

Segmentos de Renta Variable y Renta Fija

Ficheros de Datos

8 de julio de 2024

Versión 1.27

Historia de Revisiones

FECHA ACTUALIZACIÓN	VERSIÓN	DESCRIPCIÓN	AUTOR
20 de diciembre de 2013	1.0	Versión Inicial	BME CLEARING IT
4 de julio de 2014	1.1	Change Requests junio 2014	BME CLEARING IT
27 de noviembre de 2014	1.2	Change Requests octubre 2014	BME CLEARING IT
23 de marzo de 2015	1.3	Change Requests enero 2015	BME CLEARING IT
18 de mayo de 2015	1.4	Cambios menores mayo 2015	BME CLEARING IT
13 de noviembre de 2015	1.5	Cambios menores noviembre 2015	BME CLEARING IT
23 de septiembre de 2016	1.6	Versión producción septiembre 2016	BME CLEARING IT
24 de noviembre de 2016	1.7	Inclusión de campos a informar por el segmento de Renta Fija y cambios en Renta Variable por implantación T2S.	BME CLEARING IT
18 de mayo de 2017	1.8	Cambio nomenclatura: rating por solvencia.	BME CLEARING IT
1 de diciembre de 2017	1.9	Fichero CACCOUNTS incluye el LEI. Cambios en valores válidos del Indicador de Capacidad.	BME CLEARING IT
1 de febrero de 2018	1.10	Registro de Deuda Indexada en Renta Fija.	BME CLEARING IT
6 de febrero de 2018	1.11	Cambios por MiFID II y Nueva estructura de cuentas	BME CLEARING IT
3 de septiembre de 2018	1.12	Fichero CTRANSFTRADES: en asignaciones múltiples el campo TrdDt contiene la Fecha Teórica de Liquidación.	BME CLEARING IT
5 de noviembre de 2018	1.13	Cambio en campo TrdDt de los ficheros CGIVEIN, CGIVEOUT y CGIVEINCLM. Cambios en ficheros por la Separación de Flujos de Efectivo.	BME CLEARING IT
15 de marzo de 2019	1.14	Fichero CENTITIES: no informa del BIC del Agente de Pagos.	BME CLEARING IT
30 de octubre de 2019	1.16	Fichero CISINDATA: se modifica el contenido de los campos EventType y EventText del bloque Instrmt/Evnt. Nuevos ficheros CREQMARGM y CREQMARGMCCP. Fichero CMARGINSCLM: incluye el Límite de Riesgo Intradía resultante a fin de sesión.	BME CLEARING IT
15 de febrero de 2020	1.17	Nuevos ficheros CALLOCAS y CALLOCBS. Cambios en ficheros CISINCODES, CTRADES, CHISTTRADES, CALLTRADES y CBALANCEBYDATE, para el segmento de Renta Fija. Cambios en fichero CMARGINSCLM.	BME CLEARING IT
19 de junio de 2020	1.18	Cambios en fichero CMARGINSCLM	BME CLEARING IT
1 de febrero de 2021	1.19	Cambios en CTRADES, CHISTTRADES y CALLTRADES para el segmento de Renta Fija	BME CLEARING IT

FECHA ACTUALIZACIÓN	VERSIÓN	DESCRIPCIÓN	AUTOR
1 de marzo de 2022	1.20	Cambios en fichero CFAILPENALTIES y nuevo fichero CFAILFEES	BME CLEARING IT
24 de marzo de 2022	1.21	CSTRESSTESTING: Revisión Descripción MarginAmtType 313	BME CLEARING IT
11 de noviembre de 2022	1.24	Cambios en ficheros CPLEDGES, CALLOCAS y CALLOCBs. Nuevo fichero COLLATERALFEES.	BME CLEARING IT
25 de enero de 2024	1.25	Cambios en fichero COLLATERALFEES	BME CLEARING IT
21 de febrero de 2024	1.26	Cambios en ficheros CALLOCAS, CCASHMOVBRKD, CCASHMOVCC y CCASHMOVCLM.	BME CLEARING
8 de julio de 2024	1.27	Eliminar fichero CFAILPENALTIES. Nuevo campo en el fichero CMARGINACCOUNTS.	BME CLEARING

Modificaciones realizadas en la última revisión

Principales cambios respecto a la documentación v1.26:

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

Tabla de Contenidos

1. Introducción	7	7. Asignación de la Cuenta de Posición	67
1.1. Alcance	7	7.1 Asignaciones Internas de Cuenta y Traspasos realizados	67
1.2 Estructura del documento	7	7.2 Asignaciones Externas (Miembro Origen)	71
1.3 Convenciones utilizadas en este documento	9	7.3 Asignaciones Externas (Miembro Destino)	76
1.4 Futuras versiones de este documento	11	7.4 Asignaciones Externas (Compensador de Miembro Destino)	82
2. Mecanismo de obtención de los ficheros	11	8. Retención y Liberación de Operaciones	89
3. Datos Generales	12	8.1 Retenciones/liberaciones realizadas	89
3.1 Estado de la sesión	12	8.2 Operaciones Retenidas	92
3.2 Entidades de la ECC	13	9. Comisiones	97
3.3 Datos de Valores	15	9.1 Comisiones Miembro Compensador	97
4. Información Pública	21	9.2 Comisiones Colateral	99
4.1 Datos Diarios de Valores para el cálculo de Garantías	21	10. Garantías Depositadas	105
5. Datos Privados de Configuración	26	10.1 Detalle de Garantías Depositadas	105
5.1 Cuentas de Posición	26	10.2 Previsión del colateral asignado a cada cuenta de colateral para la siguiente sesión	108
5.2 Cuentas de Garantías	32	10.3 Colateral asignado a cada cuenta de colateral	113
5.3 Cuentas de Colateral	34	11. Resultados a nivel de Cuenta	117
5.4 Referencias de Asignación Externa (Miembro Origen)	37	11.1 Saldo neto y saldo agregado por Fecha Teórica de Liquidación	117
5.5 Referencias de aceptación de Asignación Externa (Miembro Destino)	38	11.2 Detalle del cálculo de Garantía Diaria (Garantía por Posición)	121
5.6 Filtros de aceptación de Asignación Externa (Miembro Destino)	40	11.3 Garantías por Cuenta de Garantías	126
5.7 Filtros de Aceptación de Asignación Externa (Compensador de Miembro Destino)	42	11.4 Garantías por Cuenta de Colateral	128
5.8 Módulo de Parametrización por Miembro Origen	44	11.5 Información de las Pruebas Retrospectivas	130
6. Información de Operaciones	47	11.6 Información de las Pruebas de Resistencia	132
6.1 Operaciones de la sesión procedentes de plataformas y movimientos entre Miembros/ Cuentas	47	11.7 Detalle por cuenta de colateral de los Movimientos de efectivo	134
6.2 Operaciones de cualquier sesión procedentes de plataformas y movimientos entre Miembros/ Cuentas	53	11.8 Resumen agregado por cuenta de colateral de los Movimientos de efectivo	136
6.3 Detalle de todas las Operaciones registradas en la sesión	59	11.9 Garantías por cuenta de garantías no asociadas a cuentas de posición	138
		11.10 Garantías exigidas y colateral depositado por cuenta de colateral no asociadas a cuentas posición	140

Tabla de Contenidos

12. Resultados a nivel de Miembro Compensador	143
12.1 Garantías requeridas al Miembro Compensador a nivel de Contrapartida Central	143
12.2 Movimientos de efectivo para el Miembro Compensador a nivel de Contrapartida Central	148
13. Resultados a nivel de Agente de Pagos	150
13.1 Movimientos de efectivo para el Agente de Pagos a nivel de Contrapartida Central	150
14. Compensación e Instrucciones de Liquidación	152
14.1 Instrucciones a liquidar en la siguiente sesión	152
14.2 Nuevas Instrucciones generadas por liberación	155
14.3 Detalle de Operaciones de cada Instrucción de Liquidación	158
15. Información de Liquidaciones y Fallidos	163
15.1 Instrucciones liquidadas en la sesión	163
15.2 Instrucciones pendientes de liquidar	166
15.3 Liquidación de Fallidos por Recompra	170
15.4 Liquidación de Fallidos en Efectivo	174
15.5 Penalizaciones DCV	177
15.6 Comisiones por fallidos	180
16. Información de Eventos	183
16.1 Instrucciones generadas sobre Fallidos por Eventos Corporativos	183
Apéndice A Información adicional	186
A.1 Campos de Usuario	186

Índice de Ficheros

CSTATUS.sc	12	CALLOCBS.sc	113
CENTITIES.sc	13	CBALANCEBYDATE.sc	117
CISINCODES.sc	15	CMARGINCALC.sc	121
CISINDATA.sc	21	CACCOUNTSETTL.cc	126
CACCOUNTS.sc	26	CACCOUNTSETTLCCP.cc	128
CMARGINACCOUNTS.sc	32	CBACKTESTING.sc	130
CCOLLATERALACCOUNTS.sc	34	CSTRESSTESTING.sc	132
CGIVEOUTREF.sc	37	CCASHMOVBRKD.cc	134
CGIVEINREF.sc	38	CCASHMOVCC.cc	136
CGIVEINFILT.sc	40	CREQMARGM.sc	138
CGIVEINFILTCLM.sc	42	CREQMARGMCCP.cc	140
CPARMODULE.sc	44	CMARGINSCLM.cc	143
CTRADES.sc	47	CCASHMOVCLM.cc	148
CHISTTRADES.sc	53	CCASHMOVTREAS.cc	150
CALLTRADES.sc	59	CSETTLINSTNEXT.sc	152
CTRANSFTRADES.sc	67	CSETTLINSTREL.sc	155
CGIVEOUT.sc	71	CSETTLINSTDET.sc	158
CGIVEIN.sc	76	CSETTLEDINST.sc	163
CGIVEINCLM.sc	82	CPENDINGINST.sc	166
CHOLDRELEASE.sc	89	CFAILBUYIN.sc	170
CHELDTRADES.sc	92	CFAILCASHSETTL.sc	174
CMONTHLYFEES.sc	97	CFAILPENALTIES.sc	177
CCOLLATERALFEES.cc	99	CFAILFEES.sc	180
CPLEDGES.cc	105	CFAILSADJUST.sc	183
CALLOCAS.sc	108		

1. Introducción

1.1. Alcance

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

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

La implementación propia de BME Clearing se describe en el esquema incluido en el archivo BMEclearing_FIXML.5.0_v1.25.7z, que es el que deberá ser tenido en cuenta por los desarrolladores.

1.2 Estructura del documento

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

En los capítulos restantes se definen los ficheros agrupándolos funcionalmente.

- Datos Generales: estado de la sesión, datos de entidades y Valores.
- Información pública diaria: datos empleados por los algoritmos de cálculo de Garantías.
- Datos privados de configuración: características de la configuración de Cuentas (de posición, garantías y colateral) Referencias y Filtros de Asignación Externa y Módulo de Parametrización.
- Operaciones: detalle de las Operaciones del día y de todas aquellas que están pendientes de liquidar.
- Asignación de la Cuenta de Posición: acciones de Asignación Interna de cuenta, Traspaso o Asignación Externa efectuadas sobre las Operaciones.

- Gestión de Operaciones para la Liquidación: retenciones/liberaciones realizadas, y resumen de Operaciones retenidas.
- Comisiones: datos relativos al importe de comisiones.
- Garantías Depositadas: datos relativos a las Garantías Depositadas.
- Resultados a nivel de Cuenta de Posición: saldo por cuenta de posición (neto para cuentas netas y agregado para cuentas brutas).
- Resultados a nivel de Cuenta de Garantías para Miembros Compensadores: datos relativos a las Garantías Exigidas y datos de Movimientos de Efectivo.
- Resultados a nivel de Cuenta de Colateral para Miembros Compensadores: datos relativos a las Garantías Depositadas, y datos de Movimientos de Efectivo.
- Resultados para Agentes de Pagos: datos relativos a los Movimientos de Efectivo para el Agente de Pagos.
- Información de Compensación e Instrucciones: Instrucciones a liquidar en la siguiente sesión, con el detalle de las Operaciones que incluyen.
- Información de Liquidaciones y Fallidos: Instrucciones de Liquidación, Fallidos, Liquidaciones por Recompra y en Efectivo y Penalizaciones.
- Información de Eventos: datos sobre Instrucciones generadas por Eventos Corporativos.

1.3 Convenciones utilizadas en este documento

1.3.1 Información general de cada fichero

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

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

	(1)
Grupo	(2)
Descripción	(3)
Destinatarios	(4)
Privacidad	(5)
Timing	(6)

(1)Nombre del fichero tal y como es generado. Todos los ficheros contienen en su nombre el código de entorno correspondiente (genéricamente, se indica “.cc” para la cámara, y “.sc” para un determinado segmento dentro de la cámara). Aunque no se indica expresamente, todos tienen la extensión XML.

(2)Grupo al que pertenece el fichero.

(3)Descripción del fichero.

(4)Destinatarios del fichero.

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

(6)Informa del momento en el que el fichero está disponible, cuándo varía y la forma de actualización de los registros.

1.3.2 Formato de las tablas de definición de mensajes

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

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

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

1.3.3 Estructura de cada fichero

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

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

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

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

1.4 Futuras versiones de este documento

1.4.1 Nuevos ficheros

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

1.4.2 Resaltando cambios

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

2. Mecanismo de obtención de los ficheros

Ver documento de conectividad.

3. Datos Generales

3.1 Estado de la sesión

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CSTATUS / RgstInstrctns				(1 time)		
513	RegistID	ID	S		String	Identificador único para cada mensaje Registration Instructions
514	RegistTransType	TransTyp	S	0 = New	Char	
58*	Text	Txt	N	I = Iniciada 1 = 1ª ventana agregación 2 = 2ª ventana agregación durante la sesión 3 = última ventana agregación F = Finalizada	String	Indica el estado de la sesión actual
715	Clearing Business 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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CSTATUS / RgstInstrctns / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	o	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Contiene "????"
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero

3.2 Entidades de la ECC

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CENTITIES / PtyDetlListRpt						(n times)
1510	PartyDetailsListReportID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Party Details List Report
715*	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716*	SettlSessID	SetSesID	N	ITD = Intradía EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
CENTITIES / PtyDetlListRpt / Hdr						

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
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 /PtyDetListRpt/ PtyDetl				(n times)		
→1691	PartyDetailID	ID	N		String	Contiene el código de la Entidad en la ECC
→1692	PartyDetailID Source	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	char	
→1693	PartyDetail Role	R	N	1 = Firm	int	
→1672	PartyDetail Status	Stat	N	0 = Activo 1 = Baja	int	Situación del party
CENTITIES /PtyDetListRpt/ PtyDetl/ ReltdPtyDetl/ Sub				(n times)		
→→ 1567	RelatedParty DetailSubID	ID	N		String	Información del party. Contiene la información especificada en RelatedPartyDetailSubIDType [1568] Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4100, contiene el tipo de Entidad en la ECC (ver Tabla 7 del documento "Tablas de Codificación")
→→ 1568	RelatedParty DetailSubIDType	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	

3.3 Datos de Valores

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CISINCODES / SecList						(n times)
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716*	SettlSessID	SetSesID	N	ITD = Intradía EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
CISINCODES / SecList/ Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	y	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Contiene "????"
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
CISINCODES /SecList/ SecL					(1 time)	
→15	Currency	Ccy	N		Currency	Código de divisa. Expresada según estándar ISO 4217
→58	Text	Txt	N		String	Descripción del valor
CISINCODES /SecList/ SecL/ Instrmt						
→55	Symbol	Sym	N	[N/A] o código de valor	String(5)	
→48	SecurityID	ID	N		String(12)	Código ISIN

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→22	SecurityID Source	Src	N	4 = ISIN number	String	
→1151	SecurityGroup	SecGrp	N	Ver Tabla 2 del documento "Tablas de Codificación"	String	Grupo de Valores
→167	SecurityType	SecTyp	N	Ver Tabla 3 del documento "Tablas de Codificación"	String	Tipo de producto
→200	Maturity Month Year	MMY	N	AAAAMM	Month- Year	Vencimiento del valor
→541	MaturityDate	MatDt	N		LocalMktDate	Fecha de vencimiento
→225	IssueDate	Issued	N		UTCDate	Fecha de emisión del valor
→202	StrikePrice	StrkPx	N		Price	Precio de Ejercicio. Sólo para activos de RV
→968	StrikeValue	StrkValu	N		Float	Unidad de contratación. Número de acciones equivalentes a cada valor. Sólo para activos de RV
→206	OptAttribute	OptAt	N	A = Americano E = Europeo B = Bermudas O = Otros	Char	Estilo del ejercicio. Sólo para activos de RV
→231	Contract Multiplier	Mult	N		Float	Indica el factor multiplicativo para convertir unidades de precio a unidades monetarias. Sólo para activos de RV
→201	PutOrCall	PutCall	N	0 - Put 1 - Call	Int	Indica si el valor es call o put. Sólo para activos de RV
→106	Issuer	Issr	N		String	Código de la entidad emisora del valor o Código de gestora
→223	CouponRate	CpnRt	N		Percentage	Cupón en porcentaje del nominal. Sólo para activos de Renta Fija.
→874	InterestAccrual Date	IntAcrl	N		LocalMktDate	Fecha en la que el activo empieza a devengar cupón. Sólo para activos de Renta Fija.
→1639*	MarginClass	Cls	N		String	Grupo de compensación del activo. Sólo para activos de Renta Fija.

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→461	CFICode	CFI	N		String	Clasificación del valor usado como colateral (estándar ISO 10692 Código CFI, 6 caracteres alfabéticos). Sólo para activos de Renta Fija.
→470	CountryOfIssue	IssuCtry	N		String	Jurisdicción del Emisor (código de país según estándar ISO 3166). Sólo para activos de Renta Fija.
CISINCODES /SecList/ SecL/ Instrmt/ AID						(n times)
→→455	SecurityAltID	AltID	N		String(22)	Nombre corto del valor
→→456	SecurityAltID Source	AltIDSrc	N	8 = Exchange Symbol	String	
CISINCODES /SecList/ SecL/ Instrmt/ Evnt						(n times)
→→865	EventType	EventTyp	N	100 = Barrera (turbo warrants) / Barrera inferior (Inlines). Sólo para activos de RV 101 = Último día de negociación 104 = Barrera superior (inlines) Sólo para activos de RV 105 = Barrera inferior activación (turbo pro) Sólo para activos de RV 106 = Barrera superior activación (turbo pro) Sólo para activos de RV 114 = Número de decimales en el precio del valor 120 = Código del Sistema de Liquidación 122 = Barrera (bonus) Sólo para activos de RV 201 = Periodicidad del cupón 215 = Método de cálculo del cupón corrido 216 = Índice Base 217 = Calidad del colateral 218 = LEI emisor 219 = Tipo de colateral	Int	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→→ 866	EventDate	Dt	N		LocalMktDate	Último día de negociación, cuando EventType = 101
						Precio barrera del warrant (turbowarrants) o Precio barrera inferior del warrant inline, cuando EventType = 100
						Precio barrera superior del warrant inline cuando EventType = 104
→→867	EventPx	Px	N		Price	Precio barrera inferior del warrant para la activación del turbo pro cuando EventType = 105
						Precio barrera superior para la activación del turbo pro cuando EventType = 106
						Precio barrera del bonus warrant cuando EventType = 122

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→→868	EventText	Txt	N		String	<p>Si EventType = 114, contiene el número de decimales en el precio del valor</p> <p>Si EventType = 120, contiene el Código del Sistema de Liquidación (DCV, misma codificación que para PartyRole[452]=10)</p> <p>Segmento de Renta Fija:</p> <p>Si EventType [865] = 201, contiene el nº de cupones al año</p> <p>Si EventType [865] = 215, contiene el método de cálculo del c.corrido:</p> <p>1 = Actual/Actual 2 = Actual/360 3 = Actual/365</p> <p>Si EventType [865] = 216, contiene el índice base</p> <p>Si EventType [865] = 217 contiene la calidad del colateral:</p> <p>'INVG'-Grado de inversión 'NIVG'-Grado de especulación 'NOTR'-Sin Rating 'NOAP' - No aplica</p> <p>Si EventType [865] = 218 contiene el LEI emisor</p> <p>Si EventType [865] = 219 contiene el tipo de colateral:</p> <p>'GOVS' - Deuda Soberana 'SUNS' - Deuda Supranacional 'FIDE' - Deuda Entidades Financieras 'NFID' - Deuda Corporativa 'SEPR' - Productos Titulizados 'MEQU' - Principales índices RV 'OEUQ' - Otros índices RV 'OTHR'- Otros Activos 'NA' - No aplica</p>
CISINCODES /SecList/ SecL/ Undly						(n times)
→→311	UnderlyingSymbol	Sym	N		String(5)	Símbolo del valor que actúa como subyacente
→→309	UnderlyingSecurityID	ID	N		String	Código ISIN del valor subyacente
→→305	UnderlyingSecurityIDSource	Src	N	4 = ISIN number	String	
→→318	UnderlyingCurrency	Ccy	N		Currency	Código de divisa en que se expresa el subyacente y el strike. Expresada según estándar ISO 4217

4. Información Pública

4.1 Datos Diarios de Valores para el cálculo de Garantías

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CISINDATA / MktDataFull				(n times)		
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716*	SettlSessID	SetSesID	N	ITD = Intradía EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
CISINDATA / MktDataFull / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	W	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
CISINDATA /MktDataFull/ Instrmt						

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
55	Symbol	Sym	N	[N/A] o código de valor	String(5)	
48	SecurityID	ID	N		String(12)	Código ISIN
22	SecurityID Source	Src	N	4 = ISIN number	String	
971	NTPositionLimit	NTPosLmt	N		Int	Número de títulos a partir del cual se deben aplicar Parámetros de Garantías por Grandes Posiciones
→224	CouponPaymentDate	CpnPmt	N		LocalMktDate	Fecha del próximo cupón. Sólo aplica al segmento de RF
→874	InterestAccrualDate	IntAcrl	N		LocalMktDate	Fecha de inicio de devengo de cupón. Presente si es diferente de la fecha de emisión. Sólo aplica al segmento de RF.
→1639*	MarginClass	Clss	N		String	Grupo de compensación del activo Sólo aplica al segmento de RF.

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CISINDATA /MktDataFull/ Instrmt/ Evnt						
				300: Primer Margin Rate para Grandes Posiciones		
				301: Porcentaje a aplicar sobre el precio de cierre para determinar los precios para el cálculo del Variation Margin para posiciones compradoras y vendedoras (0 => usar precio de cierre)		
				302: Segundo Margin Rate para grandes posiciones		
→865	EventType	EventTyp	N	303: Tercer Margin Rate para grandes posiciones	Int	
				304: Cuarto Margin Rate para grandes posiciones		
				305: Quinto Margin Rate para grandes posiciones		
				306: Sexto Margin Rate para grandes posiciones		
				307: Séptimo Margin Rate para grandes posiciones		
				308: Octavo Margin Rate para grandes posiciones		
				320: Coeficiente de Indexación		

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→868	EventText	Txt	N		String	<p>Si EventType es 300, 302, 303...308 contiene los porcentajes a aplicar para el cálculo de Garantías de Grandes Posiciones</p> <p>Si EventType = 301, contiene el porcentaje a aplicar sobre el precio de cierre para determinar los precios de cálculo del Variation Margin para posiciones compradoras y vendedoras (0 => usar precio de cierre)</p> <p>Segmento de Renta Fija:</p> <p>Si EventType = 320, contiene el Coeficiente de Indexación</p>
CISINDATA /MktDataFull/ Leg						(n times)
600	LegSymbol	Sym	N	[N/A] o código de valor	String(5)	Otro valor con el que se puede calcular una compensación de Garantías por haber correlación Sólo aplica al segmento de RV.
602	LegSecurityID	ID	N		String(12)	Código ISIN Sólo aplica al segmento de RV.
603	LegSecurityID Source	Src	N	4 = ISIN number	String	Sólo aplica al segmento de RV.
→1639*	MarginClass	Cls	N		String	Grupo de compensación del activo. Sólo aplica al segmento de RF.
CISINDATA /MktDataFull/ Leg/ Stip*						(n times)
→233*	StipulationType	Typ	N	SPRPRIO SPRQTYM SPRQTYO SPRPER	String	<p>Si StipulationType = SPRPRIO, es el número de orden de prioridad de la compensación</p> <p>Si StipulationType = SPRQTYM, es el número de títulos del valor principal (del bloque Instrument). Igual a 1 para el segmento de Renta Fija</p>
→234*	StipulationValue	Val	N		String	<p>Si StipulationType = SPRQTYO, es el número de títulos del valor compensable (del bloque InstrumentLeg). Igual a 1 para el segmento de Renta Fija</p> <p>Si StipulationType = SPRPER, es el porcentaje de compensación a aplicar</p>

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CISINDATA /MktDataFull/ Full						(n times)
→269	MDEntryType	Typ	S	5 G R U	Char	<p>Tipo de información que contiene la presente entrada:</p> <p>5: Para el precio de cierre (de la sesión actual o de la sesión anterior). Igual al precio de referencia para el segmento de Renta Fija</p> <p>G: Para el intervalo de Garantías del Initial Margin</p> <p>R: Precio para el cálculo de Variation Margin en posiciones compradoras (calculado según el precio de cierre de la sesión actual y/o de la anterior). Igual al precio de referencia para el segmento de Renta Fija</p> <p>U: Precio para el cálculo de Variation Margin en posiciones vendedoras (calculado según el precio de cierre de la sesión actual y/o de la anterior). Igual al precio de referencia para el segmento de Renta Fija</p>
→ 270	MDEntryPx	Px	N		Price	Precio. Presente cuando MDEntryType es igual a 5, R o U
→ 286	OpenCloseSettleFlag	OpenClsSettleFlag	N	1 = Session Open / Close / Settlement entry 4 = Entry from previous business day	MultipleValueString	<p>Cuando MDEntryType = 5, los Valores 1 y 4 se usan para indicar si el precio de cierre es el de la sesión anterior (valor 4) o el de la sesión actual (valor 1)</p> <p>Cuando MDEntryType = R o U, los Valores 1 y 4 se usan para indicar si el precio según el que están calculados es el de cierre de la sesión anterior (valor 4) o de la sesión actual (valor 1)</p>
→ 1026	MDEntrySpotRate	MDEntrySpotRate	N		float	Presente cuando MDEntryType=G
→158*	AccruedInterestRate	AcrIntRt	N		Percentage	Cupón corrido porcentaje
→159*	AccruedInterestAmt	AcrdIntAmt	N		Amt	Importe del cupón corrido. Sólo para activos de Renta Fija.

5. Datos Privados de Configuración

5.1 Cuentas de Posición

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CACCOUNTS / PtyDetlListRpt				(n times)		
1510	PartyDetailsList ReportID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Party Details List Report
715*	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMkt Date	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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CACCOUNTS /PtyDetListRpt/ PtyDetl						(n times)
						<p>Si PartyDetailRole [1693] = 1, contiene el código de Miembro de la ECC al que pertenece la cuenta de posición</p> <p>Si PartyDetailRole [1693] = 4, contiene el código de miembro que actúa como Compensador de la cuenta de posición de la que se está tratando</p> <p>Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV</p> <p>Si PartyDetailRole [1693] = 30, contiene el código del Agente de Pagos para movimientos de efectivo</p>
→1691	PartyDetailID	ID	N		String	<p>Si PartyDetailRole [1693] = 38, contiene el código de la Cuenta de posición</p> <p>Si PartyDetailRole [1693] = 15, contiene el código de miembro al que pertenece la Cuenta de garantías</p> <p>Si PartyDetailRole [1693] = 100, contiene el código de la Cuenta de garantías</p> <p>Si PartyDetailRole [1693] = 49, contiene el código de miembro al que pertenece la Cuenta de colateral</p> <p>Si PartyDetailRole [1693] = 101, contiene el código de la Cuenta de colateral</p>
→1692	PartyDetailID Source	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	char	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→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	PartyDetail Status	Stat	N	0 = Active 1 = Removal	int	Situación del party

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CACCOUNTS /PtyDetListRpt/ PtyDet/ ReltdPtyDet/ Sub					(n times)	<p>Información del party. Contiene la información especificada en RelatedPartyDetailSubIDType [1568]</p> <p>Para PartyDetailRole [1693] = 38 (Position Account) los Valores posibles son:</p> <ul style="list-style-type: none"> •Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 26 contiene el tipo de Cuenta de posición (ver Tabla 9 del documento "Tablas de Codificación") •Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4110, contiene la Cuenta Residual. Este campo sólo es significativo cuando el registro se refiere a una Cuenta Diaria. Cuenta de posición a la que se moverán las Operaciones pendientes de asignar una vez finalizado el periodo de Asignación de Cuenta Diaria. Sólo aplica al Segmento de RV <p>Para PartyDetailRole [1693] = 101: (Collateral Account) los Valores posibles son:</p> <ul style="list-style-type: none"> •Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 2, contiene el tipo de persona (ver Tabla 8 del documento "Tablas de Codificación") •Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 5, contiene la Razón Social •Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 9, contiene el Nombre del Titular •Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 39, contiene la Nacionalidad del Titular según estándar ISO 3166 •Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4101, contiene el 1er Apellido del Titular •Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4102, contiene el 2º Apellido del Titular •Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4103, contiene el tipo de Identificación del Titular (ver Tabla 15 del documento "Tablas de Codificación") •Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4104, contiene la Identificación del Titular
→→ 1567	RelatedParty DetailSubID	ID	N		String	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
						<ul style="list-style-type: none"> •Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 34 contiene la Población •Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 36, contiene el Código Postal •Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 37, contiene el Domicilio •Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 38, contiene el País de Residencia según estándar ISO 3166 •Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4105, contiene el Modelo de Cuenta: 'A' (Agente), 'P' (Principal-to-Principal) •Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4107, contiene el LEI •Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4108, contiene el Indicador de Clearing Indirecto Para PartyDetailRole [1693] = 10 (CSD Code) los Valores posibles son: •RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 90, contiene el código de la Entidad Participante •RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
				26 = Clase de Cuenta de posición		
				4110 = Cuenta Residual		
				2 = Tipo de Persona		
				5 = Razón Social		
				9 = Nombre		
				39 = Nacionalidad		
				4101 = 1er Apellido		
				4102 = 2º Apellido		
				4103 = Tipo Identificación		
→→ 1568	RelatedParty DetailSubIDType	Typ	N	4104 = Identificación	int	
				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		

5.2 Cuentas de Garantías

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CMARGINACCOUNTS / PtyDetListRpt					(n times)	
1510	Party Details ListReportID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Party Details List Report
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
CMARGINACCOUNTS / PtyDetListRpt / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	CG	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Contiene "????"
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CMARGINACCOUNTS /PtyDetListRpt/ PtyDetl					(n times)	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→1691	PartyDetailID	ID	N		String	<p>Si PartyDetailRole [1693] = 4, contiene el código de miembro que actúa como Compensador de la cuenta de Garantías de la que se está tratando</p> <p>Si PartyDetailRole [1693] = 15, contiene el código de miembro al que pertenece la Cuenta de garantías</p> <p>Si PartyDetailRole [1693] = 100, contiene el código de la Cuenta de garantías</p> <p>Si PartyDetailRole [1693] = 49, contiene el código de miembro al que pertenece la Cuenta de colateral</p> <p>Si PartyDetailRole [1693] = 101, contiene el código de la Cuenta de colateral</p>
→1692	Party DetailID Source	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	Party Detail Status	Stat	N	0 = Activo 1 = Baja	int	Situación del party
CMARGINACCOUNTS /PtyDetlListRpt/ PtyDetl/ ReltdPtyDetl/ Sub						(n times)
→ → 1567	RelatedParty Detail SubID	ID	N		String	<p>Información del party. Contiene la información especificada en RelatedPartyDetailSubIDType [1568]</p> <p>Para PartyDetailRole [1693] = 100 (Margin Account) los Valores posibles son:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4109, Tipo de Garantías que cubre la cuenta • Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4116, Tipo de cálculo de Garantías

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→ → 1568	Related Party Detail SubID Type	Typ	N	4109 = Tipo de Garantías que cubre la cuenta 4116 = Tipo de cálculo de Garantías	int	

5.3 Cuentas de Colateral

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CCOLLATERALACCOUNTS / PtyDetlListRpt					(n times)	
1510	Party Details ListR eportID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Party Details List Report
715*	ClearingBusiness Date	BizDt	S		LocalMkt Date	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 "????"

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CCOLLATERALACCOUNTS /PtyDetlListRpt/ PtyDetl						(n times)
→1691	PartyDetailID	ID	N		String	<p>Si PartyDetailRole [1693] = 4, contiene el código de miembro que actúa como Compensador de la cuenta de Colateral de la que se está tratando</p> <p>Si PartyDetailRole [1693] = 30, contiene el código del Agente de Pagos para movimientos de efectivo</p> <p>Si PartyDetailRole [1693] = 49, contiene el código de miembro al que pertenece la Cuenta de colateral</p> <p>Si PartyDetailRole [1693] = 101, contiene el código de la Cuenta de colateral</p>
→1692	Party DetailID 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	PartyDetail Status	Stat	N	0 = Activo 1 = Baja	int	Situación del party
CCOLLATERALACCOUNTS /PtyDetlListRpt/ PtyDetl/ ReltdPtyDetl/ Sub						(n times)

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→→ 1567	RelatedPartyDetailSubID	ID	N		String	<p>Información del party. Contiene la información especificada en RelatedPartyDetailSubIDType [1568]</p> <p>Para PartyDetailRole [1693] = 101: (Collateral Account) los Valores posibles son:</p> <ul style="list-style-type: none"> •Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4105, contiene el Modelo de Cuenta: 'A' (Agente), 'P' (Principal-to-Principal) •Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4108, contiene el Indicador de Clearing Indirecto •Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4111, contiene el Grupo de movimientos de efectivo asociados al Agente de Pagos •Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4112, contiene el Tipo ajuste Efectivo •Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4113, contiene el Indicador de reinversión •Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4114, contiene la Referencia estructura de cuenta •Si RelatedPartyDetailSubIDType [1568] = 4115, contiene el Tipo de estructura. Ver tabla 17 Tipos de Estructura de Cuenta
→→ 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	

5.4 Referencias de Asignación Externa (Miembro Origen)

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CGIVEOUTREF / RgstInstrctns						(n times)
513	RegistID	ID	S		String (30)	Identificador único para cada mensaje Registration Instructions
514	RegistTransType	TransTyp	S	0 = New	Char	
715	Clearing BusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716*	SettlSessID	SetSesID	N	ITD = Intradía EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
CGIVEOUTREF / RgstInstrctns / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	o	String	Identifica el tipo de mensaje
49	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
CGIVEOUTREF /RgstInstrctns/ Pty						(n times)
→448	PartyID	ID	S*		String	Si PartyRole[452]=96, contiene el Miembro Destino de la Asignación

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→ 447	PartyIDSource	Src	S	D = Proprietary/ Custom code	String	
→ 452	PartyRole	R	S	96= Take-up Trading Firm	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
CGIVEOUTREF /RgstInstrctns/ Pty/ Sub						(1 time)
→→ 523	PartySubID	ID	S*	GOR = Give-out references	String	
→→ 803	PartySubIDType	Typ	S		Int	El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta, está presente por requerimiento del estándar
CGIVEOUTREF /RgstInstrctns/ Alloc*						(1 time)
→ 1729*	FirmMnemonic	FirmMnem	N		String (10)	Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm)
→161*	AllocText	Txt	N		String (18)	Referencia de Asignación Externa
→ 1732*	FirmAllocText	FirmTxt	N		String (18)	Referencia de Asignación definida por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm) para uso interno

5.5 Referencias de aceptación de Asignación Externa (Miembro Destino)

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CGIVEINREF / RgstInstrctns						(n times)
513	RegistID	ID	S		String (30)	Identificador único para cada mensaje Registration Instructions
514	RegistTransType	TransTyp	S	0 = New	Char	
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716*	SettlSessID	SetSesID	N	ITD = Intradía EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
CGIVEINREF / RgstInstrctns / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	o	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Contiene "????"
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CGIVEINREF /RgstInstrctns/ Pty						(n times)
→448	PartyID	ID	S*		String	Si PartyRole[452]=38, contiene la Cuenta de Posición Destino en la que debe registrarse la Asignación en caso de ser aceptada Si PartyRole[452]=95, contiene el Miembro Origen de la Asignación
→ 447	PartyIDSource	Src	S	D = Proprietary/ Custom code	String	
→ 452	PartyRole	R	S	38 = Position Account 95 = Give-up Trading Firm	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
CGIVEINREF /RgstInstrctns/ Pty/ Sub						(1 time)
→→523	PartySubID	ID	S*	GIR = Give-in references	String	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→→ 803	PartySubIDType	Typ	S		Int	El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta, está presente por requerimiento del estándar
CGIVEINREF /RgstInstrctns/ Alloc*						(1 time)
→1729*	FirmMnemonic	FirmMnem	N		String (10)	Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Destino (Take-up Trading Firm)
→161*	AllocText	Txt	N		String(18)	Referencia de Asignación Externa

5.6 Filtros de aceptación de Asignación Externa (Miembro Destino)

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CGIVEINFILT / RgstInstrctns						(n times)
513	RegistID	ID	S		String (30)	Identificador único para cada mensaje Registration Instructions
514	RegistTransType	TransTyp	S	0 = New	Char	
715	Clearing BusinessDate	BizDt	S		LocalMkt Date	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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CGIVEINFILT / RgstInstrctns / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	o	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Contiene "????"
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CGIVEINFILT /RgstInstrctns/ Pty						(n times)
→448	PartyID	ID	S*		String	Si PartyRole[452]=95, contiene el Miembro Origen de la Asignación El uso del carácter comodín "?" está permitido sólo si se utiliza en todas las posiciones tanto en el Miembro Origen de la Asignación como en la Referencia de Asignación AllocText [161] (pero no en ambos campos a la vez)
→ 447	PartyIDSource	Src	S	D = Proprietary/ Custom code	String	
→ 452	PartyRole	R	S	95 = Give-up Trading Firm	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
CGIVEINFILT /RgstInstrctns/ Pty/ Sub						(1 time)
→→ 523	PartySubID	ID	S*	GIF = Give-in filters	String	
→→ 803	PartySubIDType	Typ	S		Int	El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta, está presente por requerimiento del estándar
CGIVEINFILT /RgstInstrctns/ Stip*						(n times)
→233*	StipulationType	Typ	N	TAL SAL	String	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→ 234*	Stipulation Value	Val	N	[N/A] o un valor numérico >=0 and <= 999999999	String	<p>Si StipulationType = TAL, es el importe efectivo máximo para una Asignación que será aceptado automáticamente para ese Miembro Origen de la Asignación y Referencia de Asignación</p> <p>Si StipulationType = SAL, es el importe efectivo acumulado máximo por sesión de asignaciones que serán aceptados automáticamente para ese Miembro Origen y Referencia de Asignación</p> <p>Se informará a [N/A] cuando se desee que el Filtro sea totalmente abierto, esto es, no haya un importe efectivo máximo específico a comprobar</p>
CGIVEINFILT /RgstInstrctns/ Alloc*						(1 time)
→161*	AllocText	Txt	N		String (18)	<p>Referencia de Asignación Externa El uso del carácter comodín "?" está permitido sólo si se utiliza en todas las posiciones tanto en el Miembro Origen de la Asignación como en la Referencia de Asignación AllocText [161] (pero no en ambos campos a la vez)</p>

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CGIVEINFILTCLM / RgstInstrctns						(n times)
513	RegistID	ID	S		String (30)	Identificador único para cada mensaje Registration Instructions
514	RegistTransType	TransTyp	S	0 = New	Char	
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMkt Date	Fecha de la sesión
716*	SettlSessID	SetSesID	N	ITD = Intradía EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
CGIVEINFILTCLM / RgstInstrctns / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	o	String	Identifica el tipo de mensaje
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
CGIVEINFILTCLM / RgstInstrctns / Pty						(n times)
→448	PartyID	ID	S*		String	
→447	PartyIDSource	Src	S	D = Proprietary/ Custom code	String	Si PartyRole[452] = 38, contiene la Cuenta de Posición Destino de la Asignación Si PartyRole[452] = 96, contiene el Código de Miembro Destino de la Asignación
→ 452	PartyRole	R	S	38 = Position Account 96= Take-up Trading Firm	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
CGIVEINFILTCLM / RgstInstrctns / Pty / Sub						(1 time)
→→523	PartySubID	ID	S*	GIFCM = Give-in filters of clearing member	String	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→→803	PartySubIDType	Typ	S		Int	El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta, está presente por requerimiento del estándar
CGIVEINFILTCLM /RgstInstrctns/ Stip*						(n times)
→233*	StipulationType	Typ	N	TAL SAL	String	
→234*	StipulationValue	Val	N	[N/A] o un valor numérico >=0 and <= 999999999	String	Si StipulationType = TAL, es el importe efectivo máximo para una Asignación para que sea aceptada automáticamente para ese Miembro Destino Si StipulationType = SAL, es el importe efectivo acumulado máximo por sesión de asignaciones que serán aceptados automáticamente para ese Miembro Destino Se informará a [N/A] cuando se desee que el Filtro sea totalmente abierto, esto es, no haya un importe efectivo máximo específico a comprobar

5.8 Módulo de Parametrización por Miembro Origen

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CPARMODULE / RgstInstrctns						(n times)
513	RegistID	ID	S		String (30)	Identificador único para cada mensaje Registration Instructions
514	RegistTransType	TransTyp	S	0 = New	Char	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
1	Account	Acct	N		String	Código de cliente introducido en la orden
493	RegistAcctType	AcctTyp	S*	1 – AOTC 3 – MTCH 4 – DEAL	String	Indicador de capacidad
1300*	Market SegmentID	MktSegID	N	Ver Tabla 5 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de Segmento de Negociación Si no está informado, significa "para todos los Segmentos de Negociación"
58*	Text	Txt	N		String	Referencia externa: Referencia de la orden asignada por el usuario
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716*	SettlSessID	SetSesID	N	ITD = Intradía EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
CPARMODULE / RgstInstrctns / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	o	String	Identifica el tipo de mensaje
49	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
CPARMODULE /RgstInstrctns / Pty						
						(n times)
→448	PartyID	ID	S*		String	Si PartyRole[452]=11, contiene el código del Usuario Origen de la plataforma Si PartyRole[452]=13, contiene el código del Miembro Origen en la plataforma Si Usuario Origen (PartyRole[452]=11) no está informado, significa "para todos los usuarios del Miembro" Si PartyRole[452]=38, contiene la Cuenta de Posición

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→ 447	PartyIDSource	Src	S	D = Proprietary/ Custom code	String	
→452	PartyRole	R	S	11 = Order Origination Trader	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
CPARMODULE /RgstInstrctns/ Pty/ Sub						(1 time)
→→523	PartySubID	ID	S*	PAM = Parameter Module	String	
→→ 803	PartySubIDType	Typ	S		Int	El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta, está presente por requerimiento del estándar
CPARMODULE /RgstInstrctns/ Alloc*						(1 time)
→1729*	FirmMnemonic	FirmMnem	N		String (10)	Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm)
CPARMODULE /RgstInstrctns/ Stip*						(n times)
→233*	StipulationType	Typ	N	PL	String	
→ 234*	StipulationValue	Val	N		String	Código de Plataforma Si no está informado, significa "para todas las Plataformas"

6. Información de Operaciones

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

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
150	ExecType	ExecTyp	N	F = Trade	Char	
820	TradeLinkID	LinkID	N		String	Referencia original primaria de la Operación. Para el segmento de RF: Se informa de la referencia común de las operaciones que vincula la ida y la vuelta del repo.
880	TrdMatchID	MtchID	N		String	Número de registro de negociación de la Operación inicial. Coincide con el campo TrdMatchID del mensaje Execution Report Este campo estará vacío para activos de RF
17	ExecID	ExecID	N		String	Referencia original secundaria de la Operación asignada por la ECC
1300	Market SegmentID	MktSegID	N	Ver Tabla 5 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de Segmento de Negociación
32	LastQty	LastQty	S	>= 0, sin decimales	Qty	Volumen/Nominal de la Operación
151*	LeavesQty	LeavesQty	N		Qty	Volumen/Nominal vivo de la Operación
31	LastPx	LastPx	S		Price	Precio de la Operación. Para RF se mostrará en %
15	Currency	Ccy	N		Currency	Código de divisa. Expresada según estándar ISO 4217
75	TradeDate	TrdDt	N		LocalMkt Date	Fecha de Contratación
60	TransactTime	TxnTm	N		UTCTime stamp	Fecha y hora, en formato UTC, en que se realizó la transacción
64	SettlDate	SettlDt	N		LocalMkt Date	Fecha Teórica de Liquidación
381	GrossTradeAmt	GrossTrdAmt	N		Amt	Importe Efectivo de la Operación
5681*	Exchange TradeType	ExchTrdTyp	N	Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación"	String	Tipo de Operación de la ECC
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMkt Date	Fecha de la sesión

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
716	SettlSessID	SetSesID	N	ITD = Intradía EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
CTRADES / TrdCaptRpt / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	AE	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Contiene "????"
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CTRADES / TrdCaptRpt / Instrmt						
55	Symbol	Sym	N	[N/A] o código de valor	String (5)	
48	SecurityID	ID	N		String (12)	Código ISIN
22	SecurityIDSource	Src	N	4 = ISIN number	String	
CTRADES / TrdCaptRpt / Amt						(n times)
→708	PosAmt	Amt	N		Amt	
→1585	PosAmtReason	Rsn	N	1000 = Importe Efectivo vivo de la Operación	Int	
CTRADES / TrdCaptRpt / TrdRegTS						(1 time)
→769	TrdRegTimestamp	TS	N		UTCTime stamp	Día y hora de la Operación inicial en el Sistema de Negociación
→770	TrdRegTimestampType	Typ	N	3 = Time Out	Int	
CTRADES / TrdCaptRpt / RptSide						(1 time) Siempre 1 ya que sólo se incluye la parte compradora o vendedora, según corresponda al destinatario del mensaje
→ 54	Side	Side	S	1 = Buy 2 = Sell	Char	Signo de la Operación

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→ 1	Account	Acct	N		String	Código de cliente introducido en la orden. Sólo aplica al Segmento de RV
→ 581	AccountType	AcctTyp	N	1 – AOTC 3 – MTCH 4 – DEAL	Int	Indicador de capacidad Sólo aplica al Segmento de RV
→ 77	PositionEffect	PosEfct	N	“O” = Open “C” = Close		Indica si la Operación abre o cierra posición
→ 58	Text	Txt	N		String	Para el segmento de RV: Si es una Operación procedente de una orden, contiene la Referencia asignada en la orden Si es una Asignación de Cuenta Diaria o un traspaso, contiene la Referencia de la Operación previa. Solo aplica al segmento de RV
CTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ Pty						(n times)
→→448	PartyID	ID	N		String	Si PartyRole[452]=1, contiene el código de Miembro de la ECC Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV Si PartyRole[452]=11, contiene el código del usuario de la plataforma Si PartyRole[452]=13, contiene el código del Miembro de la plataforma Si PartyRole[452]=16, contiene el código de plataforma de negociación Si PartyRole[452]=38, contiene el código de la Cuenta de Posición asociada con la Operación Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación
→→447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→→452	PartyRole	R	N	1 = Executing Firm 4 = Clearing Firm 10 = CSD Code 11 = Order Origination Trader 13 = Order Origination Firm 16 = Executing System (platform Code) 38 = Position Account 90 = Settlement Firm 91 = Settlement Account	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
CTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ Stip						(n times)
→→233	StipulationType	Typ	N	TOPEM QTYM AMTM UTI SFTTYPE FINRATE UTIPRIOR	String	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
						Para Operaciones de compraventa: •Si StipulationType [233] = TOPEM, contiene el código de la ejecución en la plataforma de negociación •Si StipulationType [233] = QTYM, contiene el volumen / nominal de la ejecución en la plataforma de negociación •Si StipulationType [233] = AMTM, contiene el importe efectivo de la ejecución en la plataforma de negociación
→→ 234	StipulationValue	Val	N		String	Sólo para RF: •Si StipulationType [233] = UTI, contiene el UTI de la operación •Si StipulationType [233] = SFTTYPE, contiene el Tipo de SFT: B: Simultánea R: Repo N: No aplica •Si StipulationType [233] = FINRATE, contiene el tipo de interés fijo. •Si StipulationType [233] = UTIPRIOR, contiene el UTI PRIOR de la operación.
CTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ MiscFees						(1 time)
→→ 137	MiscFeeAmt	Amt	N		Amt	Corretaje de la Operación Sólo aplica al Segmento de RV
→→ 139	MiscFeeType	Typ	N	12 = Agent	String	
CTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ TrdRptOrdDetl						(1 time) Sólo aplica al Segmento de RV
→ 198	Secondary OrderID	OrdID2	N		String	Identificador único de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación.
→ 586	OrigOrd ModTime	OrigOrd ModTm	N		UTCTimestamp	Fecha y hora de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→1729*	FirmMnemonic	FirmMnem	N		String (10)	Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm) o Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Destino (Take-up Trading Firm)
→161*	AllocText	Txt	N		String (18)	Referencia de Asignación

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

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

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
381	GrossTradeAmt	GrossTrdAmt	N		Amt	Importe Efectivo de la Operación
5681*	Exchange TradeType	ExchTrdTyp	N	Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación"	String	Tipo de Operación de la ECC
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMkt Date	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
CHISTTRADES / TrdCaptRpt / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	AE	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Contiene "????"
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CHISTTRADES / TrdCaptRpt/ Instrmt						
55	Symbol	Sym	N	[N/A] o código de valor	String (5)	
48	SecurityID	ID	N		String (12)	Código ISIN
22	SecurityID Source	Src	N	4 = ISIN number	String	
CHISTTRADES / TrdCaptRpt/ Amt						(n times)
→708	PosAmt	Amt	N		Amt	
→1585	PosAmtReason	Rsn	N	1000 = Importe Efectivo vivo de la Operación	Int	
CHISTTRADES / TrdCaptRpt/ TrdRegTS						(1 time)

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→769	TrdRegTimest amp	TS	N		UTCTime stamp	Día y hora de la Operación inicial en el Sistema de Negociación
→770	TrdRegTimest ampType	Typ	N	3 = Time Out	Int	
	CHISTTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide					(1 time) Siempre 1 ya que sólo se incluye la parte compradora o vendedora, según corresponda al destinatario del mensaje
→ 54	Side	Side	S	1 = Buy 2 = Sell	Char	Signo de la Operación
→1	Account	Acct	N		String	Código de cliente introducido en la orden Sólo aplica al Segmento de RV
→ 581	AccountType	AcctTyp	N	1 – AOTC 3 – MTCH 4 – DEAL	Int	Indicador de capacidad Sólo aplica al Segmento de RV
→ 77	PositionEffect	PosEfct	N	“O” = Open “C” = Close		Indica si la Operación abre o cierra posición

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→58	Text	Txt	N		String	Si es una Operación procedente de una orden, contiene la Referencia asignada en la orden Si es una Asignación de Cuenta Diaria o un Traspaso, contiene la Referencia de la Operación previa Sólo aplica al Segmento de RV.
CHISTRTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ Pty						(n times)
→→448	PartyID	ID	N		String	<p>Si PartyRole[452]=1, contiene el código de Miembro de la ECC</p> <p>Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador</p> <p>Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV Si PartyRole[452]=11, contiene el código del usuario de la plataforma</p> <p>Si PartyRole[452]=13, contiene el código del Miembro de la plataforma</p> <p>Si PartyRole[452]=16, contiene el código de plataforma de negociación</p> <p>Si PartyRole[452]=38, contiene el código de la Cuenta de Posición asociada con la Operación</p> <p>Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante</p> <p>Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación</p>
→→447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→→452	PartyRole	R	N	1 = Executing Firm 4 = Clearing Firm 10 = CSD Code 11 = Order Origination Trader 13 = Order Origination Firm 16 = Executing System (platform Code) 38 = Position Account 90 = Settlement Firm 91 = Settlement Account	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID.
CHISTTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ Stip						(n times)
→→233	StipulationType	Typ	N	TOPEM QTYM AMTM UTI SFTTYPE FINRATE UTIPRIOR	String	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
						<p>Para Operaciones de compraventa:</p> <ul style="list-style-type: none"> •Si StipulationType [233] = TOPEM, contiene el código de la ejecución en la plataforma de negociación •Si StipulationType [233] = QTYM, contiene el volumen / nominal de la ejecución en la plataforma de negociación •Si StipulationType [233] = AMTM, contiene el importe efectivo de la ejecución en la plataforma de negociación <p>Sólo para RF:</p> <ul style="list-style-type: none"> •Si StipulationType [233] = UTI, contiene el UTI de la operación •Si StipulationType [233] = SFTTYPE, contiene el Tipo de SFT: <p>B: Simultánea R: Repo N: No aplica</p> <ul style="list-style-type: none"> •Si StipulationType [233] = FINRATE, contiene el tipo de interés fijo. •Si StipulationType [233] = UTIPRIOR, contiene el UTI PRIOR de la operación.
→→ 234	StipulationValue	Val	N		String	
CHISTTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ MiscFees						(1 time) Sólo aplica al Segmento de RV
→→ 137	MiscFeeAmt	Amt	N		Amt	Brokerage fee of the trade
→→ 139	MiscFeeType	Typ	N	12 = Agent	String	Corretaje de la Operación
CHISTTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ MiscFees						(1 time) Sólo aplica al Segmento de RV
→198	Secondary OrderID	OrdID2	N		String	Identificador único de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación

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

6.3 Detalle de todas las Operaciones registradas en la sesión

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CALLTRADES / TrdCaptRpt						(n times)
1003	TradeID	TrdID	N		String	Identificador de registro en la ECC. Este campo siempre está presente en el mensaje
1040	SecondaryTradeID	TrdID2	N		String	Contiene el identificador de registro en la ECC de la Operación inicial

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
828	TrdType	TrdTyp	N	Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación"	Int	Tipo de Operación FIX. Este valor es usado conjuntamente con TrdSubType [829]
829	TrdSubType	TrdSubTyp	N	Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación"	Int	Este valor es usado conjuntamente con TrdType [828]
1126	OrigTradeID	OrigTrdID	N		String	<p>Contiene el identificador de registro de la ECC de la Operación previa</p> <p>Si se trata de Recompras o Liquidaciones en Efectivo, contiene el identificador de registro de la ECC de la Instrucción fallida que liquida</p> <p>Si se trata de un Ajuste y éste cancela una Instrucción, este campo contiene el identificador de registro de la ECC de la Instrucción que cancela</p>
820	TradeLinkID	LinkID	N		String	<p>Referencia original primaria de la Operación asignada por la ECC.</p> <p>Si se trata de una operación de Neteo / Agregación contiene el Identificador de Registro de la ECC (TradeId[1003]) de la Instrucción de Liquidación</p> <p>Para el segmento de RF: Se informa de la referencia común de las operaciones que vincula la ida y la vuelta del repo.</p>
150	ExecType	ExecTyp	N	F = Trade	Char	
880	TrdMatchID	MtchID	N		String	<p>Número de registro de negociación de la Operación inicial</p> <p>Coincide con el campo TrdMatchID del mensaje Execution Report</p> <p>Sólo está informado para Operaciones procedentes de plataformas y movimientos entre Miembros/Cuentas de Posición</p>
17	ExecID	ExecID	N		String	Referencia original secundaria de la Operación asignada por la ECC
1300	Market SegmentID	MktSegID	N	Ver Tabla 5 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de Segmento de Negociación

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
32	LastQty	LastQty	S	>= 0, sin decimales	Qty	Volumen/Nominal de la Operación / Instrucción Puede ser cero en Instrucciones sólo de efectivo
151*	LeavesQty	LeavesQty	N		Qty	Volumen/Nominal vivo de la Operación
31	LastPx	LastPx	S		Price	Precio de la Operación. Si se trata de una Instrucción se trata de un precio medio. Para RF se mostrará en %
15	Currency	Ccy	N		Currency	Código de divisa. Expresada según estándar ISO 4217
75	TradeDate	TrdDt	N		LocalMkt Date	Fecha de Contratación
60	TransactTime	TxnTm	N		UTCTime stamp	Fecha y hora, en formato UTC, en que se realizó la transacción
64	SettlDate	SettlDt	N		LocalMkt Date	Fecha Teórica de Liquidación
381	GrossTradeAmt	GrossTrdAmt	N		Amt	Importe Efectivo de la Operación En caso de una Instrucción, puede ser negativo en función del resultado de la compensación en cuentas de Posición netas
5681*	Exchange TradeType	ExchTrdTyp	N	Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación"	String	Tipo de Operación de la ECC
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMkt Date	Fecha de la sesión
716	SettlSessID	SetSesID	N	ITD = Intradía EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
CALLTRADES / TrdCaptRpt / Hdr						CALLTRADES / TrdCaptRpt / Hdr
35	MsgType	MsgTyp	S	AE	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Contiene "????"
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CALLTRADES /TrdCaptRpt/ Instrmt						
55	Symbol	Sym	N	[N/A] o código de valor	String (5)	
48	SecurityID	ID	N		String (12)	Código ISIN
22	SecurityID Source	Src	N	4 = ISIN number	String	
CALLTRADES /TrdCaptRpt/ Amt						(n times)
→708	PosAmt	Amt	N		Amt	
→1585	PosAmtReason	Rsn	N	1000 = Importe Efectivo vivo de la Operación 1001 = Importe Efectivo de Valores retenidos Sólo aplica al Segmento de RV	Int	En caso de una Instrucción parcialmente liquidada, contiene el importe efectivo pendiente de liquidar
CALLTRADES /TrdCaptRpt/ TrdRegTS						Bloque sólo cumplimentado para compraventas (1 time)
→769	TrdRegTimestamp	TS	N		UTC Time stamp	Día y hora de la Operación inicial en el Sistema de Negociación
→770	TrdRegTimestampType	Typ	N	3 = Time Out	Int	
CALLTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide						(1 time) Siempre 1 ya que sólo se incluye la parte compradora o vendedora, según corresponda al destinatario del mensaje
→54	Side	Side	S	1 = Buy 2 = Sell	Char	Signo de la Operación / signo de la posición de Valores Si es una Instrucción de sólo efectivo: si es 1 es efectivo a pagar y si es 2 es efectivo a recibir
→1	Account	Acct	N		String	Para compraventas, contiene el código de cliente introducido en la orden Sólo aplica al Segmento de RV
→581	AccountType	AcctTyp	N	1 – AOTC 3 – MTCH 4 – DEAL	Int	Indicador de capacidad Sólo aplica al Segmento de RV

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→77	PositionEffect	PosEfct	N	"O" = Open "C" = Close		Indica si la Operación abre o cierra posición
→ 58	Text	Txt	N		String	Si es una Operación procedente de una orden, contiene la Referencia asignada en la orden. Sólo aplica al Segmento de RV Si es una Asignación de Cuenta Diaria (Sólo aplica al Segmento de RV) o un traspaso, contiene la Referencia de la Operación previa. Solo aplica el segmento de RV.
CALLTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ Pty						(n times)
→→448	PartyID	ID	N		String	Si PartyRole[452]=1, contiene el código de Miembro de la ECC Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV Si PartyRole[452]=11, contiene el código del usuario de la plataforma Si PartyRole[452]=13, contiene el código del Miembro de la plataforma Si PartyRole[452]=16, contiene el código de plataforma de negociación Si PartyRole[452]=38, contiene el código de la Cuenta de Posición asociada con la Operación Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación
→→447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→→452	PartyRole	R	N	1 = Executing Firm 4 = Clearing Firm 10 = CSD Code 11 = Order Origination Trader 13 = Order Origination Firm 16 = Executing System (platform Code) 38 = Position Account 90 = Settlement Firm 91 = Settlement Account	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
CALLTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ Stip						(n times)
→→233	Stipulation Type	Typ	N	TOPEM QTYM AMTM CLIQ ILIQDCV TINST ICORPDCV UTI SFTTYPE FINRATE UTIPRIOR	String	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→→234	Stipulation Value	Val	N		String	<p>Para Operaciones de compraventa:</p> <ul style="list-style-type: none"> •Si StipulationType [233] = TOPEM, contiene el código de la ejecución en la plataforma de negociación. •Si StipulationType [233] = QTYM, contiene el volumen / nominal de la ejecución en la plataforma de negociación •Si StipulationType [233] = AMTM, contiene el importe efectivo de la ejecución en la plataforma de negociación <p>Para Instrucciones de Liquidación:</p> <ul style="list-style-type: none"> •Si StipulationType [233] = CLIQ, contiene el número de la ventana de agregación en la que se envía la Instrucción a liquidar. •Si StipulationType [233] = ILIQDCV, contiene el identificador de la Instrucción Liquidación en el DCV •Si StipulationType [233] = TINST, contiene el Tipo Instrucción: <ul style="list-style-type: none"> *DVP = Entrega contra pago *RVP = Recepción contra pago *DWP = Entrega con pago *DFP = Entrega libre de pago *RFP = Recepción libre de pago *PWD = Pago / cobro sin entrega de Valores *ROC = Instrucciones de pago sin entrega con efectivo cero *RWP = Recepción con pago <ul style="list-style-type: none"> •Si StipulationType [233] = QTYM, contiene el número de Valores / Nominal de la Instrucción fallida que liquida •Si StipulationType [233] = AMTM, contiene el importe efectivo de la Instrucción fallida que liquida <p>Para Eventos Corporativos:</p> <ul style="list-style-type: none"> •Si StipulationType [233] = ICORPCV, contiene el identificador del Evento en el DCV •Si StipulationType [233] = QTYM, contiene el número de Valores / Nominal de la Instrucción fallida que liquida

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
						<ul style="list-style-type: none"> •Si StipulationType [233] = AMTM, contiene el importe efectivo de la Instrucción fallida que liquida Sólo para RF: <ul style="list-style-type: none"> •Si StipulationType [233] = UTI, contiene el UTI de la operación •Si StipulationType [233] = SFTTYPE, contiene el Tipo de SFT: B: Simultánea R: Repo N: No aplica <ul style="list-style-type: none"> •Si StipulationType [233] = FINRATE, contiene el tipo de interés fijo. •Si StipulationType [233] = UTIPRIOR, contiene el UTI PRIOR de la operación.
CALLTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ MiscFees						(1 time) Sólo aplica al Segmento de RV
→→ 137	MiscFeeAmt	Amt	N		Amt	Corretaje de la Operación
→→ 139	MiscFeeType	Typ	N	12 = Agent	String	
CALLTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ TrdRptOrdDetl						Bloque sólo cumplimentado para compraventas (1 time) Sólo aplica al Segmento de RV
→→ 198	Secondary OrderID	OrdID2	N		String	Identificador único de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación
→→ 586	OrigOrdMod Time	OrigOrd ModTm	N		UTCTime stamp	Fecha y hora de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación
→→ 1729*	FirmMnemonic	FirmMnem	N		String (10)	Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm) o Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Destino (Take- up Trading Firm)
→→ 161*	AllocText	Txt	N		String (18)	Referencia de Asignación
CALLTRADES /TrdCaptRpt/RptSide/ Qty*						(n times)
→→ 703*	PosType	Typ	N	RCV	String	Para Operaciones de compraventa: RCV indica los Valores retenidos por la Entidad Liquidadora Sólo aplica al Segmento de RV
→→ 705*	ShortQty	Short	N	>= 0, sin decimales	Qty	

7. Asignación de la Cuenta de Posición

7.1 Asignaciones Internas de Cuenta y Traspasos realizados

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CTRAFTRADES / AllocRpt						(n times)
755	AllocReportID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Allocation Report
70	AllocID	ID	N		String (30)	Identificador del mensaje Allocation Instruction relacionado
71	AllocTransType	TransTyp	S	0 = New 2 = Cancel	Char	
795	AllocReport RefID	RptRefID	N		String	Presente cuando AllocTransType [71] = 2 (Cancel)
796	AllocCanc ReplaceReason	CxlRplcRsn	N	99 = Other	Int	Presente cuando AllocTransType [71] = 2 (Cancel)
793	Secondary AllocID	ID2	N		String	Identificador único del traspaso asignado por la Cámara
794	AllocReportType	RptTyp	S	15 = Give-up 16 = Take-up	Int	
87	AllocStatus	Stat	S	9 = Claimed	Int	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
72	RefAllocID	RefID	N		String	Presente cuando AllocTransType [71] = 2 (Cancel)
54	Side	Side	S	1 = Buy 2 = Sell	Char	Indica si la Operación a transferir es compradora o vendedora
53	Quantity	Qty	S		Qty	Volumen de la asignación/traspaso
6	AvgPx	AvgPx	S		Price	Precio de la Operación
75	TradeDate	TrdDt	S		LocalMkt Date	En asignaciones simples: Fecha de Contratación En asignaciones múltiples: Fecha Teórica de Liquidación
64	SettlDate	SettlDt	N		LocalMkt Date	Fecha Teórica de Liquidación
381	GrossTradeAmt	GrossTrdAmt	N		Amt	Importe efectivo de la asignación/traspaso
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMkt Date	Fecha de la sesión
716*	SettlSessID	SetSesID	N	ITD = Intradía EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
CTRADES / AllocRpt / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	AS	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Contiene "????"
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CTRADES / AllocRpt / OrdAlloc						Bloque OrdAlloc enviado por el cliente (1 time)
→11	CIOrdID	CIOrdID	N	[N/A]	String	
→198	SecondaryOrderID	CIOrdID2	N		String	Identificador único de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→→ 234*	StipulationValue	Val	N		String	Si StipulationType [233] = TOPEM, contiene el código de la ejecución en la plataforma de negociación Si StipulationType [233] = QTYM, contiene el volumen de la ejecución en la plataforma de negociación Si StipulationType [233] = MEMM, contiene el código de miembro de la ejecución en la plataforma de negociación
CTRAASFTRADES /AllocRpt/ AllExc/ MiscFees*						(1 time)
→→ 137*	MiscFeeAmt	Amt	N		Amt	Corretaje de la Operación inicial
→→ 139*	MiscFeeType	Typ	N	12 = Agent	String	
CTRAASFTRADES /AllocRpt/ Instrmt						
55	Symbol	Sym	N	[N/A] o código de valor	String (5)	
48	SecurityID	ID	N		String (12)	Código ISIN
22	SecurityID Source	Src	N	4 = ISIN number	String	
CTRAASFTRADES /AllocRpt/ Pty						(n times)
→448	PartyID	ID	N		String	Si PartyRole[452]=12, contiene el usuario que inició la solicitud Si PartyRole[452]=95, contiene el código de Miembro
→447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	
→452	PartyRole	R	N	12 = Executing Trader 95 = Give- up Trading Firm	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
CTRAASFTRADES /AllocRpt/ Alloc						(1 time)
→79	AllocAccount	Acct	N		String	Cuenta de Posición Destino
→80	AllocQty	Qty	N		Qty	Volumen de la asignación/traspaso. Debe ser igual al campo Quantity

7.2 Asignaciones Externas (Miembro Origen)

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CGIVEOUT / AllocRpt						(n times)
755	AllocReportID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Allocation Report
70	AllocID	ID	N		String (30)	Identificador del mensaje Allocation Instruction relacionado
71	AllocTransType	TransTyp	S	0 = New 2 = Cancel	Char	
795	AllocReport RefID	RptRefID	N		String	Presente cuando AllocTransType [71] = 2 (Cancel)
796	AllocCancReplaceReason	CxlRplcRsn	N	99 = Other	Int	Presente cuando AllocTransType [71] = 2 (Cancel)
793	Secondary AllocID	ID2	N		String	Identificador único del traspaso asignado por la Cámara
794	AllocReport Type	RptTyp	S	15 = Give-up 16 = Take-up	Int	
87	AllocStatus	Stat	S	5 = Rejected by intermediary 6 = Allocation pending 9 = Claimed 12 = Cancelled 13 = Pending take-up approval	Int	
72	RefAllocID	RefID	N		String	Presente cuando AllocTransType [71] = 2 (Cancel)

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
54	Side	Side	S	1 = Buy 2 = Sell	Char	Indica si la Operación a transferir es compradora o vendedora
53	Quantity	Qty	S		Qty	Volumen de la Asignación Externa
6	AvgPx	AvgPx	S		Price	Precio de la Operación
75	TradeDate	TrdDt	S		LocalMkt Date	En asignaciones simples: Fecha de Contratación En asignaciones múltiples: Fecha Teórica de Liquidación
64	SettlDate	SettlDt	N		LocalMkt Date	Fecha Teórica de Liquidación
381	GrossTradeAmt	GrossTrdAmt	N		Amt	Importe efectivo de la Asignación Externa
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMkt Date	Fecha de la sesión
716*	SettlSessID	SetSesID	N	ITD = Intraday EOD = End of day	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
CGIVEOUT / AllocRpt / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	AS	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Contiene "????"
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CGIVEOUT / AllocRpt / OrdAlloc						Bloque OrdAlloc enviado por el cliente (1 time)
→11	CIOrdID	CIOrdID	N	[N/A]	String	
→ 198	Secondary OrderID	CIOrdID2	N		String	Identificador único de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación
→ 586*	OrigOrd ModTime	OrigOrd ModTm	N		UTCTime stamp	Fecha y hora de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación
→ 1*	Account	Acct	N		String	Código de cliente introducido en la orden

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→58*	Text	Txt	N		String	Si es una Operación procedente de una orden, contiene la Referencia asignada en la orden Si es una Asignación de Cuenta Diaria o un Traspaso, contiene la Referencia de la Operación previa
→ 581*	AccountType	AcctTyp	N	1 – AOTC 3 – MTCH 4 – DEAL	Int	Indicador de capacidad
CGIVEOUT /AllocRpt/ AllExc						No está presente cuando OrdAllocGrp informado (n times)
→32	LastQty	LastQty	N		Qty	Volumen de la Operación
→31	LastPx	LastPx	N		Price	Precio de la Operación
→1003	TradeID	TrdID	N		String	Identificador de registro de la ECC de la nueva Operación Sólo está presente cuando AllocStatus [87] = 9 (Claimed)
→ 1126*	OrigTradeID	OrigTrdID	N		String	Identificador de registro de la ECC de la Operación previa Sólo está presente cuando el mensaje va destinado a los usuarios del Miembro que solicitó el traspaso
1300*	Market SegmentID	MktSegID	N	Ver Tabla 5 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de Segmento de Negociación
880*	TrdMatchID	MtchID	N		String	Número de registro de negociación de la Operación inicial
CGIVEOUT /AllocRpt/ AllExc/ Stip*						
→→ 233*	StipulationType	Typ	N	TOPEM QTYM MEMM	String	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→→ 234*	StipulationValue	Val	N		String	<p>Si StipulationType [233] = TOPEM, contiene el código de la ejecución en la plataforma de negociación</p> <p>Si StipulationType [233] = QTYM, contiene el volumen de la ejecución en la plataforma de negociación</p> <p>Si StipulationType [233] = MEMM, contiene el código de miembro de la ejecución en la plataforma de negociación</p>
CGIVEOUT /AllocRpt/ AllExc/ MiscFees*						(1 time)
→→ 137*	MiscFeeAmt	Amt	N		Amt	Corretaje de la Operación inicial
→→ 139*	MiscFeeType	Typ	N	12 = Agent	String	
CGIVEOUT /AllocRpt/ Instrmt						
55	Symbol	Sym	N	[N/A] o código de valor	String (5)	
48	SecurityID	ID	N		String (12)	Código ISIN
22	SecurityID Source	Src	N	4 = ISIN number	String	
CGIVEOUT /AllocRpt/ Pty						(n times)
→448	PartyID	ID	N		String	<p>Si PartyRole[452]=12, contiene el usuario que inició la solicitud</p> <p>Si PartyRole[452]=16, contiene el código de la plataforma</p> <p>Si PartyRole[452]=36, contiene el usuario del Miembro Destino que realizó la aceptación o rechazo de la Asignación</p> <p>Si PartyRole[452]=95, contiene el Miembro Origen</p> <p>Si PartyRole[452]=96, contiene el Miembro Destino</p> <p>Si PartyRole[452]=98, contiene el Miembro Compensador de la Cuenta de Posición de la Operación a traspasar</p>
→447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
						Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
				12 = Executing Trader		El valor 12 está presente en los mensajes destinados a los usuarios del Miembro que realizó la solicitud de traspaso, así como a los usuarios del Miembro Destino de la Asignación si es el caso, informándoles del usuario que inició la solicitud
				16 = Executing System (platform Code)		El valor 36, cuando esté presente, informa del usuario del Miembro Destino que realizó la aceptación o rechazo de una Asignación
→452	PartyRole	R	N	36 = Clearing Broker Trader	Int	El valor 95 está presente en los mensajes destinados al Miembro Origen y al Miembro Destino de una Asignación informándoles del Miembro Origen
				95 = Give-up Trading Firm		El valor 96 está presente en todos los mensajes relacionados con Asignación Externa, informando del Miembro Destino
				96 = Take-up Trading Firm		El valor 98 está presente en los mensajes destinados al Miembro Destino cuando el mensaje contiene una cuenta de posición en el campo AllocAccount [79], informándole del Miembro Compensador de dicha cuenta. Este valor también está presente en los mensajes enviados al Miembro Compensador
				98 = Take-up Clearing Firm		
CGIVEOUT /AllocRpt/ Alloc						(1 time)
→79	AllocAccount	Acct	N		String	Cuenta de Posición Destino En una Asignación Externa sólo se informa de este campo cuando se recibe el mensaje como Destino o Compensador (nunca como Origen). En cualquier otro caso contiene "[N/A]"
→80	AllocQty	Qty	N		Qty	Volumen de la Asignación Externa. Debe ser igual al campo Quantity
→1729	FirmMnemonic	FirmMnem	N		String	Cuando está presente, informa del Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm) o del Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Destino (Take- up Trading Firm)

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

7.3 Asignaciones Externas (Miembro Destino)

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CGIVEIN / AllocRpt						(n times)
755	AllocReportID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Allocation Report
70	AllocID	ID	N		String (30)	Identificador del mensaje Allocation Instruction relacionado
71	AllocTransType	TransTyp	S	0 = New 2 = Cancel	Char	
795	AllocReport RefID	RptRefID	N		String	Presente cuando AllocTransType [71] = 2 (Cancel)
796	AllocCancRe placeReason	CxIRplcRsn	N	99 = Other	Int	Presente cuando AllocTransType [71] = 2 (Cancel)

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
793	Secondary AllocID	ID2	N		String	Identificador único del traspaso asignado por la Cámara
794	AllocReport Type	RptTyp	S	15 = Give-up 16 = Take-up	Int	
87	AllocStatus	Stat	S	5 = Rejected by intermediary 6 = Allocation pending 9 = Claimed 12 = Cancelled 13 = Pending take-up approval	Int	
72	RefAllocID	RefID	N		String	Presente cuando AllocTransType [71] = 2 (Cancel)
54	Side	Side	S	1 = Buy 2 = Sell	Char	Indica si la Operación a transferir es compradora o vendedora
53	Quantity	Qty	S		Qty	Volumen de la Asignación Externa
6	AvgPx	AvgPx	S		Price	Precio de la Operación
75	TradeDate	TrdDt	S		LocalMkt Date	En asignaciones simples: Fecha de Contratación En asignaciones múltiples: Fecha Teórica de Liquidación
64	SettlDate	SettlDt	N		LocalMkt Date	Fecha Teórica de Liquidación
381	GrossTradeAmt	GrossTrdAmt	N		Amt	Importe efectivo de la Asignación Externa
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMkt Date	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
CGIVEIN / AllocRpt / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	AS	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Contiene "????"

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CGIVEIN /AllocRpt/ OrdAlloc						Bloque OrdAlloc enviado por el cliente (1 time)
→11	CIOrdID	CIOrdID	N	[N/A]	String	
→198	Secondary OrderID	CIOrdID2	N		String	Identificador único de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación
→586*	OrigOrd ModTime	OrigOrd ModTm	N		UTCTime stamp	Fecha y hora de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación
→1*	Account	Acct	N		String	Código de cliente introducido en la orden
→58*	Text	Txt	N		String	Si es una Operación procedente de una orden, contiene la Referencia asignada en la orden Si es una Asignación de Cuenta Diaria o un Traspaso, contiene la Referencia de la Operación previa
→581*	AccountType	AcctTyp	N	1 – AOTC 3 – MTCH 4 – DEAL	Int	Indicador de capacidad
CGIVEIN /AllocRpt/ AllExc						No está presente cuando OrdAllocGrp informado (n times)
→32	LastQty	LastQty	N		Qty	Volumen de la Operación
→31	LastPx	LastPx	N		Price	Precio de la Operación
→1003	TradeID	TrdID	N		String	Identificador de registro de la ECC de la nueva Operación Sólo está presente cuando AllocStatus [87] = 9 (Claimed)

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→1126*	OrigTradeID	OrigTrdID	N		String	Identificador de registro de la ECC de la Operación previa Sólo está presente cuando el mensaje va destinado a los usuarios del Miembro que solicitó el traspaso
1300*	Market SegmentID	MktSegID	N	Ver Tabla 5 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de Segmento de Negociación
880*	TrdMatchID	MtchID	N		String	Número de registro de negociación de la Operación inicial
CGIVEIN / AllocRpt/ AllExc/ Stip*						
→→ 233*	StipulationType	Typ	N	TOPEM = Código de la ejecución QTYM = Volumen de la ejecución MEMM = Código del Miembro de la plataforma	String	
→→ 234*	StipulationValue	Val	N		String	Si StipulationType [233] = TOPEM, contiene el código de la ejecución en la plataforma de negociación Si StipulationType [233] = QTYM, contiene el volumen de la ejecución en la plataforma de negociación Si StipulationType [233] = MEMM, contiene el código de miembro de la ejecución en la plataforma de negociación
CGIVEIN / AllocRpt/ AllExc/MiscFees*						(1 time)
→→ 137*	MiscFeeAmt	Amt	N		Amt	Corretaje de la Operación inicial
→→ 139*	MiscFeeType	Typ	N	12 = Agent	String	
CGIVEIN / AllocRpt/ Instrmt						
55	Symbol	Sym	N	[N/A] o código de valor	String(5)	
48	SecurityID	ID	N		String (12)	Código ISIN
22	SecurityID Source	Src	N	4 = ISIN number	String	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CGIVEIN / AllocRpt/ Pty						(n times)
→448	PartyID	ID	N		String	<p>Si PartyRole[452]=11, contiene el código del usuario de la plataforma</p> <p>Si PartyRole[452]=13, contiene el código del Miembro de la plataforma</p> <p>Si PartyRole[452]=16, contiene el código de la plataforma</p> <p>Si PartyRole[452]=12, contiene el usuario que inició la solicitud</p> <p>Si PartyRole[452]=36, contiene el usuario del Miembro Destino que realizó la aceptación o rechazo de la Asignación</p> <p>Si PartyRole[452]=95, contiene el Miembro Origen</p> <p>Si PartyRole[452]=96, contiene el Miembro Destino</p> <p>Si PartyRole[452]=98, contiene el Miembro Compensador de la Cuenta de Posición.</p>
→447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→452	PartyRole	R	N	11 = Order Origination Trader 12 = Executing Trader 13 = Order Origination Firm 16 = Executing System (Código de plataforma) 36 = Clearing Broker Trader 95 = Give-up Trading Firm 96 = Take-up Trading Firm 98 = Take-up Clearing Firm	Int	<p>Indica el rol que toma el código especificado en PartyID</p> <p>El valor 11 está presente en los mensajes destinados al Miembro Destino, cuando OrdAllocGrp informado, informándole del código del usuario de la plataforma</p> <p>El valor 13 está presente en los mensajes destinados al Miembro Destino, cuando OrdAllocGrp informado, informándole del código del Miembro de la plataforma</p> <p>El valor 16 está presente en los mensajes destinados al Miembro Destino, cuando OrdAllocGrp informado, informándole del código de la plataforma</p> <p>El valor 12 está presente en los mensajes destinados a los usuarios del Miembro que realizó la solicitud de traspaso, así como a los usuarios del Miembro Destino de la Asignación si es el caso, informándoles del usuario que inició la solicitud</p> <p>El valor 36, cuando esté presente, informa del usuario del Miembro Destino que realizó la aceptación o rechazo de una Asignación</p> <p>El valor 95 está presente en los mensajes destinados al Miembro Origen y al Miembro Destino de una Asignación informándoles del Miembro Origen</p> <p>El valor 96 está presente en todos los mensajes relacionados con Asignación Externa, informando del Miembro Destino</p> <p>El valor 98 está presente en los mensajes destinados al Miembro Destino cuando el mensaje contiene una cuenta de posición en el campo AllocAccount [79], informándole del Miembro Compensador de dicha cuenta. Este valor también está presente en los mensajes enviados al Miembro Compensador</p>

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CGIVEIN /AllocRpt/ Alloc						(1 time)
→79	AllocAccount	Acct	N		String	Cuenta de Posición Destino En una Asignación Externa sólo se informa de este campo cuando se recibe el mensaje como Destino o Compensador (nunca como Origen). En cualquier otro caso contiene "[N/A]"
→80	AllocQty	Qty	N		Qty	Volumen de la Asignación Externa. Debe ser igual al campo Quantity
→1729	FirmMnemonic	FirmMnem	N		String	Cuando está presente, informa del Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm) o Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Destino (Take-up Trading Firm)
→161	AllocText	Txt	N		String	Cuando está presente, informa de la Referencia de Asignación
→1732	FirmAllocText	FirmTxt	N		String	Cuando está presente, informa de la Referencia de Asignación asignada por el Miembro Origen (Give-up Trading Firm) para uso interno

7.4 Asignaciones Externas (Compensador de Miembro Destino)

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
381	GrossTradeAmt	GrossTrdAmt	N		Amt	Importe efectivo de la Asignación Externa
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716*	SettlSessID	SetSesID	N	ITD = Intradía EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
CGIVEINCLM / AllocRpt / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	AS	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Contiene "????"
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC.
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CGIVEINCLM / AllocRpt/ OrdAlloc						Bloque OrdAlloc enviado por el cliente (1 time)
→11	CIOrdID	CIOrdID	N	[N/A]	String	
→198	Secondary OrderID	CIOrdID2	N		String	Identificador único de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación
→586*	OrigOrd ModTime	OrigOrd ModTm	N		UTC Timestamp	Fecha y hora de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación
→1*	Account	Acct	N		String	Código de cliente introducido en la orden
→58*	Text	Txt	N		String	Si es una Operación procedente de una orden, contiene la Referencia asignada en la orden Si es una Asignación de Cuenta Diaria o un Traspaso, contiene la Referencia de la Operación previa
→581*	AccountType	AcctTyp	N	1 – AOTC 3 – MTCH 4 – DEAL	Int	Indicador de capacidad

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CGIVEINCLM / AllocRpt/ AllExc						No está presente cuando OrdAllocGrp informado (n times)
→32	LastQty	LastQty	N		Qty	Volumen de la Operación
→31	LastPx	LastPx	N		Price	Precio de la Operación
→1003	TradeID	TrdID	N		String	Identificador de registro de la ECC de la nueva Operación Sólo está presente cuando AllocStatus [87] = 9 (Claimed)
→1126*	OrigTradeID	OrigTrdID	N		String	Identificador de registro de la ECC de la Operación previa Sólo está presente cuando el mensaje va destinado a los usuarios del Miembro que solicitó el traspaso
1300*	Market SegmentID	MktSegID	N	Ver Tabla 5 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de Segmento de Negociación
880*	TrdMatchID	MtchID	N		String	Número de registro de negociación de la Operación inicial.
CGIVEINCLM / AllocRpt/ AllExc/ Stip*						
→→ 233*	StipulationType	Typ	N	TOPEM QTYM MEMM	String	
→→ 234*	StipulationValue	Val	N		String	Si StipulationType [233] = TOPEM, contiene el código de la ejecución en la plataforma de negociación. Si StipulationType [233] = QTYM, contiene el volumen de la ejecución en la plataforma de negociación. Si StipulationType [233] = MEMM, contiene el código de miembro de la ejecución en la plataforma de negociación.
CGIVEINCLM / AllocRpt/ AllExc/ MiscFees*						(1 time)
→→ 137*	MiscFeeAmt	Amt	N		Amt	Corretaje de la Operación inicial
→→ 139*	MiscFeeType	Typ	N	12 = Agent	String	

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→ 452	PartyRole	R	N	11 = Order Origination Trader 12 = Executing Trader 13 = Order Origination Firm 16 = Executing System (Código de plataforma) 36 = Clearing Broker Trader 95 = Give-up Trading Firm 96= Take-up Trading Firm 98 = Take-up Clearing Firm	Int	<p>Indica el rol que toma el código especificado en PartyID</p> <p>El valor 11 está presente en los mensajes destinados al Miembro Destino, cuando OrdAllocGrp informado, informándole del código del usuario de la plataforma</p> <p>El valor 12 está presente en los mensajes destinados a los usuarios del Miembro que realizó la solicitud de traspaso, así como a los usuarios del Miembro Destino de la Asignación si es el caso, informándoles del usuario que inició la solicitud</p> <p>El valor 13 está presente en los mensajes destinados al Miembro Destino, cuando OrdAllocGrp informado, informándole del código del Miembro de la plataforma</p> <p>El valor 36, cuando esté presente, informa del usuario del Miembro Destino que realizó la aceptación o rechazo de una Asignación</p> <p>El valor 95 está presente en los mensajes destinados al Miembro Origen y al Miembro Destino de una Asignación informándoles del Miembro Origen</p> <p>El valor 96 está presente en todos los mensajes relacionados con Asignación Externa, informando del Miembro Destino</p> <p>El valor 98 está presente en los mensajes destinados al Miembro Destino cuando el mensaje contiene una cuenta de posición en el campo AllocAccount [79], informándole del Miembro Compensador de dicha cuenta. Este valor también está presente en los mensajes enviados al Miembro Compensador</p>
CGIVEINCLM /AllocRpt/ Alloc						(1 time)
→79	AllocAccount	Acct	N		String	<p>Cuenta de Posición Destino</p> <p>En una Asignación Externa sólo se informa de este campo cuando se recibe el mensaje como Destino o Compensador (nunca como Origen). En cualquier otro caso contiene "[N/A]"</p>
→80	AllocQty	Qty	N		Qty	Volumen de la Asignación Externa. Debe ser igual al campo Quantity

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

8. Retención y Liberación de Operaciones

8.1 Retenciones/liberaciones realizadas

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CHOLDRELEASE / AllocRpt						(n times)
755	AllocReportID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Allocation Report
70	AllocID	ID	N		String (30)	Identificador del mensaje Allocation Instruction relacionado
71	AllocTransType	TransTyp	S	0 = New	Char	
793	Secondary AllocID	ID2	N		String	Identificador único de la acción de Retención o Liberación
794	AllocReport Type	RptTyp	S	15 = Retener o Liberar una Operación	Int	Ver StipulationType [233] = RL
87	AllocStatus	Stat	S	9 = Claimed	Int	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
54	Side	Side	S	2 = Sell	Char	La Operación a retener siempre es de venta
53	Quantity	Qty	S		Qty	Número de Valores retenidos/ liberados
6	AvgPx	AvgPx	S		Price	Precio de la Operación
75	TradeDate	TrdDt	S		LocalMktDate	Fecha de Contratación
64	SettlDate	SettlDt	N		LocalMktDate	Fecha Teórica de Liquidación
381	GrossTradeAmt	GrossTrdAmt	N		Amt	Importe efectivo de la retención/ liberación
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716*	SettlSessID	SetSesID	N	ITD = Intradía EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
CHOLDRELEASE / AllocRpt / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	AS	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Contiene "????"
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CHOLDRELEASE / AllocRpt / AllExc						(1 time)
→32	LastQty	LastQty	N		Qty	Volumen de la Operación
→31	LastPx	LastPx	N		Price	Precio de la Operación
→1003	TradeID	TrdID	N		String	Identificador de registro de la ECC de la Operación a retener/liberar

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CHOLDRELEASE /AllocRpt/ Instrmt						
55	Symbol	Sym	N	[N/A] o código de valor	String (5)	
48	SecurityID	ID	N		String (12)	Código ISIN
22	SecurityID Source	Src	N	4 = ISIN number	String	
CHOLDRELEASE /AllocRpt/ Pty (n times)						
→448	PartyID	ID	N		String	<p>Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC</p> <p>Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC</p> <p>Si PartyRole[452]=38, contiene la Cuenta de Posición</p> <p>Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante</p> <p>Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación</p>
→447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	
→452	PartyRole	R	N	1 = Executing Firm 4 = Clearing Firm 38 = Position Account 90 = Settlement Firm 91 = Settlement Account	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID.
CHOLDRELEASE /AllocRpt/ Stip (1 time)						
→ 233	StipulationType	Typ	N	RL = Retención / Liberación de Valores	String	
→234	StipulationValue	Val	N		String	Los Valores posibles son: •RO = Retención Operación •LO = Liberación Operación
CHOLDRELEASE /AllocRpt/ Alloc (1 time)						
→80	AllocQty	Qty	N		Qty	Número de Valores retenidos/ liberados. Debe ser igual al campo Quantity

8.2 Operaciones Retenidas

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CHELDTRADES / TrdCaptRpt						(n times)
1003	TradeID	TrdID	N		String	Identificador de registro de la ECC. Este campo siempre está presente en el mensaje
1040	Secondary TradeID	TrdID2	N		String	Contiene el identificador de registro de la ECC de la Operación inicial
828	TrdType	TrdTyp	N	Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación"	Int	Tipo de Operación FIX. Este valor es usado conjuntamente con TrdSubType [829]
829	TrdSubType	TrdSubTyp	N	Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación"	Int	Este valor es usado conjuntamente con TrdType [828]
1126	OrigTradeID	OrigTrdID	N		String	Contiene el identificador de registro de la ECC de la Operación previa
150	ExecType	ExecTyp	N	F = Trade	Char	
820	TradeLinkID	LinkID	N		String	Referencia original primaria de la Operación asignada por la ECC
880	TrdMatchID	MtchID	N		String	Número de registro de negociación de la Operación inicial Coincide con el campo TrdMatchID del mensaje Execution Report
17	ExecID	ExecID	N		String	Referencia original secundaria de la Operación asignada por la ECC

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
1300	Market SegmentID	MktSegID	N	Ver Tabla 5 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de Segmento de Negociación
32	LastQty	LastQty	S	>= 0, sin decimales	Qty	Volumen de la Operación
151*	LeavesQty	LeavesQty	N		Qty	Volumen vivo de la Operación
31	LastPx	LastPx	S		Price	Precio de la Operación
15	Currency	Ccy	N		Currency	Código de divisa. Expresada según estándar ISO 4217
75	TradeDate	TrdDt	N		LocalMktDate	Fecha de Contratación
60	TransactTime	TxnTm	N		UTCTimestamp	Fecha y hora, en formato UTC, en que se realizó la transacción.
64	SettlDate	SettlDt	N		LocalMktDate	Fecha Teórica de Liquidación
381	GrossTradeAmt	GrossTrdAmt	N		Amt	Importe Efectivo de la Operación
5681*	Exchange TradeType	ExchTrdTyp	N	Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación"	String	Tipo de Operación de la ECC
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716	SettlSessID	SetSesID	N	ITD = Intradía EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
CHELDTRADES / TrdCaptRpt / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	AE	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje 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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CHELDTRADES /TrdCaptRpt/ Instrmt						
55	Symbol	Sym	N	[N/A] o código de valor	String (5)	
48	SecurityID	ID	N		String (12)	Código ISIN.
22	SecurityID Source	Src	N	4 = ISIN number	String	
CHELDTRADES /TrdCaptRpt/ Amt						(n times)
→708	PosAmt	Amt	N		Amt	
→1585	PosAmtReason	Rsn	N	1000 = Importe Efectivo vivo de la Operación 1001 = Importe Efectivo de Valores retenidos	Int	
CHELDTRADES /TrdCaptRpt/ TrdRegTS						(1 time)
→769	TrdRegTime stamp	TS	N		UTCTimest amp	Día y hora de la Operación inicial en el Sistema de Negociación
→770	TrdRegTime stampType	Typ	N	3 = Time Out	Int	
CHELDTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide						(1 time) Siempre 1 ya que sólo se incluye la parte compradora o vendedora, según corresponda al destinatario del mensaje
→54	Side	Side	S	2 = Sell	Char	Signo de la Operación
→1	Account	Acct	N		String	Código de cliente introducido en la orden
→581	AccountType	AcctTyp	N	1 – AOTC 3 – MTCH 4 – DEAL	Int	Indicador de capacidad
→77	PositionEffect	PosEfct	N	“0” = Open		

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→→234	StipulationValue	Val	N		String	Para Operaciones de compraventa: •Si StipulationType [233] = TOPEM, contiene el código de la ejecución en la plataforma de negociación •Si StipulationType [233] = QTYM, contiene el volumen de la ejecución en la plataforma de negociación •Si StipulationType [233] = AMTM, contiene el importe efectivo de la ejecución en la plataforma de negociación •Si StipulationType [233] = NDAYS, contiene el número de días late
CHELDTRADES /TrdCaptRpt/ RptSide/ TrdRptOrdDetl						(1 time)
→→198	Secondary OrderID	OrdID2	N		String	Identificador único de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación
→→586	OrigOrd ModTime	OrigOrd ModTm	N		UTCTimest amp	Fecha y hora de la orden de la ejecución tal y como se asignó por la plataforma de negociación
CHELDTRADES /TrdCaptRpt/RptSide Qty*						(n times)
→→703*	PosType	Typ	N	RCV	String	RCV indica los Valores retenidos por la Entidad Liquidadora
→→705*	ShortQty	Short	N	> 0, sin decimales	Qty	

9. Comisiones

9.1 Comisiones Miembro Compensador

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CMONTHLYFEES / AcctSumRpt						(n times)
1699	AccountSummaryReportID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Account Summary Report
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716	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
CMONTHLYFEES / 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 "????"

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC.
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CMONTHLYFEES /AcctSumRpt/ Pty						(n times)
→448	PartyID	ID	N		String	Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC
→447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	
→452	PartyRole	R	N	1 = Executing Firm 4 = Clearing Firm 38 = Position Account	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador Si PartyRole[452]=38, contiene el código de la Cuenta de Posición
CMONTHLYFEES /AcctSumRpt/ PayCol						Movimientos de efectivo (n times)
→1708	PayCollectType	Typ	N	Facturable para el segmento RV: 20 21 22 24 25 Facturable para el segmento RF: 31 32 33 34 36 Ver Tabla 11 del documento "Tablas de Codificación" Informativo: TT	String	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→53*	Quantity	Qty	N		Qty	<p>Depende del valor de PayCollectType [1708]:</p> <p>20: Número de miembros para los que actúa como miembro compensador</p> <p>21: Número de transacciones facturables del mes (teniendo en cuenta cap)</p> <p>22: Número de cuentas de Posición facturables</p> <p>24: Número de instrucciones de liquidación</p> <p>25: Número de GUIs.</p> <p>TT: Número de transacciones del mes</p>
→ 1711	CollectAmount	PayAmt	N		Amt	Importe de la comisión
→1712	PayCollect Market SegmentID	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

9.2 Comisiones Colateral

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	NAME	FIXML	REQ	VALID VALUES	FORMAT	DESCRIPTION
CCOLLATERALFEES / CollRpt						(n times)
908	CollRptID	RptID		S	String	Identificador único para cada mensaje Account Summary 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	LocalMkt Date	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	Contiene el código de Segmento de la ECC.
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CCOLLATERALFEES / CollRpt / Pty						(n times)

TAG	NAME	FIXML	REQ	VALID VALUES	FORMAT	DESCRIPTION
→448	PartyID	ID	N		String	<p>Si PartyRole[452]=49, contiene el código del Miembro al que pertenece la Cuenta de Colateral</p> <p>Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC</p> <p>Si PartyRole[452]=101, contiene la Cuenta de Colateral</p> <p>Si PartyRole[452]=22, contiene el código de Segmento de la ECC</p> <p>Si PartyRole[452]= 112, contiene el origen del colateral. Cuando el colateral sea de la propia cuenta se mostrará la misma cuenta de colateral. Cuando sea de una cuenta buffer, se mostrará el código de la cuenta buffer.</p>
→447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	
→452	PartyRole	R	N	49 = Collateral Firm (código de Miembro de la ECC) 4 = Clearing Firm 101 = Collateral Account 22 = Segmento 112 = Collateral Source Account	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID.
CCOLLATERALFEES / CollRpt/ Instrmt						
55	Symbol	Sym	N	[N/A] o código del activo	String(5)	
48	SecurityID	ID	N		String(12)	Código del activo entregado.
22	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						

TAG	NAME	FIXML	REQ	VALID VALUES	FORMAT	DESCRIPTION
→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)
				MARGIN_INST		
				CCY_		
				REINVESTMENT_		
				IND		
				ACC_		
				REINVESTMENT_		
				IND		
				SPREAD		
				ADD_ON_		
				SPREAD		
				REF_RATE_NAME		
→233	StipulationType	Typ	N	REF_RATE	String	
				CASH_RATE		
				TREASURY_FEE_		
				AMT		
				NON_CASH_		
				COL_FEE		
				NON_CASH_		
				COL_FEE_AMT		
				ASSET_PRICE		
				EXCHANGE_RATE		
				NDAYSC		

TAG	NAME	FIXML	REQ	VALID VALUES	FORMAT	DESCRIPTION
→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] = 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</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: "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>

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

10. Garantías Depositadas

10.1 Detalle de Garantías Depositadas

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CPLEDGES / CollRpt						(n times)
908	CollRptID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Collateral Report
910	CollStatus	Stat	S	3 = Assigned (Accepted)		
15	Currency	Ccy	N		Currency	Código de divisa en la que está expresado el importe efectivo. Expresada según estándar ISO 4217
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716	SettlSessID	SetSesID	N	ITD = Intradía EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
CPLEDGES / CollRpt / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	BA	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
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 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	SecurityID Source	Src	N	4 = ISIN number	String	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
543	InstrRegistry	Rgstry	N	Ver Tabla 13, para colateral en valores, o Tabla 18, para efectivo del documento "Tablas de Codificación".	String	Código del Depositario Central del activo en el que está constituida la Garantía o del Banco en el que está depositado el efectivo.
CPLEDGES /CollRpt/ Instrmt/ Evt						(1 time)
→865	EventType	EventTyp	N	204 = Nominal		
→868	EventText	Txt	N		String	Valor nominal del activo entregado En caso de acciones es el número de títulos
CPLEDGES /CollRpt/ Stip						(n times)
→233	StipulationType	Typ	N	MARGIN_INST ASSET_TYPE HAIRCUT ASSET_PRICE ASSET_VALUE NOMINAL_CU RRENCY EXCHANGE_R ATE	String	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→ 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 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> <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>

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

CALLOCAS.sc	
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	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
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)

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→448	PartyID	ID	N		String	<p>Si PartyRole[452]=49, contiene el código del Miembro al que pertenece la Cuenta de Colateral</p> <p>Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC</p> <p>Si PartyRole[452]=101, contiene la Cuenta de Colateral</p> <p>Si PartyRole[452]=22, contiene el código de Segmento de la ECC</p> <p>Si PartyRole[452]= 112, contiene el origen del colateral. Cuando el colateral sea de la propia cuenta se mostrará la misma cuenta de colateral. Cuando sea de una cuenta buffer, se mostrará el código de la cuenta buffer.</p>
→447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	
→452	PartyRole	R	N	49 = Collateral Firm (código de Miembro de la ECC) 4 = Clearing Firm 101 = Collateral Account 22 = Segmento 112 = Collateral Source Account	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID.
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	Security ID 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.

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CALLOCAS /CollRpt/ Instrmt/ Evnt						(n times)
→865	EventType	EventTyp	N	204 = Nominal 205 = Nominal Requerido 206 = Nominal en Exceso		
→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_CURR ENCY EXCHANGE_RATE	String	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→ 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> <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>

10.3 Colateral asignado a cada cuenta de colateral

CALLOCBS.sc	
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	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
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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CALLOCBS /CollRpt/ Pty						(n times)
→448	PartyID	ID	N		String	<p>Si PartyRole[452]=49, contiene el código del Miembro al que pertenece la Cuenta de Colateral</p> <p>Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC</p> <p>Si PartyRole[452]=101, contiene la Cuenta de Colateral</p> <p>Si PartyRole[452]=22, contiene el código de Segmento de la ECC</p> <p>Si PartyRole[452]= 112, contiene el origen del colateral. Cuando el colateral sea de la propia cuenta se mostrará la misma cuenta de colateral. Cuando sea de una cuenta buffer, se mostrará el código de la cuenta buffer.</p>
→447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	
→452	PartyRole	R	N	49 = Collateral Firm (código de Miembro de la ECC) 4 = Clearing Firm 101 = Collateral Account 22 = Segmento 112 = Collateral Source Account	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID.
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	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.

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CALLOCBS /CollRpt/ Instrmt/ Evnt						(n times)
→865	EventType	EventTyp	N	204 = Nominal 205 = Nominal Requerido 206 = Nominal en Exceso		
→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_ CURR ENCY EXCHANGE_RAT E	String	

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

11. Resultados a nivel de Cuenta

11.1 Saldo neto y saldo agregado por Fecha Teórica de Liquidación

CBALANCEBYDATE.sc	
Grupo	Datos para Cálculo de Garantías
Descripción	Información del saldo de compraventas por: Cuenta de Posición, Valor, Fecha de Contratación y Fecha de Liquidación (sólo aquellas que tienen saldo) para RV, y Cuenta de Posición, Valor y Fecha de Liquidación (sólo aquellas que tienen saldo) para RF. Para cuentas de posición netas se informa del saldo neto comprador o vendedor; para cuentas de posición brutas (para RV) se da el saldo agregado de compras y ventas. Información del saldo vendedor retenido para operaciones de RV. También se informa de la posición de Ajustes pendientes de liquidar por Eventos Corporativos, así como de las posiciones de efectivo pendientes de liquidar del segmento de RV y RF.
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador, Entidad Participante
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible durante la sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros en cualquier momento

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CBALANCEBYDATE / PosRpt						(n times)
721	PosMaintRptID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Position Report
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
→64	SettlDate	SettlDt	N		LocalMktDate	Fecha Teórica de Liquidación
716	SettlSessID	SetSesID	N	ITD = Intradía EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
15	Currency	Ccy	N		Currency	Código de divisa Expresada según estándar ISO 4217

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
58	Text	Txt	N		String	Sólo para RF, contiene el Tipo de SFT: B: Simultánea R: Repo N: No aplica
CBALANCEBYDATE / PosRpt / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	AP	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje
56	TargetCompID	TID	S		String	Contiene "????"
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CBALANCEBYDATE / PosRpt/ Pty (n times)						
→448	PartyID	ID	S		String	Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV Si PartyRole[452]=38, contiene el código de la Cuenta de Posición Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación
→447	PartyIDSource	Src	S	D = Proprietary/ Custom code	Char	
→452	PartyRole	R	S	1 = Executing Firm 4 = Clearing Firm 10 = CSD code 38 = Position Account 90 = Settlement Firm 91 = Settlement Account	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CBALANCEBYDATE /PosRpt/ Instrmt						
55	Symbol	Sym	N	[N/A] o código de valor	String(5)	
→1639*	MarginClass	Cls	N		String	Grupo de compensación del activo. Aplica al segmento de RF.
48	SecurityID	ID	N		String (12)	Código ISIN
22	SecurityID Source	Src	N	4 = ISIN number	String	
CBALANCEBYDATE /PosRpt/ Qty						(n times)
→703	PosType	Typ	N	NET GRS RCV TRF CAA PNTN DLV	String	NET indica la posición neta de compraventas pendiente de liquidar para cada fecha de liquidación. GRS indica la posición bruta de compraventas pendiente de liquidar para cada fecha de liquidación Sólo aplica al Segmento de RV RCV indica la posición retenida (short) para cada fecha de liquidación. Sólo aplica al Segmento de RV TRF indica la posición fallida para cada fecha de liquidación CAA indica la posición debida a Ajustes por Eventos para cada fecha PNTN indica la posición debida a operaciones especiales con fecha de contratación igual a la fecha de sesión. Sólo aplica al Segmento de RV. DLV indica la posición prevista por entrega en las fechas de vencimiento de futuros y opciones. Sólo aplica al Segmento de RV
→704	LongQty	Long	N	>= 0, sin decimales	Qty	Indica el número de Valores / Nominal que conforman el saldo de recepción de valores asociado al tipo indicado en el campo PosType [703]
→705	ShortQty	Short	N	>= 0, sin decimales	Qty	Indica el número de Valores / Nominal que conforman el saldo de entrega de valores asociado al tipo indicado en el campo PosType [703]
→976	QuantityDate	QtyDt	N		LocalMktDate	Fecha de Contratación Sólo aplica al Segmento de RV
CBALANCEBYDATE /PosRpt/ Amt						(n times)

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→708	PosAmt	Amt	N		Amt	Puede ser negativo en función del resultado de la compensación en cuentas de Posición netas
→707	PosAmtType	Typ	N	NET GRS RCV TRF CAA PNTN DLV PA	String	Mismos comentarios que para PosType[703] en grupo Qty PA indica posiciones en efectivo pendientes de liquidar
→1585	PosAmtReason	Rsn	N	1001 = Importe Efectivo de compras (posición asociada a LongQty) 1002 = Importe Efectivo de ventas (posición asociada a ShortQty) 1005 = Valor actual del efectivo de compras (posición asociada a LongQty) Aplica al segmento de RF 1006 = Valor actual del efectivo (posición asociada a ShortQty). Aplica al segmento de RF 1050 = Efectivos pendientes de liquidar	Int	
→75*	TradeDate	TrdDt	N		LocalMktDate	Fecha de Contratación. Sólo aplica al Segmento de RV

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CMARGINCALC / PosRpt						(n times)
721	PosMaintRptID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Position Report
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
730	SettlPrice	SetPx	S*			Precio de cierre
15	Currency	Ccy	N		Currency	Código de divisa Expresada según estándar ISO 4217
CMARGINCALC / PosRpt / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	AP	String	Identifica el tipo de mensaje
49	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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CMARGINCALC /PosRpt/ Pty						(n times)
→448	PartyID	ID	S		String	<p>Si PartyRole[452]= 15, contiene el código del Miembro de la Cuenta de Garantías</p> <p>Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador</p> <p>Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV</p> <p>Si PartyRole[452]= 100, contiene el código de la Cuenta de Garantías</p> <p>Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante</p> <p>Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación</p>
→447	PartyIDSource	Src	S	D = Proprietary/ Custom code	Char	
→452	PartyRole	R	S	<p>15 = Margin Firm</p> <p>4 = Clearing Firm</p> <p>10 = CSD Code</p> <p>100 = Margin Account</p> <p>90 = Settlement Firm</p> <p>91 = Settlement Account</p>	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
CMARGINCALC /PosRpt/ Instrmt						
55	Symbol	Sym	N	[N/A] or Security Code	String (5)	
→1639*	MarginClass	Clss	N		String	Grupo de compensación del activo. Aplica al segmento de RF
48	SecurityID	ID	N		String (12)	Código ISIN
22	SecurityID Source	Src	N	4 = ISIN number	String	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→703	PosType	Typ	N	PIT TA ETR TQ RCV TRF ASF CAA IES	String	<p>(n times)</p> <p>Escenario o Concepto de riesgo aplicables al segmento de RV.</p> <p>PIT indica escenario 1 por compraventas (incluyendo todas las operaciones pendientes de liquidar)</p> <p>TA indica escenario 2 por compraventas (excluyendo las operaciones con fecha teórica de liquidación D y D+1)</p> <p>ETR indica escenario 3 por compraventas (excluyendo operaciones especiales con Fecha de Contratación igual a la Fecha de Sesión)</p> <p>TQ indica escenario 4 por compraventas (excluyendo las operaciones con fecha teórica de liquidación d y D+1, así como las operaciones especiales con Fecha de Contratación igual a la Fecha de Sesión).</p> <p>RCV indica la posición retenida (short) para cada fecha de liquidación</p> <p>TRF indica la posición fallida</p> <p>CAA indica la posición debida a Ajustes</p> <p>IES indica la posición de Valores en compraventas netas en el peor escenario después de aplicar las compensaciones entre Valores.</p> <p>Escenario o Concepto de riesgo para el segmento de Renta Fija:</p> <p>PIT indican escenario 1 del segmento de RF por compraventas (incluyendo todas las operaciones pendientes de liquidar)</p> <p>TB indica escenario 2 del segmento de RF por compraventas (excluyendo las operaciones con fecha teórica de liquidación D)</p> <p>TA indica escenario 3 del segmento de RF por compraventas (excluyendo las operaciones con fecha teórica de liquidación D y D+1).</p> <p>TRF indica la posición fallida.</p> <p>IES indica la posición de Valores en compraventas netas en el peor escenario después de aplicar las compensaciones entre Valores.</p>

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→704	LongQty	Long	N	>= 0, sin decimales	Qty	Indica el número de Valores / Nominal que conforman el saldo de recepción de valores
→705	ShortQty	Short	N	> 0, sin decimales	Qty	Indica el número de Valores / Nominal que conforman el saldo de entrega de valores
CMARGINCALC / PosRpt/ Amt						(n times)
→708	PosAmt	Amt	N		Amt	Puede ser negativo en función del resultado de la compensación en cuentas netas
→707	PosAmtType	Typ	N	PIT TA ETR TQ RCV TRF ASF CAA IES PA TOT	String	Mismos comentarios que en campo PosType[703] del grupo Qty PA indica posiciones en efectivo pendientes de liquidar TOT incluirá las garantías totales por cuenta y valor

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→ 1585	PosAmtReason	Rsn	N	1001 = Importe Efectivo de compras (posición asociada a LongQty) 1002 = Importe Efectivo de ventas (posición asociada a ShortQty) 1003 = Valor de mercado compras 1004 = Valor de mercado ventas. 1005 = Valor actual del efectivo de compra. (posición asociada a LongQty) 1006 = Valor actual del efectivo de ventas (posición asociada a ShortQty) 1020: Initial Margin antes de compensar (cuentas netas)1021: Initial Margin final 1022 = Variation Margin 1050: Posiciones Efectivo 1060: Garantía por Posición Exigida	Int	Los Valores 1001 y 1002 se corresponden a los importes efectivos de las operaciones asociadas a los volúmenes especificados en LongQty y ShorQty Los valores 1003 y 1004 se corresponden con las valoraciones de mercado asociadas a los volúmenes especificados en LongQty y ShortQty Para el segmento de RV: Los valores 1020, 1021, 1022 corresponden con Initial Margin y Variation Margin (VM = 1001-1002-1003+1004) Para el segmento de RF: Los Valores 1005 y 1006 se corresponden a los importes efectivos de las operaciones asociadas a los volúmenes especificados en LongQty y ShorQty Los valores 1020, 1021, 1022 corresponden con Initial Margin y Variation Margin (VM = 1003-1004-1005+1006)

11.3 Garantías por Cuenta de Garantías

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CACCOUNTSETTL / AcctSumRpt						(n times)
1699	AccountSummaryReportID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Account Summary Report
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716	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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
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	Margin AmountMarket SegmentID	MktSegID	N	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de Segmento de la ECC
→1715	Margin Amount MarketID	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
→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

11.4 Garantías por Cuenta de Colateral

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CACCOUNTSETTLCCP / AcctSumRpt						(n times)
1699	Account Summary ReportID	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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
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
→1715	MarginAmount MarketID	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 Collateral (n times)						Garantías depositadas (n times)
→1706	CollateralType	Typ	S	Ver Tabla 12 del documento "Tablas de Codificación"	String	Tipo de Garantía Depositada
→1704	Current Collateral Amount	Amt	S		Amt	Importe de la Garantía Depositada
→2093	Collateral Amount MarketID	MktID	N	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
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	PayCollect MarketID	MktID	N	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC

11.5 Información de las Pruebas Retrospectivas

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CBACKTESTING / AcctSumRpt						(n times)
1699	AccountSummaryReportID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Account Summary Report
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716	SettlSessID	SetSesID	N	EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
15	Currency	Ccy	N		Currency	Código de divisa en la que están expresados los importes de este mensaje. Expresada según estándar ISO 4217
CBACKTESTING / AcctSumRpt / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	CQ	String	Identifica el tipo de mensaje
49	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
CBACKTESTING /AcctSumRpt/ MgnAmt						Importes de Garantía
→1645	MarginAmt	Amt	N		Amt	Importe asociado a MarginAmtType[1644]
→1644	MarginAmtType	Typ	N	301 302 303 304 305 306	Int	301: Valor actual de la posición: valor de la posición de la sesión que se está analizando al precio de cierre de la sesión actual. 302: Initial Margin de la sesión que se está analizando. 303: Máxima Pérdida 304: Pérdida no cubierta por el Initial Margin 305: Pérdida a 1 día 306: Pérdida a 2 días.
→1714	MarginAmount Market SegmentID	MktSegID	N	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de Segmento de la ECC
→1715	MarginAmount MarketID	MktID	N	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CBACKTESTING / AcctSumRpt/ Pty						(n times)
→448	PartyID	ID	N		String	Si PartyRole[452]= 15, contiene el código de Miembro al que pertenece la Cuenta de Garantías Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador Si PartyRole[452]= 100, contiene el código de la Cuenta de Garantías
→447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	
→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

11.6 Información de las Pruebas de Resistencia

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
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
CSTRESSTESTING / AcctSumRpt / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	CQ	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Contiene "????"
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CSTRESSTESTING /AcctSumRpt/ MgnAmt						Importes de Garantía (n times)
→1645	MarginAmt	Amt	N		Amt	Importe asociado a MarginAmtType[1644]
→1644	MarginAmtType	Typ	N	311 312 313 314	Int	311: Peor escenario del Miembro Compensador 312: Garantía exigida con parámetros peor escenario 313: Garantía por posición 314: Riesgo en situación de Stress Test
→1714	MarginAmount Market SegmentID	MktSegID	N	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de Segmento de la ECC
→1715	MarginAmount MarketID	MktID	N	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CSTRESSTESTING /AcctSumRpt/ Pty						(n times)
→448	PartyID	ID	N		String	Si PartyRole[452]= 15, contiene el código de Miembro al que pertenece la Cuenta de Garantías Si PartyRole[452]=4, contiene el código de Miembro Compensador Si PartyRole[452]= 100, contiene el código de la Cuenta de Garantías
→447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	
→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

11.7 Detalle por cuenta de colateral de los Movimientos de efectivo

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CCASHMOVBRKD / AcctSumRpt						(n times)
1699	AccountSummaryReportID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Account Summary Report
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 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 101 = Collateral Account	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
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	PayCollect Market SegmentID	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*	StipulationType	Typ	N	CMGRP	String	"CMGRP"
→234*	StipulationValue	Val	N		String	Grupo de movimiento de efectivo asociado al Agente de Pagos

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CCASHMOVCC / AcctSumRpt						
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 Si PartyRole[452]=101, contiene la Cuenta de Colateral
→447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→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	PayCollect Market SegmentID	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
CCASHMOVCC /AcctSumRpt/ PayCol/ Stip*						
→ 233*	StipulationType	Typ	N	CMGRP	String	"CMGRP"
→ 234*	StipulationValue	Val	N		String	Grupo de movimiento de efectivo asociado al Agente de Pagos

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CREQMARGM / AcctSumRpt						
1699	Account Summary ReportID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Account Summary Report
715	Clearing BusinessDate	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 /AcctSum Rpt/ MgnAmt						Importes de Garantía (n times)
→1645	MarginAmt	Amt	N		Amt	Importe Garantía
→1714	Margin AmountMarket SegmentID	MktSegID	N	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de Segmento de la ECC
→1715	Margin Amount MarketID	MktID	N	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CREQMARGM /AcctSumRpt/ Pty						(n times)
→448	PartyID	ID	N		String	<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	
→452	PartyRole	R	N	15 = Margin Firm 4 = Clearing Firm 100 = Margin Account	Int	<p>Indica el rol que toma el código especificado en PartyID</p> <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>

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CREQMARGMCCP / AcctSumRpt						
1699	Account Summary ReportID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Account Summary Report
715	Clearing BusinessDate	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	MarginAmount MarketID	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 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
→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

12. Resultados a nivel de Miembro Compensador

12.1 Garantías requeridas al Miembro Compensador a nivel de Contrapartida Central

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CMARGINSCLM / AcctSumRpt						(n times)
1699	AccountSummaryReportID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Account Summary Report
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716	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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
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	Required Margin Type.
→1714	Margin AmountMarket SegmentID	MktSegID	N	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	CCP segment code
→1715	Margin Amount MarketID	MktID	N	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	CCP code
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.

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
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	N	Ver Tabla 12 del documento "Tablas de Codificación"	String	Tipo de Garantía Depositada. Si no se incluye, el bloque informa del importe total.
→1704	CurrentCollateralAmount	Amt	S		Amt	Importe de la Garantía Depositada
→2093	CollateralAmountMarketID	MktID	N	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
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	<p>Si StipulationType=CLME: Total del valor efectivo depositado como colateral en la cuenta de colateral buffer del Compensador.</p> <p>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.</p> <p>Si StipulationType=CAIE: Total del valor efectivo depositado como colateral cuentas de colateral que cubren garantías Individuales o Extraordinarias.</p>
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
→ 1713	PayCollect MarketID	MktID	N	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC
CMARGINSCLM /AcctSumRpt/ PayCol/ Stip*						Desglose de movimientos de efectivo (n times)
→ 233*	StipulationType	Typ	N	CLME CADF CAIEE	String	Si StipulationType=CLME: Movimiento de efectivo de efectivo en la cuenta de colateral buffer del Compensador.
→ 234*	StipulationValue	Val	N		String	<p>Si StipulationType=CADF: Movimiento de efectivo en cuentas de colateral que ajustan automático o por déficit y cubren el Default Fund.</p> <p>Si StipulationType=CAIE: Movimiento de efectivo en cuentas de colateral que y cubren garantías Individuales o Extraordinarias</p>

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
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)
						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 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
→1530*	RiskLimitType	Typ	N		String	
→1531*	RiskLimit Amount	Amt	N		Amt	
→1714*	Margin AmountMarket SegmentID	MktSegID	N	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código del Segmento de la ECC
→1715*	Margin Amount MarketID	MktID	N	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CCASHMOVCLM / AcctSumRpt						(n times)
1699	AccountSummaryReportID	RptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Account Summary Report
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716	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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
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	
→452	PartyRole	R	N	1 = Executing Firm (CCP Member code) 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	PayCollect Market SegmentID	MktSegID	N	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de Segmento de la ECC
→1713	PayCollect MarketID	MktID	N	Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"	String	Código de la ECC
CCASHMOVCLM /AcctSumRpt/ PayCol/ Stip*						Cash movements (n times)
→233*	StipulationType	Typ	N	CMGRP	String	"CMGRP"
→234*	StipulationValue	Val	N		String	Grupo de movimiento de efectivo asociado al Agente de Pagos

13. Resultados a nivel de Agente de Pagos

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CCASHMOV TREAS / 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
CCASHMOV TREAS / 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"

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
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/ Custom code	Char	
→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	PayCollect Market SegmentID	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
CCASHMOVTREAS /AcctSumRpt/ PayCol / Stip*						
→233*	StipulationType	Typ	N	CMGRP	String	"CMGRP"
→234*	StipulationValue	Val	N		String	Grupo de movimiento de efectivo asociado al Agente de Pagos

14. Compensación e Instrucciones de Liquidación

14.1 Instrucciones a liquidar en la siguiente sesión

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CSETTLINSTNEXT / TrdCaptRpt						(n times)
1003	TradeID	TrdID	N		String	Identificador de registro de la ECC. Este campo siempre está presente en el mensaje
828	TrdType	TrdTyp	N	Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación"	Int	Tipo de Operación FIX. Este valor es usado conjuntamente con TrdSubType [829]
829	TrdSubType	TrdSubTyp	N	Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación"	Int	Este valor es usado conjuntamente con TrdType [828]
32	LastQty	LastQty	S	>= 0, sin decimales	Qty	Volumen//Nominal de títulos de la Instrucción
31	LastPx	LastPx	S		Price	Precio de la Operación. Para RF se mostrará en %

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
15	Currency	Ccy	N		Currency	Código de divisa. Expresada según estándar ISO 4217
60	TransactTime	TxnTm	N		UTCTimestamp	Fecha y hora, en formato UTC, en que se realizó la transacción
64	SettlDate	SettlDt	N		LocalMktDate	Fecha Teórica de Liquidación
381	GrossTradeAmt	GrossTrdAmt	N		Amt	Importe Efectivo de la Instrucción Puede ser negativo en función del resultado de la compensación en cuentas de Posición netas
5681*	Exchange TradeType	ExchTrdTyp	N	Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación"	String	Tipo de Operación de la ECC
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716	SettlSessID	SetSesID	N	EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
CSETTLINSTNEXT / TrdCaptRpt / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	AE	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Contiene "????"
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CSETTLINSTNEXT / TrdCaptRpt/ Instrmt						
55	Symbol	Sym	N	[N/A] o código de valor	String(5)	
48	SecurityID	ID	N		String(12)	Código ISIN
22	SecurityID Source	Src	N	4 = ISIN number	String	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CSETTLINSTNEXT /TrdCaptRpt/ RptSide						(1 time) Siempre 1 ya que sólo se incluye la parte compradora o vendedora, según corresponda al destinatario del mensaje
→ 54	Side	Side	S	1 = Buy 2 = Sell	Char	Signo de la posición de Valores
→ 77	PositionEffect	PosEfct	N	"0" = Open "		
CSETTLINSTNEXT /TrdCaptRpt/ RptSide/ Pty						(n times)
→→448	PartyID	ID	N		String	Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV Si PartyRole[452]=38, contiene la Cuenta de posición Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación
→→447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	
→→452	PartyRole	R	N	1 = Executing Firm 4 = Clearing Firm 10 = CSD Code 38 = Position Account 90 = Settlement Firm 91 = Settlement Account	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
CSETTLINSTNEXT /TrdCaptRpt/ RptSide/ Stip						(n times)
→→233	StipulationType	Typ	N	CLIQ ILIQDCV TINST	String	

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

14.2 Nuevas Instrucciones generadas por liberación

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CSETTLINSTREL /TrdCaptRpt/ Instrmt						
55	Symbol	Sym	N	[N/A] o código de valor	String(5)	
48	SecurityID	ID	N		String(12)	Código ISIN
22	SecurityID Source	Src	N	4 = ISIN number	String	
CSETTLINSTREL /TrdCaptRpt/ RptSide						(1 time) Siempre 1 ya que sólo se incluye la parte compradora o vendedora, según corresponda al destinatario del mensaje.
→54	Side	Side	S	1 = Buy 2 = Sell	Char	Signo de la posición de Valores
→77	PositionEffect	PosEfct	N	"0" = Open		
CSETTLINSTREL /TrdCaptRpt/ RptSide/ Pty						(n times)
→→448	PartyID	ID	N		String	Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV Si PartyRole[452]=38, contiene la cuenta de posición Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación
→→447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→→452	PartyRole	R	N	1 = Executing Firm 4 = Clearing Firm 10 = CSD Code 38 = Position Account 90 = Settlement Firm 91 = Settlement Account	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID.
CSETTLINSTREL /TrdCaptRpt/ RptSide/ Stip						(n times)
→→233	StipulationType	Typ	N	CLIQ ILIQDCV TINST	String	
→→234	StipulationValue	Val	N		String	<p>Para Instrucciones de Liquidación:</p> <ul style="list-style-type: none"> •Si StipulationType [233] = CLIQ, contiene el número de la ventana de agregación en la que se envía la Instrucción a liquidar •Si StipulationType [233] = ILIQDCV, contiene el identificador de la Instrucción Liquidación en el DCV •Si StipulationType [233] = TINST, contiene el Tipo Instrucción: <p>*RVP = Recepción contra pago</p>

14.3 Detalle de Operaciones de cada Instrucción de Liquidación

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

TAG	NOMBRE FIX	NOMBRE FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CSETTLINSTDET / RgstInstrctns						(n times)
513	RegistID	ID	S		String (30)	Identificador único para cada mensaje Registration Instructions
514	RegistTrans Type	TransTyp	S	0 = New	Char	
1003*	TradeID	TrdID	N		String	Identificador de registro en la ECC de la Instrucción de Liquidación
828*	TrdType	TrdTyp	N	Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación"	Int	Tipo de Operación FIX de la Instrucción de Liquidación. Este valor es usado conjuntamente con TrdSubType [829]
829*	TrdSubType	TrdSubTyp	N	Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación"	Int	Este valor es usado conjuntamente con TrdType [828]
5681*	Exchange TradeType	ExchTrdTyp	N	Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación"	String	Tipo de Operación de la ECC de la Instrucción de Liquidación
54*	Side	Side	N	1 = Buy 2 = Sell	Char	Signo de la posición de los valores
32*	LastQty	LastQty	S	>= 0, sin decimales	Qty	Volumen/Nominal de la Instrucción de Liquidación
381*	GrossTradeAmt	GrossTrdAmt	N		Amt	Importe Efectivo de la Instrucción de Liquidación Puede ser negativo en función del resultado de la compensación en cuentas de Posición netas
64*	SettlDate	SettlDt	N		LocalMktDate	Fecha Teórica de Liquidación
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716*	SettlSessID	SetSesID	N	ITD = Intradía EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
CSETTLINSTDET / RgstInstrctns / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	o	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Contiene "????"

TAG	NOMBRE FIX	NOMBRE FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CSETTLINSTDET /RgstInstrctns / Pty						(n times)
→448	PartyID	ID	S*		String	Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC Si PartyRole[452]=38, contiene la cuenta de posición Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación
→ 447	PartyIDSource	Src	S	D = Proprietary / Custom code	String	
→452	PartyRole	R	S	1 = Executing Firm 4 = Clearing Firm 38 = Position Account 90 = Settlement Firm 91 = Settlement account	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
CSETTLINSTDET /RgstInstrctns/ Pty/ Sub						(1 time)
→→523	PartySubID	ID	S*	TRD = Información de detalle de una Operación	String	
→→803	PartySubIDType	Typ	S		Int	Este campo es requerido por el estándar.
CSETTLINSTDET /RgstInstrctns/ Instrmt*						
55*	Symbol	Sym	N	[N/A] o código de valor	String(5)	
48*	SecurityID	ID	N		String(12)	Código ISIN

TAG	NOMBRE FIX	NOMBRE FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
22*	SecurityID Source	Src	N	4 = ISIN number	String	
CSETTLINSTDET /RgstInstrctns/ Stip*						(n times)
→233*	StipulationType	Typ	N	CLIQ TINST	String	
						<p>Si StipulationType [233] = CLIQ, contiene el número de la ventana de agregación en la que se envía la Instrucción a liquidar</p> <p>Si StipulationType [233] = TINST, contiene el tipo de la Instrucción de Liquidación:</p> <ul style="list-style-type: none"> •DVP = Entrega contra pago •RVP = Recepción contra pago •DWP = Entrega con pago •DFP = Entrega libre de pago •RFP = Recepción libre de pago •PWD = Pago / cobro sin entrega de Valores •ROC = Instrucciones de pago sin entrega con efectivo cero •RWP = Recepción con pago
→ 234*	StipulationValue	Val	N		String	
CSETTLINSTDET /RgstInstrctns/ ReltdTrd *						(n times)
→1856*	RelatedTradeID	ID	N		String	Identificador de registro en la ECC de la Operación incluida en la Instrucción de Liquidación
CSETTLINSTDET /RgstInstrctns/ ReltdTrd*/ Stip*						(n times)
→233*	StipulationType	Typ	N	TRTYP TRSUBT EXTT SIDE LASTQ GRTA	String	

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

15. Información de Liquidaciones y Fallidos

15.1 Instrucciones liquidadas en la sesión

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CSETTLEDINST / TrdCaptRpt						(n times)
1003	TradeID	TrdID	N		String	Identificador de registro de la ECC. Este campo siempre está presente en el mensaje
828	TrdType	TrdTyp	N	Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación"	Int	Tipo de Operación FIX. Este valor es usado conjuntamente con TrdSubType [829]
829	TrdSubType	TrdSubTyp	N	Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación"	Int	Este valor es usado conjuntamente con TrdType [829]
32	LastQty	LastQty	S	>= 0, sin decimales	Qty	Volumen//Nominal de la Instrucción
151*	LeavesQty	LeavesQty	N		Qty	Volumen / Nominal vivo de la Instrucción

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
31	LastPx	LastPx	S		Price	Precio medio de la Instrucción Para RF se mostrará en %
15	Currency	Ccy	N		Currency	Código de divisa. Expresada según estándar ISO 4217
60	TransactTime	TxnTm	N		UTCTimestamp	Fecha y hora, en formato UTC, en que se realizó la transacción.
64	SettlDate	SettlDt	N		LocalMktDate	Fecha Teórica de Liquidación
381	GrossTradeAmt	GrossTrdAmt	N		Amt	Importe Efectivo de la Instrucción En caso de compraventas, puede ser negativo en función del resultado de la compensación en cuentas de Posición netas
5681*	Exchange TradeType	ExchTrdTyp	N	Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación"	String	Tipo de Operación de la ECC
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716	SettlSessID	SetSesID	N	ITD = Intradía EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
CSETTLEDINST / TrdCaptRpt / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	AE	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Contiene "????"
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CSETTLEDINST / TrdCaptRpt/ Instrmt						
55	Symbol	Sym	N	[N/A] o código de valor	String(5)	
48	SecurityID	ID	N		String(12)	Código ISIN
22	SecurityID Source	Src	N	4 = ISIN number	String	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CSETTLEDINST /TrdCaptRpt/ Amt						(n times)
→708	PosAmt	Amt	N		Amt	
→1585	PosAmtReason	Rsn	N	1000 = Importe Efectivo vivo de la Operación	Int	Es el importe efectivo pendiente de liquidar en caso de liquidación parcial
CSETTLEDINST /TrdCaptRpt/ RptSide						(1 time) Siempre 1 ya que sólo se incluye la parte compradora o vendedora, según corresponda al destinatario del mensaje
→54	Side	Side	S	1 = Buy 2 = Sell	Char	Signo de la posición de Valores
→77	PositionEffect	PosEfct	N	"0" = Open		
CSETTLEDINST /TrdCaptRpt/ RptSide/ Pty						(n times)
→→448	PartyID	ID	N		String	Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV Si PartyRole[452]=38, contiene la Cuenta de Posición Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación
→→447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	
→→452	PartyRole	R	N	1 = Executing Firm 4 = Clearing Firm 10 = CSD Code 38 = Position Account 90 = Settlement Firm 91 = Settlement Account	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
CSETTLEDINST /TrdCaptRpt/ RptSide/ Stip						(n times)

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→→ 233	StipulationType	Typ	N	CLIQ ILIQDCV TINST ICORPDCV	String	<p>Para Instrucciones de Liquidación:</p> <ul style="list-style-type: none"> •Si StipulationType [233] = CLIQ, contiene el número de la ventana de agregación en la que se envía la Instrucción a liquidar •Si StipulationType [233] = ILIQDCV, contiene el identificador de la Instrucción Liquidación en el DCV •Si StipulationType [233] = TINST, contiene el Tipo Instrucción: <p>*DVP = Entrega contra pago *RVP = Recepción contra pago *DWP = Entrega con pago *DFP = Entrega libre de pago *RFP = Recepción libre de pago *PWD = Pago / cobro sin entrega de Valores *ROC = Instrucciones de pago sin entrega con efectivo cero *RWP = Recepción con pago</p> <p>Para Eventos Corporativos:</p> <ul style="list-style-type: none"> •Si StipulationType [233] = ICORPDCV, contiene el identificador del Evento en el DCV
→→234	StipulationValue	Val	N		String	

15.2 Instrucciones pendientes de liquidar

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

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CPENDINGINST / TrdCaptRpt / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	AE	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Contiene "????"
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CPENDINGINST / TrdCaptRpt/ Instrmt						
55	Symbol	Sym	N	[N/A] o código de valor	String(5)	
48	SecurityID	ID	N		String(12)	Código ISIN
22	SecurityID Source	Src	N	4 = ISIN number	String	
CPENDINGINST / TrdCaptRpt/ Amt						(n times)
→708	PosAmt	Amt	N		Amt	
→1585	PosAmtReason	Rsn	N	1000 = Importe Efectivo vivo de la Operación	Int	Es el importe efectivo pendiente de liquidar total o parcialmente
CPENDINGINST / TrdCaptRpt/ RptSide						(1 time)
						Siempre 1 ya que sólo se incluye la parte compradora o vendedora, según corresponda al destinatario del mensaje
→ 54	Side	Side	S	1 = Buy 2 = Sell	Char	Signo de la posición de Valores
→77	PositionEffect	PosEfct	N	"0" = Open		

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CPENDINGINST /TrdCaptRpt/ RptSide/ Pty						(n times)
→→448	PartyID	ID	N		String	Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV Si PartyRole[452]=38, contiene la cuenta de Posición Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación
→→447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	
→→452	PartyRole	R	N	1 = Executing Firm 4 = Clearing Firm 10 = CSD Code 38 = Position Account 90 = Settlement Firm 91 = Settlement Account	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
CPENDINGINST /TrdCaptRpt/ RptSide/ Stip						(n times)
→→233	StipulationType	Typ	N	CLIQ ILIQDCV TINST ICORPDCV BUYIND NDAYSLS	String	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→→ 234	StipulationValue	Val	N		String	<p>Para Instrucciones de Liquidación:</p> <ul style="list-style-type: none"> •Si StipulationType [233] = CLIQ, contiene el número de la ventana de agregación en la que se envía la Instrucción a liquidar •Si StipulationType [233] = ILIQDCV, contiene el identificador de la Instrucción Liquidación en el DCV •Si StipulationType [233] = TINST, contiene el Tipo Instrucción: <ul style="list-style-type: none"> *DVP = Entrega contra pago *RVP = Recepción contra pago *DWP = Entrega con pago *DFP = Entrega libre de pago *RFP = Recepción libre de pago *PWD = Pago / cobro sin entrega de Valores *ROC = Instrucciones de pago sin entrega con efectivo cero *RWP = Recepción con pago <ul style="list-style-type: none"> •Si StipulationType [233] = BUYIND, contiene la fecha de recompra •Si StipulationType [233] = NDAYSL, contiene el número de días fallida <p>Para Eventos Corporativos:</p> <ul style="list-style-type: none"> •Si StipulationType [233] = ICORPDCV, contiene el identificador del Evento en el DCV

15.3 Liquidación de Fallidos por Recompra

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CFAILBUYIN / TrdCaptRpt						(n times)
1003	TradeID	TrdID	N		String	Identificador de registro de la ECC. Este campo siempre está presente en el mensaje
828	TrdType	TrdTyp	N	Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación"	Int	Tipo de Operación FIX. Este valor es usado conjuntamente con TrdSubType [829]
829	TrdSubType	TrdSubTyp	N	Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación"	Int	Este valor es usado conjuntamente con TrdType [828]
1126	OrigTradeID	OrigTrdID	N		String	Contiene el identificador de registro de la ECC de la Instrucción fallida que liquida
32	LastQty	LastQty	S	>= 0, sin decimales	Qty	Volumen/Nominal de la Operación de Recompra
151*	LeavesQty	LeavesQty	N		Qty	Volumen/Nominal vivo de la Operación
31	LastPx	LastPx	S		Price	Precio medio de la Instrucción que liquida. Para RF se mostrará en %
15	Currency	Ccy	N		Currency	Código de divisa. Expresada según estándar ISO 4217
60	TransactTime	TxnTm	N		UTCTimestamp	Fecha y hora, en formato UTC, de la operación
64	SettlDate	SettlDt	N		LocalMktDate	Fecha Teórica de Liquidación de la operación
381	GrossTradeAmt	GrossTrdAmt	N		Amt	Importe Efectivo de la recompra
5681*	Exchange TradeType	ExchTrdTyp	N	Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación"	String	Tipo de Operación de la ECC
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716	SettlSessID	SetSesID	N	EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
CFAILBUYIN / TrdCaptRpt / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	AE	String	Identifica el tipo de mensaje

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Contiene "????"
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CFAILBUYIN /TrdCaptRpt/ Instrmt						
55	Symbol	Sym	N	[N/A] o código de valor	String(5)	
48	SecurityID	ID	N		String(12)	Código ISIN
22	SecurityID Source	Src	N	4 = ISIN number	String	
						(1 time)
CFAILBUYIN /TrdCaptRpt/ RptSide						Siempre 1 ya que sólo se incluye la parte compradora o vendedora, según corresponda al destinatario del mensaje
→ 54	Side	Side	S	1 = Buy 2 = Sell	Char	Signo de la posición de Valores
→ 77	PositionEffect	PosEfct	N	"0" = Open		
CFAILBUYIN /TrdCaptRpt/ RptSide/ Pty						(n times)
						Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC
						Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC
→→448	PartyID	ID	N		String	Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV
						Si PartyRole[452]=38, contiene la cuenta de Posición
						Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante
						Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación
→→447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→→452	PartyRole	R	N	1 = Executing Firm 4 = Clearing Firm 10 = CSD Code 38 = Position Account 90 = Settlement Firm 91 = Settlement Account	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
CFAILBUYIN /TrdCaptRpt/ RptSide/ Stip						(n times)
→→233	StipulationType	Typ	N	CLIQ ILIQDCV TINST QTYM AMTM	String	<p>Para Instrucciones de Liquidación:</p> <ul style="list-style-type: none"> •Si StipulationType [233] = CLIQ, contiene el número de la ventana de agregación en la que se envía la Instrucción a liquidar •Si StipulationType [233] = ILIQDCV, contiene el identificador de la Instrucción Liquidación en el DCV •Si StipulationType [233] = TINST, contiene el Tipo Instrucción:
→→234	StipulationValue	Val	N		String	<ul style="list-style-type: none"> *DVP = Entrega contra pago *RVP = Recepción contra pago *PWD = Pago / cobro sin entrega de Valores •Si StipulationType [233] = QTYM, contiene el número de Valores / Nominal de la Instrucción fallida que liquida •Si StipulationType [233] = AMTM, contiene el importe efectivo de la Instrucción fallida que liquida

15.4 Liquidación de Fallidos en Efectivo

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMAT	DESCRIPTION
CFAILCASHSETTL / TrdCaptRpt						(n times)
1003	TradeID	TrdID	N		String	Identificador de registro de la ECC. Este campo siempre está presente en el mensaje
828	TrdType	TrdTyp	N	Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación"	Int	Tipo de Operación FIX. Este valor es usado conjuntamente con TrdSubType [829]
829	TrdSubType	TrdSubTyp	N	Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación"	Int	Este valor es usado conjuntamente con TrdType [828]
1126	OrigTradeID	OrigTrdID	N		String	Contiene el identificador de registro de la ECC de la Instrucción que liquida
32	LastQty	LastQty	S	>= 0, sin decimales	Qty	Volumen/Nominal de la Operación
31	LastPx	LastPx	S		Price	Precio para el cálculo de la compensación. Para RF se mostrará en %
15	Currency	Ccy	N		Currency	Código de divisa. Expresada según estándar ISO 4217
60	TransactTime	TxnTm	N		UTCTimestamp	Fecha y hora, en formato UTC, en que se realizó la transacción.
64	SettlDate	SettlDt	N		LocalMktDate	Fecha de liquidación del efectivo

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMAT	DESCRIPTION
381	GrossTradeAmt	GrossTrdAmt	N		Amt	Importe compensación en efectivo
5681*	Exchange TradeType	ExchTrdTyp	N	Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación"	String	Tipo de Operación de la ECC
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716	SettlSessID	SetSesID	N	EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
CFAILCASHSETTL / TrdCaptRpt / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	AE	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Contiene "????"
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CFAILCASHSETTL / TrdCaptRpt / Instrmt						
55	Symbol	Sym	N	[N/A] o código de valor	String(5)	
48	SecurityID	ID	N		String(12)	Código ISIN
22	SecurityID Source	Src	N	4 = ISIN number	String	
						(1 time)
CFAILCASHSETTL / TrdCaptRpt / RptSide						Siempre 1 ya que sólo se incluye la parte compradora o vendedora, según corresponda al destinatario del mensaje.
→ 54	Side	Side	S	1 = Buy 2 = Sell	Char	Si es 1 es efectivo a pagar y si es 2 es efectivo a recibir
→ 77	PositionEffect	PosEfct	N	"0" = Open		
CFAILCASHSETTL / TrdCaptRpt / RptSide / Pty						(n times)

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMAT	DESCRIPTION
→→448	PartyID	ID	N		String	<p>Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC</p> <p>Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC</p> <p>Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV</p> <p>Si PartyRole[452]=38, contiene la cuenta de Posición</p> <p>Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante</p> <p>Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación</p>
→→447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	
→→452	PartyRole	R	N	1 = Executing Firm 4 = Clearing Firm 10 = CSD Code 38 = Position Account 90 = Settlement Firm 91 = Settlement Account	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
CFAILCASHSETTL /TrdCaptRpt/ RptSide/ Stip						(n times)
→→233	StipulationType	Typ	N	CLIQ ILIQDCV TINST QTYM AMTM	String	

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMAT	DESCRIPTION
→→234	StipulationValue	Val	N		String	Para Instrucciones de Liquidación: •Si StipulationType [233] = CLIQ, contiene el número de la ventana de agregación en la que se envía la Instrucción a liquidar •Si StipulationType [233] = ILIQDCV, contiene el identificador de la Instrucción Liquidación en el DCV •Si StipulationType [233] = TINST, contiene el Tipo Instrucción: *PWD = Pago / cobro sin entrega de Valores •Si StipulationType [233] = QTYM, contiene el número de Valores / Nominal de la Instrucción fallida que liquida •Si StipulationType [233] = AMTM, contiene el importe efectivo de la Instrucción fallida que liquida

15.5 Penalizaciones DCV

CFAILPENALTIES.sc	
Grupo	Información de Liquidaciones y Fallidos
Descripción	Información mensual de las penalizaciones resultantes de los Fallidos de liquidación del segmento de RV y RF recibidas del DCV
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador, Entidad Participante
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CFAILPENALTIES / TrdCaptRpt						(n times)
1003	TradeID	TrdID	N		String	Campo no incluido
1126	OrigTradeID	OrigTrdID	N		String	Campo no incluido

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
32	LastQty	LastQty	N	>= 0, sin decimales	Qty	Campo no incluido
151*	LeavesQty	LeavesQty	N		Qty	Campo no incluido
31	LastPx	LastPx	N		Price	Campo no incluido
15	Currency	Ccy	N		Currency	Código de divisa. Expresada según estándar ISO 4217
64	SettlDate	SettlDt	N		LocalMktDate	Fecha del último día del mes de cómputo de penalizaciones
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716	SettlSessID	SetSesID	N	EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión
CFAILPENALTIES / TrdCaptRpt / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	AE	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Contiene "????"
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CFAILPENALTIES / TrdCaptRpt / Instrmt						
55	Symbol	Sym	N	[N/A] o código de valor	String(5)	Campo no incluido
48	SecurityID	ID	N		String(12)	Campo no incluido
22	SecurityID Source	Src	N	4 = ISIN number	String	Campo no incluido
CFAILPENALTIES / TrdCaptRpt / Amt						
→ 2097	PositionFXR ate	FxRt	N		Float	Campo no incluido
→ 708	PosAmt	Amt	N		Amt	Importe penalización: Si es positivo = abono Si es negativo = cargo
→ 1585	PosAmtReason	Rsn	N	2002	Int	2002 = penalización mensual DCV

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

15.6 Comisiones por fallidos

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CFAILFEES/ TrdCaptRpt						(n times)
1003	TradeID	TrdID	N		String	Identificador de registro de la ECC.
1126	OrigTradeID	OrigTrdID	N		String	Contiene el identificador de registro de la ECC de la Instrucción que liquida
32	LastQty	LastQty	N	>= 0, sin decimales	Qty	Volumen/Nominal de la Operación
151*	LeavesQty	LeavesQty	N		Qty	Volumen/Nominal al que aplica la penalización.
31	LastPx	LastPx	S		Price	Precio para el cálculo de la compensación. Para RF se mostrará en %
15	Currency	Ccy	N		Currency	Código de divisa. Expresada según estándar ISO 4217
64	SettlDate	SettlDt	N		LocalMktDate	Fecha Teórica de Liquidación
715	ClearingBusinessDate	BizDt	S		LocalMktDate	Fecha de la sesión
716	SettlSessID	SetSesID	N	EOD = Fin de sesión	String	Indica si es un fichero intradía o de final de sesión

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CFAILFEES / TrdCaptRpt / Hdr						
35	MsgType	MsgTyp	S	AE	String	Identifica el tipo de mensaje
49	SenderCompID	SID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje Contiene "BMCL"
56	TargetCompID	TID	S		String	Contiene "????"
50	SenderSubID	SSub	S*	Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el código de Segmento de la ECC
52	SendingTime	Snt	S		UTC Timestamp	Hora de generación del fichero
CFAILFEES / TrdCaptRpt / Instrmt						
55	Symbol	Sym	N	[N/A] o código de valor	String(5)	
48	SecurityID	ID	N		String(12)	Código ISIN
22	SecurityID Source	Src	N	4 = ISIN number	String	
CFAILFEES / TrdCaptRpt / Amt						
→ 2097	PositionFXR ate	FxRt	N		Float	Porcentaje aplicable en la penalización diaria
→ 708	PosAmt	Amt	N		Amt	Importe
→ 1585	PosAmtReason	Rsn	N	2001 2003	Int	2001 = coste administrativo por recompra o liquidación en efectivo 2003 = coste administrativo por fallido
						(1 time)
CFAILFEES / TrdCaptRpt / RptSide						
						Siempre 1 ya que sólo se incluye la parte compradora o vendedora, según corresponda al destinatario del mensaje
→ 54	Side	Side	N	1 = Buy 2 = Sell	Char	Signo de la Operación
CFAILFEES / TrdCaptRpt / RptSide / Pty						(n times)

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
→→448	PartyID	ID	N		String	<p>Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC</p> <p>Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC</p> <p>Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV</p> <p>Si PartyRole[452]=38, contiene la cuenta de Posición</p> <p>Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante</p> <p>Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación</p>
→→447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	
→→452	PartyRole	R	N	<p>1 = Executing Firm</p> <p>4 = Clearing Firm</p> <p>10 = CSD Code</p> <p>38 = Position Account</p> <p>90 = Settlement Firm</p> <p>91 = Settlement account</p>	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID

16. Información de Eventos

16.1 Instrucciones generadas sobre Fallidos por Eventos Corporativos

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
CFAILSADJUST / TrdCaptRpt						(n times)
1003	TradeID	TrdID	N		String	Identificador de registro de la ECC. Este campo siempre está presente en el mensaje
828	TrdType	TrdTyp	N	Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación"	Int	Tipo de Operación FIX. Este valor es usado conjuntamente con TrdSubType [829]
829	TrdSubType	TrdSubTyp	N	Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación"	Int	Este valor es usado conjuntamente con TrdType [828]
1126	OrigTradeID	OrigTrdID	N		String	Este campo contiene el identificador de registro de la ECC de la Instrucción fallida que cancela
32	LastQty	LastQty	S	>= 0, sin decimales	Qty	Volumen/Nominal de la Operación

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

TAG	NOMBRE	FIXML	REQ	VALORES VÁLIDOS	FORMATO	DESCRIPCIÓN
						(1 time)
						CFAILSADJUST /TrdCaptRpt/ RptSide
						Siempre 1 ya que sólo se incluye la parte compradora o vendedora, según corresponda al destinatario del mensaje
→54	Side	Side	S	1 = Buy 2 = Sell	Char	Signo de la posición de Valores
→77	PositionEffect	PosEfct	N	"O" = Open "C" = Close		Indica si la Operación abre o cierra posición
						CFAILSADJUST /TrdCaptRpt/ RptSide/ Pty
						(n times)
→→448	PartyID	ID	N		String	Si PartyRole[452]=1, contiene el código del Miembro de la ECC Si PartyRole[452]=4, contiene el código del Miembro Compensador de la ECC Si PartyRole[452]=10, contiene el código del DCV Si PartyRole[452]=38, contiene la Cuenta de Posición Si PartyRole[452]=90, contiene el código de la Entidad Participante Si PartyRole[452]=91, contiene el código de la Cuenta de Liquidación
→→447	PartyIDSource	Src	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	
→→452	PartyRole	R	N	1 = Executing Firm 4 = Clearing Firm 10 = CSD Code 38 = Position Account 90 = Settlement Firm 91 = Settlement Account	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID
						CFAILSADJUST /TrdCaptRpt/ RptSide/ Stip
						(n times)
→→233	StipulationType	Typ	N	ICORPDCV QTYM AMTM	String	
→→234	Stipulation Value	Val	N		String	•Si StipulationType [233] = ICORPDCV, contiene el identificador del Evento en el DCV

Apéndice A Información adicional

A.1 Campos de Usuario

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

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

BME

Bolsas y Mercados Españoles
Plaza de la Lealtad, 1
Palacio de la Bolsa
28014 Madrid

www.bolsasymercados.es

This material has been prepared by Bolsas y Mercados Españoles, Sociedad Holding de Mercados y Sistemas Financieros S. A. (BME) and/or its subsidiaries (collectively, "BME", all of the foregoing entities belonging to the group headed by SIX Group Ltd., hereinafter "SIX Group") for the exclusive use of the persons to whom BME delivers this material. This material or any of its contents should not be construed as a binding agreement, recommendation, investment advice, solicitation, invitation or offer to buy or sell any financial information, products, solutions or services. Nor is this information a reflection of the firm positions (of its own or of third parties) of the participants in the Spanish Stock Market.

Neither BME nor SIX Group is under any obligation to update, revise or keep current the content of this material, and it is subject to change without notice at any time. No representation, warranty or undertaking - express or implied - is or will be given by BME or SIX Group as to the accuracy, completeness, adequacy, suitability or reliability of the content of this material. Neither BME nor SIX guarantee the legality, reliability, usefulness, truthfulness, accuracy, completeness and timeliness of the information provided by external sources, particularly in the data used throughout the report. Therefore, neither BME nor SIX shall be liable for any damages that users may suffer as a result of the unlawfulness, unreliability, inaccuracy, lack of truthfulness, incompleteness and/or non-timeliness of the contents.

As it reflects theoretical opinions, its content is merely informative and therefore should not be used for the valuation of portfolios or assets, nor serve as a basis for investment recommendations. The Contributing Entities, BME and the entities belonging to the SIX Group shall not be liable for any financial loss or decision made on the basis of the information contained in this material. In general, neither BME nor any of its subsidiaries, nor the Contributing Entities, their administrators, representatives, associates, controlled companies, directors, partners, employees or advisors assume any liability in relation to such information, nor for any unauthorized use thereof.

This material is the property of BME and may not be printed, copied, reproduced, published, transmitted, disclosed or distributed in any form without the prior written consent of BME.