

Segmentos de Renta Variable, Renta Fija e IRS

Tablas de Codificación / 14 de marzo de 2024
Versión 1.27

Historia de Revisiones

FECHA ACTUALIZACIÓN	VERSIÓN	DESCRIPCIÓN	AUTOR
24 de noviembre de 2016	1.7	Inclusion de campos a informar por el segmento de Renta Fija y cambios en Renta Variable por implantación T2S.	BME Clearing IT
18 de mayo de 2017	1.8	Nueva tabla 16 "Información de Supervisión".	BME Clearing IT
1 de diciembre de 2017	1.9	Cambios en tablas 16 "Información de Supervisión", 8 "Tipos de persona" y 4 "Códigos de Operación".	BME Clearing IT
1 de febrero de 2018	1.10	Registro de Deuda Indexada en Renta Fija	BME Clearing IT
6 de febrero de 2018	1.11	Cambios por la nueva estructura de cuentas	BME Clearing IT
15 de marzo de 2019	1.14	Nuevo Código de Operación Z en el segmento de Renta Variable.	BME Clearing IT
3 de octubre de 2019	1.15	Tabla 4 "Códigos de Operación": nuevo código I (RV) y cambio en la descripción de la 1 y la 2 (RF). Tabla 2 "Grupo de valores": nuevos valores (RF). Tabla 11 "Conceptos de Movimientos de Efectivo": nuevo concepto 37 (RF).	BME Clearing IT
15 de febrero de 2020	1.17	Cambio valor válido Tabla 14 "Tipos de Activo". Nuevo valor válido Tabla 7 "Tipos de Entidades de la ECC".	BME Clearing IT
19 de junio de 2020	1.18	Nuevos valores válidos en Tabla 10 para las garantías adicionales.	BME Clearing IT
1 de marzo de 2021	1.19	Nuevo tipo de producto en Tabla 3.	BME Clearing IT
1 de febrero de 2022	1.20	Nuevos conceptos de movimientos de efectivo en tabla 11	BME Clearing IT
4 de febrero de 2022	1.21	Nuevos conceptos de movimientos de efectivo en tabla 11	BME Clearing IT
24 de marzo de 2022	1.22	Nuevos conceptos de movimientos de efectivo en tabla 11	BME Clearing IT
3 de mayo de 2022	1.23	Nuevos DCV en tabla 13 Nuevos conceptos de movimientos de efectivo en tabla 11	BME Clearing IT
11 de noviembre de 2022	1.24	Nueva tabla 18 "Códigos blanco depositario". Actualización Conceptos de Movimientos de Efectivo (Tabla 11). Actualización tipos de activo (Tabla 14)	BME Clearing IT
13 de febrero de 2023	1.25	Actualización Conceptos de Movimientos de Efectivo (Tabla 11). Ampliación de alcance del documento al segmento de IRS (ver detalles en modificaciones)	BME Clearing IT
25 de enero de 2024	1.26	Actualización Conceptos en Tabla 4. Actualización Conceptos de Movimientos de Efectivo (Tabla 11).	BME Clearing Architecture
14 de marzo de 2024	1.27	Actualización tabla 11: "Conceptos de Movimientos de Efectivo".	BME Clearing Architecture

Modificaciones realizadas en la última revisión

Principales cambios respecto a la documentación v1.26 publicada el 25 de enero de 2024:

- Tabla 11 “Conceptos de movimientos de efectivo”: se actualizan los valores válidos.

Tabla de contenido

TABLAS DE VALORES	5
Tabla 1. Segmentos de la Cámara	5
Tabla 2. Grupos de valores	5
Tabla 3. Tipos de producto	6
Tabla 4. Códigos de Operación	7
Tabla 5. Segmentos de Negociación	7
Tabla 6. Código de ECC	7
Tabla 7. Tipos de Entidades de la ECC	8
Tabla 8. Tipos de Persona	8
Tabla 9. Tipos de Cuentas de Posición	8
Tabla 10. Tipos de Garantías Exigidas	9
Tabla 11. Conceptos de Movimientos de Efectivo	9
Tabla 12. Modos de Materialización de Garantías	13
Tabla 13. Códigos Depositarios Centrales de Valores	13
Tabla 14. Tipos de Activo	14
Tabla 15. Tipos de Identificación de Titular	14
Tabla 16. Información de Supervisión	14
Tabla 17. Tipos de Estructura de Cuenta	15
Tabla 18. Códigos banco depositario	15

Tablas de valores

Tabla 1. Segmentos de la Cámara

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN
C0	BME Clearing Renta Variable
C2	BME Clearing Derivados Financieros
C7	BME Clearing Energía
C8	BME Clearing Repo
C9	BME Clearing IRS
CD	BME Clearing Derivados Financieros Divisas

Tabla 2. Grupos de valores

Valores válidos para el segmento de Renta Variable

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN
AC	Acciones
DE	Derechos
CP	Cuotas participativas
CE	Corros electrónicos
NC	Fondos no cotizados
OA	ETFs
WC	Certificados
WA	Warrants
WO	Otros
EE	Empresas en expansión
SI	SICAVs
SO	SOCIMIs
FC	Fondos capital riesgo
IL	Sociedades de inversión libre
IC	IIC de IIC de IL
AL	Acciones LATIBEX
DL	Derechos LATIBEX

Valores válidos para el segmento de Renta Fija

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN
SD	Deuda Soberana Española
AT	Deuda Soberana Austriaca
DE	Deuda Soberana Alemana
FR	Deuda Soberana Francesa
IT	Deuda Soberana Italiana
NL	Deuda Soberana Holandesa
PT	Deuda Soberana Portuguesa

Tabla 3. Tipos de producto

Valores válidos para el segmento de Renta Variable

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN
A	Acciones
B	Bonos estructurados
C	Certificados
D	Derechos de suscripción
E	Sociedades de inversión libre
F	Fondos
G	Discount
H	Bonus CAP
I	Inlines
J	Stay Low
K	Bonus
L	Sprint
M	Acciones novísimas
N	Acciones nuevas
O	Otros productos
P	Turbo Pros
R	Acciones preferentes
S	Subyacentes
T	Turbo Warrants
U	Cuotas participativas
V	Derechos bonos convertibles
W	Warrants
X	Participaciones
Y	Stay High
Z	Multis
1	SICAVs VL D+1
2	SICAVs VL D+2
3	SICAVs VL D+3

Valores válidos para el segmento de Renta Fija

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN
BON	Bono
OBL	Obligación
LET	Letra
IDX	Deuda Indexada

Tabla 4. Códigos de Operación

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN	CÓDIGO OPERACIÓN FIX	
		TrdType [828]	TrdSubType [829]
1	Operación de ida de la simultánea o repo	1	1001
2	Operación de vuelta de la simultánea o repo	1	1002
3	Generación Instrucción de Liquidación	2009	0
6	Recompra	2012	0
7	Liquidación en Efectivo	2014	0
B	Liquidación de IL	2020	0
C	Ajuste por Eventos	2000	0
D	Operación de Asignación Interna	3	10
G	Operación de Asignación Externa	2001	0
Q	Bloque	1	34
M	Compraventa de Mercado	0	0
A	Operación Especial	1	33
L	Operaciones delta	2018	0
O	Operaciones a valor liquidativo SICAVS	2019	0
N	Neteo / Agregación	2016	0
T	Traspaso de operación	3	2
X	Cancelación	2004	0
U	Bilateral procedente de IBERCLEAR	1	33
E	Ejercicios y Vencimientos del Segmento de Derivados	15	0
W	Transformaciones realizadas por BME Clearing	2002	0
Z	Cierre de posición por default - RV	2013	0
Z	Traspaso de la posición - RF	2013	
I	Traspaso de instrucciones de liquidación	2015	0

Tabla 5. Segmentos de Negociación

Valores válidos para el segmento de Renta Variable

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN
EQ	Acciones + Corros Electrónicos
TF	ETFs
CW	Certificados y Warrants
MA	MaB
LT	Latibex

Tabla 6. Código de ECC

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN
CM	Código de la ECC – Cámara de Contrapartida Central

Tabla 7. Tipos de Entidades de la ECC

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN
MNCO	Miembro No Compensador
MNCS	Miembro No Compensador Segregado
MCI	Miembro Compensador Individual
MCIE	Miembro Compensador Individual Especial
MCG	Miembro Compensador General
EP	Entidad Participante del DCV
AP	Agente de Pagos

Tabla 8. Tipos de Persona

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN
AV	Agencias de Valores
B	Bancos
CA	Cajas de Ahorro
CB	Comunidad de Bienes
CL	Clientes
CM	Empresas Comercializadoras
CS	Compañías de Seguros
EF	Otras Entidades Financieras
FI	Fondos de Inversión
FP	Fondos de Pensiones
OT	Otros
PF	Persona Física
PJ	Otras Personas Jurídicas
SV	Sociedades de Valores

Tabla 9. Tipos de Cuentas de Posición

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN
CD	Diaria
CP	Propia
CTB	Cuenta General de Terceros Bruta
CTN	Cuenta General de Terceros Neta
CI	Cuenta Individual
CIEB	Cuenta de Intermediario Financiero Bruta
CIEN	Cuenta de Intermediario Financiero Neta
CIG	Cuenta cliente Indirecto para GOSAs

Tabla 10. Tipos de Garantías Exigidas

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN
101	Contribución a la Garantía Colectiva (Default Fund Contribution)
102	Garantía Individual para cumplir los criterios de Stress Test de la Garantía Colectiva
103	Déficit de Recursos Propios
104	Garantía por Límites de riesgo
105	Límite de Riesgo Intradía
106	Garantías Extraordinarias por Margin Call
107	Otras Garantías Extraordinarias
108	Garantía por Posición a constituir por el Compensador (no cubiertas por garantías de titulares o miembros negociadores)
109	Garantía por Registro de Detalle (aplica sólo en ciertos segmentos de la ECC) (Register Margin)
110	Garantía por Límite de Margin Call
111	Garantía Individual para poder registrar operaciones en el Segmento de Valores de Renta Fija
112	Garantía Individual por Posición
113	Garantía Individual por Posición voluntaria
114	Contribución a la Garantía Colectiva para el CCD Patrocinado
115	Garantía Extraordinaria Intradía
116	Garantía Individual Intradía

Tabla 11. Conceptos de Movimientos de Efectivo

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN	DERIVADOS FINANCIEROS	ENERGÍA	RF	RV	IRS	CRY PTO
01	Garantías	X	X	X	X	X	X
02	Otras Garantías	X	X	X	X	X	X
03	Variation Margin	X	X			X	X
05	Primas	X					
09	Regularización por Tarifa Mínima Mensual			X			
10	Comisiones Diarias Negociación	X	X				X
11	Comisiones Diarias Liquidación	X	X				X
12	Cupones					X	
13	Considerations					X	
14	PAI					X	
15	Intercambio Nominales					X	
20	Comisión de miembro RV				X		
21	Comisión de Clearing RV				X		
22	Comisión por mantenimiento de cuentas				X		
24	Tarifa por Instrucción de Liquidación RV				X		
25	Comisión por GUIs RV				X		
28	Cánones de negociación				X		
29	Comisión de miembro IRS					X	

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN	DERIVADOS FINANCIEROS	ENERGÍA	RF	RV	IRS	CRYPTO
30	Comisión de Clearing IRS					X	
31	Comisión de miembro RF			X			
32	Comisión de Clearing RF			X			
33	Tarifa por Instrucción de Liquidación RF			X			
34	Comisión por GUIs RF			X			
36	Comisión por mantenimiento de cuentas RF			X			
37	Cupones RF			X			
40	Liquidación de la entrega de Gas PVB		X				
41	Comisión de Diferimiento de FX	X					
42	Comisión de Diferimiento (xRS)	X					
43	Pago Compensatorio (xRS)	X					
44	Flujos por diferimiento (xRS)	X					
45	Margin Call intradía						X
46	Liberación de colateral en efectivo						X
47	Tarifa Entrega Física de Gas PW		X				
48	Liquidación de la entrega de Gas TVB		X				
98	Otros conceptos MEFF	X	X	X	X	X	
99	Otros conceptos (BME Clearing)	X	X	X	X	X	
A1	Tarifas de garantía no monetaria DF	X					
A2	Tarifas de garantía no monetaria ENE		X				
A3	Tarifas de garantía no monetaria RF			X			
A4	Tarifas de garantía no monetaria RV				X		
A5	Tarifas de garantía no monetaria IRS					X	
A6	Tarifas de garantía no monetaria Crypto						X
A7	Tarifas de garantía no monetaria FX	X					
B1	Intereses sobre garantías en efectivo DF	X					
B2	Intereses sobre garantías en efectivo ENE		X				
B3	Intereses sobre garantías en efectivo RF			X			
B4	Intereses sobre garantías en efectivo RV				X		
B5	Intereses sobre garantías en efectivo IRS					X	
B6	Intereses sobre garantías en efectivo Crypto						X

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN	DERIVADOS FINANCIEROS	ENERGÍA	RF	RV	IRS	CRYPTO
B7	Intereses sobre garantías en efectivo FX	X					
C2	Tarifa de cuentas ISA ENE		X				
C3	Tarifa de cuentas una única OSA DF	X					
C4	Tarifa de cuentas ISA DF	X					
C6	Tarifa de cuentas varias cuentas OSA ENE		X				
C7	Tarifa de cuentas una única OSA ENE		X				
C8	Tarifa de cuentas varias cuentas OSA DF	X					
1C	Tarifa de cuentas FX	X					
E1	Tarifa Movimientos de efectivo DF	X					
E2	Tarifa Movimientos de efectivo ENE		X				
E3	Tarifa Movimientos de efectivo RV				X		
E4	Tarifa Movimientos de efectivo RF			X			
E5	Tarifa Movimientos de efectivo IRS					X	
E6	Tarifa Movimientos de efectivo Crypto						X
E7	Tarifa Movimientos de efectivo FX	X					
F2	Tarifa Movimientos de colateral DF	X					
F3	Tarifa Movimientos de colateral ENE		X				
F4	Tarifa Movimientos de colateral RV				X		
F5	Tarifa Movimientos de colateral RF			X			
F6	Tarifa Movimientos de colateral IRS					X	
F7	Tarifa Movimientos de colateral Crypto						X
2F	Tarifa Movimientos de Colaterales FX	X					
G1	Tarifa mínima RegisTR BME Clearing DF	X					
G2	RegisTR BME Clearing PW		X				
G3	RegisTR BME Clearing IRS					X	
G4	Regis TR Nivel 1 envío UTIs Op.	X					X
G5	Regis TR Nivel 1 envío UTIs Pos.	X					
G6	Regis TR Nivel 2 envío UTIs Op.PE	X					
G7	Regis TR Nivel 2 envío UTIs Op.PPJ	X					
G8	RegisTR Nivel 2 envío UTIs Pos.PE	X					
G9	Regis TR Nivel 2 envío UTIs Po.PPJ	X					
J1	Separación de Flujos de Efectivo RV				X		
J2	Separación de Flujos de Efectivo DF	X					
J3	Separación de Flujos de Efectivo ENE		X				
J4	Separación de Flujos de Efectivo RF			X			
J5	Separación de Flujos de Efectivo IRS					X	
J6	Separación de Flujos de Efectivo FX	X					

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN	DERIVADOS FINANCIEROS	ENERGÍA	RF	RV	IRS	CRYPTO
L1	Tarifa por LEI Expirado DF	X					
L2	Tarifa por LEI Expirado ENE		X				
L3	Tarifa por LEI Expirado IRS					X	
L4	Tarifa por LEI Expirado Crypto						X
R1	Repercusión costes de liquidación y custodia del colateral DF	X					
R2	Repercusión costes de liquidación y custodia del colateral ENE		X				
R3	Repercusión costes de liquidación y custodia del colateral RV				X		
R4	Repercusión costes de liquidación y custodia del colateral RF			X			
R5	Repercusión costes de liquidación y custodia del colateral IRS					X	
R6	Repercusión costes de liquidación y custodia del colateral Crypto						X
T0	Traspaso Posición FX	X					
T1	Tarifa de Acceso MEFF	X					
T2	Traspasos Históricos ENE		X				
T3	Traspasos Históricos DF	X					
T4	Traspaso Posición DF	X					
T5	Traspaso Posición ENE		X				
T8	Tarifa de Acceso ENE		X				
T9	Traspasos Históricos FX	X					
U1	Incentivos BME CLEARING FX	X					
U2	Incentivos MEFF Exchange FX	X					
U3	Incentivos Diferimiento BME CLEARING FX	X					
U4	Traspaso Posición Crypto						X
U5	Tarifa de Miembro BME CLEARING Crypto						X
X1	Costes administrativos RV				X		
X2	Costes administrativos RF			X			
X3	Penalizaciones DCV RV				X		
X4	Penalizaciones DCV RF			X			
X5	Tarifa de Miembro MEFF DF	X					
X6	Tarifa de Miembro MEFF Power		X				
X7	Tarifa de Miembro BME CLEARING DF	X					
X8	Tarifa de Miembro BME CLEARING ENE		X				
X9	Tarifa de Miembro BME CLEARING GAS		X				
5X	Tarifa de Miembro MEFF FX	X					
7X	Tarifa de Miembro BME CLEARING FX	X					
Y1	Tarifa Acceso Directo Desarrolladores y Proveedores DF	X					
Y2	Tarifa Descarga Ficheros Datos PW		X				

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN	DERIVADOS FINANCIEROS	ENERGÍA	RF	RV	IRS	CRYPTO
Y3	Tarifa Conexión Acceso VPN RV				X		
Y4	Tarifa de descarga ficheros datos RV				X		
Y5	Tarifa por Precio Medio	X					
Y6	Tarifa Acceso Directo Desarrolladores y Proveedores Crypto						X
5Y	Tarifa por Precio Medio FX	X					
Z1	Tasas Representación CNMV	X	X				
Z2	Trabajos Especiales DF	X					
Z3	Trabajos Especiales ENE		X				
Z4	Trabajos Especiales RV				X		
Z5	Trabajos Especiales RF			X			
Z6	Trabajos Especiales IRS					X	
Z7	Trabajos Especiales Crypto						X
2Z	Trabajos Especiales FX	X					
1T	Opciones Mini Ibex Rebate MEFF	X					
2T	Opciones Mini Ibex Rebate BME CLEARING	X					
3T	Opciones Acciones Rebate MEFF	X					
4T	Opciones Acciones Rebate BME CLEARING	X					
5T	Futuros IBEX MEFF	X					
6T	Futuros IBEX BME Clearing	X					
7T	Futuros Dividendos Acciones MEFF	X					
8T	Futuros Acciones Rebate MEFF	X					
9T	Futuros Acciones Rebate BME CLEARING	X					

Tabla 12. Modos de Materialización de Garantías

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN
C	Efectivo
I	Prenda de otro CSD diferente IBERCLEAR
P	Prenda cuyo CSD es IBERCLEAR
S	Transferencia de valores de otro CSD diferente IBERCLEAR
T	Transferencia de Valores cuyo CSD es IBERCLEAR

Tabla 13. Códigos Depositarios Centrales de Valores

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN
--------	-------------

0	NO APLICA
1	IBERCLEAR
2	CLEARSTREAM
3	EUROCLEAR
7	SIX SIS

Tabla 14. Tipos de Activo

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN
ACE	Acciones Españolas
DE	Bono Alemán
AT	Bono Austríaco
BE	Bono Belga
FR	Bono Francés
NL	Bono Holandés
IT	Bono Italiano
BON	Bonos del Estado Español
BPV	Bono País Vasco
UK	Bono Reino Unido
US	Bono Americano
EUR	Efectivo Euro
IDX	Deuda Indexada
LET	Letras del Tesoro
OBL	Obligaciones del Estado
CHF	Efectivo Franco Suizo
GBP	Efectivo Libra
USD	Efectivo Dólar Estadounidense
AUD	Efectivo Dólar Australiano
JPY	Efectivo Yen Japonés
CH	Bono Suizo
BP	Bono Portugués

Tabla 15. Tipos de Identificación de Titular

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN
B	BIC
C	CIF
E	NIE
N	NIF
O	Otros

Tabla 16. Información de Supervisión

Se indican los valores válidos posibles para cada segmento:

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN	RF	RV
STSS	Sesión Abierta - AAAA-MM-DD	X	X

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN	RF	RV
ST01-S	Inicio Ciclo Nocturno – AAAA-MM-DD	X	X
ST01-E	Fin Ciclo Nocturno – AAAA-MM-DD	X	X
ST02-S-n	Inicio Ventana Agregación Intermedia – AAAA-MM-DD		X
ST02-E-n	Fin Ventana Agregación Intermedia – AAAA-MM-DD		X
ST03-S	Inicio Última Ventana Agregación – AAAA-MM-DD		X
ST03-E	Fin Última Ventana Agregación – AAAA-MM-DD		X
STEA	Fin Período Asignación Externa – AAAA-MM-DD		X
STIA	Fin Período Asignación Interna – AAAA-MM-DD		X
STCC	Inicio Cálculo Clearing – AAAA-MM-DD	X	X
STSG	Fin de Segmento – AAAA-MM-DD	X	X
STSE	Fin de Sesión – AAAA-MM-DD	X	X
SPRV	Información de Supervisión	X	X

Siendo:

n = Número de iteraciones de la ventana de agregación intermedia.

AAAA-MM-DD = fecha de sesión

Tabla 17. Tipos de Estructura de Cuenta

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN
HS	Propia
IS	ISA
OS	OSA
GS	GOSA
CM	Exigidos MC no asociados a cuenta de posición
NC	Exigidos MNC no asociados a cuenta de posición
BC	Buffer MC (colateral no asociado a garantías)
BN	Buffer MNC (colateral no asociado a garantías)

Tabla 18. Códigos banco depositario

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN
0	Para BME: Banco Central Europeo
8	Citi - Dublin
9	Citi - NY
A	Citi-Londres



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



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

