comprador y vendedor afectados.
- Además, la ECC generará mensajes de Trade Capture Report para la actualización de las Instrucciones liquidadas.

13.5 Información por Miembro Negociador y/o Compensador y/o Entidad Participante

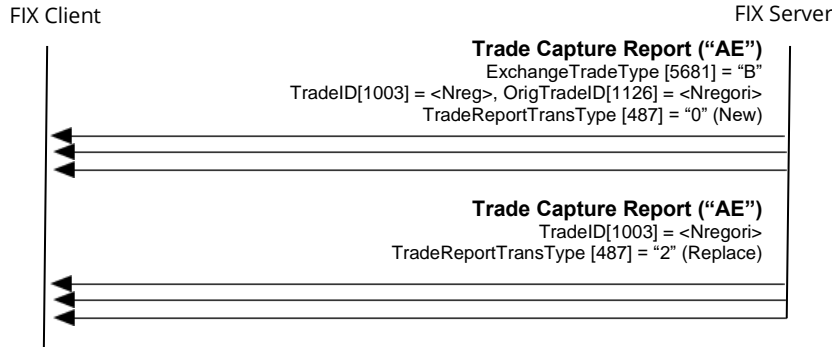
La información se envía a las entidades recogidas en el bloque Parties, concretamente en las definidas por PartyRole 4 (Clearing Firm: Miembro Compensador), PartyRole 1 (Executing Firm: Miembro Negociador) y PartyRole 90 (SettlementFirm: Entidad Participante).

13.6 Lista de mensajes

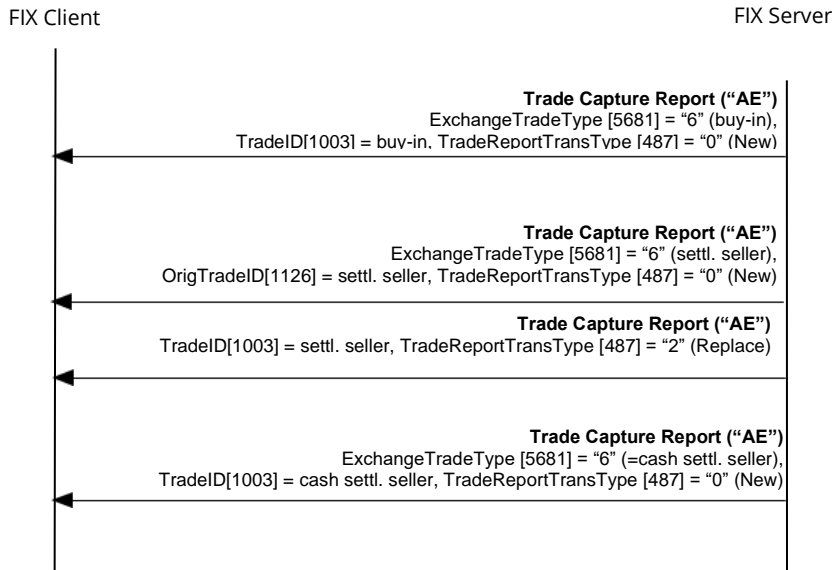
Mensaje	Descripción
Trade Capture Report (Msg Type = AE)	Información de las Operaciones de liquidación de Instrucciones, Recompra y Liquidación en efectivo

13.7 Flujo de mensajes

Liquidación de Instrucciones



Recompra

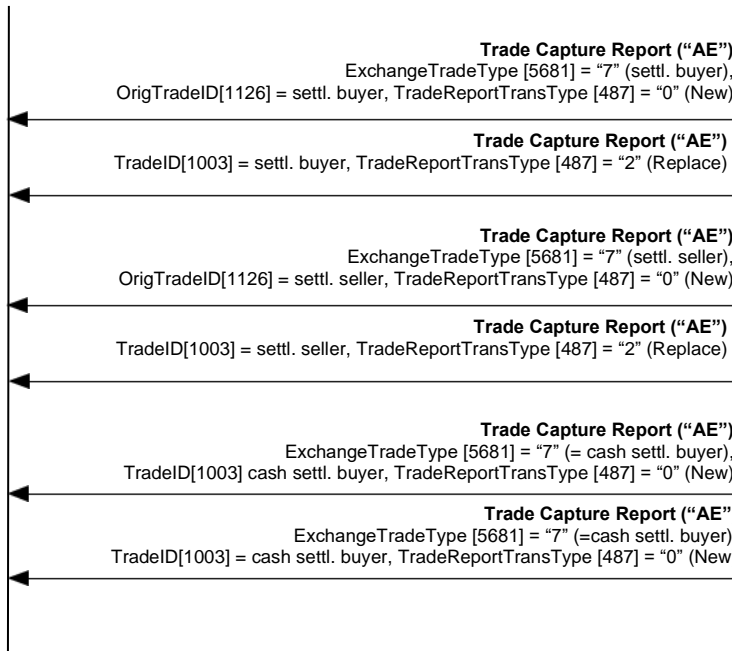


Además, se recibirán los mensajes Trade Capture Report correspondientes a la liquidación de las instrucciones de recompra, liquidación de efectivo y compra afectada (ExchangeTradeType [5681] = 'B') y a la actualización de dichas instrucciones (TradeReportTransType [487] = "2").

Liquidación en efectivo

FIX Client

FIX Server



Además, se recibirán los mensajes Trade Capture Report correspondientes a la liquidación de las instrucciones de liquidación de efectivo (ExchangeTradeType [5681] = 'B') y a la actualización de dichas instrucciones (TradeReportTransType [487] = "2").

14. Eventos Corporativos

14.1 Introducción

Los Eventos Corporativos sólo afectarán a Instrucciones fallidas y Operaciones Retenidas. La ECC informará a las aplicaciones cliente de las Instrucciones de Liquidación generadas como consecuencia de un Evento. La ECC informará de las Instrucciones que a su vez le son enviadas por el DCV.

14.2 Información de Eventos Corporativos

En función del tipo de Evento, los Ajustes generados por Instrucciones fallidas y Opeaciones retenidas serán diferentes:

- Para Eventos de distribución (Market Claims) se generarán nuevas Instrucciones.
- Para Eventos de reorganización (Transformations) se cancelarán las Instrucciones fallidas pendientes y se generarán nuevas.

14.3 Información por Miembro Negociador y/o Compensador y/o Entidad Participante

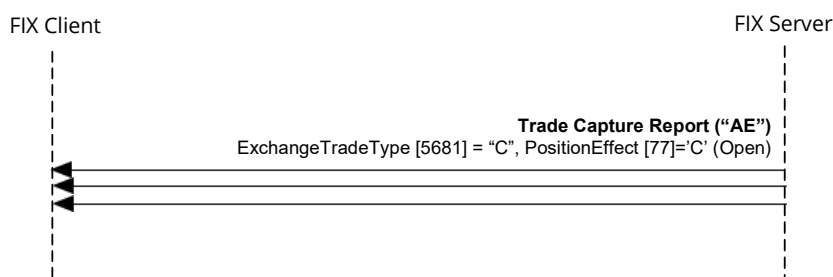
La información se envía a las entidades recogidas en el bloque Parties, concretamente en las definidas por PartyRole 4 (Clearing Firm: Miembro Compensador), PartyRole 1 (Executing Firm: Miembro Negociador) y PartyRole 90 (SettlementFirm: Entidad Participante).

14.4 Lista de mensajes

Mensaje	Descripción
Trade Capture Report (Msg Type = AE)	Información de las Instrucciones de Liquidación creadas como consecuencia de un Evento Corporativo

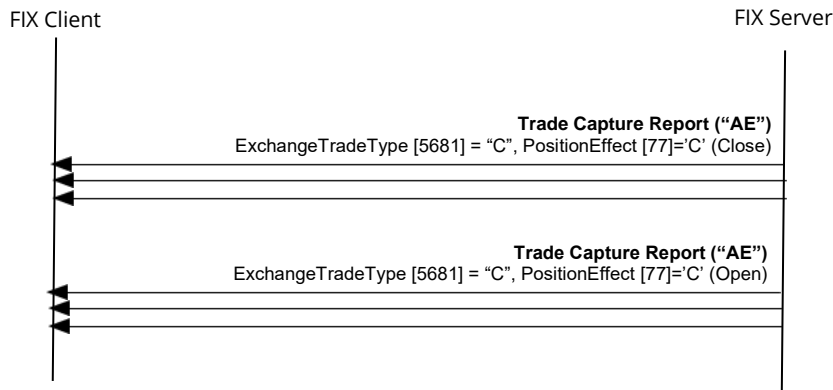
14.5 Flujo de mensajes

Evento Corporativo de Distribución (Market Claim)



Además, se recibirán los mensajes Trade Capture Report correspondientes a la liquidación de las nuevas instrucciones de ajuste (ExchangeTradeType [5681] = 'B') y a la actualización de las mismas (TradeReportTransType [487] = "2").

Evento Corporativo de Reorganización (Transformation)



Además, se recibirán los mensajes Trade Capture Report correspondientes a la liquidación de las nuevas instrucciones de ajuste (ExchangeTradeType [5681] = 'B') y a la actualización de las mismas (TradeReportTransType [487] = "2").

Apéndice A 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



Plaza de la Lealtad,1
Palacio de la Bolsa
28014 Madrid
www.bolsasymercados.es

