

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

Segmento de IRS

Ficheros de Datos – Nivel Cámara

21 de febrero de 2024
Versión 1.8

Historia de Revisiones

| FECHA ACTUALIZACIÓN | VERSIÓN | DESCRIPCIÓN | AUTOR |
|---------------------|---------|--|----------------------------------|
| 05/10/2015 | 1.0 | Version Inicial | Desarrollo de Negocio |
| 26/01/2016 | 1.1 | Modificaciones e inclusiones de campos Se incluye definicion del fichero CCASHMOV TREAS | Desarrollo de Negocio |
| 27/01/2016 | 1.2 | Actualizaciones de campos en los ficheros | Desarrollo de Negocio |
| 23/03/2018 | 1.3 | Cambios por la nueva estructura de cuentas | BME Clearing IT |
| 30/11/2018 | 1.4 | Cambios en ficheros por la Separación de Flujos de Efectivo. | BME Clearing IT |
| 19/06/2020 | 1.5 | Cambios en fichero CMARGIN SCLM. | BME Clearing IT |
| 11/11/2022 | 1.6 | Cambios en ficheros CPLEDGES, CALLOCAS y CALLOCBS. Nuevo fichero COLLATERALFEES | BME Clearing IT |
| 25/01/2024 | 1.7 | Cambios en fichero COLLATERALFEES | BME Clearing IT |
| 21/02/2024 | 1.8 | Cambios en ficheros CCPALLOCAS, CCASHMOVBRKD, CCASHMOVCC y CCASHMOVCLM. | BME Clearing Architecture |

Modificaciones realizadas en la última versión

- Cambios en fichero CCPALLOCAS, CCASHMOVBRKD, CCASHMOVCC y CCASHMOVCLM.

Índice

| | | |
|----------|--|----------|
| 1 | INTRODUCCIÓN | 4 |
| 1.1 | ALCANCE | 4 |
| 1.2 | ESTRUCTURA DEL DOCUMENTO | 4 |
| 1.3 | CONVENCIONES UTILIZADAS EN ESTE DOCUMENTO | 4 |
| 1.4 | FUTURAS VERSIONES DE ESTE DOCUMENTO | 6 |
| 2 | DESCRIPCIÓN GENERAL DE FICHEROS A GENERAR | 7 |
| 2.1 | RESULTADOS | 7 |
| 2.2 | DATOS PRIVADOS DE CONFIGURACION | 8 |
| 2.3 | DATOS GENERALES | 8 |
| 3 | DETALLE DE FICHEROS | 9 |
| 3.1 | FICHEROS DE RESULTADOS | 9 |
| 3.2 | FICHEROS DE DATOS PRIVADOS DE CONFIGURACION | 46 |

1 INTRODUCCIÓN

1.1 ALCANCE

Este documento tiene como objetivo la descripción funcional de los ficheros de datos que pueden ser obtenidos por los usuarios de la ECC de instrumentos de Derivados de Tipos de Interés, en el proceso de Final de Día (End of Day – EoD).

1.2 ESTRUCTURA DEL DOCUMENTO

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

- Descripción general de ficheros a generar.
- Detalle de cada uno de los ficheros. Para cada fichero se presenta:
- Descripción ampliada de los ficheros.
- Descripción estructurada de los campos de los ficheros,
- Estructura de los ficheros desarrollados en FixML y CSV del reporte de referencia.

1.3 CONVENCIONES UTILIZADAS EN ESTE DOCUMENTO

1.3.1 INFORMACIÓN GENERAL DE CADA FICHERO

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

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

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

- (1) - Nombre del fichero tal y como es generado.
- (2) - Código del fichero tal y como es generado.
- (3) - Descripción del fichero.
- (4) - Grupo al que pertenece el fichero.
- (5) - Destinatarios del fichero.
- (6) - Informa de si el fichero contiene datos públicos o privados.
- (7) - Informa del momento en el que el fichero está disponible.

1.3.2 FORMATO DE LAS TABLAS DE DEFINICIÓN DE LOS FICHEROS.

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

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

| Columna | Significado |
|-----------------|--|
| 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 TIPOS DE DATOS

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

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

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

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

1.4 FUTURAS VERSIONES DE ESTE DOCUMENTO

1.4.1 Nuevos ficheros

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

1.4.2 Resaltando cambios

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

2 DESCRIPCIÓN GENERAL DE FICHEROS A GENERAR

BME CLEARING difundirá la información de la actividad diaria de sus Miembros Compensadores a través de ficheros propios del segmento de IRS y ficheros generales que consolidan la información de todos los segmentos de la Cámara, estos últimos una vez finalizada la actividad de la Cámara (EoD), bajo los formatos FIXML.

A continuación se detallan los ficheros que consolidan la información de todos los segmentos de la Cámara en los que cada Miembro Compensador se encuentre activo, teniendo en consideración:

- **Miembro Compensador con el mismo código de Miembro:** Si un Miembro Compensador por ejemplo es miembro del segmento de Renta Fija (AXXX) y es Miembro Compensador del segmento de IRS usando el mismo código XXXX estos ficheros se recibirán con los mismos datos en formato FIXML a través de la conexión SFTP establecida para IRS y en CSV a través del S/MART.
- **Miembro Compensador con diferente código de Miembro:** Si un Miembro Compensador por ejemplo es miembro del segmento de Renta Fija (RXXX) y es Miembro Compensador del segmento de IRS usando otro código distinto, IXXX recibirá sólo los datos de IRS en formato FIXML a través de la conexión SFTP establecida para este segmento y recibirá sólo los datos de Repo en CSV (a través del S/MART).

2.1 RESULTADOS

En este grupo de fichero se informará a nivel Cámara los conceptos que serán liquidados a Miembros Compensadores en el EoD producto de su actividad en BME CLEARING.

| GRUPO | NOMBRE DEL FICHERO | DESCRIPCIÓN | HORARIO DE PUBLICACIÓN |
|------------|--------------------|--|------------------------|
| RESULTADOS | COLLATERALFEES | Detalle del cálculo de la remuneración del colateral en efectivo y la tarifa sobre el colateral en valores | EoD |
| | CPLEDGES | Valoración de los activos depositados en la Cuenta de Colateral como Garantía en la fecha de la sesión, detalladas por activo del segmento de IRS. | EoD |
| | CALLOCAS | Previsión del colateral asignado a cada Cuenta de Colateral incluyendo los movimientos de colateral en efectivo que resulten del cierre de la sesión actual. | EoD |
| | CALLOCBS | Distribución y valoración del colateral asignado a cada Cuenta de Colateral a cierre de sesión. | EoD |
| | CACCOUNTSETTL | Importes de Garantías por Posición por Cuenta de Garantías del segmento IRS. | EoD |
| | CACCOUNTSETTLCCP | Importes de Garantías por Posición y Garantías Depositadas por Cuenta de Colateral en la ECC. | EoD |
| | CCASHMOVBRKD | 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. | EoD |
| | CCASHMOVCC | Información del Movimiento de Efectivo de un Miembro Compensador desglosado por Negociador, Cuenta de Colateral y grupo de movimiento de efectivo. | EoD |
| | CREQMARGM | Importes por cuenta de garantías de las garantías exigidas no asociadas a cuentas de posición | EoD |
| | CREQMARGMCCP | Importes por cuenta de colateral del colateral depositado y las garantías exigidas no asociadas a cuentas de posición | EoD |

| GRUPO | NOMBRE DEL FICHERO | DESCRIPCIÓN | HORARIO DE PUBLICACIÓN |
|-------|----------------------|---|------------------------|
| | CMARGINSCLM | Garantías Exigidas y Depositadas, desglosadas en conceptos. Información de todos los tipos de Garantías de la ECC. | EoD |
| | CCASHMOVCLM | Información del Movimiento de Efectivo de un Miembro Compensador desglosado por Negociador y concepto. Incluye conceptos diarios y mensuales del segmento de IRS. | EoD |
| | CCASHMOVTREAS | Movimientos de efectivo a realizar por el Agente de Pagos del segmento de IRS. | EoD |

2.2 DATOS PRIVADOS DE CONFIGURACION

En este grupo de fichero se informará a nivel Cámara las características de la configuración de las Cuentas de posición, garantías y colateral.

| GRUPO | NOMBRE DEL FICHERO | DESCRIPCIÓN | HORARIO DE PUBLICACIÓN |
|--------------------------------|---------------------|---|------------------------|
| DATOS PRIVADO DE CONFIGURACION | CACCOUNTS | Información de las Cuentas de Posición abiertas por un Miembro en el Segmento de IRS de la ECC y la relación con las Cuentas de Garantías y Colateral | ITD / EoD |
| | CMARGINACCOUNTS | Información de las Cuentas de Garantías abiertas por un Miembro en el Segmento de IRS de la ECC | ITD / EoD |
| | CCOLLATERALACCOUNTS | Información de las Cuentas de Colateral abiertas por un Miembro en el Segmento de IRS de la ECC | ITD / EoD |

Los ficheros que componen el grupo Datos Privados de Configuración no son tratamiento obligatorio.

2.3 DATOS GENERALES

| NOMBRE DEL FICHERO | DESCRIPCIÓN | HORARIO DE PUBLICACIÓN |
|--------------------|--|------------------------|
| CENTITIES | Información pública de las entidades que intervienen en la ECC | ITD / EoD |

3 DETALLE DE FICHEROS

3.1 FICHEROS DE RESULTADOS

| | |
|---------------|---|
| | CCOLLATERALFEES.cc |
| 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 | SettlSessID | SetSessID | N | EOD = Fin de sesión | String | Indica que es un fichero de final de sesión |
| CCOLLATERALFEES / CollRpt / Hdr | | | | | | |
| 35 | MsgType | MsgType | S | BA | 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 |
| CCOLLATERALFEES / 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 Si PartyRole[452]=101, contiene la Cuenta de Colateral |

| Tag | Nombre | FIXML | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|--|-------------------|----------|-----|--|------------|---|
| | | | | | | 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 49 = Collateral Firm (código de Miembro de la ECC) 4 = Clearing Firm | Char | |
| → 452 | PartyRole | R | N | 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 | SecurityID Source | 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 | Stipulation Type | Typ | N | MARGIN_INST CCY_REINVESTMENT_IND ACC_REINVESTMENT_IND 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 | String | |

| Tag | Nombre | FIXML | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|----------|-------------------|-------|-----|-----------------|---------|---|
| | | | | | | <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] = 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:</p> <p>"S"=Yes "N"=No</p> <p>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:</p> <p>"S"=Yes "N"=No</p> |
| → 234 | Stipulation Value | Val | N | | String | <p>"S"=Yes "N"=No</p> <p>Si StipulationType [233] = SPREAD indica el Spread aplicado al cálculo de la remuneración del colateral en efectivo, expresado en puntos básicos.</p> <p>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.</p> <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> |

| Tag | Nombre | FIXML | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----|--------|-------|-----|-----------------|---------|--|
| | | | | | | 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). |
| | | | | | | Si StipulationType [233] = TREASURY_FEE_AMT indica el Importe de remuneración del colateral depositado en efectivo. |
| | | | | | | Si StipulationType [233] = NON_CASH_COL_FEE indica la Tarifa sobre el colateral en valores, expresado en puntos básicos |
| | | | | | | 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. |
| | | | | | | Si StipulationType [233] = ASSET_PRICE indica el precio del activo al cierre. Para los bonos y obligaciones incluye cupón corrido. |
| | | | | | | Si StipulationType [233] = EXCHANGE_RATE indica el tipo de cambio aplicable. |
| | | | | | | Si StipulationType [233] = NDAYSC indica el número de días de cálculo. |

| 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 IRS. |
| 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 | ClearingBusiness Date | 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 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 |
| → 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 (código de Miembro de la ECC) 4 = Clearing Firm 101 = Collateral Account | Int | 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 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 | | | | | | (1 time) |
| →865 | EventType | EventTyp | N | 204 = Nominal | | |
| →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 HAIRCUT ASSET_VALUE NOMINAL_CU RRENCY EXCHANGE_R ATE | 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 indica el Tipo de cambio aplicable.</p> |

| 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 |
| CALLOCAS / 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) | | |
| | | | | 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 | 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. |
| CALLOCAS /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 times) |
| CALLOCAS /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 |
|-----|--------|-------|-----|-----------------|---------|--|
| | | | | | | 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. |

| 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 | SettlDt | 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 |
|---|------------------|----------|-----|--|------------|--|
| | | | | | | <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 | |
| | | | | 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 |
|--------------------------------|------------------|-------|-----|---|---------|---|
| →868 | EventText | Txt | N | | String | <p>Si EventType = 204, contiene el valor nominal del colateral total asignado a la cuenta</p> <p>Si EventType = 205, contiene el valor nominal del colateral requerido asignado a la cuenta</p> <p>Si EventType = 206, contiene el valor nominal del colateral en exceso asignado a la cuenta.</p> <p>En caso de acciones es el número de títulos (n veces)</p> |
| 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 | |
| → 234 | StipulationValue | Val | N | | 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. 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> <p>Si StipulationType [233] = ASSET_PRICE indica el precio del activo al cierre. Para los bonos y obligaciones incluye cupón corrido</p> |

| 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> |

| CACCOUNTSETTL.sc | |
|------------------|---|
| Grupo | Resultados a nivel de Cuenta de Garantías |
| Descripción | Importes de Garantías por Posición por Cuenta de Garantías del segmento de IRS. |
| 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 "????" |
| 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 | MarginAmount | Amt | N | | Amt | Importe Garantía |
| →1644 | MarginAmountType | Typ | N | 201 | Int | 201 - Garantía por Posición |
| →1714 | MarginAmountMarketSegmentID | MktSegID | N | Ver Tabla 1 del documento | String | Código de Segmento de la ECC |

| Tag | Nombre | FIXML | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|---------------------------------------|----------------------|-------|-----|---|---------|---|
| | | | | "Tablas de Codificación" | | |
| →1715 | MarginAmountMarketID | MktID | N | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación" | String | Código de la ECC |
| CACCOUNTSETTL /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 de garantías. |
| →447 | PartyIDSource | Src | N | D = Proprietary/ Custom code | Char | |
| →452 | PartyRole | R | N | 15 = Margin Firm 4 = Clearing Firm 100 = Margin Account | Int | 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 Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador Si PartyRole[452]= 100 contiene el código de la Cuenta de Garantías |

| 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 |

| Tag | Nombre | FIXML | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|--|-------------------------|-------|-----|---|---------|---|
| →1715 | MarginAmountMarketID | MktID | N | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación" | String | Código de la ECC |
| CACCOUNTSETTLCCP /AcctSumRpt/ 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 Si PartyRole[452]=101, contiene la Cuenta de Colateral |
| →447 | PartyIDSource | Src | N | D = Proprietary/Custom code | Char | |
| →452 | PartyRole | R | N | 49 = Collateral Firm 4 = Clearing Firm 101 = Collateral Account | Int | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID Si PartyRole[452]=49, 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 |

| Tag | Nombre | FIXML | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|---|--------------------------|--------|-----|--|---------|---|
| →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 |
| →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 |

| 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. |
| 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 |
| 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 |
| 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 |

| Tag | Nombre | FIXML | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|--|----------------------------|----------|-----|---|---------|---|
| | | | | | | Si PartyRole[452]=101, contiene la Cuenta de Colateral |
| → 447 | PartyIDSource | Src | N | D Proprietary/ Custom code | = Char | |
| → 452 | PartyRole | R | N | 4 = Clearing Firm 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) |
| →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 |

| CCASHMOVCC.cd | |
|---------------|--|
| 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 | 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 |
| 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 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) | |
| → 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 |

| Tag | Nombre | FIXML | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|--|---------------------------|----------|-----|---|---------|---|
| | | | | | | Si PartyRole[452]=101, contiene la Cuenta de Colateral |
| → 447 | PartyIDSource | Src | N | D Proprietary/ Custom code | = Char | |
| → 452 | PartyRole | R | N | 4 = Clearing Firm 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 |

| 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 | 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 |
| CREQMARGM / AcctSumRpt / Hdr | | | | | | |
| 35 | MsgType | MsgTyp | S | CQ | String | Identifica el tipo de mensaje |
| 49 | SenderId | SID | S | | String | Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL" |
| 56 | TargetSenderId | TID | S | | String | Contiene "????" |
| 50 | SenderSegmentID | 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 |
| CREQMARGM /AcctSumRpt/ Pty | | | | | | (n times) |

| Tag | Nombre | FIXML | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|----------|---------------|-------|-----|---|---------|--|
| → 448 | PartyID | ID | N | | String | <p>Si PartyRole[452]= 15, contiene el código del Miembro al que pertenece la Cuenta de Garantías</p> <p>Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC</p> <p>Si PartyRole[452]= 100, contiene la Cuenta</p> |
| → 447 | PartyIDSource | Src | N | D = Proprietary/ Custom code | Char | <p>Indica el rol que toma el código especificado en PartyID</p> |
| → 452 | PartyRole | R | N | 15 = Margin Firm 4 = Clearing Firm 100 = Margin Account | Int | <p>Si PartyRole[452]= 15, contiene el código de Miembro al que pertenece la Cuenta de Garantías</p> <p>Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador</p> <p>Si PartyRole[452]= 100 contiene el código de la Cuenta de Garantías</p> |

| 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 |
| 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 |
| 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 | | | | | | Importes de Garantía (n times) |
| →1645 | MarginAmount | Amt | N | | Amt | Importe Garantía |
| →1715 | MarginAmountMarketID | MktID | N | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación" | String | Código de la ECC |
| CREQMARGMCCP / AcctSumRpt/ 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 | PartyIDSource | 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 Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador Si PartyRole[452]=101 contiene el código de la Cuenta de Colateral |
| → 452 | PartyRole | R | N | 49 = Collateral Firm 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 |
| 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 En este caso será el importe de las Garantías |
| →1710 | PayAmount | PayAmt | N | | Amt | 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 |

| 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 IRS. |
| 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 | | LocalMkt Date | Fecha de la sesión |
| 716 | SettlSessID | SetSesID | N | EOD = Fin de sesión | String | Indica si es un fichero intradía o de final de sesión |
| 255* | CreditRating | CrdrRtg | 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 | 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 |
| CMARGINSCLM /AcctSumRpt/ MgnAmt | | | | | | Importes de Garantía exigidas (n times) |
| →1645 | MarginAmt | Amt | N | | Amt | Importe Garantía exigida |
| →1644 | MarginAmtType | Typ | N | Ver Tabla 10 del documento "Tablas de Codificación" | Int | Tipo de Garantía exigida |

| Tag | Nombre | FIXML | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|--|-----------------------------|----------|-----|--|---------|--|
| →1714 | MarginAmountMarketSegmentID | MktSeglD | 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 | MarginAmt | 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 Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador |
| CMARGINSCLM /AcctSumRpt/ CollAmt | | | | | | Garantías depositadas (n times) |
| →1706 | CollateralType | Typ | S | Ver Tabla 12 del | String | Tipo de Garantía Depositada. |

| Tag | Nombre | FIXML | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|--|--------------------------|--------|-----|--|---------|--|
| | | | | documento "Tablas de Codificación" | | 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. |
| → 234* | StipulationValue | Val | N | | String | 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. |
| CMARGINSCLM /AcctSumRpt/ PayCol | | | | | | Movimientos de efectivo (1 time) |
| →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 Importe del Movimiento de Efectivo |

| Tag | Nombre | FIXML | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|---|--------------------|-------|-----|--|---------|--|
| →1713 | PayCollectMarketID | 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* | StipulationType | Typ | N | CLME CADF CAIE | String | Si StipulationType=CLME: Movimiento de efectivo en la cuenta de colateral buffer del Compensador. |
| → 234* | StipulationValue | Val | N | | String | 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. |
| CMARGINSCLM /AcctSumRpt/ Stip* | | | | | | (n times) |
| →233* | StipulationType | Typ | N | EQTY | String | Si StipulationType = EQTY, Recursos Propios de la Entidad |
| → 234* | StipulationValue | Val | N | | String | |
| CMARGINSCLM /AcctSumRpt/ RiskLmtTyp* | | | | | | Datos de riesgo (n times) |
| | | | | | | RiskLimitType: 100 = Consumo de Límite de Riesgo Intradía resultante a fin de sesión |
| →1530* | RiskLimitType | Typ | N | | String | 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 | MktSegl D | 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 |

| 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 IRS. |
| 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 | 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 |
| CCASHMOVCLM / 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 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 | |

| Tag | Nombre | FIXML | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|---|---------------------------|----------|-----|---|---------|--|
| →452 | PartyRole | R | N | 1 = Executing Firm (código de Miembro de la ECC) 4 = Clearing Firm | Int | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID 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 (n times) |
| →1708 | PayCollectType | Typ | N | Ver Tabla 11 del documento "Tablas de Codificación" | String | Tipo de importe del Movimiento de Efectivo |
| →1710 | PayAmount | PayAmt | N | | Amt | Importe del Movimiento de Efectivo |
| →1712 | PayCollectMarketSegmentID | MktSegID | N | Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" | String | Código de Segmento de la ECC |
| →1713 | PayCollectMarketID | MktID | N | Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación" | String | Código de la ECC |
| CCASHMOVCLM /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 |

| CCASHMOVTREAS.cc | |
|------------------|--|
| Grupo | Resultados a nivel de Agente de Pagos |
| Descripción | Movimientos de efectivo a realizar por el Agente de Pagos del segmento de IRS. |
| 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 |
| →447 | PartyIDSource | Src | N | D = Proprietary/ | Char | |

| Tag | Nombre | FIXML | Req | Valores válidos Custom code | Formato | Descripción |
|--|---------------------------|----------|-----|--|---------|--|
| →452 | PartyRole | R | N | 4 = Clearing Firm 30 = Payment Agent | Int | Indica el rol que toma el código especificado en PartyID 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 |

3.2 FICHEROS DE DATOS PRIVADOS DE CONFIGURACION

| CACCOUNTS.sc | |
|---------------|---|
| Grupo | Datos Privados de Configuración |
| Descripción | Información de las Cuentas de Posición abiertas por un Miembro en el Segmento de IRS 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 / PtyDetlListRpt | | | | | | (n times) |
| 1510 | PartyDetailsList ReportID | 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 |
| CACCOUNTS / 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 |
| CACCOUNTS /PtyDetlListRpt/ PtyDetl | | | | | | (n times) |
| | | | | | | Si PartyDetailRole [1693] = 1, contiene el código de Miembro de la ECC al que pertenece la cuenta de posición |
| →1691 | PartyDetailID | ID | N | | String | Si PartyDetailRole [1693] = 4, contiene el código de miembro que actúa como Compensador de la cuenta de posición de la que se está tratando |

| Tag | Nombre | FIXML | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|---|-------------------------|-------|-----|---|---------|---|
| | | | | | | Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV |
| | | | | | | 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 | PartyDetailDSrc | Src | N | D = Proprietary/ Custom code | char | |
| | | | | 1 = Executing Firm 4 = Clearing Firm 10 = CSD Code 30 = Payment Agent 38 = Position Account 15 = Margin Firm 100 = Margin Account 49 = Collateral Firm 101 = Collateral Account | | |
| →1693 | PartyDetailRole | R | N | | int | |
| | | | | | | |
| →1672 | PartyDetailStatus | Stat | N | 0 = Activo 1 = Baja | int | Situación del party |
| CACCOUNTS /PtyDetListRpt/ PtyDetl/ ReltdPtyDetl/ Sub | | | | | | (n times) |
| →→1567 | RelatedPartyDetailSubID | ID | N | | String | Información del party. Contiene la información especificada en |

| Tag | Nombre | FIXML | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----|--------|-------|-----|-----------------|---------|---|
| | | | | | | <p>RelatedPartyDetailSubIDType [1568]</p> <p>Para PartyDetailRole [1693] = 38 (Position Account) los Valores posibles son:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Si RelatedPartyDetailSubID Type [1568] = 26 contiene el tipo de Cuenta de posición (ver Tabla 9 del documento "Tablas de Codificación") • Si RelatedPartyDetailSubID Type [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 RelatedPartyDetailSubID Type [1568] = 2, contiene el tipo de persona (ver Tabla 8 del documento "Tablas de Codificación") • Si RelatedPartyDetailSubID Type [1568] = 5, contiene la Razón Social • Si RelatedPartyDetailSubID Type [1568] = 9, contiene el Nombre del Titular • Si RelatedPartyDetailSubID Type [1568] = 39, contiene la Nacionalidad |

| Tag | Nombre | FIXML | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|-----|--------|-------|-----|-----------------|---------|--|
| | | | | | | del Titular según estándar ISO 3166 |
| | | | | | | <ul style="list-style-type: none"> • Si RelatedPartyDetailSubID Type [1568] = 4101, contiene el 1er Apellido del Titular • Si RelatedPartyDetailSubID Type [1568] = 4102, contiene el 2º Apellido del Titular • Si RelatedPartyDetailSubID Type [1568] = 4103, contiene el tipo de Identificación del Titular (ver Tabla 15 del documento "Tablas de Codificación") • Si RelatedPartyDetailSubID Type [1568] = 4104, contiene la Identificación del Titular • Si RelatedPartyDetailSubID Type [1568] = 34 contiene la Población • Si RelatedPartyDetailSubID Type [1568] = 36, contiene el Código Postal • Si RelatedPartyDetailSubID Type [1568] = 37, contiene el Domicilio • Si RelatedPartyDetailSubID Type [1568] = 38, contiene el País de Residencia según estándar ISO 3166 • Si RelatedPartyDetailSubID Type [1568] = 4105, contiene el Modelo de Cuenta: 'A' (Agente), 'P' (Principal-to-Principal) • Si RelatedPartyDetailSubID Type [1568] = 4107, contiene el LEI |

| Tag | Nombre | FIXML | Req | Valores válidos | Formato | Descripción | |
|--------|-----------------------------|-------|-----|---|---------|---|--|
| | | | | | | <ul style="list-style-type: none"> Si RelatedPartyDetailSubID Type [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"> RelatedPartyDetailSubID Type [1568] = 90, contiene el código de la Entidad Participante RelatedPartyDetailSubID Type [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 4104 = Identificación 34 = Población 36 = Código Postal 37 = Domicilio 38 = País Residencia 90 = Settlement Firm 91 = Settlement Account 4105 = Modelo de Cuenta 4107 = LEI 4108 = Indicador de Clearing Indirecto | | | |
| →→1568 | RelatedPartyDetailSubIDType | Typ | N | | Int | | |

| CMARGINACCOUNTS.sc | |
|--------------------|--|
| Grupo | Datos Privados de Configuración |
| Descripción | Información de las Cuentas de Garantías abiertas por un Miembro en el Segmento de IRS 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 | deString | 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 | 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 |
| 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 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 |

| Tag | Nombre | FIXML | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|--|--------------------------------|-------|-----|--|---------|--|
| | | | | | | 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 | PartyDetailIDSource | Src | N | D = Proprietary/ Custom code | char | |
| | | | | 4 = Clearing Firm | | |
| | | | | 15 = Margin Firm | | |
| →1693 | PartyDetailRole | R | N | 100 = Margin Account | int | |
| | | | | 49 = Collateral Firm | | |
| | | | | 101 = Collateral Account | | |
| →1672 | PartyDetailStatus | Stat | N | 0 = Activo 1 = Baja | int | Situación del party |
| CMARGINACCOUNTS /PtyDetlListRpt/ PtyDetl/ ReltdPtyDetl/ Sub | | | | | | (n times) |
| | | | | | | Información del party. Contiene la información especificada en RelatedPartyDetailSubIDType [1568] |
| →→1567 | RelatedPartyDetailSubID | ID | N | | String | Para PartyDetailRole [1693] = 100 (Margin Account) los Valores posibles son: Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4109, Tipo de Garantías que cubre la cuenta |
| →→1568 | RelatedPartyDetailSubIDTypeTyp | | N | 4109=Tipo de Garantías que cubre la cuenta | Int | |

| CCOLLATERALACCOUNTS.sc | |
|------------------------|--|
| Grupo | Datos Privados de Configuración |
| Descripción | Información de las Cuentas de Colateral abiertas por un Miembro en el Segmento de IRS 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 / 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 |

| CCOLLATERALACCOUNTS / 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 |

| CCOLLATERALACCOUNTS /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 Colateral de la que se está tratando Si PartyDetailRole [1693] = 30, contiene el código del Agente de Pagos para movimientos de efectivo Si PartyDetailRole [1693] = 49, contiene el código de |

| Tag | Nombre | FIXML | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|---|-------------------------|-------|-----|---|---------|---|
| | | | | | | 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 | |
| →1693 | PartyDetailRole | R | N | 4 = Clearing Firm 30 = Payment Agent 49 = Collateral Firm 101 = Collateral Account | int | |
| →1672 | PartyDetailStatus | Stat | N | 0 = Activo 1 = Baja | int | Situación del party |
| CCOLLATERALACCOUNTS /PtyDetListRpt/ PtyDet/ ReltdPtyDet/ Sub | | | | | | (n times) |
| →→1567 | RelatedPartyDetailSubID | ID | N | | String | Información del party. Contiene la información especificada en RelatedPartyDetailSubIDType [1568] Para PartyDetailRole [1693]= 101: (Collateral Account) los Valores posibles son: <ul style="list-style-type: none"> • Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4105, contiene el Modelo de Cuenta: 'A' (Agente), 'P' (Principal-to-Principal) • Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4108, contiene el Indicador de Clearing Indirecto • Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4111, contiene el Grupo de movimientos de efectivo asociados al |

| Tag | Nombre | FIXML | Req | Valores válidos | Formato | Descripción |
|--------|-----------------------------|-------|-----|--|---------|--|
| | | | | | | <p>Agente de Pagos</p> <ul style="list-style-type: none"> • 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 |
| →→1568 | RelatedPartyDetailSubIDType | Typ | N | 4105 = Modelo de Cuenta 4108 = Indicador de Clearing Indirecto 4111 = Grupo de movimientos de efectivo asociados al Agente de Pagos 4112 = Tipo ajuste Efectivo 4113 = Indicador de reinversión 4114 = Referencia estructura de cuenta 4115 = Tipo de estructura | Int | |

| CENTITIES.sc | |
|---------------|--|
| Grupo | Datos Generales |
| Descripción | Información pública de las entidades que intervienen en la ECC |
| Destinatarios | Todos los usuarios del Segmento IRS 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 | PartyDetails ListReportID | 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 | PartyDetailSource | 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 RelatedPartyDetailSubl DType [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 | RelatedPartyDetailSublDType | Typ | N | 23 = Código de la Entidad Participante en el Banco Central Europeo (código ECB) | int | |
| | | | | 4100 = Tipo de Entidad en 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

