Segmento de IRS
Ficheros de Datos – Nivel Cámara

8 de julio de 2024
Versión 1.9

a SIX company

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 defincion del fichero CCASHMOVTREAS	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 CMARGINSCLM.	BME Clearing IT
11/11/2022	1.6	Cambios en ficheros CPLEDGES, CALLOCAS y CALLOCBS. Nuevo fichero CCOLLATERALFEES	BME Clearing IT
25/01/2024	1.7	Cambios en fichero CCOLLATERALFEES	BME Clearing IT
21/02/2024	1.8	Cambios en ficheros CCPALLOCAS, CCASHMOVBRKD, CCASHMOVCC y CCASHMOVCLM.	BME Clearing Architecture
08/07/2024	1.9	Cambios en fichero CMARGINACCOUNTS	BME Clearing

Modificaciones realizadas en la última versión

- Se incluye un nuevo campo en el fichero CMARGINACCOUNTS.

Sensitivity: C2 Internal

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

Sensitivity: C2 Internal

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:

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

(1) - Nombre del fichero tal y como es generado.

(2) - Código del fichero tal y como es generado.

(3) - Descripción del fichero.

(4) - Grupo al que pertenece el fichero.

(5) - Destinatarios del fichero.

(6) - Informa de si el fichero contiene datos públicos o privados.

(7) - Informa del momento en el que el fichero está disponible.

Sensitivity: C2 Internal

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.

Sensitivity: C2 Internal

- **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 revisón se presentara con fuente tachada.

Sensitivity: C2 Internal

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 ultimos 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 AXXX 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 efectiro. 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

Sensitivity: C2 Internal

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

Sensitivity: C2 Internal

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	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)
→ 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

Sensitivity: C2 Internal

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	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	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
CCOLLATERALFEES /CollRpt/ Stip						(n times)
→ 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	

Sensitivity: C2 Internal

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
→ 234	Stipulation Value	Val	N		String	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 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. Si StipulationType [233] = REF_RATE_NAME indica el nombre del índice de referencia para el cálculo de la remuneración del colateral en efectivo. Si StipulationType [233] = REF_RATE indica el valor del índice de referencia utilizado para el cálculo de la remuneración del colateral en efectivo.

Sensitivity: C2 Internal

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.

Sensitivity: C2 Internal

	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

Sensitivity: C2 Internal

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	49 = Collateral Firm (código de Miembro de la ECC) 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. 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

Sensitivity: C2 Internal

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_CURRENCY EXCHANGE_RATE	String	
→ 234	StipulationValue	Val	N		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 entregado. Ver Tabla 14 del documento "Tablas de Codificación" 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 el valor del activo: (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.

Sensitivity: C2 Internal

	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

Sensitivity: C2 Internal

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	
→ 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.
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						(n times)
→865	EventType	EventTyp	N	204 = Nominal 205 = Nominal Requerido 206 = Nominal en Exceso		

Sensitivity: C2 Internal

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
→868	EventText	Txt	N		String	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 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	
→ 234	StipulationValue	Val	N		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" 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

Sensitivity: C2 Internal

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.

Sensitivity: C2 Internal

	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

Sensitivity: C2 Internal

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	
→ 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.
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						(n times)
→865	EventType	EventTyp	N	204 = Nominal 205 = Nominal Requerido 206 = Nominal en Exceso		

Sensitivity: C2 Internal

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
→868	EventText	Txt	N		String	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 Si EventType = 206, contiene el valor nominal del colateral en exceso asignado a la cuenta. En caso de acciones es el número de títulos
CALLOCBS /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	
→ 234	StipulationValue	Val	N		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" 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

Sensitivity: C2 Internal

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.

Sensitivity: C2 Internal

	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	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
CACCOUNTSETTL / 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
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	String	Código de Segmento de la ECC

Sensitivity: C2 Internal

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

Sensitivity: C2 Internal

	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	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
CACCOUNTSETTLCCP / 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
CACCOUNTSETTLCCP /AcctSumRpt/ MgnAmt						Importes de Garantía (n times)
→1645	MarginAmt	Amt	N		Amt	Importe Garantía
→1644	MarginAmtType	Typ	N	201	Int	201 - Garantía por Posición

Sensitivity: C2 Internal

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

Sensitivity: C2 Internal

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

Sensitivity: C2 Internal

	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 efectiro. 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	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
CCASHMOVBRKD / 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
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

Sensitivity: C2 Internal

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	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
CCASHMOVBRKD /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

Sensitivity: C2 Internal

	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	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
CCASHMOVCC / 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
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

Sensitivity: C2 Internal

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

Sensitivity: C2 Internal

	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	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
CREQMARGM / 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
CREQMARGM /AcctSumRpt/ MgnAmt						Importes de Garantía (n times)
→1645	MarginAmt	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)

Sensitivity: C2 Internal

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
→ 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	
→ 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

Sensitivity: C2 Internal

	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	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	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
CREQMARGMCCP /AcctSumRpt/ MgnAmt						Importes de Garantía (n times)
→1645	MarginAmt	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

Sensitivity: C2 Internal

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	
→ 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
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

Sensitivity: C2 Internal

	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	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	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

Sensitivity: C2 Internal

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.

Sensitivity: C2 Internal

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	
→ 234*	StipulationValue	Val	N		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.
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

Sensitivity: C2 Internal

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	
→ 234*	StipulationValue	Val	N		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.
CMARGINSCLM /AcctSumRpt/ Stip*						(n times)
→233*	StipulationType	Typ	N	EQTY	String	
→ 234*	StipulationValue	Val	N		String	Si StipulationType = EQTY, Recursos Propios de la Entidad
CMARGINSCLM /AcctSumRpt/ RiskLmtTyp*						Datos de riesgo (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

Sensitivity: C2 Internal

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

Sensitivity: C2 Internal

	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	

Sensitivity: C2 Internal

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

Sensitivity: C2 Internal

	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	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
CCASHMOVTREAS / 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
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	

Sensitivity: C2 Internal

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
				Custom code		
→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*	Stipulation Type	Typ	N	CMGRP	String	"CMGRP"
→ 234*	Stipulation Value	Val	N		String	Grupo de movimiento de efectivo asociado al Agente de Pagos

Sensitivity: C2 Internal

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	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
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

Sensitivity: C2 Internal

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	PartyDetailIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	char	
→1693	PartyDetailRole	R	N	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	int	
→1672	PartyDetailStatus	Stat	N	0 = Activo 1 = Baja	int	Situación del party
CACCOUNTS /PtyDetlListRpt/ PtyDetl/ ReltdPtyDetl/ Sub						(n times)
→→1567	RelatedPartyDetailSubID	ID	N		String	Información del party. Contiene la información especificada en

Sensitivity: C2 Internal

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
						RelatedPartyDetailSubIDType [1568] Para PartyDetailRole [1693] = 38 (Position Account) los Valores posibles son: • 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 Para PartyDetailRole [1693] = 101: (Collateral Account) los Valores posibles son: • 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

Sensitivity: C2 Internal

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
						del Titular según estándar ISO 3166 • 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

Sensitivity: C2 Internal

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
						• Si RelatedPartyDetailSubID Type [1568] = 4108, contiene el Indicador de Clearing Indirecto Para PartyDetailRole [1693] = 10 (CSD Code) los Valores posibles son: • RelatedPartyDetailSubID Type [1568] = 90, contiene el código de la Entidad Participante • RelatedPartyDetailSubID Type [1568] = 91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación
→→1568	RelatedPartyDetailSubIDType	Typ	N	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	Int	

Sensitivity: C2 Internal

	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	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	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

Sensitivity: C2 Internal

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	
→1693	PartyDetailRole	R	N	4 = Clearing Firm 15 = Margin Firm 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)
→→1567	RelatedPartyDetailSubID	ID	N		String	Información del party. Contiene la información especificada en RelatedPartyDetailSubIDType [1568] Para PartyDetailRole [1693] = 100 (Margin Account) los Valores posibles son: Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4109, Tipo de Garantías que cubre la cuenta Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4116, Tipo de cálculo de Garantías
→→1568	RelatedPartyDetailSubIDTypeTyp		N	4109=Tipo de Garantías que cubre la cuenta	Int	

Sensitivity: C2 Internal

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
				4116 =Tipo de cálculo de Garantías		

Sensitivity: C2 Internal

	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	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
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

Sensitivity: C2 Internal

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 /PtyDetlListRpt/ PtyDetl/ ReltdPtyDetl/ 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: • 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

Sensitivity: C2 Internal

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
						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
→→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	

Sensitivity: C2 Internal

	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	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	PartyDetailIDSource	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]

Sensitivity: C2 Internal

Tag	Nombre	FIXML	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
						Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4100, contiene el tipo de Entidad en la ECC (ver Tabla 7 del documento "Tablas de Codificación")
→1568	RelatedPartyDetailSubIDType	Typ	N	1 = Nombre de la Entidad 16 = Código BIC de la Entidad Participante en el DCV 23 = Código de la Entidad Participante en el Banco Central Europeo (código ECB) 4100 = Tipo de Entidad en la ECC	int	

Sensitivity: C2 Internal

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

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

Sensitivity: C2 Internal