



Segmento de IRS

Ficheros de Datos – Nivel segmento

Formato: CSV-20 de Junio de 2019



BME X

a SIX company

Índice

| | | |
|----------|---|-----------|
| 1 | INTRODUCCIÓN | 6 |
| 1.1 | ALCANCE | 6 |
| 1.2 | ESTRUCTURA DEL DOCUMENTO | 6 |
| 1.3 | CONVENCIONES UTILIZADAS EN ESTE DOCUMENTO | 6 |
| 1.4 | FUTURAS VERSIONES DE ESTE DOCUMENTO | 8 |
| 2 | DESCRIPCIÓN GENERAL DE FICHEROS A GENERAR..... | 9 |
| 2.1 | OPERACIONES. | 9 |
| 2.2 | POSICIÓN ABIERTA. | 9 |
| 2.3 | DATOS GENERALES. | 11 |
| 2.4 | GARANTIAS | 13 |
| 2.5 | SUBASTAS | 15 |
| 3 | DETALLE DE FICHEROS..... | 18 |
| 3.1 | FICHEROS DE OPERACIONES | 18 |
| 3.2 | FICHEROS DE POSICION ABIERTA | 21 |
| 3.3 | FICHEROS DE DATOS GENERALES | 50 |
| 3.4 | FICHEROS DE GARANTIAS | 65 |
| 3.5 | FICHEROS DE SUBASTAS | 78 |
| 4 | CODIFICACION DE CONTRATOS | 83 |

Historia de Revisiones

| Date | Versión | Descripción | Autor |
|------------|---------|---|-----------------------|
| 16/01/2015 | 1.0 | Versión Inicial. | Desarrollo de Negocio |
| 24/03/2015 | 1.1 | Actualización de Ficheros y campos. | Desarrollo de Negocio |
| 15/06/2015 | 1.2 | Actualización de Ficheros y campos. | Desarrollo de Negocio |
| 05/10/2015 | 1.3 | Actualización de Ficheros y campos. | Desarrollo de Negocio |
| 26/01/2016 | 1.4 | Actualización de Ficheros y campos. | Desarrollo de Negocio |
| 06/05/2016 | 1.5 | Actualización de campos en el fichero COPINIRS. | Desarrollo de Negocio |
| 01/11/2016 | 1.6 | Actualización de campos en el fichero COPINIRS, COPINFRA, CCOUPONS. | Desarrollo de Negocio |
| 29/06/2018 | 2.0 | Actualización de campos por nueva estructura de cuentas e incorporación del entorno multdivisa. | Desarrollo de Negocio |
| 20/06/2019 | 2.1 | Incorporación de campos por entorno multdivisa | Desarrollo de Negocio |

Modificaciones hechas en la última revisión

Principales cambios respecto a la documentación v2.0 publicada el 29 de junio de 2019:

Se incluyen nuevos campos como prelación para un entorno multdivisa. No obstante lo anterior, no se permite el registro de operaciones en divisas diferentes del EUR.

Detalle de los cambios por fichero:

● CBACKLOADING

- En el apartado **3 PRODUCTO** se incluye el campo 3.11 Settlement Currency
- Se incluye el apartado **4 GRUPO DE COMPENSACION** y el campo 4.1 SwapClearingGroup.

● CTRADES

- En el apartado **3 PRODUCTO** se incluye el campo 3.11 Settlement Currency
- Se incluye el apartado **4 GRUPO DE COMPENSACION** y el campo 4.1 SwapClearingGroup.

● COPINIRSFRA

- En el apartado **3 PRODUCTO** se incluye el campo 3.11 Settlement Currency
- Se incluye el apartado **4 GRUPO DE COMPENSACION** y el campo 4.1 SwapClearingGroup.
- Se incluye en el apartado **6 RAMA SWAP 1** los campos: 6.19 Exchange Rate Index 1, 6.20 Exchange Rate Business Centers 1, 6.21 Business Day Convention Exchange Rate Fixing Date 1, 6.22 Exchange Rate Fixing Lag Period 1 Period, 6.23 Exchange Rate Fixing Lag Period 1 PeriodMultiplier.
- Se incluye en el apartado **7 RAMA SWAP 2** los campos: 7.18 Payment Days Offset 2, 6.19 Exchange Rate Index 2, 7.20 Exchange Rate Business Centers 2, 7.21 Business Day Convention Exchange Rate Fixing Date 2, 7.22 Exchange Rate Fixing Lag Period 2 Period, 7.23 Exchange Rate Fixing Lag Period 2 PeriodMultiplier.
- Se renombran en el apartado **9 NPV** los campos 9.1 de Leg 1 NPV a Leg 1 NPV – Currency 1, , 9.3 de Leg 2 NPV a Leg 2 NPV – Currency 2.
- Se elimina en el apartado **9 NPV** el campo Consideration NPV.
- Se incluye en el apartado **9 NPV** los campos 9.2 Currency 1 Considerations NPV a Leg 1 NPV – Settlement Currency, 9.4 Currency 2 Considerations NPV a Leg 2 NPV – Settlement Currency.

● CCOUPONS

- En el apartado **3 PRODUCTO** se incluye el campo 3.11 Settlement Currency
- Se incluye el apartado **4 GRUPO DE COMPENSACION** y el campo 4.1 SwapClearingGroup.
- Se renombran en el apartado **5 CUPONES** 5.15 Currency a Coupon Currency
- Se incluyen en el apartado **5 CUPONES** 5.28 Coupon Settlement Currency, 5.29 Exchange Rate Fixing Date, 5.30 Exchange Rate Fixed, 5.31 Exchange Rate Value.
- Se renombran en el apartado **7 NPV** 7.2 Coupon NPV a Coupon NPV – Settlement Currency.

- **CCONSIDERATIONS**

- En el apartado **3 PRODUCTO** se incluye el campo 3.11 Settlement Currency.
- Se incluye el apartado **4 GRUPO DE COMPENSACION** y el campo 4.1 SwapClearingGroup.
- Se renombran en el apartado **5 ADDITIONAL PAYMENTS (CONSIDERATIONS)** 5.6 Consideration Currency a Consideration Settlement Currency.
- Se incluyen en el apartado **5 ADDITIONAL PAYMENTS (CONSIDERATIONS)** 5.7 Exchange Rate Fixing Date, 5.8 Exchange Rate Fixed, 5.9 Exchange Rate Value.
- Se renombran en el apartado **6 NPV** 6.2 Consideration NPV a Consideration NPV – Settlement Currency.

- **CGENERICPRODUCTS**

- Se incluye el apartado **2 GENERICOS** el campo 2.5 Settlement Currency, 2.14 Swap Leg 1 Payment Days Offset, 2.15 Swap Leg 1 Exchange Rate Index, 2.16 Swap Leg 1 Exchange Rate Fixing Lag Period, 2.17 Swap Leg 1 Exchange Rate Fixing Lag PeriodMultiplier, 2.25 Swap Leg 2 Payment Days Offset, 2.27 Swap Leg 2 Exchange Rate Index, 2.28 Swap Leg 2 Exchange Rate Fixing Lag Period, 2.29 Swap Leg 2 Exchange Rate Fixing Lag PeriodMultiplier, 2.35 Basis spread leg.

- **CCURVES**

- Añadidos los campos IndexMultiplier e IndexPeriod.

- **CSCENARIOS**

- Campos 4.2 y 4.3 expresados en valores absolutos para que esté en línea con el funcional de riesgos y los valores publicados.

1 INTRODUCCIÓN

1.1 ALCANCE

Este documento tiene como objetivo la descripción funcional de los ficheros de datos que pueden ser obtenidos por los usuarios de la ECC de instrumentos de Derivados de Tipos de Interés, en Intradía (ID), en el proceso de Final de Día (End of Day – EoD) y durante el proceso de Incumplimiento de un Miembro (Subasta) del segmento de IRS

1.2 ESTRUCTURA DEL DOCUMENTO

Este documento se ha diseñado para tener en un único documento que de forma integrada recoja desde el punto de vista funcional y técnico el detalle de los campos referidos a los informes que serán generados por BME CLEARING en cada sesión para el segmento de IRS. Por ello, el documento contiene los siguientes apartados:

- Descripción general de ficheros a generar.
- Detalle de cada uno de los ficheros. Para cada fichero se presenta:
 - Descripción ampliada de los ficheros.
 - Descripción estructurada de los campos de los ficheros, con su descripción en castellano e inglés.
- Estructura de los ficheros desarrollados en CSV del reporte de referencia.
- Ejemplos de ficheros a generar.

1.3 CONVENCIONES UTILIZADAS EN ESTE DOCUMENTO

1.3.1 INFORMACIÓN GENERAL DE CADA FICHERO

Para cada fichero contenido en este documento se presenta una primera tabla como la descrita a continuación. Esta tabla presenta la información genérica del fichero con el siguiente formato:

| | |
|------------------------|-----|
| NOMBRE DEL FICHERO | (1) |
| CÓDIGO DEL FICHERO | (2) |
| DESCRIPCIÓN | (3) |
| GRUPO | (4) |
| DESTINATARIOS | (5) |
| PRIVACIDAD | (6) |
| HORARIO DE PUBLICACIÓN | (7) |

- (1) - Nombre del fichero tal y como es generado.
- (2) - Código del fichero tal y como es generado.
- (3) - Descripción del fichero.
- (4) - Grupo al que pertenece el fichero.

- (5) - Destinatarios del fichero.
- (6) - Informa de si el fichero contiene datos públicos o privados.
- (7) - Informa del momento en el que el fichero está disponible.

1.3.2 FORMATO DE LAS TABLAS DE DEFINICIÓN DE LOS FICHEROS.

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

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

| Columna | Significado |
|------------------------|--|
| # | Orden cronológico de los campos que componen el fichero de referencia. |
| * | Contiene "*" cuando el campo forma parte de la clave del fichero |
| Campo | Descripción del campo definido en el fichero. |
| Tipo | Tipo del campo |
| Valores validos | Valores válidos o rango de valores |
| Descripción | Descripción del campo. |

1.3.3 TIPOS DE DATOS

Esta sección resume los distintos tipos de datos utilizados a lo largo de la descripción de cada uno de los ficheros.

Estos tipos de datos se corresponden con valores ASCII y todos son de longitud variable. Estos son:

- **int:** Secuencia de dígitos sin separadores de miles ni decimales y opcionalmente con signo (caracteres ASCII "-" y "0" - "9". El carácter signo utiliza un byte (es decir, int es "99999" mientras que int negativo es "-99999". Téngase en cuenta que valores int pueden representar cifras que empiecen por ceros (es decir "00023" = "23").
- **float:** Secuencia de dígitos, opcionalmente con coma decimal y signo (caracteres ASCII "-", "0" - "9 y ","); la ausencia de la coma decimal en el valor del campo debe interpretarse como la representación "float" de un valor entero. Todos los campos float tendrán como máximo **quince dígitos significativos (no se tendrán en cuenta ni el signo ni la coma decimal)**. El número de decimales usados será un factor de las necesidades del negocio. Téngase en cuenta que los valores float pueden representar cifras que empiecen por ceros (es decir "00023" = "23") y pueden contener u omitir ceros al final después de la coma decimal (es decir "23,0" = "23,0000" = "23").
 - **Qty:** Campo float capaz de almacenar un número completo (sin decimales) de "contratos".
 - **Price:** Campo float que representa un precio. Téngase en cuenta que el número de decimales puede variar.
 - **Amt:** Campo float que representa un importe. Téngase en cuenta que el número de decimales puede variar.

- **char:** campo de un único carácter. Puede contener cualquier carácter alfanumérico o de puntuación excepto el delimitador. Todos los campos char son sensibles a mayúsculas/minúsculas (es decir, **m** ≠ **M**) y están delimitados por comillas (“”).

- **String:** Cadena de caracteres alfanuméricos. Puede incluir cualquier carácter alfanumérico o de puntuación excepto el delimitador. Todos los campos String son sensibles a mayúsculas/minúsculas (es decir, **ref** ≠ **Ref**) y están delimitados por comillas (“”). La anotación “String(n)” se utiliza para indicar el máximo número de caracteres en el campo String. En algunos casos, “n” implica el número exacto de caracteres y, en este caso se especificará concretamente bajo la columna “Valores válidos”.
 - **Currency:** Campo String que representa una divisa utilizando los valores definidos en la norma ISO 4217 Currency code (3 caracteres).
 - Ver “Tabla 1 – Códigos de divisa” en documento “Tablas de Codificación” o **LocalDate:**
Fecha local en formato AAAAMMDD.
 - Valores válidos: AAAA = 0000-9999, MM = 01-12, DD = 01-31.
 - **LocalTime:** Hora local de generación del fichero en formato HH:MM:SS Valores válidos: HH = 00-23, MM = 00-59, SS = 00-59

1.4 FUTURAS VERSIONES DE ESTE DOCUMENTO

1.4.1 Nuevos ficheros

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

1.4.2 Resaltando cambios

Todos cambio se reflejara sombreado en gris. El texto eliminado en la última revisión se presentará con fuente tachada.

2 DESCRIPCIÓN GENERAL DE FICHEROS A GENERAR

BME CLEARING difundirá la información de la actividad diaria e histórica de sus Miembros Compensadores a través de ficheros propios del segmento de IRS y ficheros generales que consolidan la información de todos los segmentos de la Cámara, que serán generados a lo largo de la sesión Intradía (ID) o una vez finalizada la actividad de la Cámara (EoD) y durante el proceso de Subasta.

A continuación se detallan los grupos de ficheros del segmento de IRS que cada Miembro Compensador tendrá a su disposición en formato CSV.

2.1 OPERACIONES.

En este grupo se informará a nivel de Miembro Compensador y Cuenta de posición el detalle de todas las operaciones enviadas o no a la Cámara, los eventos Post – Registros que se hayan realizado, así como flujos monetarios a intercambiar que sean conocidos a lo largo de la vida de las mismas.

| GRUPO | NOMBRE DEL FICHERO | CÓDIGO DEL FICHERO | DESCRIPCIÓN | HORARIO DE PUBLICACIÓN | FORMATO |
|-------------|------------------------------|--------------------|---|------------------------|------------|
| OPERACIONES | | | Se informa a nivel de Miembro y Cuenta de Posición el Initial Margin y Variation Margin de las operaciones pendientes en backloading. | | |
| | CBACKLOADINGPREVISION | REP-OP-001 | Si el Miembro destinatario del reporte es Compensador, el reporte debe incluir también las operaciones de aquellos otros miembros de la ECC de los que sea compensador. | ID (Bajo demanda) | FpML / CSV |

2.2 POSICIÓN ABIERTA.

En este grupo se informará a nivel de Miembro Compensador y Cuenta de posición el detalle de todas las operaciones Novadas que se encuentren Vivas.

| GRUPO | NOMBRE DEL FICHERO | CÓDIGO DEL FICHERO | DESCRIPCIÓN | HORARIO DE PUBLICACIÓN | FORMATO |
|------------------|--------------------|--------------------|--|------------------------|--|
| | CTRADES | REP-OPIN-001 | Se informa a nivel Miembro y Cuenta de Posición de todas la operaciones –aperturas y cierres de posición en la ECC- de la sesión. También todas aquellas posiciones que permanecen abiertas desde alguna sesión anterior. Este fichero no contiene los detalles económicos de las operaciones. | ID y EoD | FpML / CSV |
| | | | Si el Miembro destinatario del reporte es Compensador, el reporte debe incluir también las operaciones de aquellos otros miembros de la ECC de los que sea compensador. | | |
| POSICIÓN ABIERTA | COPINIRSFRA | REP-OPIN-002 | Se informa a nivel de Miembro y Cuenta el detalle de todas las operaciones vivas de Swaps y FRAs, indicando el estado de la operación y su valoración. | EoD y ID | CSV La información de este fichero CSV, en FpML se proporciona en el fichero CCOUNONS |
| | | | Si el Miembro destinatario del reporte es Compensador, el reporte debe incluir también las operaciones de aquellos otros miembros de la ECC de los que sea compensador. | | |
| | CCOUNONS | REP-OPIN-003 | Se informa a nivel Miembro y Cuenta el detalle por operación del importe de todos | ID y EoD | FpML / CSV El fichero FpML también incorpora la información que |

| GRUPO | NOMBRE DEL FICHERO | CÓDIGO DEL FICHERO | DESCRIPCIÓN | HORARIO DE PUBLICACIÓN | FORMATO |
|-------|------------------------|--------------------|---|------------------------|---|
| | | | <p>los cupones fijados y estimados a cobrar/pagar durante toda la vida de la operación. Este reporte contiene Swaps y FRA's.</p> <p>Si el Miembro destinatario del reporte es Compensador, el reporte debe incluir también las operaciones de aquellos otros miembros de la ECC de los que sea compensador.</p> | | <p>en los ficheros CSV se proporciona en COPINRSFRA y CCONSIDERATIONS.</p> |
| | CCONSIDERATIONS | REP-OPIN-004 | <p>Se informa a nivel Miembro y Cuenta el detalle por operación de todos los flujos, tanto los ya cobrados/pagados como los pendientes de cobrar/pagar en el futuro.</p> <p>Si el Miembro destinatario del reporte es Compensador, el reporte debe incluir también las operaciones de aquellos otros miembros de la ECC de los que sea compensador.</p> | ID y EoD | <p>CSV</p> <p>La información en este fichero CSV, en FpML se proporciona en el fichero CCOUPONS</p> |

2.3 DATOS GENERALES.

En este grupo se informará de los datos que complementan la información de las operaciones y de su comportamiento durante su ciclo de vida.

| GRUPO | NOMBRE DEL FICHERO | CÓDIGO DEL FICHERO | DESCRIPCIÓN | HORARIO DE PUBLICACIÓN | FORMATO |
|-----------------|-------------------------|--------------------|--|------------------------|------------|
| DATOS GENERALES | CFIXING | REP-GENDAT-001 | Se informan los tipos de interés fijados por índice de referencia de los últimos meses, incluido el de la sesión en curso. También los tipos de cambio spot de las divisas distintas a la de liquidación. | EoD y ID | FpML / CSV |
| | CCALENDAR | REP-GENDAT-002 | Se informan de los días no laborables en función del calendario establecido en los criterios de elegibilidad. | EoD | FpML / CSV |
| | CCURVES | REP-GENDAT-003 | Se informan las curvas utilizadas para Zero Rates y Factor de descuento. En el caso de BME Clearing, también de los tipos utilizados en la metodología de construcción de las curvas. | ID y EoD | FpML / CSV |
| | CLIQUIDITYMARGIN | REP-GENDAT-004 | Se informa de la parametrización para el ajuste por tamaño posición. Debe contener tantas parametrizaciones como tipos de genéricos se usen en los cálculos de Liquid Margin y ATP. | EoD | FpML / CSV |
| | CGENERICPRODUCTS | REP-GENDAT-005 | Se informa de los productos genéricos usados para el cálculo del LiquidityMargin. Para cada genérico se identifica el tipo de riesgo para el que debe usarse. | EoD | FpML / CSV |
| | CSCENARIOS | REP-GENDAT-006 | Se informa de todos los escenarios que se utiliza para el cálculo de las garantías, incluyendo la tabla de escenarios no escalada para VaR. | EoD | FpML / CSV |

| GRUPO | NOMBRE DEL FICHERO | CÓDIGO DEL FICHERO | DESCRIPCIÓN | HORARIO DE PUBLICACIÓN | FORMATO |
|-------|--------------------|--------------------|--|------------------------|---------|
| | | | También de todos los escenarios hipotéticos que se utiliza para el cálculo del StressTest, incluyendo la tabla de escenarios no escalada para VaR. | | |

2.4 GARANTIAS

En este grupo se informará de los datos y parámetros utilizados por BME CLEARING para medir el riesgo de actividad para cada Miembro Compensador y Cuenta.

| GRUPO | NOMBRE DEL FICHERO | CÓDIGO DEL FICHERO | DESCRIPCIÓN | HORARIO DE PUBLICACIÓN | FORMATO |
|-----------|--------------------------|--------------------|---|------------------------|------------|
| GARANTÍAS | CMARGINPARAMETERS | REP-MAR-001 | Se informa el modelo de cálculo de garantías. | EoD | FpML / CSV |
| | CSENSITIVITY | REP-MAR-002 | Se informa a nivel de Miembro y Cuenta de Garantías de las sensibilidades a las variaciones del tipo de interés. Si el Miembro destinatario del reporte es Compensador, el reporte debe incluir también las cuentas de aquellos otros miembros de la ECC de los que sea compensador. | EoD | FpML / CSV |
| | CLIQUIDMARGIN | REP-MAR-003 | Se informa a nivel de Miembro y Cuenta de Garantías de las operaciones de cobertura que se han tomado en consideración en el cálculo del IM para obtener el Initial Margin por liquidez. | EoD | FpML / CSV |
| | | | < | | |

| GRUPO | NOMBRE DEL FICHERO | CÓDIGO DEL FICHERO | DESCRIPCIÓN | HORARIO DE PUBLICACIÓN | FORMATO |
|-------|----------------------------|--------------------|---|------------------------|------------|
| | CTOTALINITIALMARGIN | REP-MAR-004 | <p>Se informa a nivel de Miembro y Cuenta de Garantías, el IM Total calculado, Método de cálculo hoy, NPV calculado hoy, VM calculado hoy. IM Total calculado ayer, Método de cálculo ayer., NPV calculado ayer, VM calculado ayer. IM Total calculado ayer.</p> <p>Si el Miembro destinatario del reporte es Compensador, el reporte debe incluir también las cuentas de aquellos otros miembros de la ECC de los que sea compensador.</p> | ID y EoD | FpML / CSV |
| | CSTRESSTESTING | REP-MAR-005 | Se informa a nivel de Miembro Compensador de los resultados de pruebas de resistencia. | EoD | FpML / CSV |
| | CBACKTESTING | REP-MAR-006 | Se informa a nivel de Miembro Compensador y Cuenta los resultados de pruebas retrospectivas. | EoD | FpML |
| | CWORSTSCENARIOS | REP-MAR-007 | Se informa a nivel de Miembro Compensador y Cuenta de los 10 (diez) peores escenarios y sus pérdidas por escenarios. | EoD | FpML |

2.5 SUBASTAS

En este grupo se informará el detalle de los portfolios a subastar referentes al Miembro Incumplidor, así como los datos necesarios para su análisis.

| GRUPO | NOMBRE DEL FICHERO | CÓDIGO DEL FICHERO | DESCRIPCIÓN | HORARIO DE PUBLICACIÓN | FORMATO |
|----------|-----------------------|--------------------|---|------------------------|---------|
| SUBASTAS | CFIXING_AUC | REP-AUC-001 | | ID (Bajo demanda) | |
| | CCALENDAR_AUC | REP-AUC-002 | Set de ficheros para SwaMI Auctions. Sus formatos se ajustan a los homónimos sin la extensión _AUC. Contienen información referida a los portfolios de un Miembro Compensador que ha sido declarado en Default y que van a ser subastados. | ID (Bajo demanda) | |
| | CCURVES_AUC | REP-AUC-003 | | ID (Bajo demanda) | |
| | CLIQUIDITYMARGIN_AUC | REP-AUC-004 | | ID (Bajo demanda) | |
| | CGENERICPRODUCTS_AUC | REP-AUC-005 | | ID (Bajo demanda) | |
| | CSCENARIOS_AUC | REP-AUC-006 | | ID (Bajo demanda) | CSV |
| | COPINIRSFRA_AUC | REP-AUC-007 | | ID (Bajo demanda) | |
| | CCOUPONS_AUC | REP-AUC-008 | | ID (Bajo demanda) | |
| | CCONSIDERATIONS_AUC | REP-AUC-009 | | ID (Bajo demanda) | |
| | CMARGINPARAMETERS_AUC | REP-AUC-010 | | ID (Bajo demanda) | |
| | CLIQUIDMARGIN_AUC | REP-AUC-011 | | ID (Bajo demanda) | |
| | CAUCTION_AUC | REP-AUC-012 | Se informa a nivel Miembro Compensador del detalle de los Portfolios del Miembro Compensador en situación de Incumplimiento por los cuales el primero debe | ID (Bajo demanda) | |

| GRUPO | NOMBRE DEL FICHERO | CÓDIGO DEL FICHERO | DESCRIPCIÓN | HORARIO DE PUBLICACIÓN | FORMATO |
|-------|-------------------------|--------------------|---|------------------------|---------|
| | | | pujar. Tras la resolución de la subasta, el reporte informa también del resultado de la misma. | | |
| | COPINIRSFRA_PAS_AUC | REP-AUC-013 | <p>Su formato se ajusta al de COPINIRSFRA.</p> <p>Se informa a nivel de Miembro Compensador y Cuenta de Posición del detalle de las operaciones de Swaps y FRA's que componen los portfolios referidos en CAUTION_AUC.</p> <p>También se genera tras la resolución de la subasta.</p> | ID (Bajo demanda) | |
| | CCOUPONS_PAS_AUC | REP-AUC-014 | <p>Su formato se ajusta al de CCOUPONS.</p> <p>Se informa a nivel de Miembro Compensador y Cuenta de Posición del detalle de los cupones de las operaciones de Swaps y FRA's que componen los portfolios referidos en CAUTION_AUC.</p> <p>También se genera tras la resolución de la subasta.</p> | ID (Bajo demanda) | |
| | CCONSIDERATIONS_PAS_AUC | REP-AUC-015 | <p>Su formato se ajusta al de CCONSIDERATIONS.</p> <p>Se informa a nivel de Miembro Compensador y Cuenta de Posición del detalle de los pagos adicionales de las operaciones de Swaps y FRA's que componen los portfolios referidos en CAUTION_AUC.</p> | ID (Bajo demanda) | |

| GRUPO | NOMBRE DEL FICHERO | CÓDIGO DEL FICHERO | DESCRIPCIÓN | HORARIO DE PUBLICACIÓN | FORMATO |
|-------|--|--------------------|---|------------------------|---------|
| | | | También se genera tras la resolución de la subasta. | | |
| | *_BIDCSV_* (El nombre del fichero debe contener la cadena de caracteres "_BIDCSV_") | REP-AUC-016 | Fichero de pujas generado por cada participante en una subasta. | ID | |

La generación de estos ficheros seguirán las siguientes reglas:

1. Cuando los ficheros se generan en ID, al nombre del fichero se añadirá la hora en que se generó. Por ejemplo, si el fichero CTRADES del Miembro A720 se generó a las 11:45:30, el nombre del fichero será "CTRADES-11:45:30".
2. Los ficheros en ID se generan:
 - a. Los ficheros CCCURVES y CFIXING en el momento que el Supervisor los aprueba.
 - b. Los ficheros de la familia Operaciones y de la familia de Garantías cuando haya algo que comunicar a dicho Miembro Compensador, siempre que hayan transcurrido al menos diez minutos desde el último envío a este Miembro Compensador.
 - c. El fichero CTOTALINITIALMARGIN cada diez (10) minutos.
 - d. El fichero BACKLOADINGPREVISION se generara bajo demanda del supervisor de BME Clearing.
3. Cuando los ficheros se generan en EOD, llevarán sufijo EOD. Por ejemplo "CTRADES-EOD".
4. Los ficheros de EOD se generan todos en un único paquete, a excepción de:
 - a. CCURVES que se generará cuando el Supervisor haya aprobado las curvas de cálculo EOD.
 - b. CFIXING que se generará cuando el Supervisor haya validado el fixing del EONIA.
5. Los ficheros que utilizaran para los Simulacros de Subasta se generan llevaran sufijo AUC (Auction)

3 DETALLE DE FICHEROS

3.1 FICHEROS DE OPERACIONES

| | |
|------------------------|---|
| NOMBRE DEL FICHERO | CBACKLOADINGPREVISION |
| CÓDIGO DEL FICHERO | REP-OP-001 |
| DESCRIPCIÓN | Se informa a nivel de Miembro y Cuenta de Posición el Initial Margin y Variation Margin de las operaciones pendientes en backloading, Si el Miembro destinatario del reporte es Compensador, el reporte debe incluir también las operaciones de aquellos otros miembros de la ECC de los que sea compensador. |
| GRUPO | OPERACIONES |
| DESTINARIOS | Miembro de la CCP |
| PRIVACIDAD | Contiene datos privados |
| HORARIO DE PUBLICACIÓN | ID (Bajo demanda) |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|---|----------------|----------------------------|--------------------|---|
| 1 | | REPORTE | | | Elementos que componen la cabecera del reporte |
| 1.1 | | exchName | String | | ClearingHouseld, Nombre o código corto de la Cámara |
| 1.2 | | contractGroup | String(2) | | Segmento |
| 1.3 | | rptCod | String | | Código del informe |
| 1.4 | | rptName | String | | Nombre del informe |
| 1.5 | | rptType | Values{Intraday, EndOfDay} | Intraday, EndOfDay | Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión |
| 1.6 | | rptSessionDate | LocalDate | | Fecha de sesión |
| 1.7 | | rptPrntRunDat | LocalDate | | Fecha y Hora de creación del informe |
| 1.8 | | CCPMember | String | | Código del miembro destinatario del reporte. |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|---|---------------------------------------|--|-----------------|---|
| | | | | | Si CCPMember es No Compensador el reporte contiene las operaciones de sus cuentas (propias y de clientes; Member = CCPMember). Si CCPMember es Compensador el reporte contiene, además de las operaciones de sus cuentas, las operaciones de las cuentas de otros miembros de los que es compensador (Member = CCPMember, pero ClearingMember = CCPMember) |
| 2 | | CUENTA POSICIÓN | | | Datos de la cuenta donde se registra la operación |
| 2.1 | | Member | String | | Código del miembro |
| 2.2 | | ClearingMember | String | | Código del miembro compensador |
| 2.3 | | PositionAccount | String(12) | | Código de la Cuenta de Posición en la CCP |
| 2.4 | | LEI | String(20) | | LEI de la entidad a nombre de quien está la cuenta |
| 2.5 | | AccountClass | Value{CP, CI} | | Tipo de cuenta en la que se registran las operaciones, Cuenta propia ("CP") o Cuenta Individual ("CI") |
| 3 | | PRODUCTO | | | Datos principales de la producto |
| 3.1 | | CCP Trade id | String | | Número de identificación de la cámara una vez novada, Código en CTRADES |
| 3.2 | | Approved Trade Source Trade Id | String | | ID de la operación en Bilateral o trade ID de la operación anterior en la plataforma de aceptación, (Initial trade execution ID, spTradeld) |
| 3.3 | | Approved Trade Source Trade Id - BETA | String | | ID en la plataforma de aceptación de la operación novada en la ECC |
| 3.4 | | ContractCode | String | | Codificación de los contratos del segmento IRS en la CCP, (Ver documento Codificación de los contratos de IRS), IRS Segment contracts coding |
| 3.5 | | Currency1 | Currency ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa de la pata1 de la operación |
| 3.6 | | Notional1 | Amt | | Importe notional inicial de la pata1 |
| 3.7 | | Leg_Type1 | Logic | | Indica el tipo de interés aplicado es Fijo= FIX o Flotante=FL |
| 3.8 | | Currency2 | Currency ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa de la pata2 de la operación |
| 3.9 | | Notional2 | Amt | | Importe notional inicial de la pata2 |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción | |
|------|---|---------------------|------------------------------|-------------------------|--|--|
| 3.10 | | Leg_Type2 | Logic | | Indica el tipo de interés aplicado es Fijo= FIX o Flotante=FL | |
| | | | Currency | | | |
| 3.11 | | Settlement Currency | ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa de liquidación de la operación | |
| 3.12 | | Side | char | "1"=Compra "2"=Venta | Signo de la operación: 1=Compra; 2= Venta | |
| 3.13 | | Trade Date | LocalDate | | Fecha de contratación de la operación | |
| 3.14 | | Maturity Date | LocalDate | | Fecha fin de la operación | |
| 4 | | GRUPO COMPENSACION | | | | |
| 4.1 | | SwapClearingGroup | String(12) | | Grupo de compensación | |
| 5 | | BACKLOADING | | | | Previsión de IM y VM para las operaciones backloading pendientes de aceptación |
| 5.1 | | IncrementalRisk IM | Amt | | Importe del incremento del riesgo IM introducido por la operación | |
| 5.2 | | TotalRisk IM | Amt | | Importe total del riesgo IM del portfolio original + Riesgo Incremental | |
| 5.3 | | Collateral | Amt | | Importe del Colateral requerido | |
| 5.4 | | IM | Amt | | Margen inicial del porfolio | |
| 5.5 | | VM | Amt | | Margen de variación del porfolio | |
| 5.6 | | Total IM | Amt | | IM total del porfolio considerando el paquete completo de operaciones de backloading | |
| 5.7 | | Total VM | Amt | | VM total del porfolio considerando el paquete completo de operaciones de backloading | |

3.2 FICHEROS DE POSICION ABIERTA

| | |
|------------------------|---|
| NOMBRE DEL FICHERO | CTRADES |
| CÓDIGO DEL FICHERO | REP-OPIN-001 |
| DESCRIPCIÓN | Se informa a nivel Miembro y Cuenta de Posición de todas la operaciones –aperturas y cierres de posición en la ECC- de la sesión. También todas aquellas posiciones que permanecen abiertas desde alguna sesión anterior. Este fichero no contiene los detalles económicos de las operaciones. Si el Miembro destinatario del reporte es Compensador, el reporte debe incluir también las operaciones de aquellos otros miembros de la ECC de los que sea compensador. |
| GRUPO | POSICIÓN ABIERTA |
| DESTINARIOS | Miembro de la CCP |
| PRIVACIDAD | Contiene datos privados |
| HORARIO DE PUBLICACIÓN | ID y EoD |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|---|----------------|----------------------------|--------------------|---|
| 1 | | REPORTE | | | Elementos que componen la cabecera del reporte |
| 1.1 | | exchName | String | | ClearingHouseId, Nombre o código corto de la Cámara |
| 1.2 | | contractGroup | String(2) | | Segmento |
| 1.3 | | rptCod | String | | Código del informe |
| 1.4 | | rptName | String | | Nombre del informe |
| 1.5 | | rptType | Values{Intraday, EndOfDay} | Intraday, EndOfDay | Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión |
| 1.6 | | rptSessionDate | LocalDate | | Fecha de sesión |
| 1.7 | | rptPrntRunDat | LocalDate | | Fecha y Hora de creación del informe |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|---|---------------------------------------|--|-----------------|--|
| 1.8 | | CCPMember | String | | Código del miembro destinatario del reporte. Si CCPMember es No Compensador el reporte contiene las operaciones de sus cuentas (propias y de clientes; Member = CCPMember). Si CCPMember es Compensador el reporte contiene, además de las operaciones de sus cuentas, las operaciones de las cuentas de otros miembros de los que es compensador (Member != CCPMember, pero ClearingMember = CCPMember) |
| 2 | | CUENTA POSICIÓN | | | Datos de la cuenta donde se registra la operación |
| 2.1 | | Member | String | | Código del miembro |
| 2.2 | | ClearingMember | String | | Código del miembro compensador |
| 2.3 | | PositionAccount | String(12) | | Código de la Cuenta de Posición en la CCP |
| 2.4 | | LEI | String(20) | | LEI de la entidad a nombre de quien está la cuenta |
| 2.5 | | AccountClass | Value{CP, CI} | | Tipo de cuenta en la que se registran las operaciones, Cuenta propia ("CP") o Cuenta Individual ("CI") |
| 3 | | PRODUCTO | | | Datos principales de la producto |
| 3.1 | | CCP Trade Id | String | | Número de identificación de la cámara una vez novada, Código en CTRADES |
| 3.2 | | Approved Trade Source Trade Id | String | | ID de la operación en Bilateral o trade ID de la operación anterior en la plataforma de aceptación, (Initial trade execution ID, spTradeld) |
| 3.3 | | Approved Trade Source Trade Id - BETA | String | | ID en la plataforma de aceptación de la operación novada en la ECC |
| 3.4 | | ContractCode | String | | Codificación de los contratos del segmento IRS en la CCP, (Ver documento Codificación de los contratos de IRS), IRS Segment contracts coding. |
| 3.5 | | Currency1 | Currency ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa de la pata1 de la operación |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------|---|---------------------------|--|-------------------------|--|
| 3.6 | | Notional1 | Amt | | Importe notional inicial de la pata1 |
| 3.7 | | Leg_Type1 | Logic | | Indica el tipo de interés aplicado es Fijo= FIX o Flotante=FL |
| 3.8 | | Currency2 | Currency ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa de la pata2 de la operación |
| 3.9 | | Notional2 | Amt | | Importe notional inicial de la pata2 |
| 3.10 | | Leg_Type2 | Logic | | Indica el tipo de interés aplicado es Fijo= FIX o Flotante=FL |
| 3.11 | | Settlement Currency | Currency ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa de liquidación de la operación |
| 3.12 | | Side | char | "1"=Compra "2"=Venta | Signo de la operación: 1=Compra; 2= Venta |
| 3.13 | | Trade Date | LocalDate | | Fecha de contratación de la operación |
| 3.14 | | Maturity Date | LocalDate | | Fecha fin de la operación |
| 4 | | GRUPO COMPENSACION | | | |
| 4.1 | | SwapClearingGroup | String(12) | | Grupo de compensación |
| 5 | | OPERACIÓN | | | |
| | | | | | Datos principales de la producto |
| | | | | | Tipo de Operación Register Timestamp - Descripción |
| 5.1 | | Reg Timestamp | timestamp | | Backloading B: Fecha y Hora de Registro en Cámara de la novación Registro H: Fecha y Hora de Registro en Cámara de la novación Subasta F: Fecha y Hora de Registro en Cámara de la novación mediante traspaso Vencimiento V: Fecha y Hora en la que se registra el vencimiento. Neteo N: Fecha y Hora en el que se registra el neteo de las operaciones Traspaso Z: Fecha y Hora de Registro en Cámara de la novación mediante traspaso |
| 5.2 | | Previous Trade Id | String | | CCP Trade ID Previo |
| 5.3 | | Initial Trade Id | String | | CCP Trade ID Inicial |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------|---|--------------------------|--------------|--|---|
| 5.4 | | Initial Market Code | String | | Código de mercado inicial |
| 5.5 | | Initial trading datetime | LocalDate | | Fecha y hora de la contratación del trade Inicial |
| 5.6 | | Initial Trade Type | String | | Tipo de trade inicial |
| 5.7 | | Open-Close-Indicator | Values{O, C} | | Indica si la operación abre ("O"=Open) o cierra ("C"=Close) la posición |
| 5.8 | | CCP Grouping Id | String | | Código de grupo |
| 5.9 | | Trade Type | String | | Tipo de Operación definido por la CCP, La codificación de este campo está en el Anexo I de este documento |
| 5.10 | | Rate_leg1 | Decimal | Tipo expresado en tanto por uno: 0.05 equivale a 5% con un máximo de 8 posiciones decimales. | El tipo Fijo o Flotante de la rama/pata 1 |
| 5.11 | | Rate_leg2 | Decimal | Tipo expresado en tanto por uno: 0.05 equivale a 5% con un máximo de 8 | El tipo Fijo o Flotante de la rama/pata 2 |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------|---|--------------------------|--------|-----------------------|---|
| | | | | posiciones decimales. | |
| 5.12 | | UTI | String | | UTI de la operación |
| 5.13 | | Not Transferred Quantity | Amt | | Cantidad no transferida |
| 5.14 | | Netting ID | String | | Identificador de netting generado por la cámara |

| | |
|------------------------|---|
| NOMBRE DEL FICHERO | COPINIRSFRA |
| CÓDIGO DEL FICHERO | REP-OPIN-002 |
| DESCRIPCIÓN | Se informa a nivel de Miembro y Cuenta de Posición el detalle de todas las operaciones vivas de Swaps y FRAs, indicando el estado de la operación y su valoración. Si el Miembro destinatario del reporte es Compensador, el reporte debe incluir también las operaciones de aquellos otros miembros de la ECC de los que sea compensador. |
| GRUPO | POSICIÓN ABIERTA |
| DESTINARIOS | Miembro de la CCP |
| PRIVACIDAD | Contiene datos privados |
| HORARIO DE PUBLICACIÓN | ID y EoD |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|---|----------------|----------------------------|----------------------|---|
| 1 | | REPORTE | | | Elementos que componen la cabecera del reporte |
| 1.1 | | exchName | String | | ClearingHouseld, Nombre o código corto de la Cámara |
| 1.2 | | contractGroup | String(2) | | Segmento |
| 1.3 | | rptCod | String | | Código del informe |
| 1.4 | | rptName | String | | Nombre del informe |
| 1.5 | | rptType | Values{Intraday, EndOfDay} | Intraday EndOfDay | Intraday = Intradía, EndOfDay= Fin de sesión |
| 1.6 | | rptSessionDate | LocalDate | | Fecha de sesión |
| 1.7 | | rptPrntRunDat | LocalDate | | Fecha y Hora de creación del informe |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|---|---------------------------------------|---------------|-----------------|---|
| 1.8 | | CCPMember | String | | Código del miembro destinatario del reporte. Si CCPMember es No Compensador el reporte contiene las operaciones de sus cuentas (propias y de clientes; Member = CCPMember). Si CCPMember es Compensador el reporte contiene, además de las operaciones de sus cuentas, las operaciones de las cuentas de otros miembros de los que es compensador (Member = CCPMember, pero ClearingMember = CCPMember) |
| 2 | | CUENTA POSICIÓN | | | Datos de la cuenta donde se registra la operación |
| 2.1 | | Member | String | | Código del miembro |
| 2.2 | | ClearingMember | String | | Código del miembro compensador |
| 2.3 | | PositionAccount | String(12) | | Código de la Cuenta de Posición en la CCP |
| 2.4 | | LEI | String(20) | | LEI de la entidad a nombre de quien está la cuenta |
| 2.5 | | AccountClass | Value{CP, CI} | | Tipo de cuenta en la que se registran las operaciones, Cuenta propia ("CP") o Cuenta Individual ("CI") |
| 3 | | PRODUCTO | | | Datos principales del producto |
| 3.1 | | CCP Trade id | String | | Número de identificación de la cámara una vez novada, Código en CTRADES |
| 3.2 | | Approved Trade Source Trade Id | String | | ID de la operación en Bilateral o trade ID de la operación anterior en la plataforma de aceptación, (Initial trade execution ID, spTradeId) |
| 3.3 | | Approved Trade Source Trade Id - BETA | String | | ID en la plataforma de aceptación de la operación novada en la ECC |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------|---|---------------------|--|----------------------|---|
| 3.4 | | ContractCode | String | | Codificación de los contratos del segmento IRS en la CCP, (Ver documento Codificación de los contratos de IRS), IRS Segment contracts coding, * Si se trata de un SWAP van en blanco los datos del bloque 7 (DATOS FRA). * Si se trata de un FRA van en blanco los datos de los bloques 5 (RAMA SWAP 1) y 6 (RAMA SWAP 2) |
| 3.5 | | Currency1 | Currency ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa de la pata1 del SWAP Divisa del FRA |
| 3.6 | | Notional1 | Amt | | Importe notional inicial de la pata1 del SWAP Importe notional del FRA |
| 3.7 | | Leg_Type1 | Logic | | Indica el tipo de interés aplicado es Fijo= FIX o Flotante=FL Para FRAs: - Fijo= FIX si Side= 1 (Compra) - Flotante= FL si Side= 2 (Venta) |
| 3.8 | | Currency2 | Currency ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa de la pata2 de la operación. En blanco para FRAs. |
| 3.9 | | Notional2 | Amt | | Importe notional inicial de la pata2. En blanco para FRAs. |
| 3.10 | | Leg_Type2 | Logic | | Indica el tipo de interés aplicado es Fijo= FIX o Flotante=FL. En blanco para FRAs. |
| 3.11 | | Settlement Currency | Currency ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa de liquidación de la operación |
| 3.11 | | Side | char | "1"=Compra "2"=Venta | Signo de la operación: 1=Compra; 2= Venta |
| 3.12 | | Trade Date | LocalDate | | Fecha de contratación de la operación |
| 3.13 | | Maturity Date | LocalDate | | Fecha fin de la operación |
| 4 | | GRUPO COMPENSACION | | | |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|--------------|---|--------------------------------------|------------------|-----------------|---|
| 4.1 | | SwapClearingGroup | String(12) | | Grupo de compensación |
| OPERACIÓN | | | | | |
| IDs Y ESTADO | | | | | |
| 5.1 | | Reg Timestamp | timestamp | | Tipo de Operación Register Timestamp - Descripción Backloading B: Fecha y Hora de Registro en Cámara de la novación. Registro H: Fecha y Hora de Registro en Cámara de la novación Subasta F: Fecha y Hora de Registro en Cámara de la novación mediante traspaso Vencimiento V: Fecha y Hora en la que se registra el vencimiento. Neteo N: Fecha y Hora en el que se registra el neteo de las operaciones Traspaso Z: Fecha y Hora de Registro en Cámara de la novación mediante traspaso |
| 5.2 | | Previous Trade Id | String | | CCP Trade ID Previo |
| 5.3 | | Initial Trade Id | String | | CCP Trade ID Inicial |
| 5.4 | | Initial Market Code | String | | Código de mercado inicial |
| 5.5 | | Initial trading datetime | LocalDate | | Fecha y hora de la contratación del trade Inicial |
| 5.6 | | Initial Trade Type | String | | Tipo de trade inicial |
| 5.7 | | Approved Trade Source Trade Group Id | String | | Id de grupo en la plataforma de aceptación, swGroupId |
| 5.8 | | Approved Trade Source Id | String | | Nombre de la plataforma de aceptación, tengamos en cuenta que en caso de que las operaciones se acepten por Portabilidad o se generen como resultado del proceso de neteo, aquí debe aparecer que provienen de allí, Ejemplo: Neto |
| 5.9 | | CCP Status | Values{Accepted} | | Estado en el que se encuentra la operación, en este caso "NOVATED" |
| 5.10 | | CCP Grouping Id | String | | Código de grupo en CTRADES |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------|---|--|------------------------------------|------------------------------|---|
| 5.11 | | TradeType | String | | Tipo de Operación definido por BME Clearing, La codificación de este campo está en el Anexo I de este documento |
| 5.12 | | open-close indicator | Values{O, C} | | Indica si la operación abre ("O"=Open) o cierra ("C"=Close) la posición |
| 5.13 | | Netting id | String | | Identificador de netting generado por la cámara |
| 5.14 | | User netting id | String | | Identificador de netting aportado por el cliente |
| 5.15 | | Block o Allocation Indicator | String | | Indica si la operación pertenece a un grupo de operación o a Allocation |
| 5.16 | | Block o Allocation Id | String | | Identificador del Bloque o Allocation al que pertenece la operación. |
| 5.17 | | ClientTradeld | String | | Identificación de la operación en los sistemas del cliente |
| 5.18 | | ClearingMemberTradeld | String | | Identificación de la operación en los sistemas del MC |
| 5.19 | | ClearingMember Block | String | | ID de la contrapartida que ejecuta la contratación en bloque |
| 5.20 | | UTI-CCP | String | | UTI generado en el momento de la novación |
| 5.21 | | Prior-UTI | String | | UTI previo a la novación |
| 6 | | RAMA SWAP 1 DATOS BÁSICOS RAMA SWAP 1 | | | |
| 6.1 | | Leg_Side1 | String(1) | "P" -> Pay "R" -> Receive | Indica si la rama es de pago o de cobro. |
| 6.2 | | Effective Date 1 | LocalDate | | Fecha efectiva de la operación en la rama/pata 1 |
| 6.3 | | Maturity Date Leg 1 | LocalDate | | Fecha fin de la operación en la rama/pata 1 |
| 6.4 | | Index 1 | String | | Nombre del índice de tipo de interés subyacente |
| 6.5 | | IndexTenor 1 Period | period: Value{D, W, M, Y} | | Tenor del índice de tipo de interés subyacente |
| 6.6 | | IndexTenor 1 PeriodMultiplier | periodMultiplier: Positive Integer | | Frecuencia del Índice de Referencia |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------|---|--|---|---|---|
| 6.7 | | Rate 1 | Decimal | Tipo expresado en tanto por uno: 0.05 equivale a 5% con un máximo de 8 posiciones decimales. | Tipo de interés aplicado con decimales, si es FIX es el valor del tipo fijo; si es FL: Es el valor del fixing oficial |
| 6.8 | | Spread 1 | Decimal | Tipo expresado en tanto por uno: 0.05 equivale a 5% con un máximo de 8 posiciones decimales. | Spread de la operación |
| 6.9 | | Day Count Fraction 1 | String | "30/360" "30E/360" "30E/360.ISDA" "ACT/360" "ACT/365.FIXED" "ACT/365.ISDA" "ACT/ACT.ICMA" "ACT/ACT.ISDA" "ACT/ACT.ISMA" | Convención que regula el número de días incluidos en el cálculo de los intereses |
| 6.10 | | Business Day Convention Effective Date 1 | String | "FOLLOWING" "MODFOLLOWING" "PRECEDING" "NONE" | Convención de día Hábil de la fecha de inicio de la operación. |
| 6.11 | | Business Centers 1 | String (cadena de string(4) separados por el carácter) | | Centros de negocios a los que pertenece el Trade. Rigen el calendario de pagos de la rama/pata 1. |
| 6.12 | | Roll Convention 1 | String | Valor numérico de un día de mes "EOM" "IMM" "NONE" | Convención de Fecha Fin de periodo que aplica desde el Start date |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------|---|---|--|--|--|
| 6.13 | | Compounding method 1 | String | "Flat" "Straight" blancos | Método de compounding para la pata/rama 1: "Flat", "Straight" o en blanco |
| 6.14 | | Compounding period 1 Period | period: Value{D, W, M, Y} | | Periodo de compounding para la pata/rama 1 |
| 6.15 | | Compounding period 1 PeriodMultiplier | periodMultiplier: Positive Integer | | Periodo de compounding para la pata/rama 1 |
| 6.16 | | Payment Period 1 Period | period: Value{D, W, M, Y} | | Periodo de Pago para la rama/pata 1 |
| 6.17 | | Payment Period 1 PeriodMultiplier | periodMultiplier: Positive Integer | | Periodo de Pago para la rama/pata 1 |
| 6.18 | | Payment Days Offset 1 | Integer | | Offset del pago (payment lag), expresado en días de calendario, respecto de la fecha teórica de pago desajustada. La fecha resultante debe ser ajustada de acuerdo con el centro de negocios de la pata 1. |
| 6.19 | | Exchange Rate Index 1 | String | | Nombre del índice de la tasa de cambio de la divisa de la pata 1 a la divisa de liquidación. Este campo y los siguientes referidos a esta tasa de cambio irán en blanco si ambas divisas son la misma. |
| 6.20 | | Exchange Rate Business Centers 1 | String (cadena de string(4) separados por el carácter) | | Centros de negocios por los que se rige el índice de la tasa de cambio de la pata 1. |
| 6.21 | | Business Day Convention Exchange Rate Fixing Date 1 | String | "FOLLOWING" "MODFOLLOWING" "PRECEDING" "NONE" | Convención de día Hábil para la fecha de fixing de la tasa de cambio en la rama/pata 1 |
| 6.22 | | Exchange Rate Fixing Lag Period 1 Period | period: Value{D, W, M, Y} | | Junto al campo siguiente, offset de fijación de la tasa de cambio respecto de las fechas de pago para la rama/pata 1 |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------------------------------------|---|---|---------------------------|--|---|
| 6.23 | | Exchange Rate Fixing Lag Period 1 PeriodMultiplier | periodMultiplier: Integer | | Junto al campo anterior, offset de fijación de la tasa de cambio respecto de las fechas de pago para la rama/pata 1 |
| STUBS RAMA 1 | | | | | |
| STUB INICIAL RAMA 1 | | | | | |
| 6.24 | | Initial Stub Method 1 | String | "ShortInitial" "LongInitial" blancos | Tipo de stub |
| 6.25 | | Initial Stub First Index 1 | String | | 1er índice de referencia de interpolación |
| 6.26 | | Initial Stub Second Index 1 | String | | 2do índice de referencia de interpolación |
| 6.27 | | First Reg Period Start Date 1 | LocalDate | | Fecha efectiva del primer periodo regular de la pata 1 |
| STUB FINAL RAMA 1 | | | | | |
| 6.28 | | Final Stub Method 1 | String | "ShortFinal" "LongFinal" blancos | Tipo de stub |
| 6.29 | | Final Stub First Index 1 | String | | Primer índice del stub final de la pata 1 |
| 6.30 | | Final Stub Second Index 1 | String | | Segundo índice del stub final de la pata 1 |
| 6.31 | | Last Reg Period End Date 1 | LocalDate | | Fecha efectiva del último periodo regular de la pata 1 |
| FECHAS DESAJUSTADAS RAMA SWAP 1 | | | | | |
| 6.32 | | Unadjusted effective Date 1 | LocalDate | | Fecha desajustada efectiva de la operación en la rama/pata 1 |
| 6.33 | | Unadjusted Maturity Date 1 | LocalDate | | Fecha desajustada de fin de la operación en la rama/pata 1 |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------|---|--|---|--|---|
| 6.34 | | Business Day Convention Maturity Date 1 | String | "FOLLOWING" "MODFOLLOWING" "PRECEDING" "NONE" | Convención de día Hábil para la fecha de Vencimiento de la operación en la rama/pata 1 |
| 6.35 | | Business Day Convention Last Regular Period Date 1 | String | "FOLLOWING" "MODFOLLOWING" "PRECEDING" "NONE" | Convención de día Hábil para las fechas de finales de periodos de cálculo de cupón en la rama/pata 1 |
| 6.36 | | Business Day Convention Payment Date 1 | String | "FOLLOWING" "MODFOLLOWING" "PRECEDING" "NONE" | Convención de día Hábil para las fechas de pago de cupones en la rama/pata 1 |
| 7 | | RAMA SWAP 2 DATOS BÁSICOS RAMA SWAP 2 | | | |
| 7.1 | | Leg_Side2 | String(1) | "P" -> Pay "R" -> Receive | Indica si la rama es de pago o de cobro. |
| 7.2 | | Effective Date 2 | LocalDate | | Fecha efectiva de la operación en la rama/pata 2 |
| 7.3 | | Maturity Date Leg 2 | LocalDate | | Fecha fin de la operación en la rama/pata 2 |
| 7.4 | | Index 2 | String | | Nombre del índice referencia en caso de que el tipo de pata o rama se Flotante=FL Ej: EUR-EURIBOR-3M |
| 7.5 | | IndexTenor 2 Period | period: Value{D, W, M, Y} periodMultiplier: Positive Integer | | Tenor del índice de tipo de interés subyacente |
| 7.6 | | IndexTenor 2 PeriodMultiplier | periodMultiplier: Positive Integer | | Frecuencia del Índice de Referencia |
| 7.7 | | Rate 2 | Decimal | Tipo expresado en tanto por uno: 0.05 equivale a 5% con un máximo de 8 posiciones decimales. | Tipo de interés aplicado con decimales, si es FIX es el valor del tipo fijo; si es FL: Es el valor del fixing oficial |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------|---|--|---|---|---|
| 7.8 | | Spread 2 | Decimal | Tipo expresado en tanto por uno: 0.05 equivale a 5% con un máximo de 8 posiciones decimales. | Spread de la operación |
| 7.9 | | Day Count Fraction 2 | String | "30/360" "30E/360" "30E/360.ISDA" "ACT/360" "ACT/365.FIXED" "ACT/365.ISDA" "ACT/ACT.ICMA" "ACT/ACT.ISDA" "ACT/ACT.ISMA" | Convención que regula el número de días incluidos en el cálculo de los intereses |
| 7.10 | | Business Day Convention Effective Date 2 | String | "FOLLOWING" "MODFOLLOWING" "PRECEDING" "NONE" | Convención de día Hábil de la fecha de inicio de la operación. |
| 7.11 | | Business Centers 2 | String (cadena de string(4) separados por el carácter) | | Centros de negocios a los que pertenece el Trade. Rigen el calendario de pagos de la rama/pata 2. |
| 7.12 | | Roll Convention 2 | String | Valor numérico de un día de mes "EOM" "IMM" "NONE" | Convención de Fecha Fin de periodo que aplica desde el Start date |
| 7.13 | | Compounding method 2 | String | "Flat" "Straight" blancos | Método de compounding para la pata/rama 1: "Flat", "Straight" o en blanco |
| 7.14 | | Compounding period 2 Period | period: Value{D, W, M, Y} | | Periodo de compounding para la pata/rama 2 |



| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|---------------------|---|---|--|--|--|
| 7.15 | | Compounding period 2 PeriodMultiplier | periodMultiplier: Positive Integer | | Periodo de compounding para la pata/rama 2 |
| 7.16 | | Payment Period 2 Period | period: Value{D, W, M, Y} | | Periodo de Pago para la rama/pata 2 |
| 7.17 | | Payment Period 2 PeriodMultiplier | periodMultiplier: Positive Integer | | Periodo de Pago para la rama/pata 2 |
| 7.18 | | Payment Days Offset 2 | Integer | | Offset del pago (payment lag), expresado en días de calendario, respecto de la fecha teórica de pago desajustada. La fecha resultante debe ser ajustada de acuerdo con el centro de negocios de la pata 2. |
| 7.19 | | Exchange Rate Index 2 | String | | Nombre del índice de la tasa de cambio de la divisa de la pata 2 a la divisa de liquidación. Este campo y los siguientes referidos a esta tasa de cambio irán en blanco si ambas divisas son la misma. |
| 7.20 | | Exchange Rate Business Centers 2 | String (cadena de string(4) separados por el carácter) | | Centros de negocios por los que se rige el índice de la tasa de cambio de la pata 2 . . |
| 7.21 | | Business Day Convention Exchange Rate Fixing Date 2 | String | "FOLLOWING" "MODFOLLOWING" "PRECEDING" "NONE" | Convención de día Hábil para la fecha de fixing de la tasa de cambio en la rama/pata 2 |
| 7.22 | | Exchange Rate Fixing Lag Period 2 Period | period: Value{D, W, M, Y} | | Junto al campo siguiente, offset de fijación de la tasa de cambio respecto de las fechas de pago para la rama/pata 2 |
| 7.23 | | Exchange Rate Fixing Lag Period 2 PeriodMultiplier | periodMultiplier: Integer | | Junto al campo anterior, offset de fijación de la tasa de cambio respecto de las fechas de pago para la rama/pata 2 |
| STUBS RAMA 2 | | | | | |
| STUB INICIAL RAMA 2 | | | | | |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|---------------------------------|---|---|-----------|--|--|
| 7.24 | | Initial Stub Method 2 | String | "ShortInitial" "LongInitial" blancos | Tipo de stub |
| 7.25 | | Initial Stub First Index 2 | String | | 1er índice de referencia de interpolación |
| 7.26 | | Initial Stub Second Index 2 | String | | 2do índice de referencia de interpolación |
| 7.27 | | First Reg Period Start Date 2 | LocalDate | | Fecha efectiva del primer periodo regular de la pata 2 |
| STUB FINAL RAMA 2 | | | | | |
| 7.28 | | Final Stub Method 2 | String | "ShortFinal" "LongFinal" blancos | Tipo de stub |
| 7.29 | | Final Stub First Index 2 | String | | Primer índice del stub final de la pata 2 |
| 7.30 | | Final Stub Second Index 2 | String | | Segundo índice del stub final de la pata 2 |
| 7.31 | | Last Reg Period End Date 2 | LocalDate | | Fecha efectiva del último periodo regular de la pata 2 |
| FECHAS DESAJUSTADAS RAMA SWAP 2 | | | | | |
| 7.32 | | Unadjusted effective Date 2 | LocalDate | | Fecha desajustada efectiva de la operación en la rama/pata 2 |
| 7.33 | | Unadjusted Maturity Date 2 | LocalDate | | Fecha desajustada de fin de la operación en la rama/pata 2 |
| 7.34 | | Business Day Convention Maturity Date 2 | String | "FOLLOWING" "MODFOLLOWING" "PRECEDING" "NONE" | Convención de día Hábil para la fecha de Vencimiento de la operación en la rama/pata 2 |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------|---|--|---------------------------------------|--|---|
| 7.35 | | Business Day Convention Last Regular Period Date 2 | String | "FOLLOWING" "MODFOLLOWING" "PRECEDING" "NONE" | Convención de día Hábil para las fechas de finales de periodos de cálculo de cupón en la rama/pata 2. |
| 7.36 | | Business Day Convention Payment Date 2 | String | "FOLLOWING" "MODFOLLOWING" "PRECEDING" "NONE" | Convención de día Hábil para las fechas de pago de cupones en la rama/pata 2. |
| 8 | | DATOS FRA | | | |
| | | DATOS BÁSICOS FRA | | | |
| 8.1 | | FRA Effective Date | LocalDate | | Fecha efectiva de la operación |
| 8.2 | | FRA Index | String | | Nombre del índice de tipo de interés subyacente |
| 8.3 | | FRA IndexTenor Period | period: Value{D, W, M, Y} | | Tenor del índice de tipo de interés subyacente |
| 8.4 | | FRA IndexTenor PeriodMultiplier | periodMultiplier: Positive Integer | | Tenor del índice de tipo de interés subyacente |
| 8.5 | | FRAFixedRate | Decimal | Tipo expresado en tanto por uno: 0.05 equivale a 5% con un máximo de 8 posiciones decimales. | Tipo fijo pactado para la operación |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-------------------------|---|-----------------------------------|---|---|---|
| 8.6 | | FRA Day Count Fraction | String | "30/360" "30E/360" "30E/360.ISDA" "ACT/360" "ACT/365.FIXED" "ACT/365.ISDA" "ACT/ACT.ICMA" "ACT/ACT.ISDA" "ACT/ACT.ISMA" | Convención que regula el número de días incluidos en el cálculo de los intereses |
| 8.7 | | FRA Business Day Convention | String | "FOLLOWING" "MODFOLLOWING" "PRECEDING" "NONE" | Convención de día Hábil de la fecha de inicio de la operación. |
| 8.8 | | FRA Business Centers | String (cadena de string(4) separados por el carácter) | | Centros de negocios a los que pertenece el Trade |
| FECHAS DESAJUSTADAS FRA | | | | | |
| 8.9 | | FRA Unadjusted effective Date | LocalDate | | Fecha desajustada efectiva de la operación |
| 8.10 | | FRA Unadjusted Maturity Date | LocalDate | | Fecha desajustada de fin de la operación |
| 9 | | NPV | | | |
| 9.1 | | Leg 1 NPV - Currency 1 | Amt | | Importe del Net Present Value total de la pata 1 de la operación. La divisa es Currency 1 (campo 3.5) No aplica para FRAs |
| 9.2 | | Leg 1 NPV - Settlement Currency 1 | Amt | | Importe del Net Present Value total de la pata 1 de la operación. La divisa es Settlement Currency (campo 3.12) No aplica para FRAs |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|---|-----------------------------------|------|-----------------|--|
| 9.3 | | Leg 2 NPV - Currency 2 | Amt | | Importe del Net Present Value total de la pata 2 de la operación. La divisa es Currency 2 (campo 3.8) No aplica para FRAs |
| 9.4 | | Leg 2 NPV - Settlement Currency 2 | Amt | | Importe del Net Present Value total de la pata 2 de la operación. La divisa es Settlement Currency (campo 3.12) No aplica para FRAs |
| 9.5 | | Considerations NPV | Amt | | Importe del Net Present Value total de todos los pagos adicionales en divisa de liquidación |
| 9.6 | | Trade NPV | Amt | | Importe del Net Present Value total de la operación en divisa de liquidación |
| 9.7 | | Trade Previous NPV | Amt | | Importe anterior del Net Present Value total por operación en divisa de liquidación |

| | |
|------------------------|--|
| NOMBRE DEL FICHERO | CCOUPONS |
| CÓDIGO DEL FICHERO | REP-OPIN-003 |
| DESCRIPCIÓN | Se informa a nivel Miembro y Cuenta de Posición el detalle por operación del importe de todos los cupones fijados y estimados a cobrar/pagar durante toda la vida de la operación. Este reporte contiene Swaps y FRA's. Si el Miembro destinatario del reporte es Compensador, el reporte debe incluir también las operaciones de aquellos otros miembros de la ECC de los que sea compensador. |
| GRUPO | POSICIÓN ABIERTA |
| DESTINARIOS | Miembro de la CCP |
| PRIVACIDAD | Contiene datos privados |
| HORARIO DE PUBLICACIÓN | ID y EoD |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|---|-----------------|----------------------------|----------------------|---|
| 1 | | REPORTE | | | Elementos que componen la cabecera del reporte |
| 1.1 | | exchName | String | | ClearingHouseId, Nombre o código corto de la Cámara |
| 1.2 | | contractGroup | String(2) | | Segmento |
| 1.3 | | rptCod | String | | Código del informe |
| 1.4 | | rptName | String | | Nombre del informe |
| 1.5 | | rptType | Values{Intraday, EndOfDay} | Intraday EndOfDay | Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión |
| 1.6 | | rptSessionDate | LocalDate | | Fecha de sesión |
| 1.7 | | rptPrntRunDat | LocalDate | | Fecha y Hora de creación del informe |
| 1.8 | | CCPMember | String | | Código del miembro destinatario del reporte. Si CCPMember es No Compensador el reporte contiene las operaciones de sus cuentas (propias y de clientes; Member = CCPMember). Si CCPMember es Compensador el reporte contiene, además de las operaciones de sus cuentas, las operaciones de las cuentas de otros miembros de los que es compensador (Member = CCPMember, pero ClearingMember = CCPMember) |
| 2 | | CUENTA POSICIÓN | | | Datos de la cuenta donde se registra la operación |
| 2.1 | | Member | String | | Código del miembro |
| 2.2 | | ClearingMember | String | | Código del miembro compensador |
| 2.3 | | PositionAccount | String(12) | | Código de la Cuenta de Posición en la CCP |
| 2.4 | | LEI | String(20) | | LEI de la entidad a nombre de quien está la cuenta |
| 2.5 | | AccountClass | Value{CP, CI} | | Tipo de cuenta en la que se registran las operaciones, Cuenta propia ("CP") o Cuenta Individual ("CI") |
| 3 | | PRODUCTO | | | Datos principales de la producto |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------|---|---------------------------------------|--|-------------------------|---|
| 3.1 | | CCP Trade id | String | | Número de identificación de la cámara una vez novada, Código en CTRADES |
| 3.2 | | Approved Trade Source Trade Id | String | | ID de la operación en Bilateral o trade ID de la operación anterior en la plataforma de aceptación, (Initial trade execution ID, spTradeId) |
| 3.3 | | Approved Trade Source Trade Id - BETA | String | | ID en la plataforma de aceptación de la operación novada en la ECC |
| 3.4 | | ContractCode | String | | Codificación de los contratos del segmento IRS en la CCP, (Ver documento Codificación de los contratos de IRS), IRS Segment contracts coding. |
| 3.5 | | Currency1 | Currency ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa de la pata1 de la operación |
| 3.6 | | Notional1 | Amt | | Importe notional inicial de la pata1 |
| 3.7 | | Leg_Type1 | Logic | | Indica el tipo de interés aplicado es Fijo= FIX o Flotante=FL |
| 3.8 | | Currency2 | Currency ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa de la pata2 de la operación |
| 3.9 | | Notional2 | Amt | | Importe notional inicial de la pata2 |
| 3.10 | | Leg_Type2 | Logic | | Indica el tipo de interés aplicado es Fijo= FIX o Flotante=FL |
| 3.11 | | Settlement Currency | Currency ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa de liquidación de la operación |
| 3.12 | | Side | char | "1"=Compra "2"=Venta | Signo de la operación: 1=Compra; 2= Venta |
| 3.13 | | Trade Date | LocalDate | | Fecha de contratación de la operación |
| 3.14 | | Maturity Date | LocalDate | | Fecha de terminación de la operación |
| 4 | | GRUPO COMPENSACION | | | |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------|---|-------------------|---|--|--|
| 4.1 | | SwapClearingGroup | String(12) | | Grupo de compensación |
| 5 | | CUPONES | | | Cupones futuros de la operación |
| 5.1 | | LegType | Logic | | Indica el tipo de interés aplicado es Fijo= FIX o Flotante=FL |
| 5.2 | | Leg_Side | String(1) | "P" -> Pay "R" -> Receive | Indica si la rama a la que pertenece el cupón es de pago o de cobro. |
| 5.3 | | Floating_Index | String | | Si LegType=FL, nombre del índice de tipo de interés subyacente. |
| 5.4 | | Index_A | String | | Para stubs de pata variable, nombre del índice de tipo de interés subyacente con el que se hará la interpolación |
| 5.5 | | Index Tenor_A | period: Value{D, W, M, Y} periodMultiplier: Positive Integer | | Para stubs de pata variable, tenor del índice de tipo de interés subyacente con el que se hará la interpolación |
| 5.6 | | Index_B | String | | Para stubs de pata variable, nombre del índice de tipo de interés subyacente con el que se hará la interpolación |
| 5.7 | | Index Tenor_B | period: Value{D, W, M, Y} periodMultiplier: Positive Integer | | Para stubs de pata variable, tenor del índice de tipo de interés subyacente con el que se hará la interpolación |
| 5.8 | | startDate | LocalDate | | Fecha de inicio del cupón |
| 5.9 | | endDate | LocalDate | | Fecha de fin del cupón |
| 5.10 | | fixingDate | LocalDate | | Fecha fixing del cupón |
| 5.11 | | paymentDate | LocalDate | | Fecha de pago del cupón |
| 5.12 | | Accrual_factor | Decimal | Con un máximo de 9 posiciones decimales. | Número de días del periodo de cálculo del cupón |
| 5.13 | | fixed | String | "S" -> Sí "N" -> No | Si ya está fijado. |
| 5.14 | | Settled | String | Value{Yes, No, OTC} | Si el cupón ha sido ya liquidado. |
| 5.15 | | Coupon Currency | Currency ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa del cupón |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------|---|-------------------------|---|---|---|
| 5.16 | | CouponAmount | Amt | | Importe del Nominal |
| 5.17 | | Notional | Amt | | Importe notional del cupón |
| 5.18 | | spread | Decimal | Tipo expresado en tanto por uno: 0.05 equivale a 5% con un máximo de 8 posiciones decimales. | Spread de la operación |
| 5.19 | | rate | Decimal | Tipo expresado en tanto por uno: 0.05 equivale a 5% con un máximo de 8 posiciones decimales. | Tipo de interés aplicado con decimales, si es FIX es el valor del tipo fijo; si es FL: Es el valor del fixing oficial |
| 5.20 | | Compounding method | String | "Flat" "Straight" blancos | Método de compounding para la pata/rama |
| 5.21 | | Business Day Centers | String (cadena de string(4) separados por el carácter) | | Centros de negocio a los que pertenece el Trade |
| 5.22 | | Business Day Convention | String | "FOLLOWING" "MODFOLLOWING" "PRECEDING" "NONE" | Convención de día Hábil |
| 5.23 | | Day Count Fraction | String | "30/360" "30E/360" "30E/360.ISDA" "ACT/360" "ACT/365.FIXED" "ACT/365.ISDA" "ACT/ACT.ICMA" | Convención que regula el número de días incluidos en el cálculo de los intereses |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------|---|-------------------------------|--|---|---|
| | | | | "ACT/ACT.ISDA" "ACT/ACT.ISMA" | |
| 5.24 | | Discount factor | Decimal | Tipo expresado en tanto por uno: 0.05 equivale a 5%. Con un máximo de 15 posiciones decimales. | Factor de descuento utilizado |
| 5.25 | | Fixing Type | String | | La fijación puede ser: ISDA – Fijación estándar. IRATE – índice inicial especificado. SRATE – índice del stub especificado. NSLAG –lag no estándar. |
| 5.26 | | Flow Type | String | | Tipos de Flujos: "C"-Compuestos, "S"-Standard,"O"-OIS trade, "B"- Stub Period no compuesto y "W"- Stub Period compuesto. |
| 5.27 | | Fixing_multiplier | Decimal | Con un máximo de 15 posiciones decimales. | Indica el multiplicador de fixing de los cupones OIS flotantes. |
| 5.28 | | Coupon Settlement Currency | Currency ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa de liquidación del cupón. Los tres campos a continuación irán en blanco si la divisa del cupón y la de su liquidación son la misma. |
| 5.29 | | Exchange Rate Fixng Date | LocalDate | | Fecha de fixing de la tasa de cambio para el cupón |
| 5.30 | | Exchange Rate Fixed | String | "S" -> Sí "N" -> No | Si la tasa de cambio ya está fijada. |
| 5.31 | | Exchange Rate Value | Decimal | Rate expressed in parts per one: 0.05 equals 5%. With a maximum of 5 decimal places. | Valor de la tasa de cambio aplicada. |
| 6 | | FECHAS DESAJUSTADAS | | | |
| 6.1 | | Unadjusted startDate | LocalDate | | Fecha de Inicio del periodo desajustada |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|---|----------------------------------|-----------|-----------------|--|
| 6.2 | | Unadjusted endDate | LocalDate | | Fecha Fin del periodo desajustada |
| 7 | | NPV | | | |
| 7.1 | | Coupon NPV - Currency | Amt | | Importe del Net Present Value del cupón en la divisa del cupón |
| 7.2 | | Coupon NPV - Settlement Currency | Amt | | Importe del Net Present Value del cupón. En la divisa de liquidación del cupón. |
| 7.3 | | Coupon Previous NPV | Amt | | Importe anterior del Net Present Value cupón en la divisa de liquidación del cupón |

| | |
|------------------------|--|
| NOMBRE DEL FICHERO | CCONSIDERATIONS |
| CÓDIGO DEL FICHERO | REP-OPIN-004 |
| DESCRIPCIÓN | Se informa a nivel Miembro y Cuenta de Posición el detalle por operación de todos los flujos, tanto los ya cobrados/pagados como los pendientes de cobrar/pagar en el futuro. Si el Miembro destinatario del reporte es Compensador, el reporte debe incluir también las operaciones de aquellos otros miembros de la ECC de los que sea compensador. |
| GRUPO | POSICIÓN ABIERTA |
| DESTINARIOS | Miembro de la CCP |
| PRIVACIDAD | Contiene datos privados |
| HORARIO DE PUBLICACIÓN | ID y EoD |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|---|---------------|-----------|-----------------|---|
| 1 | | REPORTE | | | Elementos que componen la cabecera del reporte |
| 1.1 | | exchName | String | | ClearingHouseId, Nombre o código corto de la Cámara |
| 1.2 | | contractGroup | String(2) | | Segmento |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|---|---------------------------------------|----------------------------|----------------------|---|
| 1.3 | | rptCod | String | | Código del informe |
| 1.4 | | rptName | String | | Nombre del informe |
| 1.5 | | rptType | Values{Intraday, EndOfDay} | Intraday EndOfDay | Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión |
| 1.6 | | rptSessionDate | LocalDate | | Fecha de sesión |
| 1.7 | | rptPrntRunDat | LocalDate | | Fecha y Hora de creación del informe |
| 1.8 | | CCPMember | String | | Código del miembro destinatario del reporte. Si CCPMember es No Compensador el reporte contiene las operaciones de sus cuentas (propias y de clientes; Member = CCPMember). Si CCPMember es Compensador el reporte contiene, además de las operaciones de sus cuentas, las operaciones de las cuentas de otros miembros de los que es compensador (Member = CCPMember, pero ClearingMember = CCPMember) |
| 2 | | CUENTA POSICIÓN | | | Datos de la cuenta donde se registra la operación |
| 2.1 | | Member | String | | Código del miembro |
| 2.2 | | ClearingMember | String | | Código del miembro compensador |
| 2.3 | | PositionAccount | String(12) | | Código de la Cuenta de Posición en la CCP |
| 2.4 | | LEI | String(20) | | LEI de la entidad a nombre de quien está la cuenta |
| 2.5 | | AccountClass | Value{CP, CI} | | Tipo de cuenta en la que se registran las operaciones, Cuenta propia ("CP") o Cuenta Individual ("CI") |
| 3 | | PRODUCTO | | | Datos principales de la producto |
| 3.1 | | CCP Trade id | String | | Número de identificación de la cámara una vez novada, Código en CTRADES |
| 3.2 | | Approved Trade Source Trade Id | String | | ID de la operación en Bilateral o trade ID de la operación anterior en la plataforma de aceptación, (Initial trade execution ID, spTradeld) |
| 3.3 | | Approved Trade Source Trade Id - BETA | String | | ID en la plataforma de aceptación de la operación novada en la ECC |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------|---|---------------------------------------|--|-------------------------|---|
| 3.4 | | ContractCode | String | | Codificación de los contratos del segmento IRS en la CCP, (Ver documento Codificación de los contratos de IRS), IRS Segment contracts coding. |
| 3.5 | | Currency1 | Currency ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa de la pata1 de la operación |
| 3.6 | | Notional1 | Amt | | Importe notional inicial de la pata1 |
| 3.7 | | Leg_Type1 | Logic | | Indica el tipo de interés aplicado es Fijo= FIX o Flotante=FL |
| 3.8 | | Currency2 | Currency ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa de la pata2 de la operación |
| 3.9 | | Notional2 | Amt | | Importe notional inicial de la pata2 |
| 3.10 | | Leg_Type2 | Logic | | Indica el tipo de interés aplicado es Fijo= FIX o Flotante=FL |
| 3.11 | | Settlement Currency | Currency ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa de liquidación de la operación |
| 3.12 | | Side | char | "1"=Compra "2"=Venta | Signo de la operación: 1=Compra; 2= Venta |
| 3.13 | | Trade Date | LocalDate | | Fecha de contratación de la operación |
| 3.14 | | Maturity Date | LocalDate | | Fecha de terminación de la operación |
| 4 | | GRUPO COMPENSACION | | | |
| 4.1 | | SwapClearingGroup | String(12) | | Grupo de compensación |
| 5 | | ADDITIONAL PAYMENTS (CONSIDERATIONS). | | | Datos de los pagos adicionales Hasta 6 posibles pagos |
| 5.1 | | Amount | Amt | | Pagos adicionales futuros a pagar durante la vida de la operación |
| 5.2 | | ConsiderationDate | LocalDate | | Fecha de pago de los flujo adicionales |
| 5.3 | | CCP Status (Consideration Status) | String | Value{Yes, No, OTC} | Estado en el que se encuentra el consideration (S-Liquidado, N-No liquidado, OTC-Liquidado en bilateral) |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|---|-----------------------------------|--|--|--|
| 5.4 | | Consideration Currency | Currency ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa del Consideration |
| | | | Decimal | Tipo expresado en tanto por uno: 0.05 equivale a 5%. | Factor de descuento utilizado |
| 5.5 | | Discount factor | | Con un máximo de 15 posiciones decimales. | |
| 5.6 | | Consideration Settlement Currency | Currency ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa de liquidación del consideration. Los tres campos a continuación irán en blanco si la divisa del consideration y la de su liquidación son la misma. |
| 5.7 | | Exchange Rate Fixng Date | LocalDate | | Fecha de fixing de la tasa de cambio para el consideration |
| 5.8 | | Exchange Rate Fixed | String | "S" -> Sí "N" -> No | Si la tasa de cambio ya está fijada. |
| 5.9 | | Exchange Rate Value | Decimal | Rate expressed in parts per one: 0.05 equals 5%. With a maximum of 5 decimal places. | Valor de la tasa de cambio aplicada. |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|--------------|---|-------------------------------------|------|-----------------|--|
| 6 NPV | | | | | |
| 6.1 | | Consideration - NPV Currency | Amt | | NPV del Consideration |
| 6.2 | | Coupon NPV - Settlement Currency | Amt | | Importe del NPV Consideration. En la divisa de liquidación del cupón. |
| 6.3 | | Consideration Previous NPV | Amt | | Valor neto presente anterior del consideration en la divisa de liquidacion del Consideration |

3.3 FICHEROS DE DATOS GENERALES

| | |
|------------------------|--|
| NOMBRE DEL FICHERO | CFIXING |
| CÓDIGO DEL FICHERO | REP-GENDAT-001 |
| DESCRIPCIÓN | Se informan los tipos de interés fijados por índice de referencia de los últimos meses, incluido el de la sesión en curso. También los tipos de cambio spot de las divisas distintas a la de liquidación. |
| GRUPO | DATOS GENERALES |
| DESTINARIOS | Todos los usuarios del segmento ECC |
| PRIVACIDAD | Contiene datos públicos |
| HORARIO DE PUBLICACIÓN | ID y EoD |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|---|---------------------|--|----------------------|--|
| 1 | | REPORTE | | | Elementos que componen la cabecera del reporte |
| 1.1 | | exchName | String | | ClearingHoused, Nombre o código corto de la Cámara |
| 1.2 | | contractGroup | String | | Segmento |
| 1.3 | | rptCod | String | | Código del informe |
| 1.4 | | rptName | String | | Nombre del informe |
| 1.5 | | rptType | Values{Intraday, EndOfDay} | Intraday EndOfDay | Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión |
| 1.6 | | rptSessionDate | YYYY-MM-DD | | Fecha de Sesión de los datos del informe |
| 1.7 | | rptPrntRunDat | YYYY-MM-DDTHH:MM:SS | | Fecha y Hora de creación del informe |
| 2 | | DATOS COMUNES | | | |
| 2.1 | | Rate type | String | "IRT" "XRT" | Si "IRT" los campos de la sección 4 irán en blanco Si "XRT" los campos de la sección 3 irán en blanco |
| 2.2 | | Fixing Capture Time | YYYY-MM-DDTHH:MM:SS | | Momento de captura del dato en formato dd/mm/yyyy hh:mm:ss |
| 2.3 | | Encrypted | Values{0,1} | | Indicador de encriptación de fixing (0=No encriptado 1= Encriptado) |
| 2.4 | | Source | String | | Descripción de la fuente de publicación, Ej: RIC Reuters, InfoValmer |
| 3 | | TIPO INTERÉS | | | Índice de referencia |
| 3.1 | | Index name | String | | Nombre del índice de referencia. Ej: EUR-EURIBOR-REUTERS |
| 3.2 | | Index currency | Currency ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa del índice |
| 3.3 | | Index calendar | String | | Código del centro financiero según estándar SWIFT. Ej: EUTA, COBO |
| 3.4 | | Index ID | String | | Identificador de índice en el resto de reportes |
| 3.5 | | Tenor period | period: Value{D, W, M, Y} | | |
| 3.6 | | Tenor multiplier | periodMultiplier: Positive Integer | | |
| 3.7 | | Tenor symbol | String | | Ej: O/N, 1M,... |
| 3.8 | | Maturity Date | YYYY-MM-DD | | Fecha de vencimiento |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|---|---------------|---------|---|---|
| 3.9 | | InterestRate | Decimal | Tipo expresado en tanto por uno: 0.05 equivale a 5%. Con un máximo de 8 posiciones decimales. | Valor del tipo de referencia publicado en la fecha de publicación |
| 4 | | TIPO CAMBIO | | | Indice de referencia |
| 4.1 | | Currency pair | String | "Currency1/Currency 2" siendo codigos de divisa ISO (3 dígitos) | Currency1/Currency2 |
| 4.2 | | ExchangeRate | Decimal | Tipo expresado en tanto por uno: 0.05 equivale a 5%. Con un máximo de 8 posiciones decimales.. | Valor del tipo de referencia. Valor en Currency2 de una unidad de Currency1. Multiplicado por un importe en Currency 1 proporciona el importe en Currency 2. |

| | |
|------------------------|---|
| NOMBRE DEL FICHERO | CCALENDAR |
| CÓDIGO DEL FICHERO | REP-GENDAT-002 |
| DESCRIPCIÓN | Se informan de los días no laborables en función del calendario establecido en los criterios de elegibilidad. |
| GRUPO | DATOS GENERALES |
| DESTINARIOS | Todos los usuarios del segmento ECC |
| PRIVACIDAD | Contiene datos públicos |
| HORARIO DE PUBLICACIÓN | EoD |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|---|-----------------------------|----------------------------|----------------------|---|
| 1 | | REPORTE | | | Elementos que componen la cabecera del reporte |
| 1.1 | | exchName | String | | ClearingHouseld, Nombre o código corto de la Cámara |
| 1.2 | | contractGroup | String(2) | | Segmento |
| 1.3 | | rptCod | String | | Código del informe |
| 1.4 | | rptName | String | | Nombre del informe |
| 1.5 | | rptType | Values{Intraday, EndOfDay} | Intraday EndOfDay | Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión |
| 1.6 | | rptSessionDate | YYYY-MM-DD | | Fecha de Sesión de los datos del informe |
| 1.7 | | rptPrntRunDat | YYYY-MM-DDTHH:MM:SS | | Fecha y Hora de creación del informe |
| 2 | | HOLIDAY | | | Día no laborable |
| 2.1 | | Business Center | | | Código del centro financiero según estándar SWIFT. Ej: EUTA |
| 2.2 | | Business Center Description | | | Nombre del centro financiero |
| 2.3 | | Holiday Date | | | Fecha no laborable |
| 2.4 | | Description | | | Descripción del día |
| 2.5 | | Holiday Date Source | | | Proveedor |

| | |
|------------------------|--|
| NOMBRE DEL FICHERO | CCURVES |
| CÓDIGO DEL FICHERO | REP-GENDAT-003 |
| DESCRIPCIÓN | Se informan las curvas utilizadas para Zero Rates y Factor de descuento. En el caso de BME Clearing, también de los tipos utilizados en la metodología de construcción de las curvas. |
| GRUPO | DATOS GENERALES |
| DESTINARIOS | Todos los usuarios del segmento ECC |
| PRIVACIDAD | Contiene datos públicos |
| HORARIO DE PUBLICACIÓN | ID y EoD |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|---|------------------|------------------------------------|----------------------|---|
| 1 | | REPORTE | | | Elementos que componen la cabecera del reporte |
| 1.1 | | exchName | String | | ClearingHouseId, Nombre o código corto de la Cámara |
| 1.2 | | contractGroup | String(2) | | Segmento |
| 1.3 | | rptCod | String | | Código del informe |
| 1.4 | | rptName | String | | Nombre del informe |
| 1.5 | | rptType | Values{Intraday, EndOfDay} | Intraday EndOfDay | Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión |
| 1.6 | | rptSessionDate | YYYY-MM-DD | | Fecha de Sesión de los datos del informe |
| 1.7 | | rptPrntRunDat | YYYY-MM-DDTHH:MM:SS | | Fecha y Hora de creación del informe |
| 2 | | CURVAS | | | Información de la curvas utilizadas |
| 2.1 | | Curve Name | String | | Nombre de la curva |
| 2.2 | | Index ID | String | | Identificador del índice de referencia de la curva. El especificado en CFIXING. |
| 2.3 | | Index Multiplier | periodMultiplier: Positive Integer | | Tenor de la curva. Los overnight no tendrán tenor. |
| 2.4 | | Index Period | period: Value{D, W, M, Y, T} | | Tenor de la curva. Los overnight no tendrán tenor. |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------|---|--------------------------------------|---|-----------------|---|
| 2.4 | | Index currency | Currency ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa del índice |
| 2.5 | | Index calendar | String | | Código del centro financiero según estándar SWIFT. Ej: EUTA, COBO |
| 2.6 | | Curve Capture Time | YYYY-MM-DDTHH:MM:SS | | Fecha de captura de la curva en formato dd/mm/yyyy hh:mm:ss |
| 2.7 | | Curve Close Date | YYYY-MM-DD | | Fecha de cierre de la curva |
| 2.8 | | KnotPoint Period | period: Value{D, W, M, Y} | | |
| 2.9 | | KnotPoint Multiplier | periodMultiplier: Positive Integer | | |
| 2.10 | | KnotPoint Symbol | String | | Ej: O/N, 1M,... |
| 2.11 | | KnotPoint Effective Date | YYYY-MM-DD | | Fecha efectiva del KnotPoint |
| 2.12 | | KnotPoint Maturity Date | YYYY-MM-DD | | Fecha de vencimiento del KnotPoint |
| 2.13 | | KnotPoint Maturity Offset Period | period: Value{D} | | Offset en días del KnotPoint |
| 2.14 | | KnotPoint Maturity Offset Multiplier | periodMultiplier: Positive Integer | | Offset en días del KnotPoint |
| 2.15 | | Accrual Curve value | Tipo expresado en tanto por uno: 0.05 equivale a 5% con un máximo de 15 posiciones decimales. | | Valor de la curva "Accrual" |
| 2.16 | | Zero Rate Curve value | Tipo expresado en tanto por uno: 0.05 equivale a 5% con un máximo de 15 posiciones decimales. | | Valor de la curva "Zero Rate" |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------|---|----------------------|---|-----------------|---------------------------------|
| 2.17 | | Discount Curve value | Tipo expresado en tanto por uno: 0.05 equivale a 5% con un máximo de 15 posiciones decimales. | | Valor de la curva de "Discount" |

| | |
|------------------------|---|
| NOMBRE DEL FICHERO | CLIQDITYMARGIN |
| CÓDIGO DEL FICHERO | REP-GENDAT-004 |
| DESCRIPCIÓN | Se informa de la parametrización para el ajuste por tamaño posición. Debe contener tantas parametrizaciones como tipos de genéricos se usen en los cálculos de Liquid Margin y ATP. |
| GRUPO | DATOS GENERALES |
| DESTINARIOS | Todos los usuarios del segmento de la ECC |
| PRIVACIDAD | Contiene datos públicos |
| HORARIO DE PUBLICACIÓN | EoD |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|---|------------------|----------------------------|----------------------|---|
| 1 | | REPORTE | | | Elementos que componen la cabecera del reporte |
| 1.1 | | exchName | String | | ClearingHouseId, Nombre o código corto de la Cámara |
| 1.2 | | contractGroup | String(2) | | Segmento |
| 1.3 | | rptCod | String | | Código del informe |
| 1.4 | | rptName | String | | Nombre del informe |
| 1.5 | | rptType | Values{Intraday, EndOfDay} | Intraday EndOfDay | Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión |
| 1.6 | | rptSessionDate | YYYY-MM-DD | | Fecha de sesión |
| 1.7 | | rptPrntRunDat | YYYY-MM-DDTHH:MM:SS | | Fecha y Hora de creación del informe |
| 2 | | LIQUIDITY MARGIN | | | Capacidad del mercado y sobrecoste de iliquidez |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|---|---------------------|------------------------------------|--|---|
| 2.1 | | Currency pair | String | "Currency1/Currency2" Donde las monedas son códigos ISO (3 dígitos) | Identifica la pareja de divisas de los genéricos a los que aplica la parametrización. Son iguales en el caso monodivisa. Este campo junto con el siguiente, identifican una parametrización de ATP. |
| 2.2 | | Product Type | String | "SWAP" "FWNDF" | Determina el tipo de producto de los genéricos a los que aplica la parametrización. Si es FWNDF la parametrización aplica a genéricos que sean Forward NDF Currency1/Currency2 Este campo junto con el anterior identifican una parametrización de ATP. |
| 2.3 | | Bucket period | period: Value{D, W, M, Y} | | Período del bucket en el que se realiza la cobertura. No aplica para FW_NDF. |
| 2.4 | | Bucket multiplier | periodMultiplier: Positive Integer | | Multiplicador del período del bucket en el que se realiza la cobertura. No aplica para FW_NDF. |
| 2.5 | | Netting | Values{S=Si, N=No} | | Indicador si el Bucket se puede netear, con el tramo más cercano. No aplica para FW_NDF. |
| 2.6 | | NominalMax | Amt | | Tamaño Máximo del nominal en mercado en el Bucket |
| 2.7 | | Notional interval | Positive Integer | | El valor de este campo por NominalMax marca la frontera con el siguiente tramo de nominal |
| 2.8 | | LiquidityMultiplier | Decimal | En tanto por 1 Con un máximo de 2 decimales. | Multiplicador de Liquidez |

| | |
|------------------------|---|
| NOMBRE DEL FICHERO | CGENERICPRODUCTS |
| CÓDIGO DEL FICHERO | REP-GENDAT-005 |
| DESCRIPCION | Se informa de los productos genéricos usados para el cálculo del LiquidityMargin. Para cada genérico se identifica el tipo de riesgo para el que debe usarse. |
| GRUPO | GARANTÍAS |
| DESTINARIOS | DATOS GENERALES |
| PRIVACIDAD | Contiene datos públicos |
| HORARIO DE PUBLICACIÓN | EoD |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|---|--------------------|----------------------------|---|---|
| 1 | | REPORTE | | | Elementos que componen la cabecera del reporte |
| 1.1 | | exchName | String | | ClearingHouseld, Nombre o código corto de la Cámara |
| 1.2 | | contractGroup | String(2) | | Segmento |
| 1.3 | | rptCod | String | | Código del informe |
| 1.4 | | rptName | String | | Nombre del informe |
| 1.5 | | rptType | Values{Intraday, EndOfDay} | Intraday EndOfDay | Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión |
| 1.6 | | rptSessionDate | LocalDate | | Fecha de sesión |
| 1.7 | | rptPrntRunDat | LocalDate | | Fecha y Hora de creación del informe |
| 2 | | GENÉRICOS | | | Características de los productos genéricos de cobertura |
| 2.1 | | Risk Factor | String | "BAS" -> Basis "IRT" -> Tipo de interés "XRT" -> Tasa de cambio | Factor de riesgo para el que debe usarse el genérico |
| 2.2 | | Risk Currency pair | String | "Currency1/Currency2" donde currency códigos ISO de divisa (3 dígitos) | Divisas del factor de riesgo. Si el factor de riesgo es "IRT" Currency1 debe ser igual a Currency2. Si el factor de riesgo es "BAS" el riesgo es el del basis de Currency1 a Currency2. |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------|---|--|---|--|--|
| | | | | | Si el factor de riesgo es "XRT" el riesgo es el del tipo de cambio de Currency1 a Currency2. |
| 2.3 | | Generic Product Type | String | SWAP FWNDF | Tipo de producto del genérico |
| 2.4 | | Swap type | String | | Ej: SWAP_OIS, SWAP_VANILLA ... |
| 2.5 | | Settlement Currency | Currency ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa de liquidación de la operación |
| 2.6 | | Swap Leg 1 Currency | Currency ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa de la pata 1 |
| 2.7 | | Swap Leg 1 Payment Period | {D,W,M,Y} | | Periodo de pago |
| 2.8 | | Swap Leg 1 Payment Multiplier | Positive integer | | Multiplicador a aplicar al periodo de pago |
| 2.9 | | Swap Leg 1 Index | String | | Indice de referencia usado para la pata |
| 2.10 | | Swap Leg 1 Day Count | String | | Day Count Convention usado en la pata |
| 2.11 | | Swap Leg 1 Business Centers | String (cadena de string(4) separados por el carácter) | | Centros de negocios que rigen el calendario de pagos de la pata |
| 2.12 | | Swap Leg 1 Calculation Business Day Convention | String | "FOLLOWING" "MODFOLLOWING" "PRECEDING" "NONE" | Convención de día Hábil para las fechas de finales de periodos de cálculo de cupón en la rama/pata 1. Aplica también en la determinación de las fechas de inicio y de vencimiento. |
| 2.13 | | Swap Leg 1 Payment Business Day Convention | String | "FOLLOWING" "MODFOLLOWING" "PRECEDING" "NONE" | Convención de día Hábil para las fechas de pago de cupones en la rama/pata 1 |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------|---|---|--|-----------------|---|
| 2.14 | | Swap Leg 1 Payment Days Offset | Integer | | Offset del pago (payment lag), expresado en días de calendario, respecto de la fecha teórica de pago desajustada. La fecha resultante debe ser ajustada de acuerdo con el centro de negocios de la pata 1. |
| 2.15 | | Swap Leg 1 Exchange Rate Index | String | | Nombre del índice de la tasa de cambio de la divisa de la pata 1 a la divisa de liquidación. Este campo y los siguientes referidos a esta tasa de cambio irán en blanco si ambas divisas son la misma. |
| 2.16 | | Swap Leg 1 Exchange Rate Fixing Lag Period | period: Value{D, W, M, Y} | | Junto al campo siguiente, offset de fijación de la tasa de cambio respecto de las fechas de pago para la rama/pata 1 |
| 2.17 | | Swap Leg 1 Exchange Rate Fixing Lag PeriodMultiplier | periodMultiplier: Integer | | Junto al campo anterior, offset de fijación de la tasa de cambio respecto de las fechas de pago para la rama/pata 1 |
| 2.18 | | Swap Leg 2 Currency | Currency ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa de la pata 2 |
| 2.19 | | Swap Leg 2 Payment Period | {D,W,M,Y} | | Periodo de pago |
| 2.20 | | Swap Leg 2 Payment Multiplier | Positive integer | | Multiplicador a aplicar al periodo de pago |
| 2.21 | | Swap Leg 2 Index | String | | Índice de referencia usado para la pata |
| 2.22 | | Swap Leg 2 Day Count | String | | Day Count Convention usado en la pata |
| 2.23 | | Swap Leg 2 Business Centers | String (cadena de string(4) separados por el carácter) | | Centros de negocios que rigen el calendario de pagos de la pata |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------|---|---|------------------------------------|--|--|
| 2.24 | | Swap Leg 2 Calculation Business Day Convention | String | "FOLLOWING" "MODFOLLOWING" "PRECEDING" "NONE" | Convención de día Hábil para las fechas de finales de periodos de cálculo de cupón en la rama/pata 2. Aplica también en la determinación de las fechas de inicio y de vencimiento. |
| 2.25 | | Swap Leg 2 Payment Business Day Convention | String | "FOLLOWING" "MODFOLLOWING" "PRECEDING" "NONE" | Convención de día Hábil para las fechas de pago de cupones en la rama/pata 2. |
| 2.26 | | Swap Leg 2 Payment Days Offset | Integer | | Offset del pago (payment lag), expresado en días de calendario, respecto de la fecha teórica de pago desajustada. La fecha resultante debe ser ajustada de acuerdo con el centro de negocios de la pata 1. |
| 2.27 | | Swap Leg 2 Exchange Rate Index | String | | Nombre del índice de la tasa de cambio de la divisa de la pata 1 a la divisa de liquidación. Este campo y los siguientes referidos a esta tasa de cambio irán en blanco si ambas divisas son la misma. |
| 2.28 | | Swap Leg 2 Exchange Rate Fixing Lag Period | period: Value{D, W, M, Y} | | Junto al campo siguiente, offset de fijación de la tasa de cambio respecto de las fechas de pago para la rama/pata 1 |
| 2.29 | | Swap Leg 2 Exchange Rate Fixing Lag PeriodMultiplier | periodMultiplier: Integer | | Junto al campo anterior, offset de fijación de la tasa de cambio respecto de las fechas de pago para la rama/pata 1 |
| 2.30 | | Swap Notional currency | ISO Currency Codes (3 digits) | | Currency 1 o Currency2 |
| 2.31 | | Swap Notional | Amt | | Amount del genérico |
| 2.32 | | Forward maturity period | period: Value{D, W, M, Y} | | Correspondiente a la duración del contrato forward |
| 2.33 | | Forward maturity period multiplier | periodMultiplier: Positive Integer | | Correspondiente a la duración del contrato forward |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------|---|--------------------------|---------|------------------|--|
| 2.34 | | Effective Date Offset | Integer | | Offset desde la fecha sesión a la fecha de comienzo del genérico |
| 2.35 | | Basis spread leg | String | "LEG1" "LEG2" | En el caso de genéricos Basis este campo especifica sobre qué pata -ambas son de tipo variable- debe aplicarse el spread calculado para anular el npv del genérico |

| | |
|------------------------|--|
| NOMBRE DEL FICHERO | CSCENARIOS |
| CÓDIGO DEL FICHERO | REP-GENDAT-006 |
| DESCRIPCION | Se informa de todos los escenarios que se utiliza para el cálculo de las garantías, incluyendo la tabla de escenarios no escalada para VaR. También de todos los escenarios hipotéticos que se utiliza para el cálculo del Stress Test, incluyendo la tabla de escenarios no escalada para VaR. |
| GRUPO | DATOS GENERALES |
| DESTINARIOS | Todos los usuarios del segmento de la ECC |
| PRIVACIDAD | Contiene datos públicos |
| HORARIO DE PUBLICACIÓN | EoD |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|---|---------------|--------|-----------------|---|
| 1 | | REPORTE | | | Elementos que componen la cabecera del reporte |
| 1.1 | | exchName | String | | ClearingHouseld, Nombre o código corto de la Cámara |
| 1.2 | | contractGroup | String | | Segmento |
| 1.3 | | rptCod | String | | Código del informe |
| 1.4 | | rptName | String | | Nombre del informe |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|----------------------------------|---|-------------------------|---------------------------------------|----------------------|--|
| 1.5 | | rptType | Values{Intraday, EndOfDay} | Intraday EndOfDay | Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión |
| 1.6 | | rptSessionDate | YYYY-MM-DD | | Fecha de Sesión de los datos del informe |
| 1.7 | | rptPrntRunDat | YYYY-MM-DDTHH:MM:SS | | Fecha y Hora de creación del informe |
| 2 DATOS GENERALES | | | | | |
| 2.1 | | Rate type | String | "IRT" "XRT" | Si "IRT" los campos de la sección 4 irán en blanco Si "XRT" los campos de la sección 3 irán en blanco |
| 2.2 | | Scenario Type | String | | HIS = Histórico, HYP = Hipotético |
| 2.3 | | Scenario Date | String | YYYY-MM-DD | Fecha del escenario En blanco para escenarios hipotéticos |
| 2.4 | | Scenario ID | String | | Fecha del escenario para Históricos Nombre del escenario para Hipotéticos |
| 3 ESCENARIO TIPOS INTERÉS | | | | | Datos de la curva |
| 3.1 | | Curve Name | String | | Nombre de la curva |
| 3.2 | | Index ID | String | | Identificador del índice de referencia de la curva. El especificado en CFIXING. Determina la divisa y el calendario. |
| 3.3 | | Index currency | Currency ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa del índice |
| 3.4 | | KnotPoint Period | period: Value{D, W, M, Y} | | |
| 3.5 | | KnotPoint Multiplier | periodMultiplier: Positive Integer | | |
| 3.6 | | KnotPoint Symbol | String | | Ej: O/N, 1M,... |
| 3.7 | | KnotPoint Maturity Date | YYYY-MM-DD | | Fecha de vencimiento del KnotPoint |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|---|------------------------|---------|---|---|
| 3.8 | | IRT Shift Scalated | Decimal | Tipo expresado en tanto por uno: 0.05 equivale a 5% con un máximo de 15 posiciones decimales. | Valor escalado En blanco para escenarios hipotéticos |
| 3.9 | | IRT Shift NonScalated | Decimal | Tipo expresado en tanto por uno: 0.05 equivale a 5% con un máximo de 15 posiciones decimales. | Valor no escalado |
| 4 | | ESCENARIO TIPOS CAMBIO | | | Datos del Escenario |
| 4.1 | | Currency pair | String | "Currency1/Currency2" donde currency son códigos ISO de divisa (3 dígitos) | Divisa origen/Divisa destino |
| 4.2 | | XRT Shift Scalated | Decimal | Se expresa en valor absoluto | Valor escalado En blanco para escenarios hipotéticos |
| 4.3 | | XRT Shift NonScalated | Decimal | Se expresa en valor absoluto | Valor no escalado |

3.4 FICHEROS DE GARANTIAS

| | |
|------------------------|---|
| NOMBRE DEL FICHERO | CMARGINPARAMETERS |
| CÓDIGO DEL FICHERO | REP-MAR-001 |
| DESCRIPCIÓN | Se informa el modelo de cálculo de garantías. |
| GRUPO | GARANTÍAS |
| DESTINARIOS | Miembro de la CCP |
| PRIVACIDAD | Contiene datos privados |
| HORARIO DE PUBLICACIÓN | oD |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|---|----------------|----------------------------|----------------------|--|
| 1 | | REPORTE | | | Elementos que componen la cabecera del reporte |
| 1.1 | | exchName | String | | ClearingHouseId, Nombre o código corto de la Cámara |
| 1.2 | | contractGroup | String(2) | | Segmento |
| 1.3 | | rptCod | String | | Código del informe |
| 1.4 | | rptName | String | | Nombre del informe |
| 1.5 | | rptType | Values{Intraday, EndOfDay} | Intraday EndOfDay | Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión |
| 1.6 | | rptSessionDate | LocalDate | | Fecha de sesión |
| 1.7 | | rptPrntRunDat | LocalDate | | Fecha y Hora de creación del informe |
| 1.8 | | CCPMember | String | | Código del miembro destinatario del reporte. Si CCPMember es No Compensador el reporte |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|---|----------------------------|------------------|--|--|
| | | | | | contiene las operaciones de sus cuentas (propias y de clientes; memId = CCPMember). Si CCPMember es Compensador el reporte contiene, además de las operaciones de sus cuentas, las operaciones de las cuentas de otros miembros de los que es compensador (memID != CCPMember, pero ClearingMemberId = CCPMember) |
| 2 | | GRUPO COMPENSACIÓN | | | |
| 2.1 | | SwapClearingGroup | String(12) | | El modelo de cálculo de garantías aplica a un grupo de compensación |
| 3 | | PARAMETRIZACIÓN GARANTÍAS | | | |
| 3.1 | | MRiesgo | Decimal | Con un máximo de 3 posiciones decimales | Multiplicador de Riesgo de crédito Informado solo en los reportes de Miembros Compensadores |
| 3.2 | | Mpor House | Positive Integer | | Número de días Mpor House |
| 3.3 | | Mpor Client | Positive Integer | | Número de días Mpor Cliente |
| 3.4 | | Hvar | Decimal | Tipo expresado en tanto por uno: 0.05 equivale a 5% con un máximo de 4 posiciones decimales. | Nivel de confianza HVAR |
| 3.5 | | Es | Decimal | Tipo expresado en tanto por uno: 0.05 equivale a 5% con un máximo de 4 posiciones decimales. | Nivel de confianza ES |
| 3.6 | | NonScaledScenariosNumber | Positive Integer | | Número de escenarios no escalados |
| 3.7 | | NonScaledScenariosNumberFV | Positive Integer | | Número de escenarios no escalados a realizar FV |
| 3.8 | | ScaledScenariosNumber | Positive Integer | | Número de escenarios escalados |
| 3.9 | | ScaledScenariosNumberFV | Positive Integer | | Número de escenarios escalados a realizar FV |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------|---|-----------------|---------|---|---|
| 3.10 | | IM Floor Factor | Decimal | Tipo expresado en tanto por uno: 0.05 equivale a 5% con un máximo de 4 posiciones decimales. | Multiplicador sobre el IM Base para obtener la garantía mínima |

| | |
|------------------------|--|
| NOMBRE DEL FICHERO | CSENSITIVITY |
| CÓDIGO DEL FICHERO | REP-MAR-002 |
| DESCRIPCIÓN | Se informa a nivel de Miembro y Cuenta de las sensibilidades a las variaciones del tipo de interés. Si el Miembro destinatario del reporte es Compensador, el reporte debe incluir también las cuentas de aquellos otros miembros de la ECC de los que sea compensador. |
| GRUPO | GARANTÍAS |
| DESTINARIOS | Miembro de la CCP |
| PRIVACIDAD | Contiene datos privados |
| HORARIO DE PUBLICACIÓN | EoD |

| # | * | Campo | Tipo | Valores Validos | Descripción |
|-----|---|----------------|----------------------------|----------------------|---|
| 1 | | REPORTE | | | Elementos que componen la cabecera del reporte |
| 1.1 | | exchName | String | | ClearingHouseId, Nombre o código corto de la Cámara |
| 1.2 | | contractGroup | String(2) | | Segmento |
| 1.3 | | rptCod | String | | Código del informe |
| 1.4 | | rptName | String | | Nombre del informe |
| 1.5 | | rptType | Values{Intraday, EndOfDay} | Intraday EndOfDay | Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión |
| 1.6 | | rptSessionDate | LocalDate | | Fecha de sesión |

| # | * | Campo | Tipo | Valores Validos | Descripción |
|-----|---|---------------------------------------|------------|---|--|
| 1.7 | | rptPrntRunDat | LocalDate | | Fecha y Hora de creación del informe |
| 1.8 | | CCPMember | String | | Código del miembro destinatario del reporte. Si CCPMember es No Compensador el reporte contiene la información de sus cuentas (propias y de clientes; MarginAccountMember = CCPMember). Si CCPMember es Compensador el reporte contiene, además de la información de sus cuentas, la información de las cuentas de otros miembros de los que es compensador (MarginAccountMember = CCPMember, pero ClearingMember = CCPMember) |
| 2 | | CUENTA GARANTÍAS + GRUPO COMPENSACIÓN | | | Tantas cuentas como tenga el miembro por orden alfabético |
| 2.1 | | MarginAccountMember | String | | Código del miembro |
| 2.2 | | ClearingMember | String | | Código del miembro compensador |
| 2.3 | | MarginAccount | String(12) | | Código de la Cuenta en la CCP |
| 2.4 | | LEI | String(20) | | LEI de la entidad a nombre de quien está la cuenta |
| 2.5 | | SwapClearingGroup | String(12) | | Grupo de compensación correspondiente al porfolio de swaps asociado a la cuenta |
| 3 | | TIPO RIESGO | | | Sensibilidad a la variación del tipo de Interés |
| 3.1 | | Risk Factor | String | "BAS" -> Basis "IRT" -> Tipo de interés "XRT" -> Tasa de cambio "IBRLIBOR" -> Curva IBRLIBOR de Colombia | Factor de riesgo |
| 3.2 | | Risk Currency pair | String | "Currency1/Currency2" donde currency son códigos ISO de divisa (3 dígitos) | Divisas del factor de riesgo. Si el tipo de riesgo es "IRT" Currency1 debe ser igual a Currency2. Si el tipo de riesgo es "BAS" el riesgo es el del basis de Currency1 a Currency2. Si el tipo de riesgo es "XRT" el riesgo es el del tipo de cambio de Currency1 a Currency2. |

| # | * | Campo | Tipo | Valores Validos | Descripción |
|------|---|-----------------------------|------------------------------------|---|---|
| | | | | | Si el tipo de riesgo es "IBRLIBOR" Currency1 y Currency2 son USD |
| 4 | | SENSIBILIDAD | | | |
| 4.1 | | Index ID | String | | Identificador del índice de referencia. Ej: IBR_3M, BASIS_USD_COP, XRATE_USD_COP |
| 4.2 | | Calculate date | YYYY-MM-DD | | Fecha de cálculo |
| 4.3 | | Tenor maturity date | YYYY-MM-DD | | Fecha de vencimiento del tenor. Este campo y sucesivos referenciando un tenor, NO aplican si Risk Factor = "XRT" |
| 4.4 | | Days to tenor maturity date | Positive Integer | | Días a la fecha de vencimiento del tenor |
| 4.5 | | Tenor period | period: Value{D, W, M, Y} | | |
| 4.6 | | Tenor multiplier | periodMultiplier: Positive Integer | | |
| 4.7 | | Tenor symbol | String | | Tenor. Ej: O/N, 1M,... |
| 4.8 | | Delta/Gamma currency | ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa de los datos Delta y Gamma |
| 4.9 | | Zero Delta | Decimal | Con un máximo de 10 posiciones decimales. | Valor del delta |
| 4.10 | | Zero Gamma | Decimal | Con un máximo de 10 posiciones decimales. | Valor del gamma |

| | |
|------------------------|---|
| NOMBRE DEL FICHERO | CLIQUIDMARGIN |
| CÓDIGO DEL FICHERO | REP-MAR-003 |
| DESCRIPCIÓN | Se informa a nivel de Miembro y Cuenta de Garantías de las operaciones de cobertura que se han tomado en consideración en el cálculo del IM para obtener el Initial Margin por liquidez. Si el Miembro destinatario del reporte es Compensador, el reporte debe incluir también las cuentas de aquellos otros miembros de la ECC de los que sea compensador. |
| GRUPO | GARANTÍAS |
| DESTINARIOS | Miembro de la CCP |
| PRIVACIDAD | Contiene datos privados |
| HORARIO DE PUBLICACIÓN | EoD |

| # | * Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|----------------|----------------------------|----------------------|--|
| 1 | REPORTE | | | Elementos que componen la cabecera del reporte |
| 1.1 | exchName | String | | ClearingHouseld, Nombre o código corto de la Cámara |
| 1.2 | contractGroup | String(2) | | Segmento |
| 1.3 | rptCod | String | | Código del informe |
| 1.4 | rptName | String | | Nombre del informe |
| 1.5 | rptType | Values{Intraday, EndOfDay} | Intraday EndOfDay | Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión |
| 1.6 | rptSessionDate | LocalDate | | Fecha de sesión |
| 1.7 | rptPrntRunDat | LocalDate | | Fecha y Hora de creación del informe |
| 1.8 | CCPMember | String | | Código del miembro destinatario del reporte. Si CCPMember es No Compensador el reporte contiene la información de sus cuentas (propias y de clientes; MarginAccountMember = CCPMember). |

| # | * Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|---|------------------------------------|---|--|
| | | | | Si CCPMember es Compensador el reporte contiene, además de la información de sus cuentas, la información de las cuentas de otros miembros de los que es compensador (MarginAccountMember = CCPMember, pero ClearingMember = CCPMember) |
| 2 | CUENTA GARANTÍAS + GRUPO COMPENSACIÓN | | | Tantas cuentas como tenga el miembro por orden alfabético |
| 2.1 | MarginAccountMember | String | | Código del miembro |
| 2.2 | ClearingMember | String | | Código del miembro compensador |
| 2.3 | MarginAccount | String(12) | | Código de la Cuenta en la CCP |
| 2.4 | LEI | String(20) | | LEI de la entidad a nombre de quien está la cuenta |
| 2.5 | SwapClearingGroup | String(12) | | Grupo de compensación correspondiente al porfolio de swaps asociado a la cuenta |
| 3. | BUCKET - MARGIN INCREMENT - SENSITIVITIES | | | Incremento de IM y sensibilidades del porfolio por bucket |
| 3.1 | Bucket period | period: Value{D, W, M, Y} | | Período del bucket en el que se realiza la cobertura. En blanco si Risk type = "XRT". |
| 3.2 | Bucket multiplier | periodMultiplier: Positive Integer | | Multiplicador del período del bucket en el que se realiza la cobertura. En blanco si Risk type = "XRT". |
| 3.3 | Bucket IM Increment | Decimal | | Incremento total -contribuido por todos los factores de riesgo- del IM en el bucket |
| 3.4 | Risk Factor | String | "BAS" -> Basis "IRT" -> Tipo de interés "XRT" -> Tasa de cambio "IBRLIBOR" -> Curva IBRLIBOR de Colombia | Factor de riesgo |

| # | * Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------|----------------------|------------------------------|--|--|
| 3.5 | Risk Currency pair | String | "Currency1/Currency2" donde currency son códigos ISO de divisa (3 dígitos) | Divisas del factor de riesgo. Si el tipo de riesgo es "IRT" Currency1 debe ser igual a Currency2. Si el tipo de riesgo es "BAS" el riesgo es el del basis de Currency1 a Currency2. Si el tipo de riesgo es "XRT" el riesgo es el del tipo de cambio de Currency1 a Currency2. Si el tipo de riesgo es "IBRLIBOR" Currency1 y Currency2 son USD. |
| 3.6 | PV01 Currency | ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa en la que se proporcionan los 2 siguientes campos |
| 3.7 | PV01 portfolio | Decimal | Con un máximo de 10 posiciones decimales. | Sensibilidad del portfolio -antes de su cobertura- en el bucket |
| 3.8 | PV01 hedging | Decimal | Con un máximo de 10 posiciones decimales. | Sensibilidad de los genéricos de cobertura en el bucket. Incluye la sensibilidad de los genéricos usados para realizar la cobertura en los buckets de más largo plazo. |
| 3.9 | RC | Decimal | Con un máximo de 10 posiciones decimales. | Ratio de Cobertura. Específico para el genérico introducido para realizar la cobertura en el bucket. |
| 3.10 | Notional currency | ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa del Nominal teórico del Genérico de Cobertura. |
| 3.11 | Notional | Decimal | Con un máximo de 10 posiciones decimales. | Nominal teórico del Genérico de Cobertura. Específico para el genérico introducido para realizar la cobertura en el bucket. |
| 3.12 | Sobre coste liquidez | Decimal | Con un máximo de 10 posiciones decimales. | Sobrecoste por cubrir el importe exacto del IRS de cobertura |

| | |
|------------------------|--|
| NOMBRE DEL FICHERO | CTOTALINITIALMARGIN |
| CÓDIGO DEL FICHERO | REP-MAR-004 |
| DESCRIPCIÓN | Se informa a nivel de Miembro y Cuenta de Garantías, el IM Total calculado, Método de cálculo hoy, NPV calculado hoy, VM calculado hoy. IM Total calculado ayer, Método de cálculo ayer., NPV calculado ayer, VM calculado ayer. IM Total calculado ayer. Si el Miembro destinatario del reporte es Compensador, el reporte debe incluir también las cuentas de aquellos otros miembros de la ECC de los que sea compensador. |
| GRUPO | GARANTÍAS |
| DESTINARIOS | Miembro de la CCP |
| PRIVACIDAD | Contiene datos privados |
| HORARIO DE PUBLICACIÓN | ID y EoD |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|---|----------------|----------------------------|----------------------|---|
| 1 | | REPORTE | | | Elementos que componen la cabecera del reporte |
| 1.1 | | exchName | String | | ClearingHouseld, Nombre o código corto de la Cámara |
| 1.2 | | contractGroup | String(2) | | Segmento |
| 1.3 | | rptCod | String | | Código del informe |
| 1.4 | | rptName | String | | Nombre del informe |
| 1.5 | | rptType | Values{Intraday, EndOfDay} | Intraday EndOfDay | Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión |
| 1.6 | | rptSessionDate | LocalDate | | Fecha de sesión |
| 1.7 | | rptPrntRunDat | LocalDate | | Fecha y Hora de creación del informe |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|---|---|------------------------------|-----------------|--|
| 1.8 | | CCPMember | String | | Código del miembro destinatario del reporte. Si CCPMember es No Compensador el reporte contiene la información de sus cuentas (propias y de clientes; MarginAccountMember = CCPMember). Si CCPMember es Compensador el reporte contiene, además de la información de sus cuentas, la información de las cuentas de otros miembros de los que es compensador (MarginAccountMember = CCPMember, pero ClearingMember = CCPMember) |
| 2 | | CUENTA GARANTÍAS + GRUPO COMPENSACIÓN | | | Tantas cuentas como tenga el miembro por orden alfabético |
| 2.1 | | MarginAccountMember | String | | Código del miembro |
| 2.2 | | ClearingMember | String | | Código del miembro compensador |
| 2.3 | | MarginAccount | String(12) | | Código de la Cuenta en la CCP |
| 2.4 | | LEI | String(20) | | LEI de la entidad a nombre de quien está la cuenta |
| 2.5 | | SwapClearingGroup | String(12) | | Grupo de compensación correspondiente al porfolio de swaps asociado a la cuenta |
| 3 | | Total NPV + INITIAL MARGIN + VARIATION MARGIN | | | Total NPV, Initial Margin y Variation Margin de la cuenta |
| 3.1 | | Currency | ISO Currency Code (3 digits) | | Divisa de los datos de riesgo a continuación |
| 3.2 | | NPV | Amt | | Today Net present value |
| 3.3 | | NPV D-1 | Amt | | Net present value from D-1 |
| 3.4 | | Porfolio PAI | Amt | | PAI del porfolio: EONIA _{d-1} * NPV _{d-1} Se liquida en D+1 |
| 3.5 | | VM | Amt | | Variation Margin |
| 3.6 | | VM D-1 | Amt | | Variation Margin from D-1 |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------|---|----------------------------|--------|---|--|
| 3.7 | | Initial Margin | Amt | | Initial Margin |
| 3.8 | | Initial Margin D-1 | Amt | | Initial Margin from D-1 |
| 3.9 | | IM calculate method | String | "DELTA_GAMMA_ES" "DELTA_GAMMA_VAR" "DELTA_GAMMA_MAX_ES_VAR" "FV_ES" "FV_VAR" "FV_MAX_ES_VAR" | IM calculation method |
| 3.10 | | ES Value | Amt | | Valor del Expected Shortfall a nivel de MC |
| 3.11 | | HVaR Value | Amt | | Valor del VaR Histórico a nivel de MC |
| 3.12 | | Liquid Margin IM Increment | Amt | | Incremento del IM debido al ATP |

| | |
|------------------------|--|
| NOMBRE DEL FICHERO | CSTRESSTESTING |
| CÓDIGO DEL FICHERO | REP-MAR-005 |
| DESCRIPCIÓN | Se informa a nivel de Miembro Compensador y Cuenta de Garantías de los resultados de pruebas de resistencia. |
| GRUPO | GARANTÍAS |
| DESTINARIOS | Miembro Compensador de la CCP |
| PRIVACIDAD | Contiene datos privados |
| HORARIO DE PUBLICACIÓN | EoD |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|---|---------------------------------------|------------------------------|----------------------|--|
| 1 | | REPORTE | | | Elementos que componen la cabecera del reporte |
| 1.1 | | exchName | String | | ClearingHouseId, Nombre o código corto de la Cámara |
| 1.2 | | contractGroup | String(2) | | Segmento |
| 1.3 | | rptCod | String | | Código del informe |
| 1.4 | | rptName | String | | Nombre del informe |
| 1.5 | | rptType | Values{Intraday, EndOfDay} | Intraday EndOfDay | Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión |
| 1.6 | | rptSessionDate | LocalDate | | Fecha de sesión |
| 1.7 | | rptPrntRunDat | LocalDate | | Fecha y Hora de creación del informe |
| 1.8 | | CCPMember | String | | El reporte contiene, además de la información de sus cuentas, la información de las cuentas de otros miembros de los que es compensador (MarginAccountMember = CCPMember, pero ClearingMember = CCPMember) |
| 2 | | CUENTA GARANTÍAS + GRUPO COMPENSACIÓN | | | Tantas cuentas como tenga el miembro por orden alfabético |
| 2.1 | | MarginAccountMember | String | | Código del miembro |
| 2.2 | | ClearingMember | String | | Código del miembro compensador |
| 2.3 | | MarginAccount | String(12) | | Código de la Cuenta en la CCP |
| 2.4 | | LEI | String(20) | | LEI de la entidad a nombre de quien está la cuenta |
| 2.5 | | SwapClearingGroup | String(12) | | Grupo de compensación correspondiente al porfolio de swaps asociado a la cuenta |
| 3 | | TEST DATA | | | Datos del Test de Stress |
| 3.1 | | Currency | ISO Currency Code (3 digits) | | Moneda |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|---|--|--------|--|---|
| 3.2 | | InfoType | String | "INFO_CP_MC" "INFO_CC_MC" "ARC_MC" "RST_MC" | <p>Ver (1) "INFO_CP_MC", "INFO_CC_MC" No aplican los campos 3.7 y 3.8. Van en blanco. "ARC_MC"</p> <p>En el bloque 2 CUENTA+SUBCUENTA -campos 2.1 a 2.6- solo van informados los campos 2.2 ClearingMemberID y 2.7 SwapClearingGroup. En el bloque 3 TEST DATA solo se informa el campo 3.7. "RST_MC"</p> <p>En el bloque 2 CUENTA+SUBCUENTA -campos 2.1 a 2.6- solo van informados los campos 2.2 ClearingMemberID y 2.7 SwapClearingGroup. En el bloque 3 TEST DATA solo se informa el campo 3.8.</p> |
| 3.3 | | WorstScenario | String | | <p>Peor escenario del MC Fecha del escenario si es un escenario histórico. Nombre del escenario si es un escenario hipotético.</p> |
| 3.4 | | WorstScenario Margin | Amt | | Margin del peor escenario |
| 3.5 | | Initial Margin | Amt | | Importe final de la garantía inicial (IM) |
| 3.6 | | Stress Test Risk | Amt | | Riesgo en situación de stress test |
| 3.7 | | Adjustment by Clearing Member Concentration Risk | Amt | | Ajuste por riesgo de concentración del Miembro Compensador |
| 3.8 | | Clearing Member Stress Test Risk | Amt | | Riesgo de stress del Miembro Compensador |

3.5 FICHEROS DE SUBASTAS

| | |
|------------------------|---|
| NOMBRE DEL FICHERO | CAUTION_AUC |
| CÓDIGO DEL FICHERO | REP- AUC- 012 |
| DESCRIPCIÓN | Se informa a nivel Miembro Compensador del detalle de los Portfolios del Miembro Compensador en situación de Incumplimiento por los cuales el primero debe pujar. Tras la resolución de la subasta, el reporte informa también del resultado de la misma. |
| GRUPO | SUBASTAS |
| DESTINARIOS | Miembro Compensador de la CCP |
| PRIVACIDAD | Contiene datos privados |
| HORARIO DE PUBLICACIÓN | ID (Bajo demanda) |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------|---|-------------------|----------------------------|----------------------|---|
| 1 | | REPORTE | | | Elementos que componen la cabecera del reporte |
| 1.1 | | exchName | String | | ClearingHouseId, Nombre o código corto de la Cámara |
| 1.2 | | contractGroup | String | | Segmento |
| 1.3 | | rptCod | String | | Código del informe |
| 1.4 | | rptName | String | | Nombre del informe |
| 1.5 | | rptType | Values{Intraday, EndOfDay} | Intraday EndOfDay | Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión |
| 1.6 | | membId | String | | Código del miembro destinatario del reporte |
| 1.7 | | BidderMember | String | | Código del miembro encargado de la puja |
| 1.8 | | RepresentedMember | String | | Código del miembro representado en la subasta |
| 1.9 | | rptPrntEffDat | YYYY-MM-DD | | Fecha de sesión |
| 1.10 | | rptPrntRunDat | YYYY-MM-DDTHH:MM:SS | | Fecha y Hora de creación del informe |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------|---|--------------------------|--------------------|---|--|
| 2 | | AUCTION | | | Detalles de la Subasta |
| 2.1 | | APid | String | | Identificación del Portfolio a Subastar (PAS) |
| 2.2 | | Apid_Status | String | ReadyToAuction AuctionInProgress AuctionOk AuctionFailed PartialAuction | Estado del PAS |
| 2.3 | | AUC_ID | Integer | | Identificador numérico de la subasta |
| 2.4 | | NPV | Amt | | NPV del PAS en el momento de generación |
| 2.5 | | Sensitivity | Amt | | Sensibilidad total del PAS en el momento de generación |
| 2.6 | | IMDeltaGamma | Amt | | Initial Margin Total del PAS calculado con sensibilidad |
| 2.7 | | AuctionType | String | 0 1 | Modelo de Subasta. Un ganador (SW): 0 o Varios Ganadores (Mult.W): 1 |
| 2.8 | | AUTotal | Integer | | Total de Unidades de Subastas |
| 2.9 | | AUTotalAssigned | Integer | | Unidades de Subasta asignadas al miembro |
| 2.10 | | Initial AuctionTimeStamp | yyy-MM-ddThh:mm:ss | | Fecha y hora de inicio de la subasta. |
| 2.11 | | Final AuctionTimeStamp | yyy-MM-ddThh:mm:ss | | Fecha y hora de fin de la subasta. |
| 2.12 | | AuctionResolutionDate | yyy-MM-ddThh:mm:ss | | Fecha y hora prevista de la resolución de la subasta. |
| 2.13 | | AuctionSettleDate | dd/MM/yyyy | | Fecha de Liquidación del resultado de la subasta. |
| 2.14 | | AAAP_1 | Amt | | Cantidad Asignada a Cada Portfolio a Subastar Nivel 1 (CAPS) |
| 2.15 | | AAAP_3_CM | Amt | | Cantidad Asignada a Cada Portfolio a Subastar Nivel 3 (CAPS) |
| 2.16 | | AU_Min_Assigned | Integer | | Total de unidades mínimas a subastar asignadas al MC |
| 3 | | AUCTION RESULTS | | | Resultado de la Subasta |

| # | * | Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------|---|----------------------|---------|---|--|
| 3.1 | | AuctionResults | String | ACCEPTED CANCELLED WINNER NOT_WINNER | Resultado de la Subasta |
| 3.2 | | AU_Awarded | Integer | | Unidades de Subasta adjudicadas |
| 3.3 | | AU_Pending | Integer | | Unidades de Subasta pendientes de adjudicación |
| 3.4 | | BestPriceAuction | Amt | | Mejor Precio de la Subasta |
| 3.5 | | AssignPrice | Amt | | Precio adjudicado |
| 3.6 | | AveragePrice | Amt | | Precio medio de los ganadores |
| 3.7 | | MinimunPrice | Amt | | Precio mínimo de los ganadores |
| 3.8 | | FirstPrice | Amt | | 1er precio no aceptado |
| 3.9 | | AU_awarded_CM | Integer | | Unidades de Subasta adjudicadas al Miembro Compensador |
| 3.10 | | AuctionPrice | Amt | | Precio asignado |
| 3.11 | | AuctionSettlePayment | Amt | | Importe a liquidar por las Unidades adjudicadas al Miembro Compensador |

| | |
|------------------------|--|
| NOMBRE DEL FICHERO | *_BIDCSV_* (El nombre del fichero debe contener la cadena de caracteres "_BIDCSV_") |
| CÓDIGO DEL FICHERO | REP-AUC-016 |
| DESCRIPCIÓN | Fichero de pujas generado por cada participante en una subasta. |
| GRUPO | SUBASTAS |
| DESTINARIOS | ECC |
| PRIVACIDAD | Contiene datos privados para la ECC |
| HORARIO DE PUBLICACIÓN | ID |

| # | * Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|-----|-------------------|-----------------|-----------------|---|
| 1 | REPORTE | | | Elementos que componen la cabecera del reporte |
| 1.1 | exchName | String | | ClearingHouseld, Nombre o código corto de la Cámara |
| 1.2 | contractGroup | String(2) | | Segmento |
| 1.3 | rptCod | String | | Código del informe |
| 1.4 | rptName | String | | Nombre del informe |
| 1.5 | rptType | Values{Bidding} | | Estado de los datos. Valores válidos: Bidding |
| 2 | PUJA | | | Información sobre la puja realizada por el miembro para la subasta en curso |
| 2.1 | membId | String | | Código del miembro |
| 2.2 | BidderMember | String | | Código del miembro que envía el fichero de puja |
| 2.3 | RepresentedMember | String | | Código del miembro destino de la puja (el miembro que se llevará el portfolio en caso de ganar) |
| 2.4 | rptPrntEffDat | LocalDate | | Fecha de sesión |
| 2.5 | rptPrntRunDat | LocalDate | | Fecha de creación del informe |
| 2.6 | Apid | String | | Identificador del portfolio a subastar (PAS) |
| 2.7 | AUC_ID | String | | Identificador del portfolio asociado a la subasta actual |



| # | * Campo | Tipo | Valores válidos | Descripción |
|------|---------------|-----------|-----------------|---|
| 2.8 | AU_Bid | Decimal | | Número de unidades por las que se puja |
| 2.9 | Price_Bid | Decimal | | Precio de la puja |
| 2.10 | Bid_TimeStamp | LocalDate | | Fecha y hora de la última modificación de la puja |

4 Codificación de contratos

BME CLEARING denominará a los contratos que se compensarán en el segmento de swaps con el siguiente esquema:

"Producto" + "Vencimiento" + "referencia variable 1" + "referencia variable 2"

Donde:

Código de producto:

3 letras que indican el nombre del producto de acuerdo a la siguiente tabla:

| Producto | |
|----------|--------------------------------|
| CSW | Coupon Swap - Fijo Flotante |
| ZCS | Zero Coupon Swap |
| FRA | Forward Rate Agreement |
| BSW | Basis Swap - Flotante Flotante |
| OIS | Overnight Indexed Swap |

Código de vencimiento:

2 Números y 1 letra, siendo los números el vencimiento y la letra el plazo temporal (Día, semana, mes o año):

| VENCIMIENTO | |
|-------------|----------|
| 01D | 1 Día |
| 02D | 2 Día |
| 01W | 1 Semana |
| 01M | 1 Mes |
| 02M | 2 Mes |
| 03M | 3 Mes |
| ... | ... |
| 12M | 12 Meses |
| 18M | 18 Meses |
| 02Y | 2 Años |
| 03Y | 3 Años |
| 04Y | 4 Años |
| 05Y | 5 Años |
| ... | |
| 50Y | 50 Años |

Código de referencias Variables:

Son los tipos de interés a los que se referencian la rama variable o las ramas variables del producto, de entre la siguiente tabla:

| REFERENCIA VARIABLE | |
|---------------------|------------------|
| E1M | Euribor 1 mes |
| E3M | Euribor 3 meses |
| E6M | Euribor 6 meses |
| E1Y | Euribor 12 meses |
| EON | Eonia |

A continuación se exponen varios ejemplos en esta tabla:

| CÓDIGO | DESCRIPCIÓN |
|--------------|---|
| CSW10YE6M | Coupon swap plain vanilla a 10 años contra Euribor 6m |
| BSW11YE6ME1Y | Basis swap a 11 años Euribor 6m contra Euribor 1y |
| FRA04ME6M | FRA 4x10 a 4 meses contra Euribor 6m |
| OIS06YEON | OIS a 6 años |
| ZCS10YE3M | Swap Zero Coupon a 10y contra E3m |



Tramontana, 2 bis
28231 Las Rozas (Madrid)
www.bmeclearing.es



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

