



Segmento de IRS

Ficheros de Datos – Nivel segmento

Formato: FpML
20 de Junio de 2019

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	7
2	DESCRIPCIÓN GENERAL DE FICHEROS A GENERAR	8
2.1	OPERACIONES.	8
2.2	POSICIÓN ABIERTA.	8
2.3	DATOS GENERALES.	10
2.4	GARANTÍAS.	11
2.5	SUBASTA	13
3	DETALLE DE FICHEROS	16
3.1	FICHEROS DE OPERACIONES	16
3.2	FICHEROS DE POSICION ABIERTA	21
3.3	FICHEROS DE DATOS GENERALES	60
3.4	FICHEROS DE GARANTIAS	81

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
06/05/2016	1.4	Actualización de campos en el fichero COPINIRS.	Desarrollo de Negocio
01/11/2016	1.5	Actualización de campos en el fichero COPINIRS, COPINFRA, CCOUPONS.	Desarrollo de Negocio
29/06/2018	1.6	Actualización de campos por nueva estructura de cuentas e incorporación del entorno multidivisa.	Desarrollo de Negocio
20/06/2019	1.7	Incorporación de campos por entorno multidivisa	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 multidivisa. 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, 6719 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.
- **CBACKTESTING**
 - Se incluye el fichero.
- **CWORSTSCENARIO**
 - Se incluye el fichero.
- **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 y técnica 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

Esta información será suministrada en ficheros con formato FpML cuya definición se encuentra más adelante en este documento. El formato de ficheros sigue, tanto como es posible, las especificaciones de FpML Version 5-7. En la mayoría de los casos la estructura y semántica de los mensajes es idéntica al estándar.

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. 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 FpML del reporte de referencia.

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
Número	Orden cronológico de los campos que componen el fichero de referencia.
Campo	Nombre del campo definido.
Descripción	Descripción del campo definido en el fichero.
FpML	Mapeo del campo en FpML.
Formato	Formato en el que se visualiza el dato.
Valores	Valores validos de los datos.

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 presentara 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.

2.1 OPERACIONES.

En este grupo de ficheros se informará a nivel de Miembro Compensador y Cuenta 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	CBACKLOADINGPREVISION	REP-OP-001	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.	ID (Bajo demanda)	FpML / CSV

2.2 POSICIÓN ABIERTA.

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

GRUPO	NOMBRE DEL FICHERO	CÓDIGO DEL FICHERO	DESCRIPCIÓN	HORARIO DE PUBLICACIÓN	FORMATO
POSICIÓN ABIERTA	CTRADES	REP-OPIN-001	Se informa a nivel Miembro y Cuenta de Posición de todas las 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.		
	COPINRSFRA	REP-OPIN-002		EoD y ID	CSV La información de este fichero CSV, en FpML se proporciona en el fichero CCOUPONS
	CCOUPONS	REP-OPIN-003	Se informa a nivel Miembro y Cuenta el detalle por operación de todas las operaciones vivas de Swaps y FRAs, indicando el estado de la operación y su valoración, el importe de todos los cupones fijados y estimados a cobrar/pagar, así como los considerations estimados a cobrar/pagar durante toda la vida de la operación. Si el Miembro destinatario del reporte es Compensador, el reporte debe incluir también las operaciones de aquellos otros miembros de la ECC	ID y EoD	FpML / CSV El fichero FpML también incorpora la información que en los ficheros CSV se proporciona en COPINRSFRA y CCONSIDERATIONS.

GRUPO	NOMBRE DEL FICHERO	CÓDIGO DEL FICHERO	DESCRIPCIÓN	HORARIO DE PUBLICACIÓN	FORMATO
			de los que sea compensador.		
	CCONSIDERATIONS	REP-OPIN-004		ID y EoD	CSV La información en este fichero CSV, en FpML se proporciona en el fichero CCOUPONS

2.3 DATOS GENERALES.

En este grupo de ficheros 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

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

2.4 GARANTÍAS.

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. 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
	CTOTALINITIALMARGIN	REP-MAR-004	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.	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 SUBASTA

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	Set de ficheros para SwaMI Auctions.	ID (Bajo demanda)	CSV
	CCALENDAR_AUC	REP-AUC-002	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)	
	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 pujar. Tras la resolución de la subasta, el reporte informa también del resultado de la misma.	ID (Bajo demanda)	
	COPINIRSFRA_PAS_AUC	REP-AUC-013	Su formato se ajusta al de COPINIRSFRA. 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 CAUCTION_AUC.	ID (Bajo demanda)	

GRUPO	NOMBRE DEL FICHERO	CÓDIGO DEL FICHERO	DESCRIPCIÓN	HORARIO DE PUBLICACIÓN	FORMATO
			También se genera tras la resolución de la subasta.		
	CCOUPONS_PAS_AUC	REP-AUC-014	Su formato se ajusta al de CCOUPONS. 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. También se genera tras la resolución de la subasta.	ID (Bajo demanda)	
	CCONSIDERATIONS_PAS_AUC	REP-AUC-015	Su formato se ajusta al de CCONSIDERATIONS. 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. También se genera tras la resolución de la subasta.	ID (Bajo demanda)	
	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 AXXX 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, a excepción de CNETTINGPREVISION y CBACKLOADINGPREVISION, de la familia de Garantías y Resultados cuando haya algo que comunicar a dicho Miembro Compensador, siempre que hay transcurrido al menos diez minutos desde el último envío a este Miembro Compensador.
 - c. Los ficheros CNETTINGPREVISION se envían automáticamente una vez finalizada la aceptación y registro de operaciones y antes que se inicie el EOD.
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:
- d. CCURVES que se generará cuando el Supervisor haya aprobado las curvas de cálculo EOD.
 - e. CFIXING que se generará cuando el Supervisor haya validado el fixing del EONIA.

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 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 CCP de los que sea compensador.
GRUPO	OPERACIONES
DESTINARIOS	Miembro de la CCP
PRIVACIDAD	Contiene datos privados
HORARIO DE PUBLICACIÓN	ID

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN	FPML
1.1		exchName	String	ClearingHouseId, Nombre o código corto de la Cámara	/valuationReport/reportIdentification/bme:ccpld with ccpldScheme="http://www.bmeclearing.es/ccp-id"	
1.2		contractGroup	String(2)	Segmento	/valuationReport/reportIdentification/bme:segmentId with segmentIdScheme="http://www.bmeclearing.es/segment-id"	
1.3		rptCod	String	Código del informe	/valuationReport/reportIdentification/reportId with reportIdScheme="http://www.bmeclearing.es/report-id"	
1.4		rptName	String	Nombre del informe	/valuationReport/dataSetName	
1.5		rptType	Values{Intraday, EndOfDay}	Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión	/valuationReport/reportIdentification/bme:reportType with reportTypeScheme="http://www.bmeclearing.es/report-type"	

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN	FPML
						1. If ITD, Intraday 2. If EoD, EndOfDay
1.6		rptSessionDate	LocalDate		Fecha de sesión	/valuationReport/asOfDate
1.7		rptPrntRunDat	LocalDate		Fecha y Hora de creación del informe	/valuationReport/header/creationTimestamp
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 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	ForEach Miembro, set /valuationReport/party with /valuationReport/party/partyId and partyIdScheme="http://www.bmeclearing.es/party-id" [If SWIFT Code, partyIdScheme="http://www.fpml.org/coding-scheme/external/iso9362"]
2.2		ClearingMember	String		Código del miembro compensador	ForEach Miembro, then: /valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.bmeclearing.es/clearing-party-id" And, if ClearingMember, then: /valuationReport/party/@id is pointing to /valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/partyTradeInformation[partyReference pointing to Clearing Member]/relatedParty[partyReference pointing to Clearing Member]/role = "ClearingFirm"

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN	FPML
2.3		PositionAccount	String(12)		Código de la Cuenta de Posición en la CCP	/valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.bme clearing.es/position-account-id"
2.4		LEI	String(20)		LEI de la entidad a nombre de quien está la cuenta	/valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.fpml.org/coding-scheme/external/iso17442"
2.5		AccountClass	Value{CP, CI}		Tipo de cuenta en la que se registran las operaciones, Cuenta propia ("CP") o Cuenta Individual ("CI")	/valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.fpml.org/coding-scheme/account-type"
3		PRODUCTO			Datos principales del producto	
3.1		CCP Trade id	String		Número de identificación de la cámara una vez novada, Código en CTRADES	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/tradeId with tradeIdScheme="http://www.bme clearing.es/initial-ccp-trade-id"
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)	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/tradeId with tradeIdScheme="http://www.swapswire.com/spec/2001/trade-id-1-0"
3.3		Approved Trade Source Trade Id - BETA	String		ID en la plataforma de aceptación de la operación novada en la ECC	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/tradeId with tradeIdScheme="http://www.swapswire.com/approved-trade-source-beta"
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	0
3.5		Currency1	Currency ISO Currency Code (3 digits)		Divisa de la pata1 de la operación	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/calculationPeriodAmount/calculation/notionalSchedule/notionalStepSchedule/currency
3.6		Notional1	Amt		Importe notional inicial de la pata1	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/calculationPeriodAmount/calculation/notionalSchedule/notionalStepSchedule/initialValue

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN	FPML
3.7		Leg_Type1	Logic		Indica el tipo de interes aplicado es Fijo= FIX o Flotante=FL	Si tiene (/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/calculationPeriodAmount/calculation/fixRateSchedule/initialValue) será FIX, sino será FL
3.8		Currency2	Currency ISO Currency Code (3 digits)		Divisa de la pata2 de la operación	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[2]/calculationPeriodAmount/calculation/notionalSchedule/notionalStepSchedule/currency
3.9		Notional2	Amt		Importe nocional inicial de la pata2	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[2]/calculationPeriodAmount/calculation/notionalSchedule/notionalStepSchedule/initialValue
3.10		Leg_Type2	Logic		Indica el tipo de interes aplicado es Fijo= FIX o Flotante=FL	Si tiene (/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/calculationPeriodAmount/calculation/fixRateSchedule/initialValue) será FIX, sino será 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	Si el payerPartyReference
3.13		Trade Date	LocalDate		Fecha de contratación de la operación	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/partyTradeInformation/executionDateTime
3.14		Maturity Date	LocalDate		Fecha fin de la operación	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/calculationPeriodDates/terminationDate/adjustedDate

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN	FPML
4.1		SwapClearingGroup	String(12)		Grupo de compensación	/valuationReport/portfolioValuationItem/bme:swapClearingGroup with swapClearingGroupScheme="http://www.bmeclearing.es/swap-clearing-group"
5		BACKLOADING			Prevision de IM y VM para las operaciones backloading pendientes de aceptación	
5.1		IncrementalRiskIM	Amt		Importe del incremento del riesgo IM introducido por la operación	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/quote/value when /valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/quote/measureType with assetMeasureScheme="BME_ASSET_MEASURE" is "IncrementalRiskIM"
5.2		TotalRiskIM	Amt		Importe total del riesgo IM del portfolio original + Riesgo Incremental	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/quote/value when /valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/quote/measureType with assetMeasureScheme="BME_ASSET_MEASURE" is "TotalRiskIM"
5.3		Collateral	Amt		Importe del Colateral requerido	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/quote/value when /valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/quote/measureType with assetMeasureScheme="BME_ASSET_MEASURE" is "Collateral"
5.4		IM	Amt		Margen inicial del porfolio	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/quote/value when /valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/quote/measureType with assetMeasureScheme="BME_ASSET_MEASURE" is "IM"

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN	FPML
5.5	VM		Amt		Margen de variación del porfolio	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/quote/value when /valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/quote/measureType with assetMeasureScheme="BME_ASSET_MEASURE" is "NPV"
5.6	Total IM		Amt		IM total del porfolio considerando el paquete completo de operaciones de backloading	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/quote/value when /valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/quote/measureType with assetMeasureScheme="BME_ASSET_MEASURE" is "TotalIm"
5.7	Total VM		Amt		VM total del porfolio considerando el paquete completo de operaciones de backloading	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/quote/value when /valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/quote/measureType with assetMeasureScheme="BME_ASSET_MEASURE" is "Total NPV"

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 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	
HORARIO DE PUBLICACIÓN	ID y EoD

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
1		REPORTE			Elementos que componen la cabecera del reporte	
	o	exchName	String		ClearingHouseId, Nombre o código corto de la Cámara	/valuationReport/reportIdentification/bme:ccpld with ccpldScheme="http://www.bmeclearing.es/ccp-id"
	1.2	contractGroup	String(2)		Segmento	/valuationReport/reportIdentification/bme:segmentId with segmentIdScheme="http://www.bmeclearing.es/segment-id"
	1.3	rptCod	String		Código del informe	/valuationReport/reportIdentification/reportId with reportIdScheme="http://www.bmeclearing.es/report-id"
	1.4	rptName	String		Nombre del informe	/valuationReport/dataSetName
	1.5	rptType	Values{Intrada y, EndOfDay}		Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión	/valuationReport/reportIdentification/bme:reportType with reportTypeScheme="http://www.bmeclearing.es/report-type" 1. If ITD, Intraday 2. If EoD, EndOfDay
	1.6	rptSessionDate	LocalDate		Fecha de sesión	/valuationReport/asOfDate
	1.7	rptPrntRunDat	LocalDate		Fecha y Hora de creación del informe	/valuationReport/header/creationTimestamp
	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 de las	/valuationReport/reportContents/partyReference

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
					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		ForEach Miembro, set /valuationReport/party with /valuationReport/party/partyId and partyIdScheme="http://www.bmeclearing.es/party-id" [If SWIFT Code, partyIdScheme="http://www.fpml.org/coding-scheme/external/iso9362"]
2.2	ClearingMember		String	Código del miembro compensador		ForEach Miembro, then: /valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.bmeclearing.es/clearing-party-id" And, if ClearingMember, then: /valuationReport/party/@id is pointing to /valuationReport/portfolioValuationItem/trade/tradeHeader/partyTradeInformation[partyReference pointing to Clearing Member]/relatedParty[partyReference pointing to Clearing Member]/role = "ClearingFirm"
2.3	PositionAccount		String(12)	Código de la Cuenta de Posición en la CCP		/valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.bmeclearing.es/position-account-id"
2.4	LEI		String(20)	LEI de la entidad a nombre de quien está la cuenta		/valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.fpml.org/coding-scheme/external/iso17442"

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
2.5		AccountClass	Value{CP, CI}		Tipo de cuenta en la que se registran las operaciones, Cuenta propia ("CP") o Cuenta Individual ("CI")	/valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.fpml.org/coding-scheme/account-type"
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	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/tradeId with tradeIdScheme="http://www.bmeclearing.es/initial-ccp-trade-id"
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)	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/tradeId with tradeIdScheme="http://www.swapswire.com/spec/2001/trade-id-1-0"
3.3		Approved Trade Source Trade Id - BETA	String		ID en la plataforma de aceptación de la operación novada en la ECC	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/tradeId with tradeIdScheme="http://www.swapswire.com/approved-trade-source-beta"
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	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/calculationPeriodAmount/calculation/notionalSchedule/notionalStepSchedule/currency
3.6		Notional1	Amt		Importe notional inicial de la pata1	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/calculationPeriodAmount/calculation/notionalSchedule/notionalStepSchedule/initialValue
3.7		Leg_Type1	Logic		Indica el tipo de interes aplicado es Fijo= FIX o Flotante=FL	Si tiene (/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/calculationPeriodAmount

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
						nt/calculation/fixRateSchedule/initialValue) será FIX, sino será FL
3.8		Currency2	Currency ISO Currency Code (3 digits)		Divisa de la pata2 de la operación	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[2]/calculationPeriodAmount/calculation/notionalSchedule/notionalStepSchedule/currency
3.9		Notional2	Amt		Importe notional inicial de la pata2	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[2]/calculationPeriodAmount/calculation/notionalSchedule/notionalStepSchedule/initialValue
3.10		Leg_Type2	Logic		Indica el tipo de interes aplicado es Fijo= FIX o Flotante=FL	Si tiene (/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/calculationPeriodAmount/calculation/fixRateSchedule/initialValue) será FIX, sino será 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	Si el payerPartyReference
3.13		Trade Date	LocalDate		Fecha de contratación de la operación	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/partyTradeInformation/executionDateTime
3.14		Maturity Date	LocalDate		Fecha fin de la operación	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/calculationPeriodDates/terminationDate/adjustedDate
4		GRUPO COMPENSACIÓN				
4.1		SwapClearingGroup	String(12)		Grupo de compensación	/valuationReport/portfolioValuationItem/bme:swapClearingGroup with swapClearingGroupScheme="http://www.bmeclearing.es/swap-clearing-group

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
5		OPERACIÓN			Datos principales de la producto	
					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	
5.1		Reg Timestamp	timestamp		Vencimiento V: Fecha y Hora en la que se registra el vencimiento.	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/partyTradeInformation/timestamps/submittedForClearing
					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	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/partyTradeIdentifier/tradeId with tradeIdScheme="http://www.bmeclearing.es/previous-ccp-trade-id"
5.3		Initial Trade Id	String		CCP Trade ID Inicial	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/partyTradeIdentifier/tradeId with tradeIdScheme="http://www.bmeclearing.es/initial-ccp-trade-id"
5.4		Initial Market Code	String		Código de mercado inicial	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/partyTradeIdentifier/tradeId with tradeIdScheme="http://www.bmeclearing.es/initial-market-code"
5.5		Initial trading datetime	LocalDate		Fecha y hora de la contratación del trade Inicial	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/partyTradeInformation/executionDateTime

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
5.6		Initial Trade Type	String		Tipo de trade inicial	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/partyTradeInformation/bme:tradeType with tradeIdScheme="http://www.bmeclearing.es/initial-trade-type"
5.7		Open-Close-Indicator	Values{O, C}		Indica si la operación abre ("O"=Open) o cierra ("C"=Close) la posición	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/partyTradeInformation/bme:openCloseIndicator
5.8		CCP Grouping Id	String		Código de grupo	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/partyTradeIdentifier/bme:groupId with groupIdScheme="http://www.bmeclearing.es/ccp-grouping-id"
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	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/partyTradeInformation/bme:tradeType with tradeIdScheme="http://www.bmeclearing.es/trade-type"
5.10		Rate_leg1	Decimal	Rate expressed in parts per one: 0.05 equals 5% With a maximum of 8 decimal places.	El tipo Fijo o Flotante de la rama/pata 1	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/calculationPeriodAmount/calculation/fixRateSchedule/initialValue
5.11		Rate_leg2	Decimal	Rate expressed in parts per one: 0.05 equals 5% With a maximum of 8 decimal places.	El tipo Fijo o Flotante de la rama/pata 2	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[2]/calculationPeriodAmount/calculation/fixRateSchedule/initialValue

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
5.12	UTI		String		UTI de la operación	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/partyTradeIdentifier/tradeId with tradeIdScheme="http://www.fpml.org/coding-scheme/external/unique-transaction-identifier"
5.13	Not Transferred Quantity		Amt		Cantidad no transferida	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/calculationPeriodAmount/calculation/notionalSchedule/notionalStepSchedule/initialValue
5.14	Netting ID		String		Identificador de netting generado por la cámara	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/partyTradeIdentifier/bme:nettingId

NOMBRE DEL FICHERO	COPINIRSFRA
CÓDIGO DEL FICHERO	REP-OPIN-002
DESCRIPCIÓN	La información en este fichero CSV, en FpML se proporciona en el fichero CCOUPONS
GRUPO	POSICIÓN ABIERTA
DESTINARIOS	Miembro de la CCP
PRIVACIDAD	Contiene datos privados
HORARIO DE PUBLICACIÓN	ID y EoD

NOMBRE DEL FICHERO	CCOUPONS
CÓDIGO DEL FICHERO	REP-OPIN-003
DESCRIPCIÓN	Se informa a nivel Miembro y Cuenta el detalle por operación de todas las operaciones vivas de Swaps y FRAs, indicando el estado de la operación y su valoración, el importe de todos los cupones fijados y estimados a cobrar/pagar, así como los considerations estimados a durante toda la vida de la operación. Este reporte contiene Swaps y FRA's.
GRUPO	POSICIÓN ABIERTA
DESTINARIOS	Miembro de la CCP
PRIVACIDAD	Contiene datos privados
HORARIO DE PUBLICACIÓN	ID y EoD

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
1		REPORTE	-		Elementos que componen la cabecera del reporte	
1.1		exchName	String		ClearingHouseId, Nombre o código corto de la Cámara	/valuationReport/reportIdentification/bme:ccpId with ccpIdScheme="http://www.bmeclearing.es/ccp-id"
1.2		contractGroup	String(2)		Segmento	/valuationReport/reportIdentification/bme:segmentId with segmentIdScheme="http://www.bmeclearing.es/segment-id"
1.3		rptCod	String		Código del informe	/valuationReport/reportIdentification/reportId with reportIdScheme="http://www.bmeclearing.es/report-id"
1.4		rptName	String		Nombre del informe	/valuationReport/dataSetName
1.5		rptType	Values{Intraday, EndOfDay}		Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión	/valuationReport/reportIdentification/bme:reportType with reportTypeScheme="http://www.bmeclearing.es/report-type" 1. If ITD, Intraday 2. If EoD, EndOfDay
1.6		rptSessionDate	LocalDate		Fecha de sesión	/valuationReport/asOfDate
1.7		rptPrntRunDat	LocalDate		Fecha y Hora de creación del informe	/valuationReport/header/creationTimestamp
1.8		CCPMember	String		Código del miembro destinatario del reporte. Si CCPMember es No	/valuationReport/reportContents/partyReference

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
					Compensador el reporte contiene las operaciones de sus cuentas (propias y de clientes; Member = CCPMember). Si CCPMember es Compensador el reporte contiene, además de 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	ForEach Miembro, set /valuationReport/party with /valuationReport/party/partyId and partyIdScheme="http://www.bmeclearing.es/party-id" [If SWIFT Code, partyIdScheme="http://www.fpml.org/coding-scheme/external/iso9362"]
2.2	ClearingMember		String		Código del miembro compensador	ForEach Miembro, then: /valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.bmeclearing.es/clearing-party-id" And, if ClearingMember, then: /valuationReport/party/@id is pointing to /valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/partyTradeInformation[partyReference pointing to Clearing Member]/relatedParty[partyReference pointing to Clearing Member]/role = "ClearingFirm"

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
2.3		PositionAccount	String(12)		Código de la Cuenta de Posición en la CCP	/valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.bmeclearing.es/position-account-id"
2.4		LEI	String(20)		LEI de la entidad a nombre de quien está la cuenta	/valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.fpml.org/coding-scheme/external/iso17442"
2.5		AccountClass	Value{CP, CI}		Tipo de cuenta en la que se registran las operaciones, Cuenta propia ("CP") o Cuenta Individual ("CI")	/valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.fpml.org/coding-scheme/account-type"
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	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/tradeId with tradeIdScheme="http://www.bmeclearing.es/initial-ccp-trade-id"
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)	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/tradeId with tradeIdScheme="http://www.swapswire.com/spec/2001/trade-id-1-0"
3.3		Approved Trade Source Trade Id - BETA	String		ID en la plataforma de aceptación de la operación novada en la ECC	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/tradeId with tradeIdScheme="http://www.swapswire.com/approved-trade-source-beta"
3.4		ContractCode	String		Codificación de los contratos del segmento IRS en la CCP, (Ver documento Codificación de los contratos de IRS), IRS	

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
					Segment contracts coding.	
3.5		Currency1	Currency ISO Currency Code (3 digits)		Divisa de la pata1 de la operación	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/calculationPeriodAmount/calculation/notionalSchedule/notionalStepSchedule/currency
3.6		Notional1	Amt		Importe notional inicial de la pata1	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/calculationPeriodAmount/calculation/notionalSchedule/notionalStepSchedule/initialValue
3.7		Leg_Type1	Logic		Indica el tipo de interes aplicado es Fijo= FIX o Flotante=FL	Si tiene (/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/calculationPeriodAmount/calculation/fixRateSchedule/initialValue) será FIX, sino será FL
3.8		Currency2	Currency ISO Currency Code (3 digits)		Divisa de la pata2 de la operación	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[2]/calculationPeriodAmount/calculation/notionalSchedule/notionalStepSchedule/currency
3.9		Notional2	Amt		Importe notional inicial de la pata2	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[2]/calculationPeriodAmount/calculation/notionalSchedule/notionalStepSchedule/initialValue
3.10		Leg_Type2	Logic		Indica el tipo de interes aplicado es Fijo= FIX o Flotante=FL	Si tiene (/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/calculationPeriodAmount/calculation/fixRateSchedule/initialValue) será FIX, sino será 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	Si el payerPartyReference
3.13		Trade Date	LocalDate		Fecha de contratación de la operación	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/partyTradeInformation/executionDateTime
3.14		Maturity Date	LocalDate		Fecha de terminación de la operación	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/calculationPeriodDates/terminationDate/adjustedDate

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
4		GRUPO COMPENSACIÓN				
4.1		SwapClearingGroup	String(12)		Grupo de compensación	/valuationReport/portfolioValuationItem/bme:swapClearingGroup with swapClearingGroupScheme="http://www.bmeclearing.es/swap-clearing-group"
5		CUPONES				
		Cupones futuros de la operación				
5.1		LegType	Logic		Indica el tipo de interes aplicado es Fijo= FIX o Flotante=FL	FIX si tiene /valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/fixedRate
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.	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream/calculationPeriodAmount/calculation/floatingRateCalculation/floatingRateIndex
5.4		Index_A	String		Para stubs de pata variable, nombre del índice de tipo de interés subyacente con el que se hara la interpolación	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream/stubCalculationPeriodAmount/initialStub/floatingRate/floatingRateIndex
5.5		Index Tenor_A	String	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 hara la interpolación	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream/stubCalculationPeriodAmount/initialStub/floatingRate/indexTenor
5.6		Index_B	String		Para stubs de pata variable, nombre del índice de tipo de interés subyacente	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream/stubCalculationPeriodAmount/finalStub/floatingRate/floatingRateIndex

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
					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	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/wapStream/stubCalculationPeriodAmount/finalStub/floatingRate/indexTenor
5.8		startDate	LocalDate		Fecha de inicio del cupón	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/wapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/adjustedStartDate
5.9		endDate	LocalDate		Fecha de fin del cupón	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/wapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/adjustedEndDate
5.10		fixingDate	LocalDate		Fecha fixing del cupón	Basándonos en el calendario de reseteo: /valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/wapStream/resetDates/businessCenters/businessCenter Aplicaremos el siguiente offset al campo #4.8 (definido aquí /valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/wapStream/resetDates/resetRelativeTo): /valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/wapStream/resetDates/fixingDates/dayType /valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/wapStream/resetDates/fixingDates/period /valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/wapStream/resetDates/fixingDates/periodMultiplier
5.11		paymentDate	LocalDate		Fecha de pago del cupón	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/wapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/adjustedPaymentDate
5.12		Accrual_factor	Decimal	With a maximum of 9 decimal places	Número de días del periodo de cálculo del cupón	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/wapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/dayCountYearFraction

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
5.13	fixed		String	"S" -> Sí "N" -> No	Si ya esta fijado.	
5.14	Settled		String	Ver Tabla Settle	Si el cupón ha sido ya liquidado.	Si siempre y cuando #4.11 < today (si la fecha de pago del cupón esta en el pasado)
5.15	Coupon Currency		Currency ISO Currency Code (3 digits)		Divisa del cupón	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/wapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/forecastPaymentAmount/currency
5.16	CouponAmount		Amt		Importe del Nominal	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/wapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/forecastPaymentAmount/amount
5.17	Notional		Amt		Importe nocional del cupón	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/wapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/notionalAmount
5.18	spread		Decimal	Rate expressed in parts per one: 0.05 equals 5% With a maximum of 8 decimal places.	Spread de la operación	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/wapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/floatingRateDefinition/spread
5.19	rate		Decimal	Rate expressed in parts per one: 0.05 equals 5% With a maximum of 8 decimal places.	Tipo de interés aplicado con decimales, si es FIX es el valor del tipo fijo; si es FL: Es el valor del fixing oficial	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/wapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/floatingRateDefinition/calculatedRate
5.20	Compounding method		String	"Flat" "Straight" blancos	Método de compounding para la pata/rama	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/wapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/compoundingMethod

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
5.21		Business Day Centers	String (cadena de string(4) separados por el carácter)		Centros de negocio a los que pertenece el Trade	Todos los /valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/wapStream/resetDates/businessCenters/businessCenter
5.22		Business Day Convention	String	"FOLLOWING" " "MODFOLLOWING" "PRECEDING" "NONE"	Convención de día Hábil	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/wapStream/resetDates/resetDatesAdjustments/businessDayConvention
5.23		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	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/wapStream/calculationPeriodAmount/calculation/dayCountFraction
5.24		Discount factor	Decimal	Rate expressed in parts per one: 0.05 equals 5% With a maximum of	Factor de descuento utilizado	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/wapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/discountFactor

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
				15 decimal places.		
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	With a maximum of 15 decimal places	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 sus liquidación son la misma.	
5.29		Exchange Rate Fixng Date	LocalDate		Fecha de fixing de la tasa de cambio para el cupón	

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
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	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/unadjustedStartDate
6.2		Unadjusted endDate	LocalDate		Fecha Fin del periodo desajustada	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/calculationPeriod/unadjustedEndDate
7 NPV						
7.1		Coupon NPV - Currency	Amt		Importe del Net Present Value del cupón. En la divisa del cupón.	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream/cashflows/paymentCalculationPeriod/presentValueAmount/amount
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.	
OPERACIÓN						

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
8		IDs Y ESTADO			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	
8.1		Reg Timestamp	timestamp			
8.2		Previous Trade Id	String		CCP Trade ID Previo	
8.3		Initial Trade Id	String		CCP Trade ID Inicial	

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
8.4		Initial Market Code	String		Código de mercado inicial	
8.5		Initial trading datetime	LocalDate		Fecha y hora de la contratación del trade Inicial	
8.6		Initial Trade Type	String		Tipo de trade inicial	
8.7		Approved Trade Source Trade Group Id	String		Id de grupo en la plataforma de aceptación, swGroupId	
8.8		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	
8.9		CCP Status	Values{Accepted}		Estado en el que se encuentra la operación, en este caso "NOVATED"	
8.10		CCP Grouping Id	String		Código de grupo en CLIVETRADES	
8.11		TradeType	String		Tipo de Operación definido por BME Clearing, La codificación de este	

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
					campo está en el Anexo I de este documento	
8.12		open-close indicator	Values{O, C}		Indica si la operación abre ("O"=Open) o cierra ("C"=Close) la posición	
8.13		Netting id	String		Identificador de netting generado por la cámara	
8.14		User netting id	String		Identificador de netting aportado por el cliente	
8.15		Block o Allocation Indicator	String		Indica si la operación pertenece a un grupo de operación o a Allocation	
8.16		Block o Allocation Id	String		Identificador del Bloque o Allocation al que pertenece la operación	
8.17		ClientTradeld	String		Identificación de la operación en los sistemas del cliente	
8.18		ClearingMember Tradeld	String		Identificación de la operación en los sistemas del MC	
8.19		ClearingMember Block	String		ID de la contrapartida que ejecuta la contratación en bloque	

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
8.20		UTI-CCP	String		UTI generado en el momento de la novación	
8.21		Prior-UTI	String		UTI previo a la novación	
9		RAMA SWAP 1				
		DATOS BÁSICOS RAMA SWAP 1				
9.1		Leg_Side 1	String(1)	"P" -> Pay "R" -> Receive	Indica si la rama es de pago o de cobro.	<p>For Swaps:</p> <p>if /valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/calculationPeriodAmount/calculation/fixedRateSchedule with /valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/payerPartyReference/@href pointing to /valuationReport/party/@id (Clearing Member Party) then "P"</p> <p>if /valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/calculationPeriodAmount/calculation/fixedRateSchedule with /valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/receiverPartyReference/@href pointing to /valuationReport/party/@id (Clearing Member Party) then "R"</p> <p>For FRA:</p> <p>if: /valuationReport/tradeValuationItem/trade/fra/buyerPartyReference/@href pointing to /valuationReport/party/@id (Clearing Member Party) then "P"</p> <p>if /valuationReport/tradeValuationItem/trade/fra/sellerPartyReference/@href pointing to /valuationReport/party/@id (Clearing Member Party) then "R"</p>
9.2		Effective Date 1	LocalDate		Fecha efectiva de la operación en la rama/pata 1	
9.3		Maturity Date Leg 1	LocalDate		Fecha fin de la operación en la rama/pata 1	

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
9.4		Index 1	String		Nombre del índice de tipo de interés subyacente	
9.5		IndexTenor 1 Period	period: Value{D, W, M, Y}		Tenor del índice de tipo de interés subyacente	
9.6		IndexTenor 1 PeriodMultiplier	periodMultiplier: Positive Integer		Frecuencia del Índice de Referencia	
9.7		Rate 1	Decimal	Rate expressed in parts per one: 0.05 equals 5% With a maximum of 8 decimal places.	Tipo de interés aplicado con decimales, si es FIX es el valor del tipo fijo; si es FL: Es el valor del fixing oficial	
9.8		Spread 1	Decimal	Rate expressed in parts per one: 0.05 equals 5% With a maximum of 8 decimal places.	Spread de la operación	
9.9		Day Count Fraction 1	String	"30/360" "30E/360" "30E/360.ISDA" "ACT/360" "ACT/365.FIXED"	Convención que regula el número de días incluidos en el cálculo de los intereses	

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
				"ACT/365.ISD A" "ACT/ACT.IC MA" "ACT/ACT.ISD A" "ACT/ACT.IS MA"		
9.10		Business Day Convention Effective Date 1	String	"FOLLOWING" " "MODFOLLOWING" "PRECEDING" "NONE"	Convención de día Hábil de la fecha de inicio de la operación.	
9.11		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 ram/pata 1.	
9.12		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	
9.13		Compounding method 1	String	"Flat" "Straight" blancos	Método de compounding para la pata/rama 1: "Flat", "Straight" o en blanco	
9.14		Compounding period 1 Period	period: Value{D, W, M, Y}		Periodo de compounding para la pata/rama 1	

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
9.15		Compounding period 1 PeriodMultiplier	periodMultiplier: Positive Integer		Periodo de compounding para la pata/rama 1	
9.16		Payment Period 1 Period	period: Value{D, W, M, Y}		Periodo de Pago para la rama/pata 1	
9.17		Payment Period 1 PeriodMultiplier	periodMultiplier: Positive Integer		Periodo de Pago para la rama/pata 1	
9.18		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.	
9.19		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.	
9.20		Exchange Rate Business Centers 1	String (cadena de string(4) separados		Centros de negocios por los que se rige el	

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
			por el carácter)		índice de la tasa de cambio de la pata 1 . .	
9.21		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	
9.22		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	
9.23		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						
9.24		Initial Stub Method 1	String	"ShortInitial" "LongInitial" blancos	Tipo de stub	
9.25		Initial Stub First Index 1	String		1er índice de referencia de interpolación	
9.26		Initial Stub Second Index 1	String		2do índice de referencia de interpolación	

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
9.27		First Reg Period Start Date 1	LocalDate		Fecha efectiva del primer periodo regular de la pata 1	
STUB FINAL RAMA 1						
9.28		Final Stub Method 1	String	"ShortFinal" "LongFinal" blancos	Tipo de stub	
9.29		Final Stub First Index 1	String		Primer índice del stub final de la pata 1	
9.30		Final Stub Second Index 1	String		Segundo índice del stub final de la pata 1	
9.31		Last Reg Period End Date 1	LocalDate		Fecha efectiva del último periodo regular de la pata 1	
FECHAS DESAJUSTADAS RAMA SWAP 1						
9.32		Unadjusted effective Date 1	LocalDate		Fecha desajustada efectiva de la operación en la rama/pata 1	
9.33		Unadjusted Maturity Date 1	LocalDate		Fecha desajustada de fin de la operación en la rama/pata 1	
9.34		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	
9.35		Business Day Convention Last Regular Period Date 1	String	"FOLLOWING" " "MODFOLLOWING"	Convención de día Hábil para las fechas de finales de periodos de cálculo	

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
				"PRECEDING" "NONE"	de cupón en la rama/pata 1	
9.36		Business Day Convention Payment Date 1	String	"FOLLOWING" " "MODFOLLO WING" "PRECEDING" "NONE"	Convención de día Hábil para las fechas de pago de cupones en la rama/pata 1	
10 RAMA SWAP 2						
DATOS BÁSICOS RAMA SWAP 2						
10.1		Leg_Side 2	String(1)	"P" -> Pay "R" -> Receive	Indica si la rama es de pago o de cobro.	For Swaps: if /valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[2]/calculationPeriodAmount/calculation/fixedRateSchedule with /valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[2]/payerPartyReference/@href pointing to /valuationReport/party/@id (Clearing Member Party) then "P" if /valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[2]/calculationPeriodAmount/calculation/fixedRateSchedule with /valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[2]/receiverPartyReference/@href pointing to /valuationReport/party/@id (Clearing Member Party) then "R" For FRA: if: /valuationReport/tradeValuationItem/trade/fra/buyerPartyReference/@href pointing to /valuationReport/party/@id (Clearing Member Party) then "P" if /valuationReport/tradeValuationItem/trade/fra/sellerPartyReference/@href pointing to /valuationReport/party/@id (Clearing Member Party) then "R"
10.2		Effective Date 2	LocalDate		Fecha efectiva de la operación en la rama/pata 2	

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
10.3		Maturity Date Leg 2	LocalDate		Fecha fin de la operación en la rama/pata 2	
10.4		Index 2	String		Nombre del índice referencia en caso de que el tipo de pata o rama se Flotante=FL Ej: EUR-EURIBOR-3M	
10.5		IndexTenor 2 Period	period: Value{D, W, M, Y} periodMultiplier: Positive Integer		Tenor del índice de tipo de interés subyacente	
10.6		IndexTenor 2 PeriodMultiplier	periodMultiplier: Positive Integer		Frecuencia del Índice de Referencia	
10.7		Rate 2	Decimal	Rate expressed in parts per one: 0.05 equals 5% With a maximum of 8 decimal places.	Tipo de interés aplicado con decimales, si es FIX es el valor del tipo fijo; si es FL: Es el valor del fixing oficial	
10.8		Spread 2	Decimal	Rate expressed in parts per one: 0.05 equals 5% With a maximum of	Spread de la operación	

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
				8 decimal places.		
10.9		Day Count Fraction 2	String	"30/360" "30E/360" "30E/360.ISD A" "ACT/360" "ACT/365.FIX ED" "ACT/365.ISD A" "ACT/ACT.IC MA" "ACT/ACT.ISD A" "ACT/ACT.IS MA"	Convención que regula el número de días incluidos en el cálculo de los intereses	
10.10		Business Day Convention Effective Date 2	String	"FOLLOWING" " "MODFOLLOWING" "PRECEDING" "NONE"	Convención de día Hábil de la fecha de inicio de la operación.	
10.11		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 ram/pata 2.	
10.12		Roll Convention 2	String	Valor numérico de un día de mes "EOM"	Convención de Fecha Fin de periodo que aplica desde el Start date	

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
				"IMM" "NONE"		
10.13		Compounding method 2	String	"Flat" "Straight" blancos	Método de compounding para la pata/rama 1: "Flat", "Straight" o en blanco	
10.14		Compounding period 2 Period	period: Value{D, W, M, Y}		Periodo de compounding para la pata/rama 2	
10.15		Compounding period 2 PeriodMultiplier	periodMultiplier: Positive Integer		Periodo de compounding para la pata/rama 2	
10.16		Payment Period 2 Period	period: Value{D, W, M, Y}		Periodo de Pago para la rama/pata 2	
10.17		Payment Period 2 PeriodMultiplier	periodMultiplier: Positive Integer		Periodo de Pago para la rama/pata 2	
10.18		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.	
10.19		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.	

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
					Este campo y los siguientes referidos a esta tasa de cambio irán en blanco si ambas divisas son la misma.	
10.20		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 . .	
10.21		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	
10.22		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	
10.23		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						
10.24		Initial Stub Method 2	String	"ShortInitial" "LongInitial" blancos	Tipo de stub	

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
10.25		Initial Stub First Index 2	String		1er índice de referencia de interpolación	
10.26		Initial Stub Second Index 2	String		2do índice de referencia de interpolación	
10.27		First Reg Period Start Date 2	LocalDate		Fecha efectiva del primer periodo regular de la pata 2	
STUB FINAL RAMA 2						
10.28		Final Stub Method 2	String	"ShortFinal" "LongFinal" blancos	Tipo de stub	
10.29		Final Stub First Index 2	String		Primer índice del stub final de la pata 2	
10.30		Final Stub Second Index 2	String		Segundo índice del stub final de la pata 2	
10.31		Last Reg Period End Date 2	LocalDate		Fecha efectiva del último periodo regular de la pata 2	
FECHAS DESAJUSTADAS RAMA SWAP 2						
10.32		Unadjusted effective Date 2	LocalDate		Fecha desajustada efectiva de la operación en la rama/pata 2	
10.33		Unadjusted Maturity Date 2	LocalDate		Fecha desajustada de fin de la operación en la rama/pata 2	
10.34		Business Day Convention Maturity Date 2	String	"FOLLOWING" " "MODFOLLOWING"	Convención de día Hábil para la fecha de Vencimiento de la operación en la rama/pata 2	

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
				"PRECEDING" "NONE"		
10.35		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	
10.36		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	
11		DATOS FRA				
		DATOS BÁSICOS FRA				
11.1		FRA Effective Date	LocalDate		Fecha efectiva de la operación	
11.2		FRA Index	String		Nombre del índice de tipo de interés subyacente	
11.3		FRA IndexTenor Period	period: Value{D, W, M, Y}		Tenor del índice de tipo de interés subyacente	
11.4		FRA IndexTenor PeriodMultiplier	periodMultiplier: Positive Integer		Tenor del índice de tipo de interés subyacente	
11.5		FRAFixedRate	Decimal	Rate expressed in parts per one: 0.05 equals 5%	Tipo fijo pactado para la operación	

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
				With a maximum of 8 decimal places.		
11.6		FRA Day Count Fraction	String	"30/360" "30E/360" "30E/360.ISD A" "ACT/360" "ACT/365.FIX ED" "ACT/365.ISD A" "ACT/ACT.IC MA" "ACT/ACT.ISD A" "ACT/ACT.IS MA"	Convención que regula el número de días incluidos en el cálculo de los intereses	
11.7		FRA Business Day Convention	String	"FOLLOWING" " "MODFOLLOWING" "PRECEDING" "NONE"	Convención de día Hábil de la fecha de inicio de la operación.	
11.8		FRA Business Centers	String (cadena de string(4) separados por el carácter)		Centros de negocios a los que pertenece el Trade	
FECHAS DESAJUSTADAS FRA						
11.9		FRA Unadjusted effective Date	LocalDate		Fecha desajustada efectiva de la operación	

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
11.10		FRA Unadjusted Maturity Date	LocalDate		Fecha desajustada de fin de la operación	
12		NPV				
12.1		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) <u>No aplica para FRAs</u>	
12.2		Leg 1 NPV - Settlement Currency	Amt		Importe del Net Present Value total de la pata 1 de la operación. La divisa es Settlement Currency (campo 3.12) <u>No aplica para FRAs</u>	
12.3		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) <u>No aplica para FRAs</u>	
12.4		Leg 2 NPV - Settlement Currency	Amt		Importe del Net Present Value total de la pata 1 de la operación. La divisa es Settlement Currency (campo 3.12) <u>No aplica para FRAs</u>	

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
12.5		Considerations NPV	Amt		Importe del Net Present Value total de todos los pagos adicionales . En la divisa de liquidación.	
12.6		Trade NPV	Amt		Importe del Net Present Value total de la operación. En la divisa de liquidación.	
12.7		Trade Previous NPV	Amt		Importe anterior del Net Present Value total por operación. En la divisa de liquidación.	
13		ADDITIONAL PAYMENTS (CONSIDERATIONS).			Datos de los pagos adicionales Hasta 6 posibles pagos	
13.1		Amount	Amt		Pagos adicionales futuros a pagar durante la vida de la operación	
13.2		ConsiderationDate	LocalDate		Fecha de pago de los flujo adicionales	
13.3		CCP Status (Consideration Status)	String	Ver Tabla Settle	Estado en el que se encuentra el consideration (S-Liquidado, N-No liquidado, OTC-Liquidado en bilateral)	
13.4		Consideration Currency	Currency ISO Currency Code (3 digits)		Divisa del Consideration. Debe ser necesariamente	

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
					la divisa de liquidación de la operación.	
13.5		Discount factor	Decimal	Rate expressed in parts per one: 0.05 equals 5% With a maximum of 15 decimal places.	Factor de descuento utilizado	
13.6		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.	
13.7		Exchange Rate Fixng Date	LocalDate		Fecha de fixing de la tasa de cambio para el consideration	
13.8		Exchange Rate Fixed	String	"S" -> Sí "N" -> No	Si la tasa de cambio ya está fijada.	
13.9		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	FpML
14	NPV					
14.1		Consideration NPV - Currency	Amt		NPV del Consideration.	
14.2		Consideration NPV - Settlement Currency	Amt		Importe del Net Present Value del consideration. En la divisa de liquidación del consideration.	
14.3		Consideration Previous NPV	Amt		Valor neto presente anterior del consideration. En la divisa de liquidación del consideration.	

NOMBRE DEL FICHERO	CCONSIDERATIONS
CÓDIGO DEL FICHERO	REP-OPIN-004
DESCRIPCIÓN	La información en este fichero CSV, en FpML se proporciona en el fichero CCOUPONS
GRUPO	POSICIÓN ABIERTA
DESTINARIOS	Miembro de la CCP
PRIVACIDAD	Contiene datos privados
HORARIO DE PUBLICACIÓN	ID y EoD

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	EoD y ID

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
1	REPORTE				Elementos que componen la cabecera del reporte	
1.1		exchName	String	ClearingHouseId, Nombre o código corto de la Cámara		/eventActivityReport/reportIdentification/bme:ccpId with ccpldScheme="http://www.bmeclearing.es/ccp-id"
1.2		contractGroup	String	Segmento		/eventActivityReport/reportIdentification/bme:segmentId with segmentIdScheme="http://www.bmeclearing.es/segment-id"
1.3		rptCod	String	Código del informe		/eventActivityReport/reportIdentification/reportId with reportIdScheme="http://www.bmeclearing.es/report-id"
1.4		rptName	String	Nombre del informe		/eventActivityReport/dataSetName
1.5		rptType	Values{Intraday, EndOfDay}	Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión		/eventActivityReport/reportIdentification/bme:reportType with reportTypeScheme="http://www.bmeclearing.es/report-type"

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
						1. If ITD, Intraday 2. If EoD, EndOfDay
1.6		rptSessionDate	YYYY-MM-DD		Fecha de Sesión de los datos del informe	/eventActivityReport/asOfDate
1.7		rptPrntRunDat	YYYY-MM-DDTHH:MM:SS		Fecha y Hora de creación del informe	/eventActivityReport/header/creationTimestamp
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	/eventActivityReport/bme:fixing/bme:rateType
2.2		Fixing Date	YYYY-MM-DD		Fecha del fixing: YYYY-MM-DD	/eventActivityReport/bme:fixing/bme:rateObservation/adjustedFixingDate
2.3		Encrypted	Values{0,1}		Indicador de encriptación de fixing (0=No encriptado 1= Encriptado)	/eventActivityReport/bme:fixing/bme:rateObservation/bme:encrypted
2.4		Source	String		Descripción de la fuente de publicación, ej:RIC Reuters, InfoValmer	Publication Source is set in @floatingRateIndexScheme /eventActivityReport/bme:fixing/bme:index/floatingRateIndex/@floatingRateIndexScheme
3 TIPO INTERÉS					Indice de referencia	ForEach Index, set /eventActivityReport/bme:fixing/bme:index
3.1		Index name	String		Nombre del índice de referencia. Ejem: EUR-EURIBOR-REUTERS	/eventActivityReport/bme:fixing/bme:fixing/floatingRateIndex For ISDA Codes: floatingRateIndexScheme="http://www.fpml.org/coding-scheme/floating-rate-index-2-12.xml"
3.2		Index currency	Currency ISO Currency Code (3 digits)		Divisa del índice	/eventActivityReport/bme:fixing/bme:index/bme:currency
3.3		Index calendar	String		Código del centro financiero según estandar SWIFT. Ej: EUTA, COBO	/eventActivityReport/bme:fixing/bme:index/bme:businessCenters/businessCenter

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
3.4		Index ID	String		Identificador de índice en el resto de reportes	No reportado/Not reported
3.5		Tenor period	period: Value{D, W, M, Y}			/eventActivityReport/bme:fixing/bme:index/indexTenor/period
3.6		Tenor multiplier	periodMultiplier: Positive Integer			/eventActivityReport/bme:fixing/bme:index/indexTenor/periodMultiplier
3.7		Tenor symbol	String		Ejem: O/N, 1M, ...	3M is set as periodMultiplier=3 and period=M: /eventActivityReport/bme:fixing/bme:index/indexTenor/[periodMultiplier + period]
3.8		Maturity Date	YYYY-MM-DD		Fecha de vencimiento	/eventActivityReport/bme:fixing/bme:rateObservation/bme:maturityDate
3.9		InterestRate	Decimal	Rate expressed in parts per one: 0.05 equals 5%. With a maximum of 8 decimal places.	Valor del tipo de referencia publicado en la fecha de publicación	/eventActivityReport/bme:fixing/bme:rateObservation/observedRate
4		TIPO CAMBIO			Indice de referencia	
4.1		Currency pair	String	"Currency1/Currency2" where currencies are ISO Currency Codes (3 digits)	Currency1/Currency2	/eventActivityReport/bme:fixing/bme:exchangeRate/quotedCurrencyPair/currency1 /eventActivityReport/bme:fixing/bme:exchangeRate/quotedCurrencyPair/currency2 /eventActivityReport/bme:fixing/bme:exchangeRate/quotedCurrencyPair/quoteBasis
4.2		ExchangeRate	Decimal	Rate expressed in parts per one: 0.05 equals 5%. With a	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.	/eventActivityReport/bme:fixing/bme:exchangeRate/rate

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
				maximum of 5 decimal places.		

NOMBRE DEL FICHERO		CCALENDAR
CÓDIGO DEL FICHERO		REP-GENDAT-002
DESCRIPCION		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	FpML
1		REPORTE			Elementos que componen la cabecera del reporte	
1.1		exchName	String		ClearingHouseId, Nombre o código corto de la Cámara	/calendarReport/reportIdentification/bme:ccpld with ccpldScheme="http://www.bmeclearing.es/ccp-id"
1.2		contractGroup	String(2)		Segmento	/calendarReport/reportIdentification/bme:segmentId with segmentIdScheme="http://www.bmeclearing.es/segment-id"
1.3		rptCod	String		Código del informe	/calendarReport/reportIdentification/reportId with reportIdScheme="http://www.bmeclearing.es/report-id"
1.4		rptName	String		Nombre del informe	/calendarReport/dataSetName

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
1.5	rptType		Values{Intraday, EndOfDay}	Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión		/calendarReport/reportIdentification/bme:reportType with reportTypeScheme="http://www.bme clearing.es/report-type" 1. If ITD, Intraday 2. If EoD, EndOfDay
1.6	rptSessionDate		YYYY-MM-DD	Fecha de Sesión de los datos del informe		/calendarReport/asOfDate
1.7	rptPrntRunDat		YYYY-MM-DDTHH:MM:SS	Fecha y Hora de creación del informe		/calendarReport/header/creationTimestamp
2		HOLIDAY		Día no laborable		
2.1	Business Center			Código del centro financiero según estándar SWIFT. Ej: EUTA		/calendarReport/bme:calendar/bme:byBusinessCenter/bme:businessCenter
2.2	Business Center Description			Nombre del centro financiero		/calendarReport/bme:calendar/bme:byBusinessCenter/bme:businessCenterDescription
2.3	Holiday Date			Fecha no laborable		/calendarReport/bme:calendar/bme:byBusinessCenter/bme:holidayDate/bme:date
2.4	Description			Descripción del día		/calendarReport/bme:calendar/bme:byBusinessCenter/bme:holidayDate/bme:dateDescription
2.5	Holiday Date Source			Proveedor		/calendarReport/bme:calendar/bme:byBusinessCenter/bme:holidayDate/bme:dateSource with dateSourceScheme="http://www.bme clearing.es/date-source"

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	FpML
1		REPORTE			Elementos que componen la cabecera del reporte	
1.1		exchName	String		ClearingHouseId, Nombre o código corto de la Cámara	/valuationReport/reportIdentification/bme:ccpId with ccpldScheme="http://www.bmeclearing.es/ccp-id"
1.2		contractGroup	String(2)		Segmento	/valuationReport/reportIdentification/bme:segmentId with segmentIdScheme="http://www.bmeclearing.es/segment-id"
1.3		rptCod	String		Código del informe	/valuationReport/reportIdentification/reportId with reportIdScheme="http://www.bmeclearing.es/report-id"
1.4		rptName	String		Nombre del informe	/valuationReport/dataSetName
1.5		rptType	Values{Intraday, EndOfDay}		Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión	/valuationReport/reportIdentification/bme:reportType with reportTypeScheme="http://www.bmeclearing.es/report-type" 1. If ITD, Intraday 2. If EoD, EndOfDay

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
1.6		rptSessionDate	YYYY-MM-DD		Fecha de Sesión de los datos del informe	/valuationReport/asOfDate
1.7		rptPrntRunDat	YYYY-MM-DDTHH:MM:SS		Fecha y Hora de creación del informe	/valuationReport/header/creationTimestamp
2		CURVAS			Información de la curvas utilizadas	
2.1		Curve Name	String		Nombre de la curva	/valuationReport/market/yieldCurve/name
2.2		Index ID	String		Identificador del índice de referencia de la curva. Se proporciona lo mismo que en el campo "Index name" en CFIXING.	/valuationReport/market/yieldCurve/forecastRateIndex/floatingRateIndex
2.3		Index Multiplier	periodMultiplier: Positive Integer		Tenor de la curva. Los overnight no tendrán tenor.	/valuationReport/market/yieldCurve/forecastRateIndex/indexTenor/periodMultiplier
2.4		Index Period	period: Value{D, W, M, Y, T}		Tenor de la curva. Los overnight no tendrán tenor.	/valuationReport/market/yieldCurve/forecastRateIndex/indexTenor/period
2.5		Index currency	Currency ISO Currency Code (3 digits)		Divisa del índice	/valuationReport/market/yieldCurve/currency
2.6		Index calendar	String		Código del centro financiero según estandar SWIFT. Ej: EUTA, COBO	/valuationReport/market/yieldCurve/bme:businessCenters/businessCenter
2.7		Curve Capture Time	YYYY-MM-DDTHH:MM:SS		Fecha de captura de la curva en formato dd/mm/yyyy hh:mm:ss	/valuationReport/market/yieldCurveValuation/buildDateTime
2.8		Curve Close Date	YYYY-MM-DD		Fecha de cierre de la curva	/valuationReport/market/yieldCurveValuation/endDate with /valuationReport/market/yieldCurveValuation/objectReference/@href pointing to /valuationReport/market/yieldCurve/@id
2.9		KnotPoint Period	period: Value{D, W, M, Y}			/valuationReport/market/yieldCurveValuation/bme:tenor/periodMultiplier with /valuationReport/market/yieldCurveValuation/objectReference/@href pointing to /valuationReport/market/yieldCurve/@id

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
2.10		KnotPoint Multiplier	periodMultiplier: Positive Integer			/valuationReport/market/yieldCurveValuation/bme:tenor/period with /valuationReport/market/yieldCurveValuation/objectReference/@href pointing to /valuationReport/market/yieldCurve/@id
2.11		KnotPoint Symbol	String		Ejem: O/N, 1M, ...	/valuationReport/market/yieldCurveValuation/bme:tenor/[periodMultiplier + period] with /valuationReport/market/yieldCurveValuation/objectReference/@href pointing to /valuationReport/market/yieldCurve/@id
2.12		KnotPoint Effective Date	YYYY-MM-DD		Fecha efectiva del KnotPoint	/valuationReport/market/yieldCurveValuation/bme:effectiveDate with /valuationReport/market/yieldCurveValuation/objectReference/@href pointing to /valuationReport/market/yieldCurve/@id
2.13		KnotPoint Maturity Date	YYYY-MM-DD		Fecha de vencimiento del KnotPoint	/valuationReport/market/yieldCurveValuation/bme:maturityDate/date with /valuationReport/market/yieldCurveValuation/objectReference/@href pointing to /valuationReport/market/yieldCurve/@id
2.14		KnotPoint Maturity Offset Period	period: Value{D}		Offset en días del KnotPoint	/valuationReport/market/yieldCurveValuation/bme:maturityDate/tenor/period with /valuationReport/market/yieldCurveValuation/objectReference/@href pointing to /valuationReport/market/yieldCurve/@id

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
2.15		KnotPoint Maturity Offset Multiplier	periodMultiplier: Positive Integer		Offset en días del KnotPoint	/valuationReport/market/yieldCurveValuation/ bme:maturityDate/tenor/periodMultiplier with /valuationReport/market/yieldCurveValuation/ objectReference/@href pointing to /valuationReport/market/yieldCurve/@id
2.16		Accrual Curve value	In parts per one: 0.05 equals 5%. With a maximum of 15 decimal places.		Valor de la curva "Accrual"	/valuationReport/market/yieldCurveValuation/ bme:maturityDate/accrual with /valuationReport/market/yieldCurveValuation/ objectReference/@href pointing to /valuationReport/market/yieldCurve/@id
2.17		Zero Rate Curve value	In parts per one: 0.05 equals 5%. With a maximum of 15 decimal places.		Valor de la curva "Zero Rate"	/valuationReport/market/yieldCurveValuation/ zeroCurve/rateCurve/point/mid with /valuationReport/market/yieldCurveValuation/ objectReference/@href pointing to /valuationReport/market/yieldCurve/@id
2.18		Discount Curve value	In parts per one: 0.05 equals 5%. With a maximum of 15 decimal places.		Valor de la curva de "Discount"	/valuationReport/market/yieldCurveValuation/ discountFactorCurve/point/mid with /valuationReport/market/yieldCurveValuation/ objectReference/@href pointing to /valuationReport/market/yieldCurve/@id

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	FpML
1		REPORTE			Elementos que componen la cabecera del reporte	
1.1		exchName	String	ClearingHouseId, Nombre o código corto de la Cámara		/valuationReport/reportIdentification/bme:ccpld with ccpldScheme="http://www.bmeclearing.es/ccp-id"
1.2		contractGroup	String(2)	Segmento		/valuationReport/reportIdentification/bme:segmentId with segmentIdScheme="http://www.bmeclearing.es/segment-id"
1.3		rptCod	String	Código del informe		/valuationReport/reportIdentification/reportId with reportIdScheme="http://www.bmeclearing.es/report-id"
1.4		rptName	String	Nombre del informe		/valuationReport/dataSetName
1.5		rptType	Values{Intraday, EndOfDay}	Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión		/valuationReport/reportIdentification/bme:reportType with reportTypeScheme="http://www.bmeclearing.es/report-type" 1. If ITD, Intraday 2. If EoD, EndOfDay

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
1.6		rptSessionDate		YYYY-MM-DD	Fecha de sesión	/valuationReport/asOfDate
1.7		rptPrntRunDat		YYYY-MM-DDTHH:MM:SS	Fecha y Hora de creación del informe	/valuationReport/header/creationTimestamp
2		LIQUIDITY MARGIN			Capacidad del mercado y sobrecoste de iliquidez	
2.1		Currency pair	String	"Currency1/Currency2" where currencies are ISO Currency Codes (3 digits)	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.	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/bme:quoteCurrencyPair/currency1 /valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/bme:quoteCurrencyPair/currency2
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.	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/bme:productType
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.	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/bme:bucket/bme:tenor/period
2.4		Bucket multiplier		periodMultiplier: Positive Integer	Multiplicador del período del bucket en el que se realiza la cobertura. No aplica para FW_NDF.	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/bme:bucket/bme:tenor/periodMultiplier
2.5		Netting		Values{S=Si, N=No}	Indicador si el Bucket se puede netear, con el tramo mas cercano. No aplica para FW_NDF.	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/bme:bucket/bme:netting
2.6		NominalMax		Amt	Tamaño Maximo del nominal en mercado en el Bucket	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/bme:bucket/bme:maxNotional

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
2.7		Notional interval	Positive Integer		El valor de este campo por NominalMax marca la frontera con el siguiente tramo de nominal	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/bme:bucket/bme:notionalInterval/bme:interval
2.8		LiquidityMultiplier	Decimal	In parts per one. With a maximum of 2 decimal places	Multiplicador de Liquidez	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/bme:bucket/bme:notionalInterval/bme:liquidityMultiplier

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	DATOS GENERALES
DESTINARIOS	Todos los usuarios del segmento de la ECC
PRIVACIDAD	Contiene datos públicos
HORARIO DE PUBLICACIÓN	EoD

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
1		REPORTE	COMUN		Elementos que componen la cabecera del reporte	
1.1		exchName	String		ClearingHouseId, Nombre o código corto de la Cámara	/valuationReport/reportIdentification/bme:ccpId with ccpIdScheme="http://www.bmeclearing.es/ccp-id"
1.2		contractGroup	String(2)		Segmento	/valuationReport/reportIdentification/bme:segmentId with segmentIdScheme="http://www.bmeclearing.es/segment-id"
1.3		rptCod	String		Código del informe	/valuationReport/reportIdentification/reportId with

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
						reportIdScheme="http://www.bmeclearing.es/report-id"
1.4		rptName	String		Nombre del informe	/valuationReport/dataSetName
1.5		rptType	Values{Intraday, EndOfDay}		Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión	/valuationReport/reportIdentification/bme:reportType with reportTypeScheme="http://www.bmeclearing.es/report-type" 1. If ITD, Intraday 2. If EoD, EndOfDay
1.6		rptSessionDate	LocalDate		Fecha de sesión	/valuationReport/asOfDate
1.7		rptPrntRunDat	LocalDate		Fecha y Hora de creación del informe	/valuationReport/header/creationTimestamp
2		GENÉRICOS		Características de los productos genéricos de cobertura		
2.1		Risk Factor	String	"ILB" -> Basis "IRT" -> Tipo de interés "XRT" -> Tasa de cambio	Factor de riesgo para el que debe usarse el genérico	/valuationReport/tradeValuationItem/bme:riskFactor/name
2.2		Risk Currency pair	String	"Currency1/Currency2" where currencies are ISO Currency Codes (3 digits)	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. Si el factor de riesgo es "XRT" el riesgo es el del tipo de cambio de Currency1 a Currency2.	/valuationReport/tradeValuationItem/bme:riskFactor/bme:QuotedCurrencyPair/currency1 /valuationReport/tradeValuationItem/bme:riskFactor/bme:QuotedCurrencyPair/currency2
2.3		Generic Product Type	String	SWAP FWNDF	Tipo de producto del genérico	/valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/productType productTypeScheme="http://www.bmeclearing.es/generic-product-type"

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
2.4		Swap type	String		Ejem: SWAP_OIS, SWAP_VANILLA, ...	/valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/productType productTypeScheme="http://www.bmeclar ing.es/generic-subproduct-type"
2.5		Settlement Currency	Currency ISO Currency Code (3 digits)		Divisa de liquidación	
2.6		Swap Leg 1 Currency	Currency ISO Currency Code (3 digits)		Divisa de la pata 1	/valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/calculationPeriodAm ount/calculation/notionalSchedule/notiona lStepSchedule/currency
2.7		Swap Leg 1 Payment Period	{D,W,M,Y}		Periodo de pago	/valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/paymentDates/pay mentFrequency/period
2.8		Swap Leg 1 Payment Multiplier	Positive integer		Multiplicador a aplicar al periodo de pago	/valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/paymentDates/pay mentFrequency/periodMultiplier
2.9		Swap Leg 1 Index	String		Indice de referencia usado para la pata	(Sólo si es Floating) /valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/calculationPeriodAm ount/calculation/notionalSchedule/floating RateCalculation/floatingRateIndex
2.10		Swap Leg 1 Day Count	String		Day Count Convention usado en la pata	/valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/calculationPeriodAm ount/calculation/notionalSchedule/dayCou ntFraction
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	/valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/paymentDates/pay mentDatesAdjustments/businessCenters/b usinessCenter (Tantos businessCenter como necesario)

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
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.	/valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/calculationPeriodDates/calculationPeriodDatesAdjustments/businessDayConvention
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	/valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/paymentDates/paymentDatesAdjustments/businessDayConvention
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	

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
2.18		Swap Leg 2 Currency	Currency ISO Currency Code (3 digits)		Divisa de la pata 2	/valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[2]/calculationPeriodAmount/calculation/notionalSchedule/notionalStepSchedule/currency
2.19		Swap Leg 2 Payment Period	{D,W,M,Y}		Periodo de pago	/valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[2]/paymentDates/paymentFrequency/period
2.20		Swap Leg 2 Payment Multiplier	Positive integer		Multiplicador a aplicar al periodo de pago	/valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[2]/paymentDates/paymentFrequency/periodMultiplier
2.21		Swap Leg 2 Index	String		Indice de referencia usado para la pata	(Sólo si es Floating) /valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[2]/calculationPeriodAmount/calculation/notionalSchedule/floatingRateCalculation/floatingRateIndex
2.22		Swap Leg 2 Day Count	String		Day Count Convention usado en la pata	/valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[2]/calculationPeriodAmount/calculation/notionalSchedule/dayCountFraction
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	/valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[2]/paymentDates/paymentDatesAdjustments/businessCenters/businessCenter (Tantos businessCenter como necesario)
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.	/valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[2]/calculationPeriodDates/calculationPeriodDatesAdjustments/businessDayConvention

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
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.	/valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[2]/paymentDates/paymentDatesAdjustments/businessDayConvention
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 2.	
2.27		Swap Leg 2 Exchange Rate Index	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.	
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 2	
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 2	
2.30		Swap Notional currency	ISO Currency Codes (3 digits)		Currency 1 ó Currency2	/valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/calculationPeriodAmount/calculation/notionalSchedule/notionalStepSchedule/currency (Notional de la pata fija)
2.31		Swap Notional	Amt		Amount del generico	/valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/calculationPeriodAmount/calculation/notionalSchedule/notional

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
						IStepSchedule/initialValue (Notional de la pata fija)
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	
2.34		Effective Date Offset	Integer		Offset desde la fecha sesión a la fecha de comienzo del genérico	/valuationReport/tradeValuationItem/trade/swap/swapStream[1]/calculationPeriodDates/relativeEffectiveDate/periodMultiplier
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 StressTest, 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	FpML
1	REPORTE	Elementos que componen la cabecera del reporte				
1.1		exchName	String		ClearingHouseId, Nombre o código corto de la Cámara	/valuationReport/reportIdentification/bme:ccpld with ccpldScheme="http://www.bmeclearing.es/ccp-id"
1.2		contractGroup	String		Segmento	/valuationReport/reportIdentification/bme:segmentId with segmentIdScheme="http://www.bmeclearing.es/segment-id"
1.3		rptCod	String		Código del informe	/valuationReport/reportIdentification/reportId with reportIdScheme="http://www.bmeclearing.es/report-id"
1.4		rptName	String		Nombre del informe	/valuationReport/dataSetName
1.5		rptType	Values{Intraday, EndOfDay}		Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión	/valuationReport/reportIdentification/bme:reportType with reportTypeScheme="http://www.bmeclearing.es/report-type" 1. If ITD, Intraday 2. If EoD, EndOfDay
1.6		rptSessionDate	YYYY-MM-DD		Fecha de Sesión de los datos del informe	/valuationReport/asOfDate
1.7		rptPrntRunDat	YYYY-MM-DDTHH:MM:SS		Fecha y Hora de creación del informe	/valuationReport/header/creationTimestamp
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	/valuationReport/asOfDate
2.2		Scenario Type	String		HIS = Histórico, HYP = Hipotético	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/valuationScenario/bme:scenarioType

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
2.3		Scenario Date	String	YYYY-MM-DD	Fecha del escenario En blanco para escenarios hipotéticos	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/valuationScenario/valuationDate
2.4		Scenario ID	String		Fecha del escenario para Históricos Nombre del escenario para Hipotéticos	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/valuationScenario/bme:scenarioId
3 ESCENARIO TIPOS INTERÉS			Datos de la curva			
3.1		Curve Name	String		Nombre de la curva	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/valuationScenario/name
3.2		Index ID	String		Identificador del índice de referencia de la curva. El especificado en CFIXING. Determina la divisa y el calendario.	/valuationReport/market/yieldCurve/forecastRateIndex/floatingRateIndex
3.3		Index currency	Currency Code (3 digits)	ISO (3 digits)	Divisa del índice	/valuationReport/market/yieldCurve/currency
3.4		KnotPoint Period	period: Value{D, W, M, Y}			/valuationReport/market/yieldCurveValuation/bme:maturityDate/tenor/period
3.5		KnotPoint Multiplier	periodMultiplier: Positive Integer			/valuationReport/market/yieldCurveValuation/bme:maturityDate/tenor/periodMultiplier
3.6		KnotPoint Symbol	String		Ejem: O/N, 1M, ...	/valuationReport/market/yieldCurveValuation:id
3.7		KnotPoint Maturity Date	YYYY-MM-DD		Fecha de vencimiento del KnotPoint	/valuationReport/market/yieldCurveValuation/bme:maturityDate/date
3.8	-	IRT Shift Scalated	Decimal	Expressed in parts per one: 0.05 equals 5%. With a maximum of 15 decimal places	Valor escalado En blanco para escenarios hipotéticos	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/valuationScenario/shift/shift

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
3.9	-	IRT Shift NonScalated	Decimal	Expressed in parts per one: 0.05 equals 5%. With a maximum of 15 decimal places	Valor no escalado	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/valuationScenario/shift/shift
4 ESCENARIO TIPOS CAMBIO			Datos del Escenario			
4.1		Currency pair	String	"Currency1/Currency2" where currencies are ISO Currency Codes (3 digits)	Divisa origen/Divisa destino	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/bme:quotedCurrencyPair/currency1 /valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/bme:quotedCurrencyPair/currency2
4.2	-	XRT Shift Scalated	Decimal	Expressed in parts per one: 0.05 equals 5%. With a maximum of 15 decimal places	Valor escalado En blanco para escenarios hipotéticos	
4.3	-	XRT Shift NonScalated	Decimal	Expressed in parts per one: 0.05 equals 5%. With a maximum of 15 decimal places	Valor no escalado	

3.4 FICHEROS DE GARANTÍAS

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	EoD

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
1		REPORTE			Elementos que componen la cabecera del reporte	
1.1		exchName	String	ClearingHouseId, Nombre o código corto de la Cámara		/valuationReport/party/partyName with partyNameScheme="http://www.bmeclarin g.es/party-name" or /valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.bmeclarin g.es/party-id"
1.2		contractGroup	String(2)	Segmento		/valuationReport/reportIdentification/bme:s egmentId with segmentIdScheme="http://www.bmeclarin g.es/segment-id"
1.3		rptCod	String	Código del informe		/valuationReport/reportIdentification/reportI d with /valuationReport/reportIdentification/reportI d/@reportIdScheme="http://www.bmeclarin g.es/report-id"
1.4		rptName	String	Nombre del informe		/valuationReport/bme:dataSetName

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
1.5		rptType		Values{Intraday, EndOfDay}	Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión	/valuationReport/reportIdentification/bme:reportType with reportTypeScheme="http://www.bmeclearing.es/report-type" 1. If ITD, Intraday 2. If EoD, EndOfDay
1.6		rptSessionDate	LocalDate		Fecha de sesión	/valuationReport/asOfDate
1.7		rptPrntRunDat	LocalDate		Fecha y Hora de creación del informe	/valuationReport/header/creationTimestamp
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; memId = CCPMember). Si CCPMember es Compensador el reporte contiene, además de de las operaciones de sus cuentas, las operaciones de las cuentas de otros miembros de los que es compensador (memID != CCPMember, pero ClearingMemberId = CCPMember)	ForEach Miembro, then: /valuationReport/party/partyId and partyIdScheme="http://www.bmeclearing.es/clearing-party-id" And, if ClearingMember, then: /valuationReport/party/@id is pointing to /valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/partyTradeInformation[partyReference pointing to Clearing Member]/relatedParty[partyReference pointing to Clearing Member]/role = "ClearingFirm"
2 GRUPO COMPENSACIÓN						
2.1		SwapClearingGroup	String(12)		El modelo de cálculo de garantías aplica a un grupo de compensación	/valuationReport/portfolioValuationItem/bme:swapClearingGroup/@swapClearingGroup Scheme="http://www.bmeclearing.es/swap-clearing-group"
3 PARAMETRIZACIÓN GARANTÍAS						
3.1		M _{Riesgo}	Decimal	With a maximum of 3 decimal places	Multiplicador de Riesgo de crédito Informado solo en los reportes de Miembros Compensadores	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote[@measureType="RiskMultiplier"]/value

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
3.2		Mpor House	Positive Integer		Número de días Mpor House	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote[@measureType="MPORHouse"]/value
3.3		Mpor Client	Positive Integer		Número de días Mpor Cliente	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote[@measureType="MPORClient"]/value
3.4		Hvar	Decimal	Expressed in parts per one: 0.05 equals 5% With a maximum of 4 decimal places.	Nivel de confianza HVAR	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote[@measureType="HVARConfidence"]/value
3.5		Es	Decimal	Expressed in parts per one: 0.05 equals 5% With a maximum of 4 decimal places.	Nivel de confianza ES	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote[@measureType="ESConfidence"]/value
3.6		NonScaledScenariosNumber	Positive Integer		Número de escenarios no escalados	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote[@measureType="NonScaledScenariosNumber"]/value
3.7		NonScaledScenariosNumberFV	Positive Integer		Número de escenarios no escalados a realizar FV	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote[@measureType="NonScaledScenariosNumberFV"]/value
3.8		ScaledScenariosNumber	Positive Integer		Número de escenarios escalados	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote[@measureType="ScaledScenariosNumber"]/value
3.9		ScaledScenariosNumberFV	Positive Integer		Número de escenarios escalados a realizar FV	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote[@measureType="ScaledScenariosNumberFV"]/value
3.10		IM Floor Factor	Decimal	Expressed in parts per one: 0.05 equals 5% With a maximum	Multiplicador sobre el IM Base para obtener la garantía mínima	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote[@measureType="FloorFactor"]/value

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
				of 4 decimal places.		

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 CCP de los que sea compensador.
GRUPO	GARANTÍAS
DESTINARIOS	Miembro de la CCP
PRIVACIDAD	Contiene datos privados
HORARIO DE PUBLICACIÓN	EoD

#	*	Campo	Tipo	Valores Validos	Descrpción	FpML
1		REPORTE			Elementos que componen la cabecera del reporte	
1.1		exchName	String	ClearingHouseId, Nombre o código corto de la Cámara		/valuationReport/reportIdentification/bme:ccpld with ccpldScheme="http://www.bmeclearing.es/ccp-id"
1.2		contractGroup	String(2)	Segmento		/valuationReport/reportIdentification/bme:segmentId with segmentIdScheme="http://www.bmeclearing.es/segment-id"
1.3		rptCod	String	Código del informe		/valuationReport/reportIdentification/reportId with reportIdScheme="http://www.bmeclearing.es/report-id"
1.4		rptName	String	Nombre del informe		/valuationReport/dataSetName

#	*	Campo	Tipo	Valores Validos	Descripción	FpML
1.5		rptType		Values{Intraday, EndOfDay}	Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión	/valuationReport/reportIdentification/bme:reportType with reportTypeScheme="http://www.bmeclearing.es/report-type" 1. If ITD, Intraday 2. If EoD, EndOfDay
1.6		rptSessionDate	LocalDate		Fecha de sesión	/valuationReport/asOfDate
1.7		rptPrntRunDat	LocalDate		Fecha y Hora de creación del informe	/valuationReport/header/creationTimestamp
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)	/valuationReport/reportContents/partyReference
2		CUENTA GARANTÍAS + GRUPO COMPENSACIÓN			Tantas cuentas como tenga el miembro por orden alfabético	
2.1		MarginAccountMember	String		Código del miembro	ForEach Miembro, set /valuationReport/party with /valuationReport/party/partyId and partyIdScheme="http://www.bmeclearing.es/party-id" [If SWIFT Code, partyIdScheme="http://www.fpml.org/coding-scheme/external/iso9362"]
2.2		ClearingMember	String		Código del miembro compensador	ForEach Miembro, then: /valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.bmeclearing.es/clearing-party-id" And, if ClearingMember, then: /valuationReport/party/@id is pointing to /valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/partyTradeInfo

#	*	Campo	Tipo	Valores Validos	Descripción	FpML
						information[partyReference pointing to Clearing Member]/relatedParty[partyReference pointing to Clearing Member]/role = "ClearingFirm"
2.3		MarginAccount	String(12)		Código de la Cuenta de Garantías en la CCP	/valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.bmeclearing.es/position-account-id"
2.4		LEI	String(20)		LEI de la entidad a nombre de quien está la cuenta	/valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.fpml.org/coding-scheme/external/iso17442"
2.5		SwapClearingGroup	String(12)		Grupo de compensación correspondiente al porfolio de swaps asociado a la cuenta	/valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.fpml.org/coding-scheme/account-type"
3		TIPO RIESGO			Sensibilidad a la variación del tipo de Interés	
3.1		Risk Factor	String	"ILB" -> Basis "IRT" -> Tipo de interés "XRT" -> Tasa de cambio	Factor de riesgo	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/bme:riskFactor/bme:name
3.2		Risk Currency pair	String	"Currency1/Currency2" " where currencies are ISO Currency Codes (3 digits)	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	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/bme:riskFactor/quotedCurrencyPair/currency1 /valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/bme:riskFactor/quotedCurrencyPair/currency2
4		SENSIBILIDAD				
4.1		Index ID	String		Identificador del índice de referencia. Ejs: IBR_3M, BASIS_USD_COP, XRATE_USD_COP	Delta-IndexID or Gamma-IndexID: /valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/sensitivitySet/name
4.2		Calculate date	YYYY-MM-DD		Fecha de cálculo	/valuationReport/AsOfDate

#	*	Campo	Tipo	Valores Validos	Descripción	FpML
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}			extract from: /valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/sensitivitySet/sensitivity:@name
4.6		Tenor multiplier	periodMultiplier: Positive Integer			extract from: /valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/sensitivitySet/sensitivity:@name
4.7		Tenor symbol	String		Tenor. Ejem: O/N, 1M, ...	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/sensitivitySet/sensitivity:@name
4.8		Delta/Gamma currency	ISO Currency Code (3 digits)		Divisa de los datos Delta y Gamma	
4.9		Zero Delta	Decimal	With a maximum of 10 decimal places	Valor del delta	if (/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/sensitivitySet/name).contains("DELTA") /valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/sensitivitySet/sensitivity
4.10		Zero Gamma	Decimal	With a maximum of 10 decimal places	Valor del gamma	if(/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/sensitivitySet/name).contains("GAMMA") /valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/sensitivitySet/sensitivity

NOMBRE DEL FICHERO	CLIQUIDMARGIN
CÓDIGO DEL FICHERO	REP-MAR-003
DESCRIPCIÓN	Se informa a nivel de Miembro y Cuenta 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	FpML
1		REPORTE			Elementos que componen la cabecera del reporte	
1.1		exchName	String	ClearingHouseId, Nombre o código corto de la Cámara		/eventActivityReport/reportIdentification/bme:ccpld with ccpldScheme="http://www.bmeclearing.es/ccp-id"
1.2		contractGroup	String(2)	Segmento		/eventActivityReport/reportIdentification/bme:segmentId with segmentIdScheme="http://www.bmeclearing.es/segment-id"
1.3		rptCod	String	Código del informe		/eventActivityReport/reportIdentification/reportId with reportIdScheme="http://www.bmeclearing.es/report-id"
1.4		rptName	String	Nombre del informe		/eventActivityReport/dataSetName
1.5		rptType	Values{Intraday, EndOfDay}	Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión		/eventActivityReport/reportIdentification/bme:reportType with reportTypeScheme="http://www.bmeclearing.es/report-type" 1. If ITD, Intraday 2. If EoD, EndOfDay

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
1.6		rptSessionDate	LocalDate		Fecha de sesión	/eventActivityReport/asOfDate
1.7		rptPrntRunDat	LocalDate		Fecha y Hora de creación del informe	/eventActivityReport/header/creationTimestamp
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)	/valuationReport/reportContents/partyReference
2		CUENTA GARANTÍAS + GRUPO COMPENSACIÓN		Tantas cuentas como tenga el miembro por orden alfabético		
2.1		MarginAccountMember	String		Código del miembro	ForEach Miembro, set /valuationReport/party with /valuationReport/party/partyId and partyIdScheme="http://www.bmeclearing.es/party-id" [If SWIFT Code, partyIdScheme="http://www.fpml.org/coding-scheme/external/iso9362"]
2.2		ClearingMember	String		Código del miembro compensador	ForEach Miembro, then: /valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.bmeclearing.es/clearing-party-id" And, if ClearingMember, then: /valuationReport/party/@id is pointing to /valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/partyTradeInformation[partyReference pointing to ClearingMember]/relatedParty[partyReference pointing to Clearing Member]/role = "ClearingFirm"

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
2.3		MarginAccount	String(12)		Código de la Cuenta en la CCP	/valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.bmeclearing.es/position-account-id"
2.4		LEI	String(20)		LEI de la entidad a nombre de quien está la cuenta	/valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.fpml.org/coding-scheme/external/iso17442"
2.5		SwapClearingGroup	String(12)		Grupo de compensación correspondiente al portfolio de swaps asociado a la cuenta	/valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.fpml.org/coding-scheme/account-type"
3.		BUCKET - MARGIN INCREMENT - SENSITIVITIES			Incremento de IM y sensibilidades del portfolio 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".	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/bme:bucket/bme:tenor/period
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".	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/bme:bucket/bme:tenor/periodMultiplier
3.3		Bucket IM Increment	Decimal		Incremento total -contribuido por todos los factores de riesgo- del IM en el bucket	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/value When: /valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/measureType == "IMIncrement"
3.1		Risk Factor	String	"ILB" -> Basis "IRT" -> Tipo de interés "XRT" -> Tasa de cambio	Factor de riesgo	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/bme:riskFactor/bme:name

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
3.2		Risk Currency pair	String	"Currency1/Currency2" where currencies are ISO Currency Codes (3 digits)	<p>Divisas del factor de riesgo.</p> <p>Si el tipo de riesgo es "IRT" Currency1 debe ser igual a Currency2.</p> <p>Si el tipo de riesgo es "BAS" el riesgo es el del basis de Currency1 a Currency2.</p> <p>Si el tipo de riesgo es "XRT" el riesgo es el del tipo de cambio de Currency1 a Currency2.</p> <p>Si el tipo de riesgo es "IBRLIBOR" Currency1 y Currency2 son USD</p>	<p>/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/bme:riskFactor/quotedCurrencyPair/currency1</p> <p>/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/bme:riskFactor/quotedCurrencyPair/currency2</p>
		PV01 Currency	ISO Currency Code (3 digits)		Divisa en la que se proporcionan los 2 siguientes campos	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/sensitivitySetDefinition/sensitivityCharacteristics/currency
3.4		PV01 porfolio	Decimal	With a maximum of 10 decimal places	Sensibilidad del portfolio -antes de su cobertura- en el bucket	<p>/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/sensitivitySetDefinition/sensitivityCharacteristics/value</p> <p>When:</p> <p>/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/sensitivitySetDefinition/sensitivityCharacteristics/measureType == "PV01"</p>
3.5		PV01 hedging	Decimal	With a maximum of 10 decimal places	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.	<p>/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/sensitivitySetDefinition/sensitivityCharacteristics/value</p> <p>When:</p> <p>/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/sensitivitySetDefinition/sensitivityCharacteristics/measureType == "PV01Hedging"</p>
3.6		RC	Decimal	With a maximum of 10 decimal places	Ratio de Cobertura . Específico para el genérico introducido para realizar la cobertura en el bucket.	<p>/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/value</p> <p>When:</p> <p>/valuationReport/portfolioValuationItem/trade</p>

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
						ValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/measureType == "RC"
3.7		Notional currency	ISO Currency Code (3 digits)		Divisa del Nominal teórico del Genérico de Cobertura.	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/currency When: /valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/measureType == "TheoreticalNominal"
3.8		Notional	Decimal	With a maximum of 10 decimal places	Nominal teórico del Genérico de Cobertura. Específico para el genérico introducido para realizar la cobertura en el bucket.	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/value When: /valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/measureType == "TheoreticalNominal"
3.9		Sobre coste liquidez	Decimal	With a maximum of 10 decimal places	Sobrecoste por cubrir el importe exacto del IRS de cobertura	/valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/value When: /valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/measureType == "AdditionalCostBasisPoints"

NOMBRE DEL FICHERO	CTOTALINITIALMARGIN
CÓDIGO DEL FICHERO	REP-MAR-004
DESCRIPCIÓN	Se informa a nivel de Miembro y Cuenta, 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 CCP de los que sea compensador.
GRUPO	GARANTÍAS
DESTINARIOS	Miembro de la CCP
PRIVACIDAD	Contiene datos privados
HORARIO DE PUBLICACIÓN	EoD y ID

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
1		REPORTE			Elementos que componen la cabecera del reporte	
1.1		exchName	String	ClearingHouseld, Nombre o código corto de la Cámara		/eventActivityReport/reportIdentification/bme:ccpld with ccpldScheme="http://www.bmeclearing.es/ccp-id"
1.2		contractGroup	String(2)	Segmento		/eventActivityReport/reportIdentification/bme:segmentId with segmentIdScheme="http://www.bmeclearing.es/segment-id"
1.3		rptCod	String	Código del informe		/eventActivityReport/reportIdentification/reportId with reportIdScheme="http://www.bmeclearing.es/report-id"
1.4		rptName	String	Nombre del informe		/eventActivityReport/dataSetName
1.5		rptType	Values{Intraday, EndOfDay}	Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión		/eventActivityReport/reportIdentification/bme:reportType with reportTypeScheme="http://www.bmeclearing.es/report-type"

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
						1. If ITD, Intraday 2. If EoD, EndOfDay
1.6		rptSessionDate	LocalDate		Fecha de sesión	/eventActivityReport/asOfDate
1.7		rptPrntRunDat	LocalDate		Fecha y Hora de creación del informe	/eventActivityReport/header/creationTimes tamp
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)	/valuationReport/reportContents/partyRef erence
2		CUENTA GARANTÍAS + GRUPO COMPENSACIÓN			Tantas cuentas como tenga el miembro por orden alfabético	
2.1		MarginAccountMember	String		Código del miembro	ForEach Miembro, set /valuationReport/party with /valuationReport/party/partyId and partyIdScheme="http://www.bmeclearing.e s/party-id" [If SWIFT Code, partyIdScheme="http://www.fpml.org/codi ng-scheme/external/iso9362"]
2.2		ClearingMember	String		Código del miembro compensador	ForEach Miembro, then: /valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.bmeclearing.e s/clearing-party-id" And, if ClearingMember, then: /valuationReport/party/@id is pointing to /valuationReport/portfolioValuationItem/tr

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
						adeValuationItem/trade/tradeHeader/part yTradeInformation[partyReference pointing to Clearing Member]/relatedParty[partyReference pointing to Clearing Member]/role = "ClearingFirm"
2.3		MarginAccount	String(12)	Código de la Cuenta en la CCP		/valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.bmeclearing.e s/position-account-id"
2.4		LEI	String(20)	LEI de la entidad a nombre de quien está la cuenta		/valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.fpml.org/codi ng-scheme/external/iso17442"
2.5		SwapClearingGroup	String(12)	Grupo de compensación correspondiente al porfolio de swaps asociado a la cuenta		/valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.fpml.org/codi ng-scheme/account-type"
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		/valuationReport/portfolioValuationItem/v aluationSet/assetValuation/quote/value When: /valuationReport/portfolioValuationItem/v aluationSet/assetValuation/quote/measure Type == "NPV"
3.3		NPV D-1	Amt	Net present value from D-1		/valuationReport/portfolioValuationItem/v aluationSet/assetValuation/quote/value When: /valuationReport/portfolioValuationItem/v

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
						aluationSet/assetValuation/quote/measure Type == "PriorNPV"
3.4		Porfolio PAI	Amt		PAI del porfolio: TipoOvernight _{d-1} * NPV _{d-1} Se liquida en D+1	/valuationReport/portfolioValuationItem/v aluationSet/assetValuation/quote/value When: /valuationReport/portfolioValuationItem/v aluationSet/assetValuation/quote/measure Type == "PAI"
3.5		VM	Amt		Variation Margin	/valuationReport/portfolioValuationItem/v aluationSet/assetValuation/quote/value When: /valuationReport/portfolioValuationItem/v aluationSet/assetValuation/quote/measure Type == "VM"
3.6		VM D-1	Amt		Variation Margin from D-1	/valuationReport/portfolioValuationItem/v aluationSet/assetValuation/quote/value When: /valuationReport/portfolioValuationItem/v aluationSet/assetValuation/quote/measure Type == "PriorVM"
3.7		Initial Margin	Amt		Initial Margin	/valuationReport/portfolioValuationItem/v aluationSet/assetValuation/quote/value When: /valuationReport/portfolioValuationItem/v aluationSet/assetValuation/quote/measure Type == "IM"
3.8		Initial Margin D-1	Amt		Initial Margin from D-1	/valuationReport/portfolioValuationItem/v aluationSet/assetValuation/quote/value When: /valuationReport/portfolioValuationItem/v aluationSet/assetValuation/quote/measure Type == "PriorIM"

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
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	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/bme:calculationMethod With schema:"http://www.bmeclearing.es/calculation-method" When: /valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/measureType == "IM"
3.10		ES Value	Amt		Valor del Expected Shortfall a nivel de MC	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/value When: /valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/measureType == "ES"
3.11		HVaR Value	Amt		Valor del VaR Histórico a nivel de MC	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/value When: /valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/measureType == "HVar"
3.12		Liquid Margin IM Increment	Amt		Incremento del IM debido al ATP	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/value When: /valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/measureType == "LiquidMarginIMIncrement"

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

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
1		REPORTE			Elementos que componen la cabecera del reporte	
1.1		exchName	String	ClearingHouseId, Nombre o código corto de la Cámara		/eventActivityReport/reportIdentification/bme:ccpld with ccpldScheme="http://www.bmeclearing.es/ccp-id"
1.2		contractGroup	String(2)	Segmento		/eventActivityReport/reportIdentification/bme:segmentId with segmentIdScheme="http://www.bmeclearing.es/segment-id"
1.3		rptCod	String	Código del informe		/eventActivityReport/reportIdentification/reportId with reportIdScheme="http://www.bmeclearing.es/report-id"
1.4		rptName	String	Nombre del informe		/eventActivityReport/dataSetName
1.5		rptType	Values{Intrada y, EndOfDay}	Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión		/eventActivityReport/reportIdentification/bme:reportType with reportTypeScheme="http://www.bmeclearing.es/report-type" 1. If ITD, Intraday 2. If EoD, EndOfDay

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
1.6		rptSessionDate	LocalDate		Fecha de sesión	/eventActivityReport/asOfDate
1.7		rptPrntRunDat	LocalDate		Fecha y Hora de creación del informe	/eventActivityReport/header/creationTimestamp
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)	/valuationReport/reportContents/partyReference
2		CUENTA GARANTÍAS + GRUPO COMPENSACIÓN			Tantas cuentas como tenga el miembro por orden alfabético	
2.1		MarginAccountMember	String		Código del miembro	ForEach Miembro, set /valuationReport/party with /valuationReport/party/partyId and partyIdScheme="http://www.bmecclearing.es/party-id" [If SWIFT Code, partyIdScheme="http://www.fpml.org/coding-scheme/external/iso9362"]
2.2		ClearingMember	String		Código del miembro compensador	ForEach Miembro, then: /valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.bmecclearing.es/clearing-party-id" And, if ClearingMember, then: /valuationReport/party/@id is pointing to /valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/partyTradeInformation[partyReference pointing to Clearing Member]/relatedParty[partyReference pointing to Clearing Member]/role = "ClearingFirm"
2.3		MarginAccount	String(12)		Código de la Cuenta en la CCP	/valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.bmecclearing.es/position-account-id"

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
2.4	LEI		String(20)		LEI de la entidad a nombre de quien está la cuenta	/valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.fpml.org/coding-scheme/external/iso17442"
2.5	SwapClearingGroup		String(12)		Grupo de compensación correspondiente al porfolio de swaps asociado a la cuenta	/valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.fpml.org/coding-scheme/account-type"
3	TEST DATA				Datos del Test de Stress	
3.1	Currency		ISO Currency Code (3 digits)		Moneda	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/
	InfoType		String	"INFO_CP_MC" "INFO_CC_MC" "ARC_MC" "RST_MC"	Ver (1) <u>"INFO_CP_MC"</u> , <u>"INFO_CC_MC"</u> No aplican los campos 3.7 y 3.8 . Van en blanco. <u>"ARC_MC"</u> 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. <u>"RST_MC"</u> 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.	If any of /valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/measureType == "INFO_CP_MC" then "INFO_CP_MC" If any of /valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/measureType == "INFO_CC_MC" then "INFO_CC_MC" If any of /valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/measureType == "ARC_MC" then "ARC_MC" If any of /valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/measureType == "RST_MC" then "RST_MC"
3.2						
	WorstScenario		String		Peor escenario del MC Fecha del escenario si es un escenario histórico. Nombre del escenario si es un escenario hipotético.	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/valuationScenario/name
3.3						

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
3.4		WorstScenario Margin	Amt		Margin del peor escenario	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/value When: /valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/measureType == "WorstEscenarioMargin"
3.5		Initial Margin	Amt		Importe final de la garantía inicial (IM)	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/value When: /valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/measureType == "IM"
3.6		Stress Test Risk	Amt		Riesgo en situación de stress test	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/value When: /valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/measureType == #3.2
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	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/value When: /valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/measureType == "RST_MC"

NOMBRE DEL FICHERO	CWORSTSCENARIOS
CÓDIGO DEL FICHERO	REP-MAR-006
DESCRIPCIÓN	Se informa a nivel de Miembro Compensador y Cuenta de los 10 (diez) peores escenarios y sus pérdidas por escenarios.
GRUPO	Garantías
DESTINARIOS	Miembro Compensador
PRIVACIDAD	Contiene datos privados
HORARIO DE PUBLICACIÓN	EoD

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
1		REPORTE			Elementos que componen la cabecera del reporte	
1.1		exchName	String		ClearingHouseId, Nombre o código corto de la Cámara	FpML
1.2		contractGroup	String(2)		Segmento	
1.3		rptCod	String		Código del informe	/eventActivityReport/reportIdentification/bme:ccpId with ccpIdScheme="http://www.bmeclearing.es/ccp-id"
1.4		rptName	String		Nombre del informe	/eventActivityReport/reportIdentification/bme:segmentId with segmentIdScheme="http://www.bmeclearing.es/segment-id"
1.5		rptType	Values{Intraday, EndOfDay}		Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión	/eventActivityReport/reportIdentification/reportId with reportIdScheme="http://www.bmeclearing.es/report-id"
1.6		rptSessionDate	LocalDate		Fecha de sesión	/eventActivityReport/dataSetName
1.7		rptPrntRunDat	LocalDate		Fecha y Hora de creación del informe	/eventActivityReport/reportIdentification/bme:reportType with reportTypeScheme="http://www.bmeclearing.es/report-type"

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
						1. If ITD, Intraday 2. If EoD, EndOfDay
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)	/valuationReport/asOfDate
2		CUENTA GARANTÍAS + GRUPO COMPENSACIÓN		Tantas cuentas como tenga el miembro por orden alfabético		
2.1		MarginAccountMember	String		Código del miembro	/valuationReport/reportContents/partyReference
2.2		ClearingMember	String		Código del miembro compensador	
2.3		MarginAccount	String(12)		Código de la Cuenta en la CCP	ForEach Miembro, set /valuationReport/party with /valuationReport/party/partyId and partyIdScheme="http://www.bmeclearing.es/party-id" [If SWIFT Code, partyIdScheme="http://www.fpml.org/coding-scheme/external/iso9362"]
2.4		LEI	String(20)		LEI de la entidad a nombre de quien está la cuenta	ForEach Miembro, then: /valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.bmeclearing.es/clearing-party-id" And, if ClearingMember, then: /valuationReport/party/@id is pointing to /valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/partyTradeInformation[partyReference pointing to ClearingMember]/relatedParty[partyReference pointing to ClearingMember]/role = "ClearingFirm"

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción	FpML
2.5		SwapClearingGroup	String(12)		Grupo de compensación correspondiente al porfolio de swaps asociado a la cuenta	/valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.bmeclearing.es/position-account-id"
3		ESCENARIOS			Datos del Escenario	
3.1		Scenario Name	String		Nombre del escenario	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/valuationScenario/name
3.2		Scenario ID	String		Identificador del escenario	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/valuationScenario/bme:scenarioid
3.3		Scenario Type	String		Tipo de escenario: Scaled (ES); NS: NonScaled (Hvar)	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/valuationScenario/bme:scenarioType with scenarioTypeScheme="http://www.bmeclearing.es/scenario-type"
3.4		Scenario Amount	Decimal ISO Currency Code (3 digits)		Pérdida/Ganancia del portfolio para el escenario	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/valuationScenario/bme:scenarioAmount/currency /valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/valuationScenario/bme:scenarioAmount/amount

NOMBRE DEL FICHERO	CBACKTESTING
CÓDIGO DEL FICHERO	REP-MAR-007
DESCRIPCIÓN	Se informa a nivel de Miembro y Cuenta de los resultados de las pruebas retrospectivas
GRUPO	GARANTÍAS
DESTINARIOS	Miembro de la CCP
PRIVACIDAD	Contiene datos privados
HORARIO DE PUBLICACIÓN	EoD

Number *	Field	Type	Value	Description	FpML
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	/eventActivityReport/reportIdentification/bme:ccpId with ccpIdScheme="http://www.bmeclearing.es/ccp-id"
1.4	rptName	String		Nombre del informe	/eventActivityReport/reportIdentification/bme:segmentId with segmentIdScheme="http://www.bmeclearing.es/segment-id"
1.5	rptType	Values{Intraday, EndOfDay}		Intraday = Intradía, EndOfDay = Fin de sesión	/eventActivityReport/reportIdentification/reportId with reportIdScheme="http://www.bmeclearing.es/report-id"
1.6	rptSessionDate	LocalDate		Fecha de sesión	/eventActivityReport/dataSetName
1.7	rptPrntRunDat	LocalDate		Fecha y Hora de creación del informe	/eventActivityReport/reportIdentification/bme:reportType with reportTypeScheme="http://www.bmeclearing.es/report-type" 1. If ITD, Intraday 2. If EoD, EndOfDay
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)	/valuationReport/asOfDate
2	CUENTA GARANTÍAS + GRUPO COMPENSACIÓN			Tantas cuentas como tenga el miembro por orden alfabético	

Number *	Field	Type	Value	Description	FpML
2.1	MarginAccountMember	String		Código del miembro	/valuationReport/reportContents/partyReference
2.2	ClearingMember	String		Código del miembro compensador	
2.3	MarginAccount	String(12)		Código de la Cuenta en la CCP	ForEach Miembro, set /valuationReport/party with /valuationReport/party/partyId and partyIdScheme="http://www.bmeclearing.es/party-id" [If SWIFT Code, partyIdScheme="http://www.fpml.org/coding-scheme/external/iso9362"]
2.4	LEI	String(20)		LEI de la entidad a nombre de quien está la cuenta	ForEach Miembro, then: /valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.bmeclearing.es/clearing-party-id" And, if ClearingMember, then: /valuationReport/party/@id is pointing to /valuationReport/portfolioValuationItem/tradeValuationItem/trade/tradeHeader/partyTradeInformation[partyReference pointing to ClearingMember]/relatedParty[partyReference pointing to Clearing Member]/role = "ClearingFirm"
2.5	SwapClearingGroup	String(12)		Grupo de compensación correspondiente al porfolio de swaps asociado a la cuenta	/valuationReport/party/partyId with partyIdScheme="http://www.bmeclearing.es/position-account-id"
3	BACKTEST			Datos del Backtest	
3.1	IMBase	Decimal String ISO Currency Code (3 digits)		IMBase del portfolio en D - MPOR	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/value /valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/measureType = IMBase with assetMeasureScheme="http://www.bmeclearing.es/asset-measure"

Number *	Field	Type	Value	Description	FpML
					/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/currency
					/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/value
3.2	Maximum Risk	Decimal String ISO Currency Code (3 digits)		Máxima pérdida $\text{Min}(\text{NPV}_{D-i} - \text{NPV}_{D-MPOR}, 0)$ (MPOR = 5 ó 7)	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/measureType = MaximumRisk with assetMeasureScheme="http://www.bme clearing.es/asset-measure"
					/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/currency
					/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/value
3.3	Uncovered/Backtest Risk	Decimal String ISO Currency Code (3 digits)		$\text{Min}(\text{IMBase} + \text{Maximum Risk}, 0)$	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/measureType = BackTestRisk with assetMeasureScheme="http://www.bme clearing.es/asset-measure"
					/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/currency
					/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/value
3.4	NPV D	Decimal String ISO Currency Code (3 digits)		NPV del portfolio de D - MPOR (D-5 ó D-7) valorado en D	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/measureType = 0DayRisk with assetMeasureScheme="http://www.bme clearing.es/asset-measure"
					/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/currency

Number *	Field	Type	Value	Description	FpML
3.4	NPV D-1	Decimal String ISO Currency Code (3 digits)		NPV del portfolio de D - MPOR (D-5 ó D-7) valorado en D -1	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/value /valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/measureType = 1DayRisk with assetMeasureScheme="http://www.bme clearing.es/asset-measure"
					/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/currency /valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/value
3.4	NPV D-2	Decimal String ISO Currency Code (3 digits)		NPV del portfolio de D - MPOR (D-5 ó D-7) valorado en D - 2	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/measureType = 2DayRisk with assetMeasureScheme="http://www.bme clearing.es/asset-measure"
					/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/currency /valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/value
3.4	NPV D-3	Decimal String ISO Currency Code (3 digits)		NPV del portfolio de D - MPOR (D-5 ó D-7) valorado en D - 3	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/measureType = 3DayRisk with assetMeasureScheme="http://www.bme clearing.es/asset-measure"
					/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/currency
3.4	NPV D-4	Decimal String		NPV del portfolio de D - MPOR (D-5 ó D-7) valorado en D - 4	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/value

Number *	Field	Type	Value	Description	FpML
		ISO Currency Code (3 digits)			/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/measureType = 4DayRisk with assetMeasureScheme="http://www.bme clearing.es/asset-measure"
					/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/currency
					/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/value
3.4	NPV D-5	Decimal String ISO Currency Code (3 digits)		NPV del portfolio de D - MPOR (D-5 ó D-7) valorado en D - 5	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/measureType = 5DayRisk with assetMeasureScheme="http://www.bme clearing.es/asset-measure"
					/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/currency
					/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/value
3.4	NPV D-6	Decimal String ISO Currency Code (3 digits)		NPV del portfolio de D - MPOR (D-5 ó D-7) valorado en D - 6	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/measureType = 6DayRisk with assetMeasureScheme="http://www.bme clearing.es/asset-measure"
					/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/currency
					/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/value
3.4	NPV D-7	Decimal String ISO Currency		NPV del portfolio de D - MPOR (D-5 ó D-7) valorado en D - 7	/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/measureType = 7DayRisk with assetMeasureScheme="http://www.bme clearing.es/asset-measure"
					/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/currency
					/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/value



Number *	Field	Type	Value	Description	FpML
		Code (3 digits)			tionSet/assetValuation/quote/measureType = 7DayRisk with assetMeasureScheme="http://www.bme clearing.es/asset-measure"
					/valuationReport/portfolioValuationItem/valuationSet/assetValuation/quote/currency



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



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

