

A large, abstract graphic in the background consisting of overlapping, semi-transparent geometric shapes in shades of blue and grey, creating a sense of depth and movement.

Segmentos de Renta Variable y Renta Fija

Ficheros de Datos / 8 de julio de 2024

Versión 1.27

Historia de Revisiones

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

FECHA ACTUALIZACIÓN	VERSIÓN	DESCRIPCIÓN	AUTOR
15 de febrero de 2020	1.17	Nuevos ficheros CALLOCAS y CALLOCBS. Cambios en ficheros CISINCODES, CTRADES, CHISTTRADES, CALLTRADES y CBALANCEBYDATE, para el segmento de Renta Fija. Cambios en fichero CMARGINSCLM.	BME CLEARING IT
19 de junio de 2020	1.18	Cambios en fichero CMARGINSCLM	BME CLEARING IT
1 de febrero de 2021	1.19	Cambios en CTRADES, CHISTTRADES y CALLTRADES para el segmento de Renta Fija	BME CLEARING IT
1 de marzo de 2022	1.20	Cambios en fichero CFAILPENALTIES y nuevo fichero CFAILFEES	BME CLEARING IT
24 de marzo de 2022	1.21	CSTRESSTESTING: Revisión descripción MarginAmtType 313	BME CLEARING IT
11 de noviembre de 2022	1.24	Cambios en ficheros CPLEDGES, CALLOCAS y CALLOCBS. Nuevo fichero COLLATERALFEES.	BME CLEARING IT
25 de enero de 2024	1.25	Cambios en fichero COLLATERALFEES	BME CLEARING IT
21 de febrero de 2024	1.26	Cambios en ficheros CALLOCAS, CCASHMOVBRKD, CCASHMOVCC y CCASHMOVCLM.	BME CLEARING
8 de julio de 2024	1.27	Eliminar fichero CFAILPENALTIES. Nuevo campo en el fichero CMARGINACCOUNTS.	BME CLEARING

Modificaciones realizadas en la última revisión

Principales cambios respecto a la documentación v1.26:

- Se elimina el fichero CFAILPENALTIES. Se incluye un nuevo campo en el fichero CMARGINACCOUNTS.

Tabla de Contenidos

1	INTRODUCCIÓN	8
1.1	Alcance	8
1.2	Estructura del documento	8
1.3	Convenciones utilizadas en este documento	9
1.4	Futuras versiones de este documento	10
2	MECANISMO DE OBTENCIÓN DE LOS FICHEROS	11
3	DATOS GENERALES	12
3.1	Estado de la sesión	12
3.2	Entidades de la ECC	13
3.3	Datos de Valores	14
4	INFORMACIÓN PÚBLICA	20
4.1	Datos Diarios de Valores para el cálculo de Garantías	20
5	DATOS PRIVADOS DE CONFIGURACIÓN	25
5.1	Cuentas de Posición	25
5.2	Cuentas de Garantías	30
5.3	Cuentas de Colateral	32
5.4	Referencias de Asignación Externa (Miembro Origen)	35
5.5	Referencias de aceptación de Asignación Externa (Miembro Destino)	36
5.6	Filtros de aceptación de Asignación Externa (Miembro Destino)	38
5.7	Filtros de Aceptación de Asignación Externa (Compensador de Miembro Destino)	40
5.8	Módulo de Parametrización por Miembro Origen	42
6	INFORMACIÓN DE OPERACIONES	45
6.1	Operaciones de la sesión procedentes de plataformas y movimientos entre Miembros/Cuentas	45
6.2	Operaciones de cualquier sesión procedentes de plataformas y movimientos entre Miembros/Cuentas	50
6.3	Detalle de todas las Operaciones registradas en la sesión	56

7	ASIGNACIÓN DE LA CUENTA DE POSICIÓN	65
7.1	Asignaciones Internas de Cuenta y Traspasos realizados	65
7.2	Asignaciones Externas (Miembro Origen)	68
7.3	Asignaciones Externas (Miembro Destino)	74
7.4	Asignaciones Externas (Compensador de Miembro Destino)	81
8	RENTENCIÓN Y LIBERACIÓN DE OPERACIONES.....	88
8.1	Retenciones/liberaciones realizadas	88
8.2	Operaciones Retenidas	90
9	COMISIONES	95
9.1	Comisiones Miembro Compensador	95
9.2	Comisiones Colateral	97
10	GARANTÍAS DEPOSITADAS	101
10.1	Detalle de Garantías Depositadas	101
10.2	Previsión del colateral asignado a cada cuenta de colateral para la siguiente sesión	104
10.3	Colateral asignado a cada cuenta de colateral	107
11	RESULTADOS A NIVEL DE CUENTA	112
11.1	Saldo neto y saldo agregado por Fecha Teórica de Liquidación	112
11.2	Detalle del cálculo de Garantía Diaria (Garantía por Posición)	116
11.3	Garantías por Cuenta de Garantías	121
11.4	Garantías por Cuenta de Colateral	123
11.5	Información de las Pruebas Retrospectivas	125
11.6	Información de las Pruebas de Resistencia	127
11.7	Detalle por cuenta de colateral de los Movimientos de efectivo	128
11.8	Resumen agregado por cuenta de colateral de los Movimientos de efectivo	130
11.9	Garantías por cuenta de garantías no asociadas a cuentas de posición	132
11.10	Garantías exigidas y colateral depositado por cuenta de colateral no asociadas a cuentas de posición	133
12	RESULTADOS A NIVEL DE MIEMBRO COMPENSADOR.....	136
12.1	Garantías requeridas al Miembro Compensador a nivel de Contrapartida Central	136

12.2	Movimientos de efectivo para el Miembro Compensador a nivel de Contrapartida Central	140
13	RESULTADOS A NIVEL DE AGENTE DE PAGOS.....	143
13.1	Movimientos de efectivo para el Agente de Pagos a nivel de Contrapartida Central	143
14	COMPENSACIÓN E INSTRUCCIONES DE LIQUIDACIÓN	145
14.1	Instrucciones a liquidar en la siguiente sesión	145
14.2	Nuevas Instrucciones generadas por liberación	148
14.3	Detalle de Operaciones de cada Instrucción de Liquidación	151
15	INFORMACIÓN DE LIQUIDACIONES Y FALLIDOS	155
15.1	Instrucciones liquidadas en la sesión	155
15.2	Instrucciones pendientes de liquidar	158
15.3	Liquidación de Fallidos por Recompra	162
15.4	Liquidación de Fallidos en Efectivo	165
15.5	Penalizaciones DCV	168
15.6	Comisiones por fallidos	170
16	INFORMACIÓN DE EVENTOS	174
16.1	Instrucciones generadas sobre Fallidos por Eventos Corporativos	174
APÉNDICE A	INFORMACIÓN ADICIONAL.....	177
A.1	Campos de Usuario	177

Índice de Ficheros

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

1 Introducción

1.1 Alcance

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

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

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

1.2 Estructura del documento

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

En los capítulos restantes se definen los ficheros agrupándolos funcionalmente.

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

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

1.3 Convenciones utilizadas en este documento

1.3.1 Información general de cada fichero

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

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

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

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

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

- (2) Grupo al que pertenece el fichero.
- (3) Descripción del fichero.
- (4) Destinatarios del fichero.
- (5) Informa de si el fichero contiene datos públicos o privados.
- (6) Informa del momento en el que el fichero está disponible, cuándo varía y la forma de actualización de los registros.

1.3.2 Formato de las tablas de definición de mensajes

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

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

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

1.3.3 Estructura de cada fichero

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

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

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

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

1.4 Futuras versiones de este documento

1.4.1 Nuevos ficheros

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

1.4.2 Resaltando cambios

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

2 Mecanismo de obtención de los ficheros

Ver documento de conectividad.

3 Datos Generales

3.1 Estado de la sesión

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

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

3.2 Entidades de la ECC

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

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

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

3.3 Datos de Valores

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

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→106	Issuer	Issr	N		String	Código de la entidad emisora del valor o Código de gestora
→223	CouponRate	CpnRt	N		Percentage	Cupón en porcentaje del nominal. Sólo para activos de Renta Fija.
→874	InterestAccrualDate	IntAcrl	N		LocalMktDate	Fecha en la que el activo empieza a devengar cupón. Sólo para activos de Renta Fija.
→1639*	MarginClass	Clss	N		String	Grupo de compensación del activo. Sólo para activos de Renta Fija.
→ 461	CFIcode	CFI	N		String	Clasificación del valor usado como colateral (estándar ISO 10692 Código CFI, 6 caracteres alfabéticos). Sólo para activos de Renta Fija.
→ 470	CountryOfIssue	IssuCtry	N		String	Jurisdicción del Emisor (código de país según estándar ISO 3166). Sólo para activos de Renta Fija.
CISINCODES /SecList/ SecL/ Instrmt/ AID						(n times)
→→455	SecurityAltID	AltID	N		String(22)	Nombre corto del valor
→→456	SecurityAltIDSource	AltIDSrc	N	8 = Exchange Symbol	String	
CISINCODES /SecList/ SecL/ Instrmt/ Evnt						(n times)
				100 = Barrera (turbo warrants) / Barrera inferior (Inlines). Sólo para activos de RV		
				101 = Último día de negociación		
→→865	EventType	EventTyp	N	104 = Barrera superior (inlines) Sólo para activos de RV	Int	
				105 = Barrera inferior activación (turbo pro) Sólo para activos de RV		

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

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

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

4 Información Pública

4.1 Datos Diarios de Valores para el cálculo de Garantías

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
						Sólo aplica al segmento de RF.
→874	InterestAccru alDate	IntrAcrl	N		LocalMktD ate	Fecha de inicio de devengo de cupón. Presente si es diferente de la fecha de emisión. Sólo aplica al segmento de RF.
→1639*	MarginClass	Clss	N		String	Grupo de compensación del activo Sólo aplica al segmento de RF.
CISINDATA /MktDataFull/ Instrmt/ Evnt						
				300: Primer Margin Rate para Grandes Posiciones		
				301: Porcentaje a aplicar sobre el precio de cierre para determinar los precios para el cálculo del Variation Margin para posiciones compradoras y vendedoras (0 => usar precio de cierre)		
				302: Segundo Margin Rate para grandes posiciones		
→865	EventType	EventTyp	N	303: Tercer Margin Rate para grandes posiciones	Int	
				304: Cuarto Margin Rate para grandes posiciones		
				305: Quinto Margin Rate para grandes posiciones		
				306: Sexto Margin Rate para grandes posiciones		
				307: Séptimo Margin Rate para grandes posiciones		
				308: Octavo Margin Rate para grandes posiciones		

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

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

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

5 Datos Privados de Configuración

5.1 Cuentas de Posición

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
						Si PartyDetailRole [1693] = 30, contiene el código del Agente de Pagos para movimientos de efectivo
						Si PartyDetailRole [1693] = 38, contiene el código de la Cuenta de posición
						Si PartyDetailRole [1693] = 15, contiene el código de miembro al que pertenece la Cuenta de garantías
						Si PartyDetailRole [1693] = 100, contiene el código de la Cuenta de garantías
						Si PartyDetailRole [1693] = 49, contiene el código de miembro al que pertenece la Cuenta de colateral
						Si PartyDetailRole [1693] = 101, contiene el código de la Cuenta de colateral
→1692	PartyDetailID Source	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	char	
				1 = Executing Firm		
				4 = Clearing Firm		
				10 = CSD Code		
				30 = Payment Agent		
				38 = Position Account		
→1693	PartyDetailRole	R	N	15 = Margin Firm	int	
				100 = Margin Account		
				49 = Collateral Firm		
				101 = Collateral Account		
→1672	PartyDetailStatus	Stat	N	0 = Activo 1 = Baja	int	Situación del party
CACCOUNTS /PtyDetlListRpt/ PtyDetl/ ReltdPtyDetl/ Sub						(n times)
→→156 7	RelatedPartyDetailSubID	ID	N		String	Información del party. Contiene la información especificada en RelatedPartyDetailSubIDType [1568]

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

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

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

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

5.2 Cuentas de Garantías

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
						<p>Si PartyDetailRole [1693] = 15, contiene el código de miembro al que pertenece la Cuenta de garantías</p> <p>Si PartyDetailRole [1693] = 100, contiene el código de la Cuenta de garantías</p> <p>Si PartyDetailRole [1693] = 49, contiene el código de miembro al que pertenece la Cuenta de colateral</p> <p>Si PartyDetailRole [1693] = 101, contiene el código de la Cuenta de colateral</p>
→1692	PartyDetailID Source	Src	N	D = Proprietary/ Custom code 4 = Clearing Firm 15 = Margin Firm	char	
→1693	PartyDetailRole	R	N	100 = Margin Account 49 = Collateral Firm 101 = Collateral Account	int	
→1672	PartyDetailStatus	Stat	N	0 = Activo 1 = Baja	int	Situación del party
CMARGINACCOUNTS /PtyDetlListRpt/ PtyDetl/ ReltdPtyDetl/ Sub						(n times)
						<p>Información del party. Contiene la información especificada en RelatedPartyDetailSubIDType [1568]</p> <p>Para PartyDetailRole [1693] = 100 (Margin Account) los Valores posibles son:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4109, Tipo de Garantías que cubre la cuenta • Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4116, Tipo de cálculo de Garantías
→→1567	RelatedPartyDetailSubID	ID	N		String	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→→156 8	RelatedPartyDetailSubIDType	Typ	N	4109 = Tipo de Garantías que cubre la cuenta 4116 = Tipo de cálculo de Garantías	Int	

5.3 Cuentas de Colateral

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CCOLLATERALACCOUNTS / PtyDetListRpt					(n times)	
1510	PartyDetailsListReportID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Party Details List Report
715*	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716*	SettlSessID	SetSesID	N	ITD = Intradía EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
CCOLLATERALACCOUNTS / PtyDetListRpt / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	CG	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderComplID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetComplID	TID	S		String	Contiene "????"
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CCOLLATERALACCOUNTS /PtyDetListRpt/ PtyDetI						(n times)

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→1691	PartyDetailID	ID	N		String	<p>Si PartyDetailRole [1693] = 4, contiene el código de miembro que actúa como Compensador de la cuenta de Colateral de la que se está tratando</p> <p>Si PartyDetailRole [1693] = 30, contiene el código del Agente de Pagos para movimientos de efectivo</p> <p>Si PartyDetailRole [1693] = 49, contiene el código de miembro al que pertenece la Cuenta de colateral</p> <p>Si PartyDetailRole [1693] = 101, contiene el código de la Cuenta de colateral</p>
→1692	PartyDetailID Source	Src	N	D = Proprietary/ Custom code 4 = Clearing Firm	char	
→1693	PartyDetailRole	R	N	30 = Payment Agent 49 = Collateral Firm 101 = Collateral Account	int	
→1672	PartyDetailStatus	Stat	N	0 = Activo 1 = Baja	int	Situación del party
CCOLLATERALACCOUNTS /PtyDetlListRpt/ PtyDetl/ ReltdPtyDetl/ Sub						(n times)
→→156 7	RelatedPartyDetailSubID	ID	N		String	<p>Información del party. Contiene la información especificada en RelatedPartyDetailSubIDType [1568]</p> <p>Para PartyDetailRole [1693] = 101: (Collateral Account) los Valores posibles son:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4105, contiene el Modelo de Cuenta: 'A' (Agente), 'P' (Principal-to-Principal)

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
				4115 = Tipo de estructura		

5.4 Referencias de Asignación Externa (Miembro Origen)

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→ 452	PartyRole	R	S	96= Take-up Trading Firm	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
CGIVEOUTREF /RgstInstrctns/ Pty/ Sub						(1 time)
→→ 523	PartySubID	ID	S*	GOR = Give-out references	String	
→→ 803	PartySubIDType	Typ	S		Int	El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta, está presente por requerimiento del estándar
CGIVEOUTREF /RgstInstrctns/ Alloc*						(1 time)
→1729*	FirmMnemonic	FirmMnem	N		String(10)	Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm)
→161*	AllocText	Txt	N		String(18)	Referencia de Asignación Externa
→1732*	Firm AllocText	FirmTxt	N		String(18)	Referencia de Asignación definida por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm) para uso interno

5.5 Referencias de aceptación de Asignación Externa (Miembro Destino)

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CGIVEINREF / RgstInstrctns					(n times)	
513	RegistID	ID	S		String (30)	Identificador único para cada mensaje Registration Instructions
514	RegistTrans Type	TransTyp	S	0 = New	Char	
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716*	SettlSessID	SetSesID	N	ITD = Intradía EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
CGIVEINREF / RgstInstrctns / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	o	String	Identifica el tipo de mensaje

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
49	SenderCom pID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetComp ID	TID	S		String	Contiene "????"
50	SenderSubl D	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC
52	SendingTim e	Snt	S		UTC Timestam p	Hora de generación del fichero
CGIVEINREF /RgstInstrctns/ Pty						(n times)
→ 448	PartyID	ID	S*		String	Si PartyRole[452]=38, contiene la Cuenta de Posición Destino en la que debe registrarse la Asignación en caso de ser aceptada Si PartyRole[452]=95, contiene el Miembro Origen de la Asignación
→ 447	PartyIDSour ce	Src	S	D = Proprietary / Custom code	String	
→ 452	PartyRole	R	S	38 = Position Account 95 = Give-up Trading Firm	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
CGIVEINREF /RgstInstrctns/ Pty/ Sub						(1 time)
→→ 523	PartySubID	ID	S*	GIR = Give-in references	String	
→→ 803	PartySubIDT ype	Typ	S		Int	El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta, está presente por requerimiento del estándar
CGIVEINREF /RgstInstrctns/ Alloc*						(1 time)
→1729*	FirmMnemo nic	FirmMnem	N		String(10)	Mnemonotécnico de Asignación definido por el Miembro Destino (Take-up Trading Firm)
→161*	AllocText	Txt	N		String(18)	Referencia de Asignación Externa

5.6 Filtros de aceptación de Asignación Externa (Miembro Destino)

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CGIVEINFILT / RgstInstrctns						(n times)
513	RegistID	ID	S		String (30)	Identificador único para cada mensaje Registration Instructions
514	RegistTransType	TransTyp	S	0 = New	Char	
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716*	SettlSessID	SetSesID	N	ITD = Intradía EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
CGIVEINFILT / RgstInstrctns / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	o	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderComplID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetComplID	TID	S		String	Contiene "????"
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CGIVEINFILT /RgstInstrctns/ Pty						(n times)
→ 448	PartyID	ID	S*		String	Si PartyRole[452]=95, contiene el Miembro Origen de la Asignación

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
						El uso del carácter comodín “?” está permitido sólo si se utiliza en todas las posiciones tanto en el Miembro Origen de la Asignación como en la Referencia de Asignación AllocText [161] (pero no en ambos campos a la vez)
→ 447	PartyIDSource	Src	S	D = Proprietary / Custom code	String	
→ 452	PartyRole	R	S	95 = Give-up Trading Firm	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID (1 time)
CGIVEINFILT /RgstInstrctns/ Pty/ Sub						
→→ 523	PartySubID	ID	S*	GIF = Give-in filters	String	
→→ 803	PartySubIDType	Typ	S		Int	El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta, está presente por requerimiento del estándar
CGIVEINFILT /RgstInstrctns/ Stip*						
→ 233*	StipulationType	Typ	N	TAL SAL	String	
→ 234*	StipulationValue	Val	N	[N/A] o un valor numérico >=0 and <= 999999999	String	Si StipulationType = TAL, es el importe efectivo máximo para una Asignación que será aceptado automáticamente para ese Miembro Origen de la Asignación y Referencia de Asignación Si StipulationType = SAL, es el importe efectivo acumulado máximo por sesión de asignaciones que serán aceptados automáticamente para ese Miembro Origen y Referencia de Asignación

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
						Se informará a [N/A] cuando se desee que el Filtro sea totalmente abierto, esto es, no haya un importe efectivo máximo específico a comprobar
CGIVEINFILT /RgstInstrctns/ Alloc*						(1 time)
						Referencia de Asignación Externa
						El uso del carácter comodín "?" está permitido sólo si se utiliza en todas las posiciones tanto en el Miembro Origen de la Asignación como en la Referencia de Asignación AllocText [161] (pero no en ambos campos a la vez)
→ 161*	AllocText	Txt	N		String(18)	

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CGIVEINFILTCLM / RgstInstrctns					(n times)	
513	RegistID	ID	S		String (30)	Identificador único para cada mensaje Registration Instructions
514	RegistTransType	TransTyp	S	0 = New	Char	
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716*	SettlSessID	SetSesID	N	ITD = Intradía EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
CGIVEINFILTCLM / RgstInstrctns / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	o	String	Identifica el tipo de mensaje

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
49	SenderComplD	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetComplD	TID	S		String	Contiene "????"
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CGIVEINFILTCLM /RgstInstrctns/ Pty						(n times)
→ 448	PartyID	ID	S*		String	
→ 447	PartyIDSource	Src	S	D = Proprietary / Custom code	String	Si PartyRole[452] = 38, contiene la Cuenta de Posición Destino de la Asignación Si PartyRole[452] = 96, contiene el Código de Miembro Destino de la Asignación
→ 452	PartyRole	R	S	38 = Position Account 96= Take-up Trading Firm	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
CGIVEINFILTCLM /RgstInstrctns/ Pty/ Sub						(1 time)
→→ 523	PartySubID	ID	S*	GIFCM = Give-in filters of clearing member	String	
→→ 803	PartySubIDType	Typ	S		Int	El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta, está presente por requerimiento del estándar
CGIVEINFILTCLM /RgstInstrctns/ Stip*						(n times)
→ 233*	StipulationType	Typ	N	TAL SAL	String	
→ 234*	StipulationValue	Val	N	[N/A] o un valor numérico >=0 and <= 999999999	String	Si StipulationType = TAL, es el importe efectivo máximo para una Asignación para que sea aceptada automáticamente para ese Miembro Destino

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
						Si StipulationType = SAL, es el importe efectivo acumulado máximo por sesión de asignaciones que serán aceptados automáticamente para ese Miembro Destino
						Se informará a [N/A] cuando se desee que el Filtro sea totalmente abierto, esto es, no haya un importe efectivo máximo específico a comprobar

5.8 Módulo de Parametrización por Miembro Origen

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CPARMODULE / RgstInstrctns					(n times)	
513	RegistID	ID	S		String (30)	Identificador único para cada mensaje Registration Instructions
514	RegistTransType	TransTyp	S	0 = New	Char	
1	Account	Acct	N		String	Código de cliente introducido en la orden
493	RegistAcctType	AcctTyp	S*	1 - AOTC 3 - MTCH 4 - DEAL	String	Indicador de capacidad
1300*	MarketSegmentID	MktSegID	N	Ver Tabla 5 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de Segmento de Negociación Si no está informado, significa "para todos los Segmentos de Negociación"
58*	Text	Txt	N		String	Referencia externa: Referencia de la orden asignada por el usuario

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716*	SettlSessID	SetSesID	N	ITD = Intradía EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
CPARMODULE / RgstInstrctns / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	o	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderComplID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetComplID	TID	S		String	Contiene "????"
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CPARMODULE /RgstInstrctns / Pty						
						(n times)
						Si PartyRole[452]=11, contiene el código del Usuario Origen de la plataforma
						Si PartyRole[452]=13, contiene el código del Miembro Origen en la plataforma
→ 448	PartyID	ID	S*		String	Si Usuario Origen (PartyRole[452]=11) no está informado, significa "para todos los usuarios del Miembro" Si PartyRole[452]=38, contiene la Cuenta de Posición
→ 447	PartyIDSource	Src	S	D = Proprietary / Custom code 11 = Order Origination Trader	String	
→ 452	PartyRole	R	S	13 = Order Origination Firm 38 = Position Account	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
CPARMODULE /RgstInstrctns/ Pty/ Sub						
						(1 time)
→→ 523	PartySubID	ID	S*	PAM = Parameter Module	String	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→→ 803	PartySubIDType	Typ	S		Int	El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta, está presente por requerimiento del estándar
CPARMODULE /RgstInstrctns/ Alloc*						
→1729*	FirmMnemonic	FirmMnem	N		String(10)	Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm)
CPARMODULE /RgstInstrctns/ Stip*						
→ 233*	StipulationType	Typ	N	PL	String	
→ 234*	StipulationValue	Val	N		String	Código de Plataforma Si no está informado, significa "para todas las Plataformas"

6 Información de Operaciones

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
						Si PartyRole[452]=16, contiene el código de plataforma de negociación
						Si PartyRole[452]=38, contiene el código de la Cuenta de Posición asociada con la Operación
						Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante
						Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación
→→ 447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	
				1 = Executing Firm		
				4 = Clearing Firm		
				10 = CSD Code		
				11 = Order Origination Trader		
→→ 452	PartyRole	R	N	13 = Order Origination Firm	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID.
				16 = Executing System (Código de plataforma)		
				38 = Position Account		
				90 = Settlement Firm		
				91 = Settlement account		
CHISTRTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ Stip						(n times)
→→ 233	StipulationType	Typ	N	TOPEM QTYM AMTM UTI SFTTYPE FINTRATE UTIPRIOR	String	
→→ 234	StipulationValue	Val	N		String	Para Operaciones de compraventa: • Si StipulationType [233] = TOPEM, contiene el código de la ejecución en la plataforma de negociación

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

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

6.3 Detalle de todas las Operaciones registradas en la sesión

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

7 Asignación de la Cuenta de Posición

7.1 Asignaciones Internas de Cuenta y Traspasos realizados

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
64	SettlDate	SettlDt	N		LocalMktDate	Fecha Teórica de Liquidación
381	GrossTradeAmt	GrossTrdAmt	N		Amt	Importe efectivo de la asignación/traspaso
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716*	SettlSessID	SetSesID	N	ITD = Intradía EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
CTTRANSFTRADES / AllocRpt / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	AS	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderComplD	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetComplD	TID	S		String	Contiene "???"
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CTTRANSFTRADES / AllocRpt/ OrdAlloc						
Bloque OrdAlloc enviado por el cliente (1 time)						
→11	CIOrdID	CIOrdID	N	[N/A]	String	
→198	SecondaryOrderID	CIOrdID2	N		String	Identificador único de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación
→ 586*	OrigOrdModTime	OrigOrdModTm	N		UTCTimestamp	Fecha y hora de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación
→ 1*	Account	Acct	N		String	Código de cliente introducido en la orden
→ 58*	Text	Txt	N		String	Si es una Operación procedente de una orden, contiene la Referencia asignada en la orden Si es una Asignación de Cuenta Diaria o un Traspaso, contiene la Referencia de la Operación previa

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

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

7.2 Asignaciones Externas (Miembro Origen)

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

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

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

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

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

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

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

7.3 Asignaciones Externas (Miembro Destino)

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

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

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

CGIVEIN / AllocRpt / Hdr

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

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

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

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

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

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

7.4 Asignaciones Externas (Compensador de Miembro Destino)

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

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

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

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

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

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

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

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

8 Rentención y Liberación de Operaciones

8.1 Retenciones/liberaciones realizadas

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

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

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

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

8.2 Operaciones Retenidas

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

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

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

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

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

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

9 Comisiones

9.1 Comisiones Miembro Compensador

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

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

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

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

9.2 Comisiones Colateral

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

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

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
						<p>Si StipulationType [233] = REF_RATE_NAME indica el nombre del índice de referencia para el cálculo de la remuneración del colateral en efectivo.</p> <p>Si StipulationType [233] = REF_RATE indica el valor del índice de referencia utilizado para el cálculo de la remuneración del colateral en efectivo.</p> <p>Si StipulationType [233] = CASH_RATE indica la Tasa utilizada para el cálculo de la remuneración del colateral en efectivo. (Reference Rate + Spread + Spread add-on).</p> <p>Si StipulationType [233] = TREASURY_FEE_AMT indica el Importe de remuneración del colateral depositado en efectivo.</p> <p>Si StipulationType [233] = NON_CASH_COL_FEE indica la Tarifa sobre el colateral en valores, expresado en puntos básicos</p> <p>Si StipulationType [233] = NON_CASH_COL_FEE_AMT indica el Importe de la tarifa sobre el colateral en valores, expresada en la divisa del activo.</p> <p>Si StipulationType [233] = ASSET_PRICE indica el precio del activo al cierre. Para los bonos y obligaciones incluye cupón corrido.</p> <p>Si StipulationType [233] = EXCHANGE_RATE indica el tipo de cambio aplicable.</p> <p>Si StipulationType [233] = NDAYSC indica el número de días de cálculo.</p>

10 Garantías Depositadas

10.1 Detalle de Garantías Depositadas

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CPLEDGES / CollRpt					(n times)	
908	CollRptID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Collateral Report
910	CollStatus	Stat	S	3 = Assigned (Accepted)		
15	Currency	Ccy	N		Currency	Código de divisa en la que está expresado el importe efectivo. Expresada según estándar ISO 4217
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716	SettlSessID	SetSesID	N	ITD = Intradía EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
CPLEDGES / CollRpt / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	BA	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Contiene "????"
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CPLEDGES / CollRpt / Pty					(n times)	
→ 448	PartyID	ID	N		String	Si PartyRole[452]=49, contiene el código del Miembro al que pertenece la Cuenta de Colateral

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
						indica el Tipo de cambio aplicable.

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

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

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

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

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

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

10.3 Colateral asignado a cada cuenta de colateral

CALLOCBS.cc	
Grupo	Garantías Depositadas

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CALLOCBS / CollRpt						(n times)
908	CollRptID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Collateral Report
910	CollStatus	Stat	S	3 = Assigned (Accepted)		
15	Currency	Ccy	N		Currency	Código de divisa en la que está expresado el importe efectivo. Expresada según estándar ISO 4217
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716	SettlSessID	SetSesID	N	ITD = Intradía EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
64	SettlDate	SettIDt	N		String	Fecha valor de los asignados (sesión en curso, ClearingBusinessDate).
CALLOCBS / CollRpt / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	BA	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Contiene "????"
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CALLOCBS /CollRpt/ Pty						(n times)
→ 448	PartyID	ID	N		String	Si PartyRole[452]=49, contiene el código del Miembro al que pertenece la Cuenta de Colateral Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
						Si PartyRole[452]=101, contiene la Cuenta de Colateral
						Si PartyRole[452]=22, contiene el código de Segmento de la ECC
						Si PartyRole[452]= 112, contiene el origen del colateral. Cuando el colateral sea de la propia cuenta se mostrará la misma cuenta de colateral. Cuando sea de una cuenta buffer, se mostrará el código de la cuenta buffer.
→ 447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	
				49 = Collateral Firm (código de Miembro de la ECC)		
→ 452	PartyRole	R	N	4 = Clearing Firm 101 = Collateral Account 22 = Segmento 112 = Collateral Source Account	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID.
CALLOCBS /CollRpt/ Instrmt						
55	Symbol	Sym	N	[N/A] o código del activo	String(5)	
48	SecurityID	ID	N		String(12)	Código del activo entregado.
22	SecurityIDSource	Src	N	4 = ISIN number	String	
543	InstrRegistry	Rgstry	N	Ver Tabla 13, para colateral en valores, o Tabla 18, para efectivo del documento "Tablas de Codificación".	String	Código del Depositario Central del activo en el que está constituida la Garantía o del Banco en el que está depositado el efectivo.
CALLOCBS /CollRpt/ Instrmt/ Evnt						
→865	EventType	EventTyp	N	204 = Nominal 205 = Nominal Requerido 206 = Nominal en Exceso		(n times)

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
						Si EventType = 204, contiene el valor nominal del colateral total asignado a la cuenta
→868	EventText	Txt	N		String	Si EventType = 205, contiene el valor nominal del colateral requerido asignado a la cuenta
						Si EventType = 206, contiene el valor nominal del colateral en exceso asignado a la cuenta.
						En caso de acciones es el número de títulos (n veces)
CALLOCBS /CollRpt/ Stip						
→233	StipulationType	Typ	N	MARGIN_INST ASSET_TYPE HAIRCUT ASSET_PRICE ASSET_VALUE ASSET_VALREQ ASSET_VALEXC NOMINAL_CURRENCY EXCHANGE_RATE	String	
						Si StipulationType [233] = MARGIN_INST indica el modo de materialización de Garantías. Ver Tabla 12 del documento "Tablas de Codificación"
						Si StipulationType [233] = ASSET_TYPE indica el tipo de activo. Ver Tabla 14 del documento "Tablas de Codificación"
→ 234	StipulationValue	Val	N		String	Si StipulationType [233] = HAIRCUT indica el coeficiente que se aplica al precio en la valoración del activo (en tanto por ciento)
						Si StipulationType [233] = ASSET_PRICE indica el precio del activo al cierre. Para los bonos y obligaciones incluye cupón corrido

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
						<p>Si StipulationType [233] = ASSET_VALUE indica la valoración del colateral total asignado a la cuenta (Nominal * precio * haircut) / Tipo de cambio.</p> <p>Si StipulationType [233] = ASSET_VALREQ indica la valoración del colateral requerido asignado a la cuenta (Nominal * precio * haircut) / Tipo de cambio.</p> <p>Si StipulationType [233] = ASSET_VALEXC indica la valoración del colateral en exceso asignado a la cuenta (Nominal * precio * haircut) / Tipo de cambio.</p> <p>Si StipulationType [233] = NOMINAL_CURRENCY indica la divisa en la que está expresado el Nominal. Expresada según estándar ISO 4217</p> <p>Si StipulationType [233] = EXCHANGE_RATE indica el Tipo de cambio aplicable.</p>

11 Resultados a nivel de Cuenta

11.1 Saldo neto y saldo agregado por Fecha Teórica de Liquidación

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

11.3 Garantías por Cuenta de Garantías

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

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

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

11.4 Garantías por Cuenta de Colateral

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

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
□1710	PayAmount	PayAmt	N		Amt	Diferencia entre la garantía exigida por posición y las garantías depositadas
→1713	PayCollectMarketID	MktID	N	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC

11.5 Información de las Pruebas Retrospectivas

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN (n times)
□1645	MarginAmount	Amt	N		Amt	Importe asociado a MarginAmtType[1644]
→1644	MarginAmtType	Typ	N	301 302 303 304 305 306	Int	301: Valor actual de la posición: valor de la posición de la sesión que se está analizando al precio de cierre de la sesión actual. 302: Initial Margin de la sesión que se está analizando. 303: Máxima Pérdida 304: Pérdida no cubierta por el Initial Margin 305: Pérdida a 1 día 306: Pérdida a 2 días.
→1714	MarginAmountMarketSegmentID	MktSegID	N	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de Segmento de la ECC
→1715	MarginAmountMarketID	MktID	N	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC
CBACKTESTING /AcctSumRpt/ Pty						(n times)
→448	PartyID	ID	N		String	Si PartyRole[452]= 15, contiene el código de Miembro al que pertenece la Cuenta de Garantías Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador Si PartyRole[452]= 100, contiene el código de la Cuenta de Garantías
→447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID 15 = Margin Firm 4 = Clearing Firm
→452	PartyRole	R	N	100 = Margin Account	Int	Si PartyRole[452]= 15, contiene el código de Miembro al que pertenece la Cuenta de Garantías Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador

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

11.6 Información de las Pruebas de Resistencia

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→ 1714	MarginAmountMarketSegmentID	MktSegID	N	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de Segmento de la ECC
→1715	MarginAmountMarketID	MktID	N	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC
CSTRESSTESTING /AcctSumRpt/ Pty						(n times)
→ 448	PartyID	ID	N		String	Si PartyRole[452]= 15, contiene el código de Miembro al que pertenece la Cuenta de Garantías Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador Si PartyRole[452]= 100, contiene el código de la Cuenta de Garantías
→ 447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
→ 452	PartyRole	R	N	15 = Margin Firm 4 = Clearing Firm 100 = Margin Account	Int	Si PartyRole[452]= 15, contiene el código de Miembro al que pertenece la Cuenta de Garantías Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador Si PartyRole[452]= 100, contiene el código de la Cuenta de Garantías

11.7 Detalle por cuenta de colateral de los Movimientos de efectivo

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CCASHMOVBRKD / AcctSumRpt					(n times)	
1699	AccountSummaryReportID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Account Summary Report

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

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

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

CCASHMOVCC.cc	
Grupo	Resultados a nivel de Cuenta de Colateral
Descripción	Información del Movimiento de Efectivo de un Miembro Compensador desglosado por Negociador, Cuenta de Colateral y grupo de movimiento de efectivo.
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

12 Resultados a nivel de Miembro Compensador

12.1 Garantías requeridas al Miembro Compensador a nivel de Contrapartida Central

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→ 1644	MarginAmountType	Typ	N	Ver Tabla 10 del documento "Tablas de Codificación"	Int	Tipo de Garantía exigida
→1714	MarginAmountMarketSegmentID	MktSegID	N	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de Segmento de la ECC
→1715	MarginAmountMarketID	MktID	N	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC
CMARGINSCLM /AcctSumRpt/ MgnAmt/ Stip*						(1 time) Sólo aplica si MarginAmtType es 114.
→ 233*	StipulationType	Typ	N	CCD	String	
→ 234*	StipulationValue	Val	N		String	Si StipulationType = CCD, Código Cliente Compensador Directo Patrocinado. Sólo aplica si MarginAmtType es 114.
CMARGINSCLM /AcctSumRpt/ MgnAmt/ MgnAmtDet*						(n times) Desglose para MarginType 106, 107, 115 o 116.
→1645	MarginAmount	Amt	S		Amt	Importe Garantía exigida
→ 448	PartyID	ID	S		String	Si PartyRole[452]=15, contiene el código del Miembro.
→ 447	PartyIDSource	Src	S	D = Proprietary/ Custom code	Char	
→ 452	PartyRole	R	S	15 = Margin Firm	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
CMARGINSCLM /AcctSumRpt/ Pty						(n times)
→ 448	PartyID	ID	N		String	Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC.
→ 447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	
→ 452	PartyRole	R	N	4 = Clearing Firm	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
CMARGINSCLM /AcctSumRpt/ CollAmt						Garantías depositadas (n times)

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→ 1706	CollateralType	Typ	S	Ver Tabla 12 del documento "Tablas de Codificación"	String	Tipo de Garantía Depositada. Si no se incluye, el bloque informa del importe total.
→1704	CurrentCollateralAmount	Amt	S		Amt	Importe de la Garantía Depositada
→2093	CollateralAmountMarketID	MktID	N	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC
CMARGINSCLM /AcctSumRpt/ CollAmt/ Stip*						Desglose de garantías depositadas según el CollateralType (n times)
→ 233*	StipulationType	Typ	N	CLME CADF CAIE	String	Si StipulationType=CLME: Total del valor efectivo depositado como colateral en la cuenta de colateral buffer del Compensador. Si StipulationType=CADF: Total del valor efectivo depositado como colateral en cuentas de colateral que ajustan automático o por déficit y cubren el Default Fund. Si StipulationType=CAIE: Total del valor efectivo depositado como colateral cuentas de colateral que cubren garantías Individuales o Extraordinarias.
→ 234*	StipulationValue	Val	N		String	
CMARGINSCLM /AcctSumRpt/ PayCol						Movimientos de efectivo (1 time)
→1708	PayCollectType	Typ	N		String	Tipo de importe del Movimiento de Efectivo En este caso será el importe de las Garantías
→1710	PayAmount	PayAmt	N		Amt	Importe del Movimiento de Efectivo

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→ 1713	PayCollect MarketID	MktID	N	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC
CMARGINSCLM /AcctSumRpt/ PayCol/ Stip*						Desglose de movimientos de efectivo (n times)
→ 233*	Stipulation Type	Typ	N	CLME CADF CAIE	String	Si StipulationType=CLME: Movimiento de efectivo de efectivo en la cuenta de colateral buffer del Compensador. Si StipulationType=CADF: Movimiento de efectivo en cuentas de colateral que ajustan automático o por déficit y cubren el Default Fund. Si StipulationType=CAIE: Movimiento de efectivo en cuentas de colateral que y cubren garantías Individuales o Extraordinarias.
→ 234*	Stipulation Value	Val	N		String	
CMARGINSCLM /AcctSumRpt/ Stip*						(n times)
→ 233*	Stipulation Type	Typ	N	EQTY	String	Si StipulationType = EQTY, Recursos Propios de la Entidad
→ 234*	Stipulation Value	Val	N		String	Datos de riesgo
CMARGINSCLM /AcctSumRpt/ RiskLmtTyp*						(n times)
→1530*	RiskLimitType	Typ	N		String	RiskLimitType: 100 = Consumo de Límite de Riesgo Intradía resultante a fin de sesión 101 = Límite de Riesgo Intradía resultante para la siguiente sesión 102 = Garantía Individual para Nuevas Operaciones

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

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

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

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

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

13 Resultados a nivel de Agente de Pagos

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

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

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

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

14 Compensación e Instrucciones de Liquidación

14.1 Instrucciones a liquidar en la siguiente sesión

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

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

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

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

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

14.2 Nuevas Instrucciones generadas por liberación

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

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

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

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

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

14.3 Detalle de Operaciones de cada Instrucción de Liquidación

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

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

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

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

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

15 Información de Liquidaciones y Fallidos

15.1 Instrucciones liquidadas en la sesión

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

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→→ 448	PartyID	ID	N		String	Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC
						Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC
						Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV
						Si PartyRole[452]=38, contiene la Cuenta de Posición
						Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante
						Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación
→→ 447	PartyIDSour ce	Src	N	D = Proprietary/ Custom code 1 = Executing Firm 4 = Clearing Firm 10 = CSD Code	Char	
→→ 452	PartyRole	R	N	38 = Position Account 90 = Settlement Firm 91 = Settlement account	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
CSETTLEDINST /TrdCaptRpt/ RptSide/ Stip						(n times)
→→ 233	StipulationT ype	Typ	N	CLIQ ILIQDCV TINST ICORPDCV	String	
→→ 234	StipulationV alue	Val	N		String	Para Instrucciones de Liquidación: <ul style="list-style-type: none"> Si StipulationType [233] = CLIQ, contiene el número de la ventana de agregación en la que se envía la Instrucción a liquidar

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

15.2 Instrucciones pendientes de liquidar

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

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

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

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

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

15.3 Liquidación de Fallidos por Recompra

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

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

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

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

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

15.4 Liquidación de Fallidos en Efectivo

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

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

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

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

15.5 Penalizaciones DCV

	CFAILPENALTIES.sc
Grupo	Información de Liquidaciones y Fallidos
Descripción	Información mensual de las penalizaciones resultantes de los Fallidos de liquidación del segmento de RV y RF recibidas del DCV

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

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

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

15.6 Comisiones por fallidos

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

CFAILFEES.sc

Timing Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
				91 = Settlement account		

16 Información de Eventos

16.1 Instrucciones generadas sobre Fallidos por Eventos Corporativos

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

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

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

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

Apéndice A Información adicional

A.1 Campos de Usuario

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

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



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



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

