

Segmentos de Renta Variable y Renta Fija

Interfaz mensajes PROPIETARIO

Historia de Revisiones

FECHA	VERSIÓN	DESCRIPCIÓN	AUTOR
20 de diciembre de 2013	1.0	Versión Inicial	BME Clearing IT
4 de julio de 2014	1.1	Change request julio 2014	BME Clearing IT
21 de noviembre de 2014	1.2	Change request noviembre 2014	BME Clearing IT
23 de marzo de 2015	1.3	Change request marzo 2015	BME Clearing IT
5 de junio de 2015	1.4	Change request junio 2015	BME Clearing IT
27 de noviembre de 2015	1.5	Change request noviembre 2015	BME Clearing IT
23 de septiembre de 2016	1.6	Versión producción septiembre 2016	BME Clearing IT
24 de noviembre de 2016	1.7	Inclusion de campos a informar por el segmento de Renta Fija y cambios en Renta Variable por implantación T2S	BME Clearing IT
18 de mayo de 2017	1.8	Cambio nomenclatura: rating por solvencia. Codificación de los mensajes de Texto. Otros cambios por implantación T2S	BME Clearing IT
1 de diciembre de 2017	1.9	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 la nueva estructura de cuentas	BME Clearing IT
12 de julio de 2018	1.12	Mensajes GA02, GA03 se dan a nivel de cuenta de colateral.	BME Clearing IT
5 de noviembre de 2018	1.13	Mensaje GA01: se añade el Grupo de Movimientos de Efectivo.	BME Clearing IT
15 de marzo de 2019	1.14	Mensaje GA01: el campo Agente de Pagos no se informa, pasa a filler.	BME Clearing IT
15 de febrero de 2020	1.17	Cambios en mensajes VA y AN, para el segmento de Renta Fija.	BME Clearing IT
11 de noviembre de 2022	1.24	Cambios en mensaje GA04.	BME Clearing IT

Modificaciones realizadas en la última revisión

Principales cambios respecto a la documentación v1.17 publicada el 15 de febrero de 2020:

- Mensaje GA04: nuevos campos en bloque R00.

Índice

Historia de Revisiones	2	6.2 Límite de Riesgo Intradía y Garantías Extraordinarias	65
Modificaciones realizadas en la última revisión	2	6.3 Garantías Depositadas	65
Índice	3	6.4 Flujo de mensajes	66
1. Relación de mensajes	4	6.5 Definición de mensajes	68
2. Estructura y formatos de los mensajes	5	7. Retención y Liberación de Operaciones	79
2.1 Convenciones y terminología utilizada	5	7.1 Uso del campo Referencia de Movimiento	80
2.2 Campos no informados	7	7.2 Flujo de mensajes	81
2.3 Cabecera mensajería propietaria	7	7.3 Definición de mensajes	84
3. Seguimiento de la Operativa	12	8. Compensación e Instrucciones de Liquidación	86
3.1 Descripción	12	8.1 Flujos de mensajes	89
3.2 Identificación de operaciones en la ECC	12	8.2 Definición de mensajes	91
3.3 Flujo de mensajes	14	9. Liquidaciones y fallidos	91
3.4 Definición de mensajes	16	9.1 Liquidación de Instrucciones	91
4. Asignación de Operaciones	26	9.2 Procedimiento de Recompra (Buy-in)	92
4.1 Asignación Interna de Cuenta y Traspaso	27	9.3 Liquidación de Efectivo	92
4.2 Asignación Externa	28	9.4 Flujos de mensajes	93
4.3 Uso de Referencias en Asignación de Operaciones	34	9.5 Definición de mensajes	96
4.4 Flujo de mensajes	35	10. Eventos Corporativos	97
4.5 Definición de mensajes	43	10.1 Flujos de mensajes	97
5. Gestión de Referencias, Filtros y Configuración del Módulo de Parametrizaciones	53	10.2 Definición de mensajes	99
5.1 Gestión de Referencias de Asignación Externa por Miembro Origen	53	11. Información de Valores	99
5.2 Gestión de Referencias y Filtros de Asignación Externa por Miembro Destino	54	11.1 Flujo de mensajes	100
5.3 Gestión de Filtros de Asignación Externa por Miembro Compensador del Miembro Destino	55	11.2 Definición de mensajes	100
5.4 Configuración del Módulo de Parametrización del Miembro	55	12. Información Precios de Valores	105
5.5 Uso del campo Id. Referencia/Filtro	56	12.1 Flujo de mensajes	105
5.6 Flujo de mensajes	57	12.2 Definición de mensajes	106
5.7 Definición de mensajes	59	13. Información de Supervisión	108
6. Garantías y Movimientos de Efectivo	64	13.1 Flujo de mensajes	108
6.1 Garantías y Movimientos de Efectivo a Fin de Sesión	64	13.2 Definición de mensajes	109
		14. Información de fin de sesión	110
		14.1 Flujo de mensajes	110
		14.2 Definición de mensajes	111

1. Relación de mensajes

A continuación se muestra una tabla con la relación de mensajes definidos en este documento:

MENSAJE	DESCRIPCIÓN	FUNCIONALIDAD
AN	Anotación de operaciones en la ECC	• Seguimiento de la operativa: registro de operaciones e información de saldos vivos • Generación de Instrucciones de Liquidación • Eventos Corporativos • Actualización de datos de operaciones registradas en la ECC
MO	Gestión de movimientos entre cuentas Notificación de Retención y Liberación de Valores	• Asignación Interna de Cuenta Traspasos • Asignación Externa
AC	Aceptación, rechazo, cancelación de Asignaciones Externas	• Notificación de Retención /Liberación • Aceptación, rechazo, cancelación de Asignaciones Externas
RF	Gestión de Referencias y Filtros de Asignaciones / Gestión Módulo de Parametrización	Gestión de Referencias y Filtros de Asignaciones / Gestión Módulo de Parametrización
GA01	Garantías y Movimientos de Efectivo	Garantías y Movimiento de Efectivos
GA02	Solicitud Límite de Riesgo Intradía	
GA03	Límite de Riesgo Intradía/ Garantías Extraordinarias	
GA04	Detalle Garantías Depositadas	
OP	Gestión de operaciones	Retención/ Liberación de operaciones
VA	Información de Valores	Información de Valores
PV	Información de Precios	Información del Precio de Cierre de los Valores
TXT	Información de Supervisión	Información de Supervisión
FS	Fin de sesión	

2. Estructura y formatos de los mensajes

Todos los mensajes propietarios se componen de dos partes diferenciadas:

- Datos de Cabecera, común a todos los mensajes propietarios.
- Datos específicos del mensaje, esta parte dependerá del tipo de mensaje descrito. Por lo general, se divide en varios bloques. Cada uno de ellos tendrá a su vez un formato característico, algunos de estos bloques son opcionales, pudiendo estar informado en base a la funcionalidad del mensaje descrito.

A continuación se describirán las convenciones y terminología utilizadas en los siguientes apartados, que describen en detalle el contenido de la mensajería propietaria.

2.1 Convenciones y terminología utilizada

En cada descripción de los formatos propietarios se detalla:

- Su Estructura
 - Composición de Bloques
 - Uso de Bloques por Funcionalidad
- Su Descripción Detallada

2.1.1 Estructura

- Composición de Bloques

BLOQUE	DESCRIPCIÓN/CONTENIDO
(a)	(b)

- a) Identificativo del Bloque que compone el registro
- b) Descripción y Contenido que se informa en ese bloque

– Uso de Bloques por Funcionalidad (A) (A)

(A)	(A)	(A)	(A)	(A)	OBSERVACIONES
(c)	(d)	(d)	(d)	(d)	(e)

a) Identificativo del Bloque que compone el registro

b) Descripción y Contenido que se informa en ese bloque

c) Uso funcional del registro

d) Indica si se utiliza o no el Bloque, en el caso de utilizarse indica el número de veces que aparece para la funcionalidad soportada.

e) Observaciones complementarias al uso del registro.

2.1.2 Descripción Detallada

En este apartado se especifica de forma más detallada la definición del formato:

(1)	DESCRIPCIÓN (2)	T (3)	L (4)	E (5)	D (6)	OBSERVACIONES (7)
(8)						

(1) Número de Campo

(2) Descripción del campo, información complementaria sobre un conjunto de campos

(3) T – Tipo de campo:

a. A – Campo alfanumérico

b. N – Campo numérico

c. NS – Campo numérico con signo. El signo siempre se informa en la primera posición

(4) L – Longitud Total del campo, para lo campos numéricos incluye posiciones enteras, decimales y el signo.

(5) E – Posiciones enteras

(6) D – Posiciones decimales

(7) Observaciones complementarias sobre el campo

(8) Identificativo del campo

2.2 Campos no informados

Con el objeto de facilitar qué campos vienen informados o no, se establece el siguiente criterio: los campos no informados se rellenarán a espacios en su totalidad, independientemente de si están definidos como alfanuméricos o numéricos.

2.3 Cabecera mensajería propietaria

La Cabecera del Mensaje es común a todos los mensajes propietarios y en ella se identifica el Origen (lógico) y Destino (lógico) del mensaje, y el Miembro que comunica el mensaje o lo recibe.

Longitud de la cabecera: Fija 100

T=tipo / L=longitud / E=enteros / D=decimales

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
Datos Cabecera						
Identificación API						
1	Tipo de Registro	A	4			
2	Versión	A	2			Reservado para uso futuro. Debe ir a espacios.
3	SubAplicación	A	2			Reservado para uso futuro. Debe ir a espacios.
4	Código de Error General	A	3			A espacios en mensajes de entrada. En mensajes de salida se informará: 000 – OK Distinto de 000 - ERROR
Identificación Emisor Mensaje						
5	Origen	A	4			Identificación del Origen del mensaje En mensajes emitidos por la ECC se informa con: BMCL
6	Usuario Origen	A	3			Usuario emisor del mensaje En mensajes emitidos por la ECC se informa bien con el código de Segmento de la ECC bien con el código de la ECC (GA01, GA03 y GA04). Ver Tablas 1 y 6 en el documento "Tablas de Codificación"

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
Identificación Receptor Mensaje						
7	Destino	A	4			Identificación del Destino del mensaje En mensajes enviados a la ECC se informa con: BMCL
8	Usuario Destino	A	3			Usuario Destino del mensaje En mensajes enviados a la ECC se informa con el código de Segmento de la ECC, a excepción del mensaje GA02, en que se informa del código de la ECC (se seguirá admitiendo el código de Segmento de la ECC). Ver Tablas 1 y 6 en el documento "Tablas de Codificación"
Identificación Miembro						
9	Miembro X(4) / BIC X(11)	A	11			Identificación del Miembro para el que se emite o recibe la mensajería. En los mensajes generados por la ECC con destino a todos sus miembros, se rellenará con el carácter "?"
10	Usuario Miembro	A	3			Usuario del Miembro para el que se emite o recibe la mensajería. En los mensajes generados por la ECC con destino a todos sus miembros, se rellenará con el carácter "?"
Datos Adicionales Mensaje						
11	Fecha envío Mensaje	A	8			AAAAMMDD
12	Hora envío Mensaje	A	9			HHMMSSMMM
13	Reservado	A	44			

Cada aplicación externa (aplicación cliente) estará identificada con un código de 4 posiciones y un Usuario. Las Aplicaciones externas se conectarán a través de un Gate a las aplicaciones Host con las que interactúan.

Para mensajes generados por las aplicaciones externas, la identificación del Emisor del

mensaje vendrá dada por el código y usuario asignado por el Gate a dicha aplicación, y el receptor del mensaje (Destino y Usuario) será el definido por el Gate.

Los Miembros por los que se emiten y reciben mensajes serán asignados por las aplicaciones Host.

Por ejemplo, el Miembro ENT1-USR, emite mensajes con destino a la ECC: BMCL-C0, utilizando como origen lógico la identificación ENT1_USR:

DESCRIPCIÓN	CONTENIDO	OBSERVACIONES
Datos Cabecera		
Identificación API		
Tipo de Registro	MO	
Versión	Espacios	
SubAplicación	Espacios	
Código de Error General		A espacios en mensaje de entrada
Identificación Emisor Mensaje		
Origen	ENT1	Identificación de la entidad emisora del mensaje
Usuario	USR	Código de usuario asignado por el Gate a la Entidad Emisora del Mensaje
Identificación Receptor Mensaje		
Destino	BMCL	Identificación del Destino del mensaje: Para la ECC: ECC1
Usuario	C0	Para mensajes a la ECC, identifica el segmento de la ECC: C0
Identificación Miembro		
Miembro	ENT1	Identificación del Miembro que comunica el mensaje
Usuario	USR	Código de usuario asignado por el Gate al Miembro
Datos Adicionales Mensaje		
Fecha envío Mensaje	AAAAMMDD	Fecha emisión del mensaje informada por el Emisor

DESCRIPCIÓN	CONTENIDO	OBSERVACIONES
Hora envío Mensaje	HHMMSSMMM	Hora emisión del mensaje informada por el Emisor
Reservado		A espacios
Buffer de Datos		

El mensaje respuesta, emitido por la ECC1, sería:

DESCRIPCIÓN	CONTENIDO	OBSERVACIONES
Datos Cabecera		
Identificación API		
Tipo de Registro	MO	
Versión	Espacios	
SubAplicación	Espacios	
Código de Error General	000	
Identificación Emisor Mensaje		
Origen	BMCL	Identificación del Origen del mensaje: Emitidos por la ECC: BMCL
Usuario	C0	Para mensajes de la ECC, se identifica el segmento de la ECC: C0
Identificación Receptor Mensaje		
Destino	ENT1	Identificación de la entidad destinataria del mensaje
Usuario	USR	Código de usuario asignado por el Gate a la Entidad Emisora del Mensaje
Identificación Miembro		
Miembro	ENT1	Identificación del Miembro al que se comunica el mensaje
Usuario	USR	Código de usuario del Miembro
Datos Adicionales Mensaje		

DESCRIPCIÓN	CONTENIDO	OBSERVACIONES
Fecha envío Mensaje	AAAAMMDD	Fecha emisión del mensaje informada por el Emisor
Hora envío Mensaje	HHMMSSMMM	Hora emisión del mensaje informada por el Emisor
Filler		A espacios
Buffer de Datos		

Un único emisor podrá enviar mensajería en nombre de varios Miembros, siempre y cuando esté autorizado. Por ejemplo, si la aplicación ENT1 estuviera autorizada para emitir mensajería por cuenta de los Miembros E001, E002 y E003 (para los usuarios 001, 002 y 003 respectivamente):

IDENTIFICACIÓN EMISOR MENSAJE	IDENTIFICACIÓN RECEPTOR MENSAJE	IDENTIFICACIÓN MIEMBRO	OBSERVACIONES
ENT1-USR	BMCL-C0	E001-001	Entrada de mensajes a la ECC, para el Miembro E001
ENT1-USR	BMCL-C0	E002-002	Entrada de mensajes a la ECC, para el Miembro E002
ENT1-USR	BMCL-C0	E003-003	Entrada de mensajes a la ECC, para el Miembro E003

Las respuestas a dichos mensajes serían:

IDENTIFICACIÓN EMISOR MENSAJE	IDENTIFICACIÓN RECEPTOR MENSAJE	IDENTIFICACIÓN MIEMBRO	OBSERVACIONES
BMCL-C0	ENT1-USR	E001-001	Salida de mensajes de la ECC, para el Miembro E001
BMCL-C0	ENT1-USR	E002-002	Salida de mensajes de la ECC, para el Miembro E002
BMCL-C0	ENT1-USR	E003-003	Salida de mensajes de la ECC, para el Miembro E003

En el caso de que la ECC emitiera mensajería no solicitada para el Miembro E002, el receptor de dicho mensaje será la ENT1, que al igual que emite mensajes en nombre de varias entidades, recibirá mensajes destinados a las entidades por las que puede emitir.

3. Seguimiento de la Operativa

3.1 Descripción

La ECC proporciona información sobre el registro de operaciones y los saldos vivos en cuentas, mediante el formato AN.

Durante la sesión la ECC, comunica:

- A inicio y a fin de día, los saldos vivos en cuentas por Fecha de Negociación (sólo RV), Fecha de Liquidación y Valor
- Las operaciones que se vayan registrando en cuentas.

En la siguiente tabla se muestran los mensajes utilizados, junto con el emisor y receptor de los mismos para el seguimiento de la operativa diaria:

EMISOR	RECEPTOR	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
ECC	Miembro Miembro Compensador Entidad Participante	AN	(R00+R04)	Saldo vivo por Cuenta de Posición/Valor/ Fecha de Liquidación a Inicio de día
ECC	Miembro Miembro Compensador Entidad Participante	AN	(R00+R01+R02+[R03]) .. (R00+R01+[R03]+R05) ..	Anotaciones en Cuenta ... durante la sesión ...
ECC	Miembro Miembro Compensador Entidad Participante	AN	(R00+R04)	Saldo vivo por Cuenta de Posición/ Valor/Fecha de Liquidación/Fecha de Negociación(sólo RV) a Fin de día

3.2 Identificación de operaciones en la ECC

Cada operación estará identificada de forma única con un número de operación asignado por la ECC. El número de operación será un campo alfanumérico de 16 posiciones con la

siguiente estructura:

AAMMDDNnnnnnnnOSC

Siendo:

- **AAMMDD**. Corresponde a la fecha de anotación
- **Nnnnnnnn**. Número secuencial único por fecha de registro
- **O**. Corresponde al código de operación de la ECC (tabla 4 del documento Tablas de Codificación)
- **S**. Sentido de la operación (Compra/Venta)
- **C**. Apertura / Cierre

Adicionalmente, en el mensaje AN, se informarán de varios conceptos que permiten facilitar la reconciliación de la información y el seguimiento de operaciones, entre ellos:

- Identificación de la ejecución según el código asignado por la plataforma de negociación.
- El número de operación previa y el número de operación inicial, estos campos permiten identificar el origen y procedencia de la anotación en el registro.

3.2.1 Campo "Información adicional de la orden"

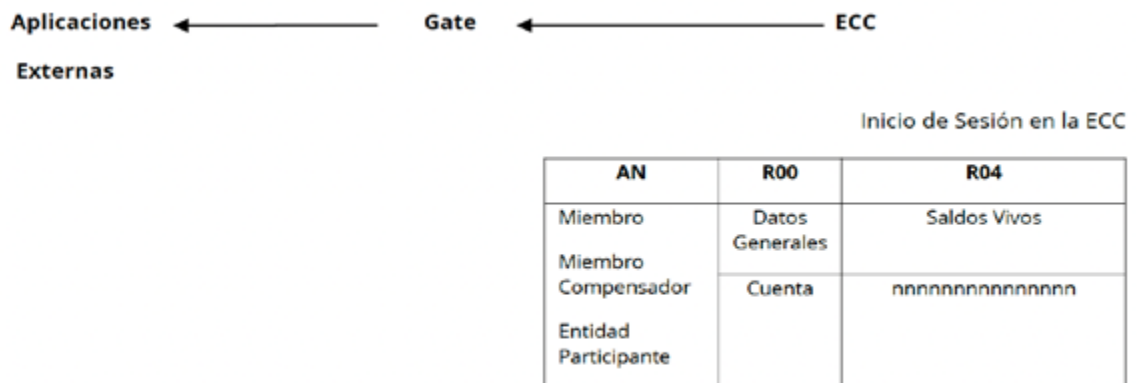
Cuando las ejecuciones procedentes de mercado llevan información de asignación interna o externa, puede suceder que dicha asignación no se pueda realizar.

En este caso, el mensaje AN contendrá información en el campo "Información adicional de la orden" (campo 60 dentro del bloque "Datos de la orden" del bloque R02):

- Si la cuenta de la ECC viene informada y no es una cuenta vigente: el campo contendrá "ERRA" + la cuenta informada en la ejecución.
- Si la cuenta no viene informada pero se indica un nemotécnico y éste no existe: el campo contendrá "ERRN" + el nemotécnico informado en la ejecución.
- Si ni la cuenta ni el nemotécnico vienen informadas pero se indica miembro destino (y referencia) y el miembro destino no existe: el campo contendrá "ERRD" + el miembro destino informado en la ejecución.

3.3 Flujo de mensajes

El flujo de mensajes para el seguimiento de la operativa en la ECC es:



Registro de Operaciones durante la sesión

AN	R00	R01	R02+[R03]
Miembro	Datos Generales	Datos Operación	Datos Negociación
Miembro Compensador	Cuenta		nnnnnnnnnnnnnnnn
Entidad Participante			

AN	R00	R01	[R03]+R05
Miembro	Datos Generales	Datos Operación	Datos Bilateral
Miembro Compensador	Cuenta		nnnnnnnnnnnnnnnn
Entidad Participante			

Fin de la Sesión en la ECC

AN	R00	R04
Miembro	Datos Generales	SalDOS Vivos
Miembro Compensador	Cuenta	nnnnnnnnnnnnnnnn
Entidad Participante		

3.4 Definición de mensajes

AN - Anotación de operaciones

AN – ANOTACIÓN DE OPERACIONES	
Descripción	Este formato se empleará para: Comunicar el registro de operaciones (según Tabla 4 del documento “Tablas de Codificación”) en Cuentas de Posición. Comunicar la actualización de operaciones registradas en la ECC. Informar de saldos vivos en las Cuentas de Posición.
Emisor	ECC
Destinatarios	Miembros, Miembros Compensadores y Entidades Participantes

El registro AN se compone de varios bloques:

BLOQUE	DESCRIPCIÓN/CONTENIDO
R00	Datos Generales, Identificación de la Cuenta de Posición
R01	Detalle registro de operaciones
R02	Datos de la Ejecución (Plataformas Multilaterales)
R03	Datos de Liquidación
R04	Saldos en Cuenta de Posición
R05	Datos de la Ejecución (Bilaterales Iberclear)

En la siguiente tabla se describe con más detalle la estructura del registro AN:

	R00	R01	R02	R03	R04	R05	OBSERVACIONES
Registro de Operaciones	1	1	0/1	0/1	0	0/1	
Actualización de Operaciones	1	1	0/1	0/1	0	0/1	
Saldos en Cuenta	1	0	0	0	n	0	Al Inicio y Fin de Sesión

Longitud del registro: Variable

T=tipo / L=longitud / E=enteros / D=decimales

	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
DATOS CABECERA						
1	Cabecera mensajería Propietaria	A	100			
Datos de Control Bloques						
2	Número de Registros R00	N	2	2		Datos Generales
3	Número de Registros R01	N	2	2		Detalle registro de operaciones
4	Número de Registros R02	N	2	2		Datos de la Ejecución (Plataformas. Multilaterales)
5	Número de Registros R03	N	2	2		Datos de Liquidación
6	Número de Registros R04	N	2	2		Saldo en Cuenta de Posición
7	Número de Registros R05	N	2	2		Datos de la Ejecución (Bilaterales Iberclear)
8	Número de Registros R06	N	2	2		No aplica
9	Número de Registros R07	N	2	2		No aplica
FIN DATOS CABECERA						
DATOS GENERALES (R00)						
10	Miembro	A	4			Miembro propietario de la cuenta
11	Cuenta de Posición	A	3			
12	Código de Valor	A	12			ISIN
13	Miembro Compensador	A	4			Compensador de la Cuenta
14	Entidad Participante BIC	A	11			Código BIC A espacios si la información está referida a la Cuenta Diaria
15	Cuenta Liquidación	A	35			A espacios si la información está referida a la Cuenta Diaria
FIN DATOS GENERALES (R00)						

DESCRIPCIÓN		T	L	E	D	OBSERVACIONES
DETALLE DE LOS DATOS DEL REGISTRO DE OPERACIONES (R01)						
16	Indicador Anotación	A	1			Indica si la ECC anota una nueva operación o bien informa de la actualización de una operación ya existente. Valores informados: 0: Nueva operación 2: Actualización de datos de una operación ya existente.
17	Número Operación	A	16			
18	Sentido (Signo de la posición de Valores)	A	1			1 (Compra) / 2 (Venta)
19	Indicador Posición	A	1			Se informa con: • 'O' Abre Posición • 'C' Cierra Posición
20	Código Operación	A	1			Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación"
21	Referencia Asignación Externa	A	18			Referencia Asignación Externa asociada a la anotación Sólo aplica al Segmento de Renta Variable A espacios cuando no aplique
22	Mnemotécnico	A	10			Mnemotécnico asignado por el Miembro origen o por el Miembro Destino en la Asignación de Cuenta Sólo aplica al Segmento de Renta Variable A espacios cuando no aplique
23	Fecha Contratación	A	8			AAAAMMDD
24	Fecha Liquidación Teórica	A	8			AAAAMMDD
25	Fecha de Registro en la ECC	A	8			AAAAMMDD
26	Hora Registro	A	9			HHMMSSMMM
27	Indicador cotización	A	1			N – Nominal U – Unidades monetarias
28	Valores/ Importe Nominal	N	18	12	6	Volumen en títulos o nominal de la operación
29	Divisa	A	3			Codificación ISO4217

	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
30	Precio	N S	14	7	6	Precio de la operación cuando sean compraventas
31	Efectivo	N S	16	13	2	Importe Efectivo de la operación Puede ser negativo en función del resultado de la compensación en cuentas netas
32	Valores/ Importe Nominal Disponibles	N	18	12	6	Volumen vivo de la Operación
33	Efectivo Disponible	N S	16	13	2	Importe Efectivo vivo de la operación
34	Valores/Importe Nominal Retenidos	N	18	12	6	Retenidos por Entidad Participante Sólo aplica al Segmento de Renta Variable
35	Efectivo Retenido	N S	16	13	2	Importe Efectivo Retenidos por Entidad Participante Sólo aplica al Segmento de Renta Variable
36	Número Operación Previa	A	16			
37	Número Operación Inicial	A	16			
38	Referencia Común	A	16			Referencia original primaria de la Operación. Si se trata de una operación de Neteo / Agregación contiene el Número de Operación de la Instrucción de Liquidación. Para el segmento de Renta Fija: Se informa de la referencia común de las operaciones que vincula la ida y vuelta del repo.
39	Corretaje	N S	16	13	2	Importe Corretaje Miembro Negociador
40	UTI de la operación	A	52			Contiene el UTI de la operación. Sólo aplica al Segmento de Renta Fija.
41	Tipo de SFT	A	1			Contiene el tipo de SFT: B: Simultánea R: Repo N: No aplica Sólo aplica al Segmento de Renta Fija.
42	Tipo de interés fijo	N S	16	9	6	Contiene el tipo de interés fijo. Sólo aplica al Segmento de Renta Fija.
DETALLE FIN DATOS DEL REGISTRO DE OPERACIONES (R01)						
DATOS EJECUCIÓN (PLATAFORMAS MULTILATERALES) (R02)						
Datos Ejecución						

	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
43	Identificación de la Plataforma	A	4			Código MIC Plataforma Negociación
44	Segmento	A	2			Segmento de negociación Ver tabla 5 del documento "Tablas de Codificación"
45	Fecha Negociación	A	8			AAAAMMDD
46	Hora Negociación	A	9			HHMMSSMMM
47	Número de Ejecución de Mercado	N	9	9		Número de ejecución asignado por la plataforma de negociación Sólo aplica al Segmento de Renta Variable
48	Código de Operación Mercado	A	2			Codificación de tipos de operación de la Plataforma de negociación
49	Miembro Mercado	A	4			Identificación del Miembro Mercado
50	Indicador cotización	A	1			N – Nominal U – Unidades monetarias
51	Código de Valor	A	12			ISIN
52	Sentido	A	1			1 (Compra) / 2 (Venta)
53	Valores / Importe Nominal	N	18	12	6	Número de Valores / Importe Nominal de la ejecución
54	Precio	N	13	7	6	Precio de la ejecución
55	Importe Efectivo	N	15	13	2	Importe Efectivo de la ejecución
Datos de la Orden						Sólo aplica al Segmento de Renta Variable
56	Fecha de la Orden de Mercado	A	8			AAAAMMDD
57	Hora de la Orden de Mercado	A	9			HHMMSSCCC
58	Número de la Orden de Mercado	N	9	9		
59	Usuario	A	3			Usuario de la Plataforma
60	Referencia de Cliente	A	16			
61	Referencia Externa	A	15			

DESCRIPCIÓN		T	L	E	D	OBSERVACIONES
						Valores informados: Antes de MIFID-II: 1: Ajena 3: Propia 7: Especialista A partir de MIFID-II: 1 – AOTC 3 – MTCH 4 – DEAL
62	Indicador Capacidad	A	1		3	
63	Información Adicional de la Orden	A	80			Información adicional sobre la orden de mercado
FIN DATOS EJECUCIÓN (PLATAFORMAS MULTILATERALES) (R02)						
DATOS DE LIQUIDACIÓN (R03)						
64	Código DCV	A	11		BIC11	
65	Ciclo Liquidación	A	4			
66	Número Operación DCV	A	35			Identificativo de Instrucción de Liquidación asignado por el DCV
						Valores informados: 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 ROC = Instrucciones de pago sin entrega con efectivo cero RWP = Recepción con pago
67	Tipo Instrucción Liquidación	A	4			
68	Referencia Evento Corporativo	A	35			Referencia evento corporativo asignada por el DCV Si la instrucción no se genera por un Evento se informa a espacios
FIN DATOS INSTRUCCIÓN DE LIQUIDACIÓN (R03)						
DATOS SALDOS EN CUENTA (R04)						

	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
69	Fecha Contratación	A	8			AAAAMMDD Sólo aplica al Segmento de Renta Variable.
70	Fecha Liquidación	A	8			AAAAMMDD
71	Tipo Saldo	A	3			Identifica el estado de la sesión: ITD=Saldo vivo intradía. El valor ITD se refiere al inicio de la sesión EOD=Saldo vivo a Fin de Sesión
72	Divisa	A	3			Código de divisa Expresada según estándar ISO 4217
73	Indicador cotización	A	1			N – Nominal U – Unidades monetarias
74	Saldo Neto Comprador Valores/ Nominal	N	18	12	6	Pendiente Liquidar para cada fecha
75	Efectivo del Saldo Neto Comprador de Valores	N S	16	13	2	Pendiente Liquidar para cada fecha
76	Saldo Neto Vendedor Valores/ Nominal	N	18	12	6	Pendiente Liquidar para cada fecha
77	Efectivo del Saldo Neto Vendedor de Valores	N S	16	13	2	Pendiente Liquidar para cada fecha
78	Saldo Bruto Comprador Valores/Nominal	N	18	12	6	Pendiente Liquidar para cada fecha. Sólo aplica al Segmento de Renta Variable.
79	Efectivo del Saldo Bruto Comprador de Valores	N S	16	13	2	Pendiente Liquidar para cada fecha Sólo aplica al Segmento de Renta Variable.
80	Saldo Bruto Vendedor Valores/ Nominal	N	18	12	6	Pendiente Liquidar para cada fecha Sólo aplica al Segmento de Renta Variable.
81	Efectivo del Saldo Bruto Vendedor de Valores	N S	16	13	2	Pendiente Liquidar para cada fecha Sólo aplica al Segmento de Renta Variable.
82	Valores/Nominal Retenido	N	18	12	6	Total de Valores retenidos por la Entidad Participante Sólo aplica al Segmento de Renta Variable.
83	Importe Efectivo Retenido	N S	16	13	2	Importe Efectivo de Valores retenidos por la Entidad Participante Sólo aplica al Segmento de Renta Variable.
84	Saldo Fallido Vendedor Valores/nominal	N	18	12	6	Pendiente Liquidar para cada fecha
85	Efectivo del Saldo Fallido Vendedor	N S	16	13	2	Pendiente Liquidar para cada fecha

	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
86	Saldo Fallido Comprador Valores/nominal	N	18	12	6	Pendiente Liquidar para cada fecha
87	Efectivo del Saldo Fallido Comprador	N S	16	13	2	Pendiente Liquidar para cada fecha
88	Saldo Prestamista Valores/ Nominal	N	18	12	6	Este campo no se informa
89	Efectivo del colateral del Saldo Prestamista	N S	16	13	2	Este campo no se informa
90	Saldo Prestatario Valores/ Nominal	N	18	12	6	Este campo no se informa
91	Efectivo del colateral del Saldo Prestatario	N S	16	13	2	Este campo no se informa
92	Recepción de Valores/Nominal por Ajustes	N	18	12	6	Posición por Ajustes de Eventos
93	Efectivo de la recepción de Valores/Nominal por Ajustes	N S	16	13	2	Posición por Ajustes de Eventos
94	Entrega de Valores/Nominal por Ajustes	N	18	12	6	Posición por Ajustes de Eventos
95	Efectivo de la entrega de Valores/Nominal por Ajustes	N S	16	13	2	Posición por Ajustes de Eventos
96	Efectivo pendiente de liquidar	N S	16	13	2	Posición de efectivo pendiente de liquidar
97	Saldo Vendedor operaciones especiales. Valores/Nominal	N	18	12	6	Posición referida a operaciones especiales con fecha contratación igual a la fecha sesión Sólo aplica al Segmento de Renta Variable.
98	Efectivo operaciones especiales Vendedor	N S	16	13	2	Posición referida a operaciones especiales con fecha contratación igual a la fecha sesión Sólo aplica al Segmento de Renta Variable.
99	Saldo Comprador operaciones especiales. Valores/Nominal	N	18	12	6	Posición referida a operaciones especiales con fecha contratación igual a la fecha sesión Sólo aplica al Segmento de Renta Variable.
100	Efectivo operaciones especiales Comprador	N S	16	13	2	Posición referida a operaciones especiales con fecha contratación igual a la fecha sesión Sólo aplica al Segmento de Renta Variable.
101	Saldo Vendedor vencimiento de futuros y opciones. Valores/ Nominal	N	18	12	6	Posición prevista por entrega en las fechas de vencimiento de futuros y opciones Sólo aplica al Segmento de Renta Variable.
102	Efectivo vencimiento de futuros y opciones. Vendedor	N S	16	13	2	Posición prevista por entrega en las fechas de vencimiento de futuros y opciones Sólo aplica al Segmento de Renta Variable.

	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
103	Saldo Comprador vencimiento de futuros y opciones. Valores/ Nominal	N	18	12	6	Posición prevista por entrega en las fechas de vencimiento de futuros y opciones Sólo aplica al Segmento de Renta Variable.
104	Efectivo vencimiento de futuros y opciones. Comprador	N S	16	13	2	Posición prevista por entrega en las fechas de vencimiento de futuros y opciones Sólo aplica al Segmento de Renta Variable.
105	Valor actual del efectivo correspondiente al Saldo Neto Comprador de Valores	N S	16	13	2	Valor actual del efectivo correspondiente al Saldo Neto Comprador de Valores. Aplica al segmento de Renta Fija.
106	Valor actual el efectivo correspondiente al Saldo Neto Vendedor de Valores	N S	16	13	2	Valor actual el efectivo correspondiente al Saldo Neto Vendedor de Valores. Aplica al segmento de Renta Fija.
107	Valor actual del efectivo correspondiente al Saldo Fallido Comprador de Valores	N S	16	13	2	Valor actual del efectivo correspondiente al Saldo Fallido Comprador de Valores. Aplica al segmento de Renta Fija.
108	Valor actual el efectivo correspondiente al Saldo Fallido Vendedor de Valores	N S	16	13	2	Valor actual el efectivo correspondiente al Saldo Fallido Vendedor de Valores. Aplica al segmento de Renta Fija.
109	Valor actual del efectivo correspondiente a la recepción de Valores/Nominal por Ajustes Comprador de Valores	N S	16	13	2	Valor actual del efectivo correspondiente a la recepción de Valores/Nominal por Ajustes Comprador de Valores. Aplica al segmento de Renta Fija.
110	Valor actual el efectivo correspondiente a la entrega de Valores/Nominal por Ajustes	N S	16	13	2	Valor actual el efectivo correspondiente a la entrega de Valores/Nominal por Ajustes. Aplica al segmento de Renta Fija.
111	Valor actual del efectivo correspondiente a las posiciones de efectivo pendientes de liquidar	N S	16	13	2	Valor actual del efectivo correspondiente a las posiciones de efectivo pendientes de liquidar. Aplica al segmento de Renta Fija.
112	Grupo Compensación	A	12			Grupo de compensación del activo. Aplica al segmento de Renta Fija, en la comunicación de saldos vivos.
113	Tipo de SFT	A	1			Contiene el tipo de SFT: B:Simultánea R:Repo N: No aplica
FIN DATOS SALDOS EN CUENTA (R04)						
DATOS DE EJECUCION (BILATERALES DE IBERCLEAR) (R05)						

	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
Identificación Ejecución						
114	Identificación de la Plataforma	A	11			Código BIC
115	Fecha Operación	A	8			AAAAMMDD
116	Referencia Operación DCV	A	35			Referencia Case asignada por el DCV
117	Entidad Participante	A	11			Identificación de la entidad en la plataforma (BIC)
Datos Ejecución						
118	Fecha de Case (Ejecución)	A	8			AAAAMMDD
119	Hora de Case (Ejecución)	A	9			HHMMSSMMM
120	Tipo de Operación Plataforma	A	4			Codificación del Tipo de Operación según definición de la Plataforma
121	Código de Valor	A	12			ISIN
122	Cuenta Liquidación	A	35			
123	Indicador cotización	A	1			N – Nominal U – Unidades monetarias
124	Valores / Importe Nominal	N	18	12		6
125	Precio	N	13	7		6
126	Importe Efectivo	N	15	13		2
127	Divisa	A	3			Codificación ISO4217
128	Sentido	A	1			1 (Compra) / 2 (Venta) 1 (Recibe) / 2 (Entrega)
129	Ordenante participante	A	35			Ordenante participante en la entrega/recepción Puede ser un código BIC o un texto de hasta 35 posiciones
130	Código participante	A	42			Código participante en la entrega/recepción
131	CCV	A	35			Identificación de la cuenta de Valores
132	Fecha Liquidación Teórica	A	8			AAAAMMDD
133	Liquidación Parcial	A	4			
134	Liquidación Tiempo Real	A	4			

	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
135	Ind. Intervención ECC	A	1			Indica que en la operación se va a interponer la ECC: • S : Interviene la ECC
136	Miembro Compensador	A	11			Para Operaciones en las que interviene una ECC, se informará el Miembro Compensador (BIC)
137	Cuenta de Posición Comunicada por el DCV	A	35			Para Operaciones en las que interviene una ECC, se informará con el Código de Cuenta de Posición
138	Código DCV	A	11			Código BIC
FIN DATOS DE EJECUCION (BILATERALES DE IBERCLEAR) (R05)						

4. Asignación de Operaciones

La Asignación de Operaciones en la ECC permite traspasar operaciones entre cuentas de un Miembro o entre Miembros, pudiendo ser, parcial o total.

En base al tipo de Cuenta, y el Origen y Destino se establece la siguiente terminología:

TERMINOLOGÍA	ORIGEN	DESTINO
Asignación Interna de Cuenta	Cuenta Diaria	Cuenta Ordinaria (sin cambio de Miembro)
Traspaso	Cuenta Ordinaria	Cuenta Ordinaria (sin cambio de Miembro)
Asignación Externa	Todas las cuentas	Otro Miembro

Este capítulo sólo aplica al segmento de Renta Variable.

A continuación se relacionan los mensajes utilizados, junto con el emisor y receptor de los mismos en varios supuestos:

4.1 Asignación Interna de Cuenta y Traspaso

El Miembro al que pertenece la cuenta donde están anotadas las operaciones a transferir solicita la Asignación de Cuenta o traspaso hacia otra cuenta suya. La ECC informa al Miembro de la aceptación de la Asignación, o de rechazo de la misma, en caso de no ser aceptada.

En el caso de que la Asignación sea aceptada, la ECC comunicará al Miembro dos nuevas operaciones y la actualización de datos en la operación origen del traspaso, mediante el formato AN, resultantes de la operativa de Asignación.

- Una operación anotada en la cuenta original, de signo opuesto a la operación original.
- Una operación anotada en la Cuenta Destino y con idéntico signo de la operación original.
- La actualización de datos de la operación origen.

El registro de estas operaciones será comunicado a la Entidad Participante y, adicionalmente, al Miembro Compensador de la cuenta, en el caso de que el Miembro que realice la Asignación Interna o el traspaso no sea Compensador de la cuenta.

4.1.1 Asignación Interna de Cuenta y Traspaso (Aceptada)

EMISOR	RECEPTOR	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
Miembro	ECC	MO	R00+n(R01)	Solicitud de Asignación Interna de Cuenta o Traspaso
ECC	Miembro	MO	R00+n(R04)	Notificación Solicitud de Asignación Interna de Cuenta o Traspaso (Aceptación)
ECC	Miembro Miembro Compensador Entidad Participante	AN	(R00+R01+R02)	Anotación en Cuenta Origen
ECC	Miembro Miembro Compensador Entidad Participante	AN	(R00+R01+R02)	Anotación en Cuenta Destino

EMISOR	RECEPTOR	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
ECC	Miembro Miembro Compensador Entidad Participante	AN	(R00+R01)	Actualización de datos en Operación origen

4.1.2 Asignación Interna de Cuenta y Traspaso (Rechazada)

EMISOR	RECEPTOR	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
Miembro	ECC	MO	R00+n(R01)	Solicitud de Asignación Interna de Cuenta o Traspaso
ECC	Miembro	MO	R00	Respuesta a la Solicitud de Asignación Interna de Cuenta o Traspaso (Rechazo)

4.2 Asignación Externa

A continuación se describen las diferentes fases o estados de la Asignación desde su inicio hasta su conclusión, ya sea porque llegue a ser completada o cancelada:

4.2.1 Inicio de Asignación Externa

El Miembro al que pertenece la cuenta donde están anotadas las operaciones a transferir, Miembro Origen, solicita la Asignación Externa hacia otro Miembro de la ECC: Miembro Destino.

En el caso de que la ECC acepte la solicitud de la Asignación Externa, la ECC notificará a los diferentes intervinientes en la Asignación el estado de la Asignación (mensaje MO).

El Miembro Origen podrá solicitar la cancelación de la Asignación Externa, siempre y cuando el Miembro Destino no haya aceptado la Asignación. Si la ECC acepta la cancelación, notificará al Miembro Origen y al Miembro Destino la cancelación de la Asignación (mensaje MO).

4.2.2 Aceptación/Rechazo de Asignación Externa por Miembro Destino

Una vez recibida la notificación de Asignación Externa de cuenta pendiente de aceptar, el Miembro Destino de la Asignación, podrá aceptarla o rechazarla, mediante el formato AC.

Si la Asignación es aceptada y el Miembro Destino es Compensador de la Cuenta Destino, la Asignación se completa. En el caso de que no sea así, la ECC notifica al Miembro

Compensador, y al resto de intervinientes en la Asignación, el estado de la Asignación (pendiente aceptación Miembro Compensador del Miembro Destino).

4.2.3 Aceptación/Rechazo de Asignación Externa por Miembro Compensador del Miembro Destino

El Miembro Compensador del Miembro Destino podrá aceptar o rechazar la Asignación, mediante el mensaje

AC, una vez haya recibido la notificación de Asignación Externa pendiente aceptar por Compensador Destino.

Si la Asignación es aceptada por el Compensador del Miembro Destino, la Asignación se completa; en este caso la ECC notifica a todos los intervinientes en la Asignación que ésta se ha completado, mediante el mensaje MO.

Si por el contrario, el Miembro Compensador rechaza la Asignación, ésta pasa a estar pendiente de aceptar por el Miembro Destino, esta nueva situación es notificada a todos los intervinientes en la Asignación, mediante el formato MO. En este caso el Miembro Destino podrá aceptar/rechazar la Asignación indicando otra Cuenta Destino o la misma.

Una vez completada la Asignación Externa, la ECC comunicará mediante el formato AN, las Anotaciones realizadas en la Cuenta Origen y en la Cuenta Destino, junto con la actualización de la operación original:

Al Miembro Origen, y al Miembro Compensador de la Cuenta Origen, si no es el mismo:

- Una operación anotada en la cuenta original, de signo opuesto a la operación original.
- La actualización de datos de la operación original.

Al Miembro Destino, y al Miembro Compensador de la Cuenta Destino, si no es el mismo:

- Una operación anotada en la Cuenta Destino y con idéntico signo de la operación original.

A continuación se relacionan los mensajes utilizados, junto con el emisor y receptor de los mismos en varios supuestos:

- a) Asignación Externa por número de Operación a un Miembro de la ECC que no es Compensador (Aceptado por la ECC)

EMISOR	RECEPTOR	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
Miembro Origen	ECC	MO	R00+n(R01)	Solicitud de Asignación Externa por número de operación
ECC	Miembro Origen	MO	R00+n(R04)	Respuesta a la Solicitud de Asignación Externa (Aceptación/ Notificación de Asignación Externa Pendiente aceptar por el Miembro Destino)
ECC	Miembro Destino	MO	R03+n(R04)	Notificación de Asignación Externa Pendiente aceptar por el Miembro Destino
Miembro Destino	ECC	AC	R00	El Miembro Destino acepta la Asignación Externa
ECC	Miembro Origen	MO	R00+n(R04)	Notificación Asignación Externa Pendiente Aprobación por el Miembro Compensador Destino
ECC	Miembro Destino	MO	R03+n(R04)	Notificación Asignación Externa Pendiente Aprobación por el Miembro Compensador Destino
ECC	Miembro Compensador Destino	MO	R03+n(R04)	Notificación Asignación Externa Pendiente Aprobación por el Miembro Compensador Destino
Miembro Compensador Destino	ECC	AC	R00	El Miembro Compensador del Miembro Destino acepta la Asignación Externa
ECC	Miembro Origen	MO	R00+n(R04)	Notificación de Asignación Externa Finalizado
ECC	Miembro Destino	MO	R03+n(R04)	Notificación de Asignación Externa Finalizado
ECC	Miembro Compensador Destino	MO	R03+ n(R04)	Notificación de Asignación Externa Finalizado
ECC	Miembro Origen	AN	n(R00+R01+R02)	Anotación en Cuenta Origen
ECC	Miembro Compensador Origen	AN	n(R00+R01+R02)	Anotación en Cuenta Origen (Este mensaje sólo se envía si el Origen no es Compensador)
ECC	Entidad Participante (Cuenta Origen)	AN	n(R00+R01+R02)	Anotación en Cuenta Origen
ECC	Miembro Origen	AN	n(R00+R01)	Actualización de datos en Operación origen
ECC	Miembro Compensador Origen	AN	n(R00+R01)	Actualización de datos en Operación origen (Este mensaje sólo se envía si el Origen no es Compensador)

EMISOR	RECEPTOR	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
ECC	Entidad Participante (Cuenta Origen)	AN	n(R00+R01)	Actualización de datos en Operación origen
ECC	Miembro Destino	AN	N (R00+R01+R02)	Anotación en Cuenta Destino
ECC	Miembro Compensador Destino	AN	n(R00+R01+R02)	Anotación en Cuenta Destino
ECC	Entidad Participante (Cuenta Destino)	AN	n(R00+R01+R02)	Anotación en Cuenta Destino

b) Asignación Externa por número de Orden a un Miembro que no es Compensador (aceptado por la ECC):

EMISOR	RECEPTOR	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
Miembro Origen	ECC	MO	R00+R02	Solicitud de Asignación Externa por número de orden
ECC	Miembro Origen	MO	R00+R04	Respuesta a la Solicitud de Asignación Externa (Aceptación/ Notificación de Asignación Externa Pendiente aceptar por el Miembro Destino)
ECC	Miembro Destino	MO	R03+R04	Notificación de Asignación Externa Pendiente aceptar por el Miembro Destino
Miembro Destino	ECC	AC	R00	El Miembro Destino acepta la Asignación Externa
ECC	Miembro Origen	MO	R00+R04	Notificación Asignación Externa Pendiente Aprobación por el Miembro Compensador Destino
ECC	Miembro Destino	MO	R03+R04	Notificación Asignación Externa Pendiente Aprobación por el Miembro Compensador Destino
ECC	Miembro Compensador Destino	MO	R03+R04	Notificación Asignación Externa Pendiente Aprobación por el Miembro Compensador Destino

EMISOR	RECEPTOR	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
Miembro Compensador Destino	ECC	AC	R00	El Miembro Compensador del Miembro Destino acepta la Asignación Externa
ECC	Miembro Origen	MO	R00+R04	Notificación de Asignación Externa Finalizado
ECC	Miembro Destino	MO	R03+R04	Notificación de Asignación Externa Finalizado
ECC	Miembro Compensador Destino	MO	R03+R04	Notificación de Asignación Externa Finalizado
ECC	Miembro Origen	AN	n(R00+R01+R02)	Anotación en Cuenta Origen
ECC	Miembro Compensador Origen	AN	n(R00+R01+R02)	Anotación en Cuenta Origen (Este mensaje sólo se envía si el Origen no es Compensador)
ECC	Entidad Participante (Cuenta Origen)	AN	n(R00+R01+R02)	Anotación en Cuenta Origen
ECC	Miembro Origen	AN	n(R00+R01)	Actualización de datos en Operación origen
ECC	Miembro Compensador Origen	AN	n(R00+R01)	Actualización de datos en Operación origen (Este mensaje sólo se envía si el Origen no es Compensador)
ECC	Entidad Participante (Cuenta Origen)	AN	n(R00+R01)	Actualización de datos en Operación origen
ECC	Miembro Destino	AN	n(R00+R01+R02)	Anotación en Cuenta Destino
ECC	Miembro Compensador Destino	AN	n(R00+R01+R02)	Anotación en Cuenta Destino
ECC	Entidad Participante (Cuenta Destino)	AN	n(R00+R01+R02)	Anotación en Cuenta Destino

c) Cancelación de Asignación Externa por el Miembro Origen:

EMISOR	RECEPTOR	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
Miembro Origen	ECC	MO	R00+n(R01)	Solicitud de Asignación Externa por número de operación
ECC	Miembro Origen	MO	R00+n(R04)	Respuesta a la Solicitud de Asignación Externa (Aceptación/ Notificación de Asignación Externa Pendiente aceptar por el Miembro Destino)
ECC	Miembro Destino	MO	R03+nR(04)	Notificación de Asignación Externa Pendiente aceptar por el Miembro Destino
Miembro Origen	ECC	AC	R00	El Miembro Origen Solicita la Cancelación de la Asignación Externa
ECC	Miembro Origen	MO	R00+n(R04)	Notificación de Asignación Externa Cancelado
ECC	Miembro Destino	MO	R03+n(R04)	Notificación de Asignación Externa Cancelado

d) Asignación Externa por número de Operación a un Miembro de la ECC que no es Compensador y no es aceptado por el Miembro Compensador del Destino:

EMISOR	RECEPTOR	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
Miembro Origen	ECC	MO	R00+n(R01)	Solicitud de Asignación Externa por número de operación
ECC	Miembro Origen	MO	R00+n(R04)	Respuesta a la Solicitud de Asignación Externa (Aceptación/ Notificación de Asignación Externa Pendiente aceptar por el Miembro Destino)
ECC	Miembro Destino	MO	R03+nR(04)	Notificación de Asignación Externa Pendiente aceptar por el Miembro Destino
Miembro Destino	ECC	AC	R00	El Miembro Destino acepta la Asignación Externa
ECC	Miembro Origen	MO	R00+n(R04)	Notificación Asignación Externa Pendiente Aprobación por el Miembro Compensador Destino
ECC	Miembro Destino	MO	R03+n(R04)	Notificación Asignación Externa Pendiente Aprobación por el Miembro Compensador Destino

EMISOR	RECEPTOR	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
ECC	Miembro Compensador Destino	MO	R03+n(R04)	Notificación Asignación Externa Pendiente Aprobación por el Miembro Compensador Destino
Miembro Compensador Destino	ECC	AC	R00	El Miembro Compensador del Miembro Destino rechaza la Asignación Externa
ECC	Miembro ECC Origen	MO	R00+n(R04)	Notificación de Asignación Externa rechazada por Miembro Destino
ECC	Miembro ECC Destino	MO	R03+n(R04)	Notificación de Asignación Externa rechazada por Miembro Destino
ECC	Miembro Compensador Destino	MO	R03+n(R04)	Notificación de Asignación Externa rechazada por Miembro Destino

4.3 Uso de Referencias en Asignación de Operaciones

En la Gestión de Asignaciones se utilizan una serie de referencias que permiten correlacionar la mensajería emitida por lo Miembros con las respuestas y notificaciones emitidas por la ECC. A continuación se describen dichas referencias:

Referencia de Movimiento:

- Referencia asignada por el Miembro en cada mensaje emitido MO y AC.
- Permite relacionar las asignaciones realizadas por el Miembro con las notificaciones del estado de la asignación comunicada por la ECC
- Tiene una longitud máxima de 10 caracteres, de las cuales las primeras 2 posiciones deben de ser informadas con el identificador del mensaje: MO ó AC

Referencia de Movimiento ECC:

- Referencia asignada por la ECC para cualquier solicitud de Asignación.
- Esta Referencia se informa en los mensajes de notificación del estado de la Asignación (MO) y debe ser informado por el Miembro Destino y/o su Compensador para aceptar o rechazar una Asignación Externa (AC) y por el Miembro Origen en la cancelación de una Asignación (AC).
- Esta Referencia contendrá el mismo valor en todos los mensajes implicados en una Asignación Externa, independientemente de papel del receptor de los mensajes.
- Tiene una longitud máxima de 10 caracteres.

Referencia de Notificación:

- Referencia asignada por la ECC para identificar los diferentes estados en los que se encuentra la Asignación.
- Se informa en los mensajes MO de notificación del estado de la Asignación.
- Tiene una longitud máxima de 9 caracteres.

Referencia de Notificación Previa:

- Esta Referencia debe ser informada por el Miembro Destino y/o su Compensador para aceptar o rechazar una Asignación Externa (AC) y por el Miembro Origen en la cancelación de una Asignación (AC) con el el valor asignado en la Referencia de Notificación comunicada previamente por la ECC.
- Tiene una longitud máxima de 9 caracteres.

4.4 Flujo de mensajes

Al inicio de cada sesión, la ECC informa de las peticiones de asignación externa de cuenta que estén pendientes de aceptación / rechazo. A continuación se muestra este flujo junto con el intercambio de mensajería en diferentes escenarios en asignaciones de cuenta.

4.4.1 Flujo de mensajes al inicio de la sesión

Inicio de Sesión en la ECC

Asignaciones de cuenta pendientes de aceptación / rechazo

MO	R00+n(R04)					
Miembro Origen XXX	Refer. Movimiento	Refer. Movimiento ECC	Referencia Notificación	Tipo Mvto	Estado	Resto Datos Asignación Externa
	xx	M0001	0001	15	6 Pendiente aceptación	nnnnnnnn

MO	R03+nR(04)					
Miembro Destino XXX	Refer. Movimiento	Refer. Movimiento ECC	Referencia Notificación	Tipo Mvto	Estado	Resto Datos Asignación Externa
	xx	M0001	0001	16	6 Pendiente aceptación	mmmmmm

MO	R03+nR(04)					
Miembro Compensador Destino ZZZ	Refer. Movimiento	Refer. Movimiento ECC	Referencia Notificación	Tipo Mvto	Estado	Resto Datos Asignación Externa
	xx	M0001	0001	16	13 Pendiente Aceptación Compens.	Cta=PPP yyyyyyy

4.4.2 Flujo de mensajes en un Traspaso aceptado por la ECC

Aplicaciones  Gate  ECC

Externas

MO	R00							R01		
Miembro Origen XXX	Refer. Movimiento	Refer. Movimiento ECC	Referencia Notificación	Tipo Mvto	Estado	Miembro Destino	Resto Datos	Num. Oper.	Num. Oper. Nuevo	Resto Datos
	xx	n/a	n/a	n/a	n/a	XXX	nnnnnnnn	OP1	n/a	xxxxxx

Aplicaciones ← Gate ← ECC

Externas

AN	R00	R01	R02
Miembro	Datos Generales	Datos Operación OP2	Datos Ejecución
Miembro Compensador	Cuenta ABC	Tipo Anotación 0 (nueva)	nnnnnnnnnnnnnnn
Entidad Participante			
AN	R00	R01	
Miembro	Datos Generales	Datos Operación OP1	
Miembro Compensador	Cuenta ABC	Tipo Anotación 2 (Actualización)	
Entidad Participante			
AN	R00	R01	R02
Miembro	Datos Generales	Datos Operación OP3	Datos Ejecución
Miembro Compensador	Cuenta H01	Tipo Anotación 0 (nueva)	nnnnnnnnnnnnnnn
Entidad Participante			

MO	R00							R04		
Miembro Origen XXX	Refer. Movimiento	Refer. Movimiento ECC	Referencia Notificación	Tipo Mvto	Estado	Miembro o Destino	Resto Datos	Num. Oper.	Num. Oper. Nuevo	Resto Datos
	xx	M0001	0001	15	9 Finalizado	XXX	nnnnnnnn	OP1	OP2	xxxxx

4.4.3 Flujo de mensajes en un Traspaso rechazado por la ECC

Aplicaciones → Gate → ECC

Externas

MO	R00							R01		
Miembro Origen XXX	Refer. Movimient o	Refer. Movimient o ECC	Referencia Notificació n	Tipo Mvto	Estado	Miembr o Destino	Resto Datos	Num. Oper.	Num. Oper Nuevo	Resto Datos
	xx	n/a	n/a	n/a	n/a	XXX	nnnnnnnn	OP1	n/a	xxxxx

Aplicaciones ← Gate ← ECC

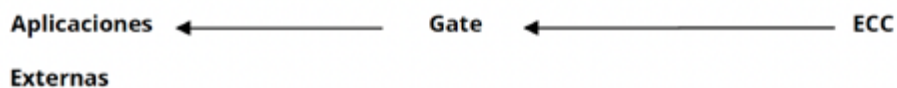
Externas

MO	R00							
Miembro Origen XXX	Refer. Movimient o	Refer. Movimient o ECC	Referencia Notificació n	Tipo Mvto	Estado	Miembr o Destino	Resto Datos	Error
	xx	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a	ERR

4.4.4 Flujo de mensajes en una Asignación Externa a un Miembro Destino que no es Compensador (la Asignación Externa es aceptada por los destinos)



MO	R00							R01		
Miembro Origen XXX	Refer. Movimiento	Refer. Movimiento ECC	Referencia Notificación	Tipo Mvto	Estado	Miembro Destino	Resto Datos	Num. Oper.	Num. Oper. Nuevo	Resto Datos
	xx	n/a	n/a	n/a	n/a	YYY	nnnnnnnn	OP1	n/a	xxxxxx



La ECC acepta la solicitud del Miembro origen

MO	R00						R04
Miembro Origen XXX	Refer. Movimiento	Refer. Movimiento ECC	Referencia Notificación	Tipo Mvto	Estado	Resto Datos Asignación Externa	Datos Bloque R04
	xx	M0001	0001	15	6 Pendiente aceptación	nnnnnnnn	nnnnnn

MO	R03						R04
Miembro Destino YYY	Refer. Movimiento	Refer. Movimiento ECC	Referencia Notificación	Tipo Mvto	Estado	Resto Datos Asignación Externa	Datos Bloque R04
	xx	M0001	0001	16	6 Pendiente aceptación	mmmmmm	xxxxxxxxxxxx



El Miembro Destino acepta la Asignación

AC	R00					
Miembro Destino YYY	Refer. Movimiento	Refer. Notificación Previa	Refer. Movimiento ECC	Actuación	Cuenta Destino	Error
	yy	0001	M0001	A	PPP	n/a



La ECC acepta la solicitud del Miembro Destino

MO	R00						R04
Miembro Origen XXX	Refer. Movimiento	Refer. Movimiento ECC	Referencia Notificación	Tipo Mvto	Estado	Resto Datos Asignación Externa	Datos Bloque R04
	yy	M0001	0003	15	13 Pendiente Aceptación Compens.	nnnnnnnn	Nnnnnnn

MO	R03						R04
Miembro Destino YYY	Refer. Movimiento	Refer. Movimiento ECC	Referencia Notificación	Tipo Mvto	Estado	Resto Datos Asignación Externa	Datos Bloque R04
	yy	M0001	0003	16	13 Pendiente Aceptación Compens.	mmmmmm	xxxxxxxxxx

MO	R03						R04
Miembro Compensador Destino ZZZ	Refer. Movimiento	Refer. Movimiento ECC	Referencia Notificación	Tipo Mvto	Estado	Resto Datos Asignación Externa	Datos Bloque R04
	yy	M0001	0003	16	13 Pendiente Aceptación Compens.	Cta=PPP yyyyyyyy	xxxxxxxxxx



El Miembro Compensador Destino acepta la Asignación

AC	R00					
Miembro Destino ZZZ	Refer. Movimiento	Refer. Notificación Previa	Refer. Movimiento ECC	Actuación	Cuenta Destino	Error
	zz	0003	M0001	O		n/a



La ECC acepta la solicitud del Miembro Compensador Destino

MO	R00						R04
Miembro Origen XXX	Refer. Movimiento	Refer. Movimiento ECC	Referencia Notificación	Tipo Mvto	Estado	Resto Datos Asignación Externa	Datos Bloque R04
	zz	M0001	0006	15	9 Finalizado	nnnnnnnn	nnnnnnnn

MO	R03						R04
Miembro Destino YYY	Refer. Movimiento	Refer. Movimiento ECC	Referencia Notificación	Tipo Mvto	Estado	Resto Datos Asignación Externa	Datos Bloque R04
	zz	M0001	0006	16	9 Finalizado	mmmmmm	xxxxxxxxxx

MO	R03						R04
Miembro Compensador Destino ZZZ	Refer. Movimiento	Refer. Movimiento ECC	Referencia Notificación	Tipo Mvto	Estado	Resto Datos Asignación Externa	Datos Bloque R04
	zz	M0001	0006	16	9 Finalizado	mmmmmm	xxxxxxxxxx

La ECC registra las nuevas operaciones

AN	R00	R01	R02
Miembro origen	Datos Generales	Datos Operación OP2	Datos Ejecución
	Cuenta Origen	Tipo Anotación 0(nueva)	nnnnnnnnnnnnnnnn n

AN	R00	R01	R02
Miembro Compensador Origen (sólo se envía si el Miembro origen no es Compensador de la Cuenta Origen)	Datos Generales	Datos Operación OP2	Datos Ejecución
	Cuenta Origen	Tipo Anotación 0(nueva)	nnnnnnnnnnnnnnnn n

AN	R00	R01	R02
Entidad Participante (cta. origen)	Datos Generales	Datos Operación OP2	Datos Ejecución
	Cuenta Origen	Tipo Anotación 0 (nueva)	nnnnnnnnnnnnnnnn

AN	R00	R01
Miembro origen	Datos Generales	Datos Operación OP1
	Cuenta Origen	Tipo Anotación 2(actualización)

AN	R00	R01
Miembro Compensador Origen (sólo se envía si el Miembro origen no es Compensador de la Cuenta Origen)	Datos Generales	Datos Operación OP1
	Cuenta Origen	Tipo Anotación 2(actualización)

AN	R00	R01
Entidad Participante (cta. origen)	Datos Generales	Datos Operación OP1
	Cuenta Origen	Tipo Anotación 2(actualización)

AN	R00	R01	R02
Miembro Compensador Destino	Datos Generales	Datos Operación OP3	Datos Ejecución
	Cuenta Destino	Tipo Anotación 0(nueva)	nnnnnnnnnnnnnnnn

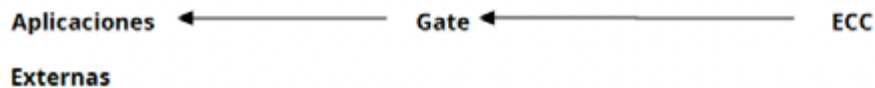
AN	R00	R01	R02
Miembro Destino	Datos Generales	Datos Operación OP3	Datos Ejecución
	Cuenta Destino	Tipo Anotación 0(nueva)	nnnnnnnnnnnnnnnn n

AN	R00	R01	R02
Entidad Participante (cta. Destino)	Datos Generales	Datos Operación OP3	Datos Ejecución
	Cuenta Destino	Tipo Anotación 0(nueva)	nnnnnnnnnnnnnnnn

4.4.5 Flujo de mensajes en una Asignación Externa a un Miembro Destino, cancelada por el Miembro Origen



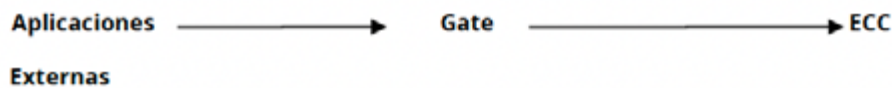
MO	R00						R01		
Miembro Origen XXX	Refer. Movimiento	Refer. Movimiento ECC	Referencia Notificación	Tipo Mvto	Estado	Resto Datos Asignación Externa	Num.Op.E CC	Num OP ECC Nuevo	Resto Datos
	xx	n/a	n/a	n/a	n/a	Destino = YYY	OP1	n/a	nnnnnn



La ECC acepta la solicitud del Miembro origen

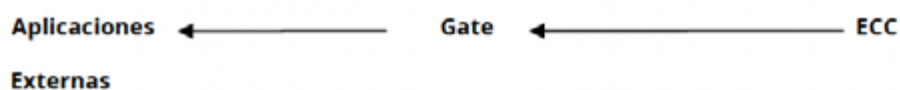
MO	R00						R04
Miembro Origen XXX	Refer. Movimiento	Refer. Movimiento ECC	Referencia Notificación	Tipo Mvto	Estado	Resto Datos Asignación Externa	Datos Bloque R04
	xx	M0001	0001	15	6 Pendiente aceptación	nnnnnnnn	nnnnnn

MO	R03						R04
Miembro Destino YYY	Refer. Movimiento	Refer. Movimiento ECC	Referencia Notificación	Tipo Mvto	Estado	Resto Datos Asignación Externa	Datos Bloque R04
	xx	M0001	0001	16	6 Pendiente aceptación	mmmmmmmm	xxxxxxxxxx



El Miembro origen cancela la Asignación

AC	R00					
Miembro Origen XXX	Refer. Movimiento	Refer. Notificación Previa	Refer. Movimiento ECC	Actuación	Cuenta Destino	Error
	yy	0001	M0001	C	n/a	n/a



La ECC acepta la solicitud del Miembro origen

MO	R00						R04
Miembro Origen XXX	Refer. Movimiento	Refer. Movimiento ECC	Referencia Notificación	Tipo Mvto	Estado	Resto Datos Asignación Externa	Datos Bloque R04
	yy	M0001	0002	15	12 Cancelado	nnnnnnn	nnnnnn

MO	R03						R04
Miembro Destino YYY	Refer. Movimiento	Refer. Movimiento ECC	Referencia Notificación	Tipo Mvto	Estado	Resto Datos Asignación Externa	Datos Bloque R04
	yy	M0001	0002	16	12 Cancelado	mmmmmm	xxxxxxxxxx

4.5 Definición de mensajes

4.5.1 MO - Movimiento de operaciones entre Cuentas de Posición

MO- MOVIMIENTO DE OPERACIONES ENTRE CUENTAS DE POSICIÓN	
Descripción	Este formato se empleará para: 1.Realizar Movimientos de Operaciones entre Cuentas de Posición: Asignación Interna de Cuenta 2.Traspasos Asignaciones externa Informar los diferentes estados en los que se encuentra la Asignación de Cuenta
Emisor	1.- Miembros ECC 2.- ECC
Destinatarios	1.- ECC 2.- Miembros ECC

El registro MO se compone de varios bloques:

BLOQUE	DESCRIPCIÓN/CONTENIDO
R00	Datos relativos a la solicitud de Asignación
R01	Detalle de operaciones incluidas en la solicitud de la Asignación
R02	Detalle número de orden incluido en la solicitud de la Asignación
R03	Notificación de Asignaciones a Destino
R04	Detalle Operaciones a traspasar
R05	Notificación de retención/liberación de operaciones

En la siguiente tabla se describe con más detalle la estructura del registro MO:

	R00	R01	R02	R03	R04	R05	OBSERVACIONES
Solicitud de Asignación de Cuenta: • Por Número de Operación	1	n	0	0	0	0	
Respuesta y Notificación de las diferentes fases en las que se encuentra una Asignación (por número de operación) al Miembro Origen	1	0	0	0	0/n	0	El bloque R04 no se informa en el caso que la solicitud sea rechazada por la ECC
Solicitud de Asignación de Cuenta: • Por Número Orden	1	0	1	0	0	0	
Respuesta y Notificación de las diferentes fases en las que se encuentra una Asignación (por número de orden) al Miembro Origen	1	0	0	0	0/1	0	El bloque R04 no se informa en el caso que la solicitud sea rechazada por la ECC
Notificación de las diferentes fases en las que se encuentra una Asignación (por número de operación/número de orden) al Miembro Destino / Miembro Compensador del Miembro Destino	0	0	0	1	0/n	0	

Longitud del registro: Variable

T=tipo / L=longitud / E=enteros / D=decimales

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
DATOS CABECERA						
1	Cabecera mensajería Propietaria	A	100			
Datos Comunes						
2	Fecha Teórica de Liquidación	A	8			AAAAMMDD
3	Sentido	A	1			Compra (1) / Venta (2)
Datos de Control Bloques						
4	Número de Registros R00	N	2	2		Datos relativos a la solicitud de Asignación
5	Número de Registros R01	N	2	2		Detalle operaciones incluidas en la solicitud de la Asignación
6	Número de Registros R02	N	2	2		Detalle número de orden incluido en la solicitud de la Asignación
7	Número de Registros R03	N	2	2		Notificación de Asignaciones a Destino
8	Número de Registros R04	N	2	2		Detalle Operaciones a traspasar
9	Número de Registros R05	N	2	2		Notificación de retención/liberación de operaciones
10	Código Error	A	3			
11	Texto Error	A	40			Texto explicativo del Error
FIN DATOS CABECERA						
DATOS SOLICITUD ASIGNACION (R00)						
Datos Cuenta Origen						
12	Referencia Movimiento	A	10			Identificador único asignado por el Miembro que solicita el Movimiento de cuenta Las dos primeras posiciones han de contener el valor: MO

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
13	Núm. Valores / Importe Nominal	N	18	12	6	Total de Valores a ser transferidos En Asignaciones multiples debe coincidir con la suma total de los volúmenes vivos de las operaciones a transferir. En Asignaciones simples puede ser inferior al volumen vivo de la operación a transferir.
14	Referencia Interna Asignación	A	18			Referencia de Asignación de Cuenta para uso interno del Miembro que solicita la Asignación
15	Referencia Asignación	A	18			Si es Asignación Interna o Traspaso: Origen = Destino Se informa a espacios
16	Mnemotécnico	A	10			Si Origen <> Destino sólo se debe informar uno de los campos Referencia Asignación o NEMO Si es Asignación Interna o Traspaso: Origen = Destino Se informa a espacios
Datos Cuenta Destino						
17	Miembro Destino	A	4			Si se informa NEMO no hay que informarlo
18	Cuenta de Posición Destino	A	3			Sólo se debe informar en Asignación Interna o Traspaso (Origen = Destino)
Datos a Devolver (R00)						
19	Referencia Movimiento ECC	A	10			Asignada por la ECC para identificar de forma única la Asignación de Cuenta
20	Ref. Notificación	A	9			Referencia asignada por la ECC. Identifica el Estado en la que se encuentra la Asignación.
21	Tipo Movimiento	A	2			15 Asignación Externa (Give-up) Asignación Externa (Take-up)
22	Estado	A	2			Indica el estado en la que se encuentra la Asignación de Cuenta: 5 Reject / Rechazado por la ECC 6 Allocation Pending / Pendiente Aceptación Destino 9 Claimed / Finalizado 12 Cancelled / Cancelado 13 Pending Take Up approval / Pendiente Aceptación Compensador Destino
23	Usuario Origen	A	3			Usuario que solicitó la Asignación de Cuenta
24	Miembro Destino	A	4			Miembro Destino de la Asignación de Cuenta

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
25	Usuario Destino	A	3			Si se informa es el Usuario del Miembro Destino que aceptó/rechazó la Asignación de Cuenta En el resto de casos a espacios
26	Efectivo	N	15	13	2	Efectivo Acumulado a ser transferido
27	Código de Valor	A	12			ISIN
FIN DATOS SOLICITUD ASIGNACION (R00)						
DETALLE OPERACIONES EN ASIGNACIÓN (R01)						Las operaciones comunicadas en este bloque deben ser del mismo valor, misma fecha teórica de liquidación y mismo sentido
28	Número Operación	A	16			Número de operación a transferir
29	Corretaje	N S	16	13	2	Importe Corretaje Miembro Negociador
FIN DETALLE OPERACIONES EN ASIGNACIÓN (R01)						
DETALLE NÚMERO ORDEN EN ASIGNACIÓN (R02)						
30	Fecha de la Orden	A	8			AAAAMMDD
31	Número de Orden	N	9			
FIN DETALLE NÚMERO ORDEN EN ASIGNACIÓN (R02)						
NOTIFICACIONES DE ASIGNACION A DESTINO (R03)						
32	Ref. Notificación	A	9			Referencia asignada por la ECC. Identifica el Estado de la Asignación de Cuenta
33	Referencia Movimiento	A	10			Referencia que identifica el mensaje relacionado: Solicitud de Movimiento de cuenta (MO-R00) Aceptación, rechazo y Cancelación (AC-R00)
34	Referencia Movimiento ECC	A	10			Asignada por la ECC para identificar de forma única la Asignación de Cuenta
35	Miembro Origen	A	4			Si se informa es el Miembro que solicitó la Asignación Externa En el resto de casos a espacios
36	Usuario Origen	A	3			Si se informa es el usuario del Miembro Origen que solicitó la Asignación de Cuenta En el resto de casos a espacios

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
37	Referencia Asignación	A	18			Se informa con la referencia comunicada por el Miembro solicitante de la Asignación
38	Mnemotécnico	A	10			Mnemotécnico de Asignación del Miembro Destino de la Asignación. Sólo se informa para notificaciones al Miembro Destino de la Asignación En el resto de casos se informa a espacios
39	Miembro Destino	A	4			
40	Usuario Destino	A	3			Si se informa es el Usuario del Miembro Destino que aceptó/rechazó la Asignación de Cuenta En el resto de casos a espacios
41	Miembro Compensador Destino	A	4			
42	Tipo Movimiento	A	2			15 Asignación Externa (Give-up) 16 Asignación Externa (Take-up)
43	Estado	A	2			Indica el estado en la que se encuentra la Asignación Externa: 5 Reject / Rechazado por la ECC 6 Allocation Pending / Pendiente Aceptación Destino 9 Claimed / Finalizado 12 Cancelled / Cancelado 13 Pending Take Up approval / Pendiente Aceptación Compensador Destino
44	Cuenta de Posición Destino	A	3			Identificación de la Cuenta de Posición Asignada por el Miembro Destino
45	Acumulado Número Valores/ Importe Nominal	N	18	12	6	Número Valores Acumulados a anotar en cuenta / Importe Nominal a anotar en cuenta
46	Precio	N	13	7	6	Precio de la operación En Asignaciones múltiples se informa a 0
47	Efectivo	A	15	13	2	Efectivo Acumulado a anotar en cuenta
48	Código de Valor	A	12			ISIN
FIN NOTIFICACIONES DE ASIGNACION A DESTINO (R03)						
DETALLE OPERACIONES A TRANSFERIR (R04)						
Datos Operación a Transferir						Los datos relativos a la Operación a Transferir no se informan si se asignan varias operaciones a partir de un número de orden.
49	Número Operación	A	16			Número de operación a transferir

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
50	Precio Operación	N	13	7	6	Precio de la operación
51	Núm. Valores / Importe Nominal	N	18	12	6	Valores o nominales del Número de operación
52	Corretaje	N S	16	13	2	Importe Corretaje Miembro Negociador
53	Número Operación Nuevo	A	16			Identificación del nuevo Número de operación en la ECC a registrar en la Cuenta Destino de la Asignación de Cuenta. Sólo se informa cuando la Asignación se ha completado.
Datos Ejecución						Los datos relativos a la Ejecución no se informan si se asignan varias operaciones a partir de un número de orden.
54	Identificación de la Plataforma	A	4			Código MIC Plataforma Negociación
55	Segmento	A	2			Segmento de negociación Ver tabla 5 del documento "Tablas de Codificación"
56	Fecha Negociación	A	8			AAAAMMDD
57	Ejecución de Mercado	A	35			Identificación Ejecución asignado por la plataforma de negociación
58	Código de Operación Mercado	A	4			Codificación de tipos de operación de la Plataforma de negociación
59	Miembro Mercado	A	11			Identificación del Miembro Mercado
60	Usuario	A	3			Usuario de la Plataforma
61	Valores / Importe Nominal	N	18	12	6	Número de Valores / Importe Nominal de la ejecución
Datos de la Orden						Los datos relativos a la orden se informan: • Si la Asignación se realiza por número de orden. • Si la Asignación se realiza por un número de operación
62	Fecha de la Orden de Mercado	A	8			AAAAMMDD
63	Número de la Orden de Mercado	N	9	9		
64	Referencia de Cliente	A	16			
65	Referencia Externa	A	15			

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
						Valores informados: Antes de MIFID-II: 1: Ajena 3: Propia 7: Especialista A partir de MIFID-II: 1 – AOTC 3 – MTCH 4 – DEAL
66	Indicador Capacidad	A	1			
FIN DETALLE OPERACIONES A TRANSFERIR (R04)						
NOTIFICACION DE RETENCIÓN Y LIBERACIÓN DE OPERACIONES (R05)						
67	Referencia Movimiento	A	10			Referencia que identifica el mensaje comunicado en Retención/Liberación de operación (OP-R00)
68	Referencia Movimiento ECC	A	10			Asignada por la ECC para identificar de forma única la Retención/Liberación de Operación
69	Ref. Notificación	A	9			Referencia asignada por la ECC. Identifica el Estado de la Retención/Liberación de Operación
70	Miembro	A	4			Miembro de la ECC
71	Cuenta Posición	A	3			Cuenta sobre la que se efectúa la retención/liberación de títulos
72	Miembro Compensador	A	4			
73	Entidad Participante BIC	A	11			Cod. BIC
74	Cuenta Liquidación	A	35			
75	Tipo Movimiento	A	2			Valores informados: RO: Retención de Operación LO: Liberación de Operación
76	Estado	A	2			Se informa con: 9 Claimed / Finalizado
77	Número Valores/ Importe Nominal	N	18	12	6	Número Valores retenidos o liberados
78	Precio	N	13	7	6	Volumen de la Operación

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
79	Efectivo	N	15	13	2	Precio de la Operación.
80	Código de Valor	A	12			
Datos Operación						
81	Número Operación	A	16			Número de operación sobre el que se ha efectuado la retención ó liberación
82	Número Valores/Nominal	N	18	12	6	Volumen de la Operación
83	Precio	N	13	7	6	Precio de la Operación.
FIN NOTIFICACION DE RETENCIÓN Y LIBERACIÓN DE OPERACIONES (R05)						

4.5.2 AC - Aceptación/Rechazo, Cancelación movimiento entre Cuentas de Posición

AC- ACEPTACIÓN/RECHAZO, CANCELACIÓN MOVIMIENTO ENTRE CUENTAS DE POSICIÓN	
Descripción	Este formato se empleará para: Aceptar/Rechazar la Asignación Externa Esta acción puede ser realizada por: El Miembro Destino de la Asignación El Miembro Compensador del Miembro Destino de la Asignación Cancelar una Asignación Externa, esta acción sólo la puede realizar el Miembro que solicitó la Asignación
Emisor	Miembros ECC
Destinatarios	ECC

El registro AC se compone del bloque:

BLOQUE	DESCRIPCIÓN/CONTENIDO
R00	Aceptación//Rechazo/Cancelación

En la siguiente tabla se describe con más detalle la estructura del registro AC:

	R00	OBSERVACIONES
Aceptación/Rechazo/Cancelación	1	

Longitud del registro: Variable

T=tipo / L=longitud / E=enteros / D=decimales

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
DATOS CABECERA						
1	Cabecera mensajería Propietaria	A	100			
Datos de Control Bloques						
2	Número de Registros R00	N	2	2		Datos Aceptación/Rechazo/Cancelación
3	Código Error	A	3			
4	Texto Error	A	40			Texto explicativo del Error
FIN DATOS CABECERA						
DATOS CONFIRMACIÓN/ RECHAZO/CANCELACIÓN (R00)						
5	Referencia Movimiento	A	10			Identificador único asignado por el Miembro que solicita: • La cancelación • El rechazo • La aceptación de la Asignación Externa Las dos primeras posiciones han de contener el valor: AC
6	Referencia Notificación Previa	A	9			Debe corresponderse con la Referencia de Notificación comunicada por la ECC en el registro MO de notificación del estado de la Asignación
7	Referencia Movimiento ECC	A	10			Asignada por la ECC para identificar de forma única la Asignación
8	Actuación	A	1			Actuación que realiza el Miembro sobre la Asignación: • A: Aceptar Asignación por destino • R: Rechazar Asignación por destino • O: Aceptar Asignación por el Compensador del Destino • N: Rechazar Asignación por el Compensador del Destino • C: Cancelar la solicitud de Asignación (esta acción sólo la puede realizar el Miembro que solicitó la Asignación)
9	Fecha Teórica de Liquidación	A	8			AAAAMMDD
10	Sentido	A	1			1 (Compra) / 2 (Venta)

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
11	Número Valores/ Importe Nominal	N	18	12	6	Número Valores/ Importe Nominal
Datos Cuenta Destino						
12	Cuenta de Posición Destino	A	3			Debe ser informado en la aceptación por el Miembro Destino de la Asignación En el resto de los casos se ignora
FIN DATOS CONFIRMACIÓN/RECHAZO/ CAN CELACIÓN (R00)						

5. Gestión de Referencias, Filtros y Configuración del Módulo de Parametrizaciones

La Gestión de Referencias y Filtros permite que los Miembros de la ECC definan una serie de Referencias y Filtros en la ECC, y configurar un Módulo de Parametrización con el fin de facilitar y optimizar los diferentes procesos que intervienen en la Asignación de Cuenta, realizándose estos de forma automática.

A continuación se describen las diferentes funciones que pueden realizar los Miembros, desde el punto de vista de Origen y Destino de la Asignación Externa.

Este capítulo sólo aplica al segmento de Renta Variable.

5.1 Gestión de Referencias de Asignación Externa por Miembro Origen

El Miembro Origen comunica una Referencia de Asignación Externa y el Miembro Destino de la Asignación. Esta Referencia, junto con el Miembro Origen, permitirá al Miembro Destino identificar el origen de la Asignación. En el proceso de Asignación Externa es fundamental que los miembros intervinientes estén de acuerdo con el uso de esta Referencia.

La ECC permite la definición de un Mnemotécnico y una Referencia interna, de uso interno para el Miembro Origen que facilita el envío de la Asignación y la gestión interna.

A continuación se relacionan los mensajes utilizados, junto con el emisor y receptor de los mismos en la gestión de Referencias de Asignación por el Miembro Origen:

ORIGEN	DESTINO	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
Miembro	ECC	RF	(R00+R01)	Configuración Módulo de Referencias de Asignación
ECC	Miembro	RF	(R00+R01)	La ECC acepta o rechaza la Configuración de Referencias de Asignación

5.2 Gestión de Referencias y Filtros de Asignación Externa por Miembro Destino

El Miembro Destino comunica una Referencia de Asignación Externa y el Miembro Origen de la Asignación. Esta Referencia, junto con el Miembro Origen, servirá al Miembro Destino para identificar el origen de la Asignación. En el proceso de Asignación Externa es fundamental que los miembros intervinientes estén de acuerdo con el uso de esta Referencia.

La ECC permite la definición de un Mnemotécnico, de uso interno para el Miembro Destino que facilita la aceptación de la Asignación.

A continuación se relacionan los mensajes utilizados, junto con el emisor y receptor de los mismos en la gestión de Referencias de Asignación Externa por Miembro Destino:

ORIGEN	DESTINO	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
Miembro	ECC	RF	(R00+R01)	Configuración Módulo de Referencias de Asignación
ECC	Miembro	RF	(R00+R01)	La ECC acepta o rechaza la Configuración de Referencias de Asignación

El Miembro Destino puede configurar una serie de Filtros que permiten automatizar la aceptación de una Asignación Externa, esto es, en el caso de que la Asignación verifique los criterios del filtro, será aceptada de forma automática, en caso contrario, la Asignación quedará pendiente de aceptación o rechazo.

A continuación se relacionan los mensajes utilizados, junto con el emisor y receptor de los mismos en la gestión Filtros de Asignación Externa por Miembro Destino:

ORIGEN	DESTINO	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
Miembro	ECC	RF	(R00+R02)	Configuración de Filtros de Asignación
ECC	Miembro	RF	(R00+R02)	La ECC acepta o rechaza la Configuración de Filtros de Asignación

5.3 Gestión de Filtros de Asignación Externa por Miembro Compensador del Miembro Destino

El Miembro Compensador del Miembro Destino puede configurar una serie de Filtros que permiten automatizar la aceptación de una Asignación Externa, esto es, en el caso de que la Asignación verifique los criterios del filtro, será aceptada de forma automática, en caso contrario, la Asignación quedará pendiente de aceptación o rechazo manual.

A continuación se relacionan los mensajes utilizados, junto con el emisor y receptor de los mismos en la gestión Filtros de Asignación Externa por Miembro Compensador del Miembro Destino:

ORIGEN	DESTINO	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
Miembro	ECC	RF	(R00+R02)	Configuración de Filtros de Asignación
ECC	Miembro	RF	(R00+R02)	La ECC acepta o rechaza la Configuración de Filtros de Asignación

5.4 Configuración del Módulo de Parametrización del Miembro

El Miembro asignará un Mnemotécnico de Asignación o una Cuenta de Posición en base a los siguientes conceptos del ámbito de la contratación:

- Plataforma
- Segmento
- Miembro de la Plataforma
- Usuario
- Indicador de Capacidad

- Referencia Cliente
- Referencia Externa

A continuación se relacionan los mensajes utilizados, junto con el emisor y receptor de los mismos en la configuración del Módulo de Parametrización:

ORIGEN	DESTINO	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
Miembro	ECC	RF	(R00+R03)	Configuración Módulo de Parametrización
ECC	Miembro	RF	(R00+R03)	La ECC acepta o rechaza la Configuración de Parametrización

5.5 Uso del campo Id. Referencia/Filtro

En la Gestión de Referencias y Filtros el Miembro debe asignar en el campo la Referencia/Filtro del formato RF un identificador que le permita la correlación con los mensajes de respuesta.

Id Referencia/Filtro:

- Referencia asignada por el Miembro en cada mensaje emitido RF.
- Permite relacionar las peticiones realizadas por el Miembro con las repuestas de la ECC.
- Tiene una longitud máxima de 10 caracteres.
- En el caso de que la longitud comunicada fuera inferior a 10 caracteres, se complementará con espacios por detrás hasta llegar a dicha longitud.

Id Referencia/Filtro ECC:

- La ECC comunica en el mensaje de respuesta una Referencia de 30 caracteres de longitud, siendo las 10 últimas posiciones las correspondientes con la la. Referencia/Filtro comunicada por el Miembro en el mensaje original.

Un usuario que quiera modificar o cancelar cualquiera de las funcionalidades relativas a la gestión de Referencias y Filtros (una Referencia, un Filtro de Asignación Externa...), debe usar el identificador asignado por la ECC en el campo "Id. Referencia/Filtro a Modificar" del mensaje RF de modificación/cancelación correspondiente.

5.6 Flujo de mensajes

Al inicio de cada sesión, la ECC informa las Referencias y Filtros de Asignación Externa y Módulo de Parametrización que estén vigentes. A continuación se muestra este flujo junto con el intercambio de mensajería en diferentes escenarios en la Gestión de Referencias y Filtros de Asignación Externa y Módulo de Parametrización.

5.6.1 Flujo de mensajes al inicio de la sesión



Inicio de Sesión en la ECC

Referencias y Filtros de Asignación Externa y Módulo de Parametrización
vigentes

RF	R00		R01
Miembro XXX	Acción	Datos Bloque R00	Datos Bloque R01
	A	xxxxxxxxxxxxxxxxxxxx	xxxxxxxxxxxxxxxxxxxx

RF	R00		R02
Miembro XXX	Acción	Datos Bloque R00	Datos Bloque R02
	A	xxxxxxxxxxxxxxxxxxxx	xxxxxxxxxxxxxxxxxxxx

RF	R00		R03
Miembro XXX	Acción	Datos Bloque R00	Datos Bloque R03
	A	xxxxxxxxxxxxxxxxxxxx	xxxxxxxxxxxxxxxxxxxx

5.6.2 Gestión de Referencias y Filtros (Mantenimiento de Referencia aceptado por la ECC)

Aplicaciones → Gate → ECC

Externas

RF	R00						R01
Miembro XXX	Acción	ID Referencia /Filtro	ID Referencia/Filtro ECC	ID Referencia/Filtro Modificación	Resto Datos	Error	Datos Bloque R01
	A	xx	n/a	n/a	xxxxx	n/a	xxxxxxxxxxxxxxxxxxxx

Aplicaciones ← Gate ← ECC

Externas

RF	R00						R01
Miembro XXX	Acción	ID Referencia /Filtro	ID Referencia/Filtro ECC	ID Referencia/Filtro Modificación	Resto Datos	Error	Datos Bloque R01
	A	xx	Prefix+xx	n/a	xxxxx	n/a	xxxxxxxxxxxxxxxxxxxx

5.6.3 Gestión de Referencias y Filtros (Mantenimiento de Referencia rechazado por la ECC)

Aplicaciones → Gate → ECC

Externas

RF	R00						R01
Miembro XXX	Acción	ID Referencia /Filtro	ID Referencia/Filtro ECC	ID Referencia/Filtro Modificación	Resto Datos	Error	Datos Bloque R01
	A	yy	n/a	Prefix+xx	xxxxx	n/a	xxxxxxxxxxxxxxxxxxxx

Aplicaciones ← Gate ← ECC

Externas

RF	R00						R01
Miembro Otigen XXX	Acción	ID Referencia /Filtro	ID Referencia/Filtro ECC	ID Referencia/Filtro Modificación	Resto Datos	Error	Datos Bloque R01
	A	yy	Prefix+yy	Prefix+xx	xxxxx	ERROR	xxxxxxxxxxxxxxxxxxxx

5.7 Definición de mensajes

5.7.1 Gestión de Referencias y Filtros de Asignación Externa /Gestión Módulo Parametrización

RF – GESTIÓN DE REFERENCIAS Y FILTROS DE ASIGNACIÓN EXTERNA /GESTIÓN MÓDULO PARAMETRIZACIÓN	
Descripción	Este formato se empleará para:
	1. Comunicar las Referencias y Filtros de Asignación Externa para automatizar la Asignación Externa entre Cuentas de Posición y la aceptación/rechazo de la misma
	2. Comunicar los criterios de configuración del Módulo de Parametrización (MP)
	3. Difusión a los Miembros ECC de las Referencias y Filtros de Asignación Externa y criterios de configuración del Módulo de Parametrización (MP) al inicio de la sesión
Emisor	1 y 2 Miembros ECC 3 ECC
Destinatarios	1 y 2 ECC 3 Miembros ECC

El registro RF se compone de varios bloques:

BLOQUE	DESCRIPCIÓN/CONTENIDO
R00	Datos Generales
R01	Gestión de Referencias de Asignación: • Referencia Asignación Miembro origen (GOR) • Referencia Asignación Miembro Destino (GIR),
R02	Gestión de Filtros de Asignación: • Filtros Asignación por Miembro Destino (GIF) • Filtros Asignación por Miembro Compensador de Destino (C-GIF)
R03	Gestión de: • Módulo Parametrización (CMP)

En la siguiente tabla se describe con más detalle la estructura del registro RF:

	R00	R01	R02	R03	OBSERVACIONES
Gestión de Referencias de Asignación:					
• Referencia Asignación Miembro origen (GOR)	1	1	0	0	
• Referencia Asignación Miembro Destino (GIR),					
Gestión de Filtros de Asignación:					
• Filtros Asignación por Miembro Destino (GIF)	1	0	1	0	
• Filtros Asignación por Miembro Compensador (C- GIF)					
Gestión del Módulo de Parametrización (CMP)	1	0	0	1	

Longitud del registro: Variable

T=tipo / L=longitud / E=enteros / D=decimales

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D
DATOS CABECERA					
1	Cabecera mensajería Propietaria	A	100		
Datos de Control Bloques					
2	Número de Registros R00	N	2	2	Datos Generales
3	Número de Registros R01	N	2	2	Referencias de Asignación
4	Número de Registros R02	N	2	2	Filtros de Asignación
5	Número de Registros R03	N	2	2	Configuración Módulo Parametrización
6	Código Error	A	3		
7	Texto Error	A	40		Texto explicativo del Error
FIN DATOS CABECERA					
DATOS GENERALES (R00)					
8	Acción	A	1		Acción a realizar en la gestión de Referencias y Filtros: • A Alta • B Baja • M Modificación

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D
9	Id. Referencia/Filtro	A	10		Identificador asignado por el Miembro que solicita la gestión de Referencias y Filtros. En las respuestas de la ECC no se informa.
10	Id. Referencia/Filtro ECC	A	30		Identificador asignado por la ECC Sólo se informa en las respuestas de la ECC En el resto de casos se ignora.
11	Id. Referencia/Filtro a Modificar	A	30		En envíos a la ECC sólo se debe informar para Acción B y M Debe cumplimentarse con la registrada en la ECC en base a la comunicada por el Miembro en la comunicación del alta Debe cumplimentarse con el Id. Referencia/Filtro ECC comunicado por la ECC.
FIN DATOS GENERALES (R00)					
DATOS REFERENCIAS ASIGNACIÓN (R01)					
12	Tipo Referencia/Filtro	A	3		Indica el Tipo de Referencia/Filtro a gestionar Valores permitidos: • GOR • GIR
13	Referencia Interna Asignación	A	18		Dependiendo del contenido del campo Tipo Referencia/Filtro se informará: • Referencia Interna Asignación, es para uso interno del Miembro solicitante de la Asignación (GOR) • A espacios para GIR
14	Referencia Asignación	A	18		Dependiendo del contenido del campo Tipo Referencia/Filtro se informará: • Con la referencia de Asignación (GOR y GIR)
15	Mnemotécnico	A	10		Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro
16	Miembro	A	4		Dependiendo del contenido del campo Tipo Referencia/Filtro se informará con el: • Miembro Destino de la Asignación(GOR) • Miembro Origen de la Asignación (GIR)
17	Cuenta de Posición	A	3		Dependiendo del contenido del campo Tipo Referencia/Filtro se informará: • A espacios (GOR) • Cuenta de Posición Destino (GIR)
FIN DATOS REFERENCIAS ASIGNACIÓN (R01)					
DATOS FILTROS ASIGNACIÓN (R02)					

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D
18	Tipo Referencia/Filtro	A	5		•
19	Miembro	A	4		Dependiendo del contenido del campo Tipo Referencia/ Filtro se informará: • Miembro que solicitó la Asignación (GIF) • Miembro Destino de la Asignación (C-GIF)
20	Referencia Asignación	A	18		Dependiendo del contenido del campo Tipo Referencia/ Filtro se informará: • Referencia Asignación (GIF) A • Espacios (C-GIF)
21	Cuenta de Posición Destino Asignación Externa	A	3		Dependiendo del contenido del campo Tipo Referencia/ Filtro se informará: • A Espacios (GIF) • Cuenta de Posición Destino de la Asignación (C-GIF)
22	TAL	N	12	12	Importe Máximo para aceptar la Asignación Externa
23	SAL	N	12	12	Importe Acumulado Máximo por sesión para aceptar la Asignación Externa.
FIN DATOS FILTROS ASIGNACIÓN (R02)					
CONFIGURACIÓN MÓDULO PARAMETRIZACIÓN (R03)					
24	Tipo Configuración	A	3		Indica el Tipo de Configuración Valores permitidos: • PAM
25	Identificación de la Plataforma	A	4		Codificación MIC de la Plataforma Si contiene "?????" se aplica a todos las Plataformas de negociación.
26	Segmento	A	2		Ver Tabla 5 del documento "Tablas de Codificación" Si se informa con "??" se aplica a todos los segmentos de negociación.
27	Indicador Capacidad	A	1		Valores permitidos: Antes de MIFID-II: 1: Ajena 3: Propia 7: Especialista A partir de MIFID-II: 1 – AOTC 3– MTCH 4 – DEAL
28	Referencia Cliente	A	16		Informada en la orden de mercado

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D
29	Referencia Externa	A	15		Informada en la orden de mercado
30	Miembro de la Plataforma	A	4		Miembro de la Plataforma
31	Código de Usuario	A	3		Usuario de la Plataforma Si contiene "???" se aplica a todos los usuarios del miembro.
32	Mnemotécnico	A	10		Mnemotécnico de Asignación definido por el Miembro Origen
33	Cuenta de Posición	A	3		Cuenta donde se anotará la operación Si se informa este campo el campo Mnemotécnico ha de ir a espacios
FIN CONFIGURACIÓN MÓDULO PARAMETRIZACIÓN (R03)					

Tabla resumen sobre los campos a informar en el registro RF por tipología de Referencia y Filtro, Dependiendo del Tipo de Referencia/Filtro gestionado por el Miembro, los campos a informar en el registro RF seguirán las siguientes reglas de cumplimentación:

TIPO REFERENCIA FILTRO	REG.	MIEMBRO	REF. ASIGNACIÓN EXTERNA	MNEMO	REF. INTERNA	CTA COMP.	TAL	SAL
GOR	R01	SÍ (Destino)	SÍ	SÍ	SÍ	NO	NO	NO
GIR	R01	SÍ (Origen)	SÍ	SÍ	NO	SÍ	NO	NO
GIF	R02	SÍ (Origen)	SÍ	NO	NO	NO	SÍ	SÍ
C-GIF	R02	SÍ (Destino)	NO	NO	NO	SÍ	SÍ	SÍ
CMP (*)	R03	NO	SÍ	NO	NO	SÍ	NO	NO

(*) Sólo informará uno de los campos

6. Garantías y Movimientos de Efectivo

La ECC proporciona los siguientes tipos de información:

- a) Información de los movimientos de Garantías al final de la sesión, así como de otros Movimientos de Efectivo a realizar en el sistema de pagos
- b) Información del Riesgo durante la Sesión.
- c) Detalle de las Garantías Depositadas

6.1 Garantías y Movimientos de Efectivo a Fin de Sesión

A fin de sesión, la ECC, informa el detalle de los movimientos de Garantías, así como de otros Movimientos de Efectivo a realizar en el sistema de pagos: mensaje GAO1. Se informa de los movimientos de todos los tipos de Garantías, no únicamente de las Garantías por Posición.

A continuación se relacionan los mensajes utilizados, junto con el emisor y receptor de los mismos:

EMISOR	RECEPTOR	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
ECC	Miembro Miembro Compensador Agente de Pagos	GA01	nR00+nR01+nR02	Información sobre las Garantías a nivel de Cuenta y Miembro al Final de la Sesión

6.2 Límite de Riesgo Intradía y Garantías Extraordinarias

Información de las Garantías durante la sesión mediante el mensaje GA03. Esta información puede ser generada como consecuencia de una solicitud del Miembro Compensador del Límite de Riesgo Intradía y Garantía por Posición por Cuenta (mensaje GA02), o bien ser generada por iniciativa de la ECC debido a la exigencia de Garantías Extraordinarias (Margin Call).

A continuación se relacionan los mensajes utilizados, junto con el emisor y receptor de los mismos:

a) Solicitud por parte del Miembro Compensador del Límite de Riesgo Intradía y Riesgo por Cuenta

EMISOR	RECEPTOR	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
Miembro Compensador	ECC	GA02		Solicitar el Límite de Riesgo Intradía y Riesgo por Cuenta
ECC	Miembro Compensador	GA03	nR00 + nR01	Información del Límite de Riesgo Intradía y Riesgo por Cuenta

b) Solicitud de Garantías Extraordinarias al Miembro Compensador

EMISOR	RECEPTOR	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
ECC	Miembro Compensador	GA03	nR00	Solicitud de Garantías Extraordinarias

6.3 Garantías Depositadas

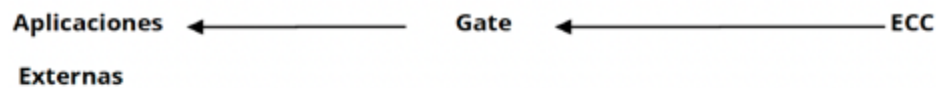
La ECC genera información detallada de las Garantías Depositadas (colateral) por el Miembro Compensador: mensaje GA04

A continuación se relacionan los mensajes utilizados, junto con el emisor y receptor de los mismos:

EMISOR	RECEPTOR	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
ECC	Miembro Miembro Compensador	GA04		Garantías Depositadas

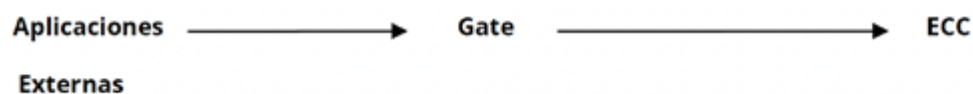
6.4 Flujo de mensajes

6.4.1 Garantías y Movimientos de Efectivo a Fin de Sesión



GA01	Datos Comunes	R01	R02	R03
Miembro	AccountSummaryReportID			
Miembro Compensador	xxx	xxxxxxxxxx	xxxxxxxxxx	xxxxxxxxxx
Agente de Pagos				

6.4.2 Solicitud por parte del Miembro Compensador del Límite de Riesgo Intradia y Riesgo por Cuenta (aceptada por la ECC)



GA02			
Miembro Compensador	MarginReqmtInqID	Datos Solicitud	Error
	xxx	xxxxxxxxxx	n/a



GA03	R00		
Miembro Compensador	MarginReqmtRptID	MarginReqmtInqID	Datos
	Z001	xxx	xxxxxxxxxxxxxxxxxx

GA03	R00		
Miembro Compensador	MarginReqmtRptID	MarginReqmtInqID	Datos
	Z001	xxx	xxxxxxxxxxxxxxxxxx

6.4.3 Solicitud por parte del Miembro Compensador del Límite de Riesgo Intradia y Riesgo por Cuenta (rechazada por la ECC)



GA02			
Miembro Compensador	MarginReqmtInqID	Datos Solicitud	Error
	xxx	nnnnnnnnnn	n/a



GA02			
Miembro Compensador	MarginReqmtInqID	Datos Solicitud	Error
	xxx	n/a	ERR

6.4.4 Solicitud de Garantías Extraordinarias al Miembro Compensador



GA03		R00	
Miembro Compensador	MarginReqmtRptID	MarginReqmtInqID	Datos
	Y001	n/a	nnnnnnnnnnnnnnnnnnnn

↓

GA03		R00	
Miembro Compensador	MarginReqmtRptID	MarginReqmtInqID	Datos
	Y001	n/a	nnnnnnnnnnnnnnnnnnnn

6.4.5 Garantías y Movimientos de Efectivo a Fin de Sesión



GA01	Datos Comunes	Resto Datos
Miembro	CollRptID	
Miembro Compensador	xxx	nnnnnnnnnnnnnn

GA01	Datos Comunes	Resto Datos
Miembro	CollRptID	
Miembro Compensador	xxx	nnnnnnnnnnnnnn

6.5 Definición de mensajes

6.5.1 GA01 - Garantías y Movimientos de Efectivo (Account summary report)

GA01 – GARANTÍAS Y MOVIMIENTOS DE EFECTIVO (ACCOUNT SUMMARY REPORT)	
Descripción	Este formato se empleará para informar de las Garantías y Movimientos de Efectivo a nivel de Cuenta de Garantías, a nivel de Cuenta de Colateral y a nivel de Miembro Compensador al final de la sesión. Se informa de todos los tipos de Garantías que la ECC exige a los Miembros Compensadores
Emisor	ECC
Destinatarios	Miembros ECC

El registro GA01 se compone de varios bloques:

BLOQUE	DESCRIPCIÓN/CONTENIDO
R00	Bloque MarginAmountData
R01	Bloque CollateralAmountGrp
R02	Bloque PayCollectGrp
R03	Bloque RiskLimit

En la siguiente tabla se describe con más detalle la estructura del registro GA01:

	R00	R01	R02	R03	OBSERVACIONES
Información sobre Garantías y Movimientos de Efectivo a nivel de Cuenta de Garantías	n				
Información sobre Garantías y Movimientos de Efectivo a nivel de Cuenta de Colateral	n	n	n		
Información sobre Garantías y Movimientos de Efectivo a nivel de Miembro Compensador	n	n	n	n	

Longitud del registro: Variable

T=tipo / L=longitud / E=enteros / D=decimales

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
DATOS CABECERA						
1	Cabecera mensajería Propietaria	A	100			
2	AccountSummaryReportID	A	20			Identificador único para cada mensaje
3	ClearingBusinessDate	A	8			Fecha de la sesión (AAAAMMDD)
4	Currency	A	3			Código de divisa en la que están expresados los importes de este mensaje. Expresada según estándar ISO 4217
5	FILLER	A	11			A espacios
6	Margin or Collateral Firm	A	4			Miembro de la Cuenta de Garantías o Colateral Informado en: • Margin Firm: Account Summary Report a nivel de Cuenta de Garantías • Collateral Firm: Account Summary Report a nivel de Cuenta de Colateral
7	Clearing Firm	A	4			
8	CreditRating	A	10			Solvencia de la entidad Informado en Account Summary Report a nivel de Miembro Compensador
9	EQTY	N	15	13	2	Recursos propios de la entidad Informado en Account Summary Report a nivel de Miembro Compensador

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
10	Margin or Collateral Account	A	3			Cuenta de Garantías o Colateral Informado en: • Margin Account: Account Summary Report a nivel de Cuenta de Garantías • Collateral Account: Account Summary Report a nivel de Cuenta de Colateral
11	Numero de Registros R00	N	9	9	0	MarginAmount
12	Numero de Registros R01	N	9	9	0	CollateralAmountGrp
13	Numero de Registros R02	N	9	9	0	Num PayCollectGrp
14	Numero de Registros R03	N	9	9	0	RiskLimit
FIN DATOS CABECERA						
MARGINAMOUNT (R00)						
15	MarginAmt	N S	15	13	2	Importe Garantía
16	MarginAmtType	N	3	3	0	Tipo de Garantía Account Summary Report a nivel de Miembro Compensador : Ver Tabla 10 del documento "Tablas de Codificación" Account Summary Report a nivel de Cuenta de Garantías y a nivel de Cuenta de Colateral: 201 - Garantía por Posición por Cuenta
17	Margin Amount Market SegmentID	A	2			Código de Segmento de la ECC Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación" Informado en Account Summary Report a nivel de Cuenta de Garantías y a nivel de Miembro Compensador
18	MarginAmountMarketID	A	2			Código de la ECC Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"
19	CCD	A	4			Código Cliente Compensador Directo Patrocinado. Sólo aplica si MarginAmtType es 114. Informado en Account Summary Report a nivel de Miembro Compensador.
FIN MARGINAMOUNT (R00)						
COLLATERALAMOUNTGRP (R01)						
20	CollateralType	A	1			Tipo de garantía depositada Ver Tabla 12 en el documento "Tablas de Codificación"

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
21	CollateralAmount	N S	15	13	2	Importe de la garantía depositada
22	CollateralAmountMarketID	A	2			Código de la ECC Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"
FIN COLLATERAL AMOUNTGRP (R01)						
PAYCOLLECTGRP (R02)						
23	PayCollectType	A	3			Tipo de importe del movimiento de efectivo Ver Tabla 11 del documento "Tablas de Codificación"
24	PayAmount	N S	15	13	2	Importe del movimiento de efectivo
25	PayCollectMarketSegmentID	A	2			Código de Segmento de la ECC Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"
26	PayCollectMarketID	A	2			Código de la ECC Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"
27	CashMovGroup	A	8			Grupo de movimientos de efectivo asociados al Agente de Pagos
FIN PAYCOLLECTGRP (R02)						
RISK LIMIT (R03)						
28	RiskLimitType	A	3			Tipo de información relativa al Riesgo: 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 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

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
29	RiskLimitAmount	N S	15	13	2	Importe
30	Margin AmountMarket SegmentID	A	2			Código de Segmento de la ECC Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación"
31	Margin Amount ID	A	2			Código de la ECC Ver Tabla 6 del documento "Tablas de Codificación"
FIN RISKLIMIT (R03)						

6.5.2 GA02 - Solicitud Límite de Riesgo Intradía (Margin requirement inquiry)

GA02 - SOLICITUD LÍMITE DE RIESGO INTRADÍA (MARGIN REQUIREMENT INQUIRY)	
Descripción	Enviado por el Miembro Compensador para solicitar el Límite de Riesgo Intradía y Riesgo por Cuenta
Emisor	Miembros ECC (Miembro Compensador)
Destinatarios	ECC

En la siguiente tabla se describe con más detalle la estructura del registro GA02:

Longitud del registro: Variable

T=tipo / L=longitud / E=enteros / D=decimales

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
DATOS CABECERA						
1	Cabecera mensajería Propietaria	A	100			
DATOS COMUNES						
2	MarginReqmtInqID	A	10			Identificador de la solicitud
3	Clearing Firm	A	4			
4	Collateral Firm	A	4			Miembro de la Cuenta de Colateral
5	Collateral Account	A	3			Informado: Margin requirement inquiry a nivel de Cuenta Puede contener “-” para solicitar el riesgo de la Cuenta Propia del Miembro No informado: Margin requirement inquiry a nivel de Miembro
FIN DATOS COMUNES						
6	Código Error	A	3			MarginReqmtInqStatus
7	Texto Error	A	40			Texto explicativo del Error

6.5.3 GA03 - Límite de Riesgo Intradía/Garantías Extraordinarias (Margin requirement report)

GA03 - LÍMITE DE RIESGO INTRADÍA/GARANTÍAS EXTRAORDINARIAS (MARGIN REQUIREMENT REPORT)	
Descripción	Enviado como respuesta a un Margin Requirement Inquiry del Miembro Compensador (Límite de Riesgo Intradía y Riesgo por Cuenta) y de forma no solicitada por el Miembro sino por la propia ECC (Garantías Extraordinarias por Margin Call)
Emisor	ECC
Destinatarios	Miembros ECC (Miembro Compensador)

El registro GA03 se compone de los siguientes bloques:

BLOQUE	DESCRIPCIÓN/CONTENIDO
R00	Bloque MarginAmountData
R01	Bloque RiskLimitType

En la siguiente tabla se describe con más detalle la estructura del registro GA03:

	R00	R01	OBSERVACIONES
Límite de Riesgo Intradía y Riesgo por Cuenta	0/n	0/n	

Longitud del registro: Variable

T=tipo / L=longitud / E=enteros / D=decimales

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
DATOS CABECERA						
1	Cabecera mensajería Propietaria	A	100			
2	MarginReqmtRptID	A	20			Identificador único para cada mensaje
3	MarginReqmtInqID	A	10			Identificador de la solicitud enviado por el aplicativo cliente Presente cuando la solicitud es un mensaje Margin Requirement Inquiry
4	MarginReqmtRptType	N	1	1	0	Valor valido = 0 – Summary
5	Currency	A	3			Código de divisa en la que están expresados los importes de este mensaje. Expresada según estándar ISO 4217
6	Collateral Firm	A	4			Miembro de la Cuenta de Colateral
7	Clearing Firm	A	4			

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
8	Collateral Account	A	3			Informado: Margin requirement report a nivel de Cuenta Contiene “-” para la Cuenta Propia del Miembro. No informado: Margin requirement report a nivel de Miembro
9	Numero de Registros R00 NumMarginAmountData	N	9	9	0	Número de ocurrencias del bloque indicado
10	Numero de Registros R01 NumRiskLimitType	N	9	9	0	Número de ocurrencias del bloque indicado
MARGINAMOUNTDATA (R00)						
11	MarginAmt	N S	15	13	2	Importe de Riesgo o Garantía Exigida
12	MarginAmtType	N	3	3	0	Tipo de Garantía: 105 – Consumo de Límite de Riesgo Intradía 106 - Garantías Extraordinarias por Margin Call 201 - Riesgo por Cuenta 202 – Garantía exigida por Cuenta
13	MarginAmountMarketID	A	2			Código de la ECC Ver Tabla 6 del documento “Tablas de Codificación”
FIN MARGINAMOUNTDATA (R00)						
RISKLIMITTYPE (R01)						
14	RiskLimitAmount	N	15	13	2	Importe Límite Riesgo por Compensador o Garantía Depositada por Cuenta
15	RiskLimitType	N	3	3	0	105 = Límite de Riesgo Intradía asignado 202 = Garantía depositada por Cuenta
16	MarginAmountMarketID	A	2			Código de la ECC Ver Tabla 6 del documento “Tablas de Codificación”
FIN RISKLIMITTYPE (R01)						

6.5.4 GA04 - Detalle Garantías Depositadas (Collateral report)

GA04 – DETALLE GARANTÍAS DEPOSITADAS (COLLATERAL REPORT)	
Descripción	Enviado por ECC para informar del detalle de las Garantías Depositadas
Emisor	ECC
Destinatarios	Miembros ECC (Miembro Compensador)

En la siguiente tabla se describe con más detalle la estructura del registro GA04:

	R00	OBSERVACIONES
Detalle de las Garantías Depositadas	n	

Longitud del registro: Variable

T=tipo / L=longitud / E=enteros / D=decimales

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
DATOS CABECERA						
1	Cabecera mensajería Propietaria	A	100			
2	CollRptID	A	20			Identificador único para cada mensaje Collateral Report
DATOS COMUNES						
3	Collateral Firm	A	4			Miembro al que pertenece la Cuenta de Colateral
4	Clearing Firm	A	4			Miembro Compensador

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
						Cuenta de Colateral
						• Collateral Report a nivel de Miembro Compensador: sólo se informará el Clearing Firm.
5	Collateral Account	A	3			• Collateral Report a nivel de Miembro al que pertenece la Cuenta de Colateral: se informará el Collateral Firm y el Clearing Firm.
						• Collateral Report a nivel de Cuenta de Colateral: se informará el Collateral Firm, el Clearing Firm y el Collateral Account
6	Symbol	A	5			
7	SecurityID	A	12			Código ISIN del activo entregado
8	InstrRegistry	A	1			Código del Depositario Central del activo en el que está constituida la garantía en valores o del Banco en el que está depositado el efectivo. Ver tabla 13, para colateral en valores, o Tabla 18, para efectivo del documento "Tablas de Codificación"
9	Nominal	N	18	12	6	Valor nominal del activo entregado. En caso de acciones es el número de títulos.
10	Currency	A	3			Codificación ISO4217
11	Numero de Registros R00	N	9	9	0	Número de ocurrencias del bloque indicado
FIN DATOS COMUNES						
GARANTIAS DEPOSITADAS (R00)						
12	MARGIN_INST	A	1			Indica el modo de materialización de Garantías Ver tabla 12 del documento "Tablas de Codificación"
13	ASSET_TYPE	A	3			Indica el tipo de activo entregado Ver tabla 14 del documento "Tablas de Codificación"
14	HAIRCUT	N	11	7	4	Indica el coeficiente que se aplica al precio en la valoración del activo (en tanto por ciento)
15	ASSET_PRICE	N	11	7	4	Indica el precio del activo al cierre. Para los bonos y obligaciones incluye cupón corrido

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
16	ASSET_VALUE	N	18	12	6	Indica el valor del activo: (Nominal * precio * haircut) / Tipo de cambio.
17	NOMINAL_CURRENCY	A	3			indica la divisa en la que está expresado el Nominal. Codificación ISO4217
18	EXCHANGE_RATE	N				indica el Tipo de cambio aplicable.
FIN GARANTIAS DEPOSITADAS (R00)						

7. Retención y Liberación de Operaciones

Las Entidades Participantes podrán realizar la gestión de Retención y Liberación de operaciones de venta anotadas en cuentas de la ECC para las que estén designadas como Entidades Participantes, mediante el formato OP. La ECC notificará el resultado de la retención o liberación de operaciones mediante el formato MO, e informará de la actualización de datos de la operación retenida mediante un mensaje AN.

Sólo se podrán retener operaciones hasta el saldo neto vendedor de una cuenta en neto o todas las operaciones de venta de cuentas en bruto.

Este capítulo sólo aplica al segmento de Renta Variable.

A continuación se relacionan los mensajes utilizados, junto con el emisor y receptor de los mismos:

a) Retención/liberación aceptada por la ECC

EMISOR	RECEPTOR	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
Entidad Participante	ECC	OP	R00+R01	La Entidad Participante efectúa la Retención/Liberación de operaciones en la ECC
ECC	Miembro Miembro Compensador Entidad Participante	MO	R05	Notificación de Retención o Liberación de operaciones
ECC	Miembro Miembro Compensador Entidad Participante	AN	R00+R01	Actualización de operación retenida/liberada

b) Retención/Liberación rechazada por la ECC:

EMISOR	RECEPTOR	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
Entidad Participante	ECC	OP	R00+R01	La Entidad Participante efectúa la Retención/ Liberación de operaciones en la ECC
ECC	Miembro Miembro Compensador Entidad Participante	MO	R05	Notificación de Retención o Liberación de operaciones
ECC	Miembro Miembro Compensador Entidad Participante	AN	R00+R01	Actualización de operación retenida/liberada

7.1 Uso del campo Referencia de Movimiento

En la Gestión de Retención/Liberación de operaciones se utilizan una serie de referencias que permiten correlacionar la mensajería emitida por la Entidad Participante con las respuestas y notificaciones emitidas por la ECC. A continuación se describen dichas referencias:

Referencia de Movimiento:

- Referencia asignada por la Entidad Participante en cada mensaje emitido OP.
- Permite relacionar la Retención/Liberación realizada por la Entidad Participantes con las notificaciones comunicadas por la ECC
- Tiene una longitud máxima de 10 caracteres, de las cuales las primeras 2 posiciones deben de ser informadas con el identificador del mensaje: OP

Referencia de Movimiento ECC:

- Referencia asignada por la ECC para cualquier solicitud de Retención/Liberación.
- Esta Referencia se informa en los mensajes de notificación del estado de la Retención/Liberación (MO).
- Tiene una longitud máxima de 10 caracteres.

7.2 Flujo de mensajes

7.2.1 Flujo en la Retención de Operaciones (aceptadas por la ECC)

Aplicaciones Externas → Gate → ECC

OP	R00				R01
Entidad Participante XXX	Acción	Referencia Movimiento	Resto Datos	Error	Datos Bloque R01
	RO	xx	xxxxxx	n/a	OP1

Aplicaciones ← Gate ← ECC

Externas

MO	R05					
Entidad Participante XXX	Refer. Movimiento	Refer. Movimiento ECC	Referencia Notificación	Tipo Mvto	Num.Operación	Resto datos
	xx	M0001	0001	RO	OP1	nnnnnnnnnnnnnnnnnn

MO	R05					
Miembro	Refer. Movimiento	Refer. Movimiento ECC	Referencia Notificación	Tipo Mvto	Num.Operación	Resto datos
	xx	M0001	0001	RO	OP1	nnnnnnnnnnnnnnnnnn

MO	R05					
Miembro Compensador	Refer. Movimiento	Refer. Movimiento ECC	Referencia Notificación	Tipo Mvto	Num.Operación	Resto datos
	xx	M0001	0001	RO	OP1	nnnnnnnnnnnnnnnnnn

Notificación de actualización de operación

AN	R00	R01
Entidad Participante	Datos Generales	Datos Operación OP1
		Tipo Anotación 2(actualización)

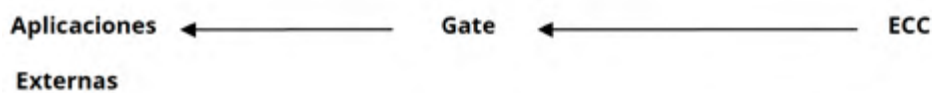
AN	R00	R01
Miembro	Datos Generales	Datos Operación OP1
		Tipo Anotación 2(actualización)

AN	R00	R01
Miembro Compensador	Datos Generales	Datos Operación OP1
		Tipo Anotación 2(actualización)

7.2.2 Flujo en la Retención de Operaciones (rechazada por la ECC)

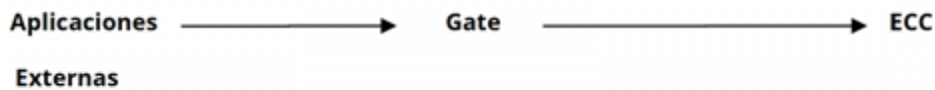


OP	R00				R01
Entidad Participante XXX	Acción	Referencia Movimiento	Resto Datos	Error	Datos Bloque R01
	RO	xx	xxxxx	n/a	OP1

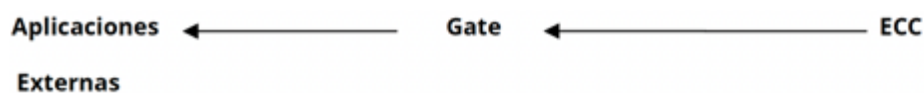


OP	R00				
Entidad Participante XXX	Acción	Referencia Movimiento	Resto Datos	Error	
	RO	xx	n/a	ERROR	

7.2.3 Flujo en la Liberación de Operaciones (aceptadas por la ECC)



OP	R00				R01
Entidad Participante XXX	Acción	Referencia Movimiento	Resto Datos	Error	Datos Bloque R01
	LO	xx	xxxxx	n/a	OP1



MO	R05					
Entidad Participante XXX	Refer. Movimiento	Refer. Movimiento ECC	Referencia Notificación	Tipo Mvto	Num.Operación	Resto datos
	xx	M0001	0001	LO	OP1	nnnnnnnnnnnnnnnnnn

MO	R05					
Miembro	Refer. Movimiento	Refer. Movimiento ECC	Referencia Notificación	Tipo Mvto	Num.Operación	Resto datos
	xx	M0001	0001	LO	OP1	nnnnnnnnnnnnnnnnnn

MO	R05					
Miembro Compensador	Refer. Movimiento	Refer. Movimiento ECC	Referencia Notificación	Tipo Mvto	Num.Operación	Resto datos
	xx	M0001	0001	LO	OP1	nnnnnnnnnnnnnnnnnn

Notificación de actualización de operación

AN	R00	R01
Entidad Participante	Datos Generales	Datos Operación OP1
		Tipo Anotación 2(actualización)

AN	R00	R01
Miembro	Datos Generales	Datos Operación OP1
		Tipo Anotación 2(actualización)

AN	R00	R01
Miembro Compensador	Datos Generales	Datos Operación OP1
		Tipo Anotación 2(actualización)

7.2.4 Flujo en la Liberación de Operaciones (rechazada por la ECC)

Aplicaciones Externas → Gate → ECC

OP	R00				R01
Entidad Participante XXX	Acción	Referencia Movimiento	Resto Datos	Error	Datos Bloque R01
	LO	xx	xxxxx	n/a	OP1

Aplicaciones Externas ← Gate ← ECC

OP	R00			
Entidad Participante XXX	Acción	Referencia Movimiento	Resto Datos	Error
	LO	xx	n/a	ERROR

7.3 Definición de mensajes

7.3.1 OP - Gestión de Operaciones de venta para la liquidación

OP – GESTIÓN DE OPERACIONES: RETENCIÓN/LIBERACIÓN DE OPERACIONES	
Descripción	Este formato se empleará para gestionar la Retención y Liberación de Operaciones
Emisor	Entidades Participantes
Destinatarios	ECC

El registro OP se compone de los siguientes bloques:

BLOQUE	DESCRIPCIÓN/CONTENIDO
R00	Identificación Retención/Liberación
R01	Detalle Operación

En la siguiente tabla se describe con más detalle la estructura del registro OP:

	R00	R01	OBSERVACIONES
Retención y Liberación de Operaciones	1	0/1	

Longitud del registro: Variable

T=tipo / L=longitud / E=enteros / D=decimales

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
DATOS CABECERA						
1	Cabecera mensajería Propietaria	A	100			
Datos de Control Bloques						
2	Número de Registros R00	N	2	2		Identificación Retención/Liberación
3	Número de Registros R01	N	2	2		Detalle Operaciones
4	Código Error	A	3			
5	Texto Error	A	40			Texto explicativo del Error
FIN DATOS CABECERA						

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
IDENTIFICACIÓN RETENCIÓN/ LIBERACIÓN (R00)						
6	Referencia Movimiento	A	10			Identificador único asignado por la Entidad que solicita la Retención /Liberación de Operaciones Las dos primeras posiciones han de contener el valor: OP
7	Actuación	A				Actuación a realizar en la Gestión de Operaciones: RO: Retención de Operación LO: Liberación de Operación
8	Fecha Teórica de Liquidación	A				AAAAMMDD
9	Sentido	A				2 (Venta)
FIN IDENTIFICACIÓN RETENCIÓN/LIBERACIÓN (R00)						
DATOS OPERACIÓN (R01)						
10	Número Operación	A				Número Operación sobre el que se efectúa la retención o liberación.
11	Número Valores / Importe Nominal	N				Número Valores / Importe Nominal a Retener/Liberar
FIN DATOS OPERACIÓN (R01)						

7.3.2 MO - Notificación de Retención / Liberación de Operaciones

MO – MOVIMIENTO DE OPERACIONES ENTRE CUENTAS DE POSICIÓN	
Descripción	Este formato se empleará para notificar la Retención y Liberación de Operaciones
Emisor	ECC
Destinatarios	Miembros ECC

El registro MO se compone de varios bloques, en la notificación de retención/liberación de operaciones se informará el bloque:

BLOQUE	DESCRIPCIÓN/CONTENIDO
R05	Notificación de retención y liberación de operaciones

En la siguiente tabla se describe con más detalle la estructura del registro MO:

	R00	R01	R02	R03	R04	R05	OBSERVACIONES
Notificación de Retención y Liberación de Operaciones	0	0	0	0	0	1	

La descripción detallada del registro MO se describe en el apartado “Asignación de Operaciones”.

8. Compensación e Instrucciones de Liquidación

La ECC deberá generar las correspondientes Instrucciones de Liquidación de forma previa al ciclo nocturno o en cada Ventana de Agregación que se establezca.

Antes del primer ciclo de liquidación, la ECC convertirá las operaciones registradas individualmente en Instrucciones de Liquidación:

- En cuentas brutas agregará el saldo comprador por un lado y el saldo vendedor por otro, generando dos Instrucciones de Liquidación.
- En cuentas netas calculará el saldo neto, generando una única Instrucción de Liquidación.
- Descontará el volumen retenido de las operaciones, a la espera de su liberación.

La agregación en cuentas brutas o neteo en cuentas netas se realizará teniendo en cuenta las operaciones de compraventa de la misma Cuenta de Posición, Valor, Fecha de Contratación (sólo en RV) y Fecha de Liquidación.

El funcionamiento es diferente en función del ciclo de liquidación:

- Al final de una sesión D, para el 1er ciclo de D+1, la ECC enviará los siguientes mensajes:
 - Un mensaje de aviso (TXT) indicando el inicio y el fin del proceso de compensación (neteo o agregación, según el tipo de cuenta) correspondiente al 1er ciclo de liquidación de D+1.

- Los mensajes relacionados con aquellas operaciones que queden pendientes de liquidar en D+1 a consecuencia de dicho proceso. Es decir:
- Los mensajes de anotación de operación (formato AN) correspondientes a las instrucciones generadas, que se enviarán a liquidar en el 1er ciclo de D+1.
- Los mensajes de anotación de operación (AN) de cierre de las operaciones que queden retenidas parcialmente.
- Los mensajes de actualización de operación (AN) correspondientes a las operaciones que queden retenidas total o parcialmente, a la espera de ser liberadas en D+1. En cuentas netas, el volumen retenido total de todas ellas será como máximo el saldo neto vendedor.

Las operaciones originales con fecha teórica de liquidación D+1 tenidas en cuenta en el proceso de compensación quedan sustituidas por las informadas en este bloque. No se generan mensajes AN de actualización de las operaciones que hayan quedado totalmente incluidas en las instrucciones creadas al final de la sesión D.

- Durante la sesión D+1, para la 2ª y posteriores Ventanas de Agregación de D+1, la ECC enviará los siguientes mensajes:
 - Un mensaje de aviso (TXT) indicando el inicio y el fin del proceso de compensación (neteo o agregación, según el tipo de cuenta) correspondiente a cada Ventana de Agregación de D+1.
 - Los mensajes de anotación de operación (AN) correspondientes a las nuevas instrucciones de liquidación generadas, que se enviarán a liquidar inmediatamente.
 - Los mensajes de anotación de operación (AN) correspondientes al cierre de las operaciones que han sido liberadas total o parcialmente desde la ventana anterior.
 - Los mensajes de actualización de operación (AN) correspondientes a la actualización del volumen y efectivo vivo de las operaciones que han sido liberadas total o parcialmente.

A continuación se relacionan los mensajes utilizados, junto con el emisor y receptor de los mismos:

Final de una sesión D, para el 1er ciclo de D+1

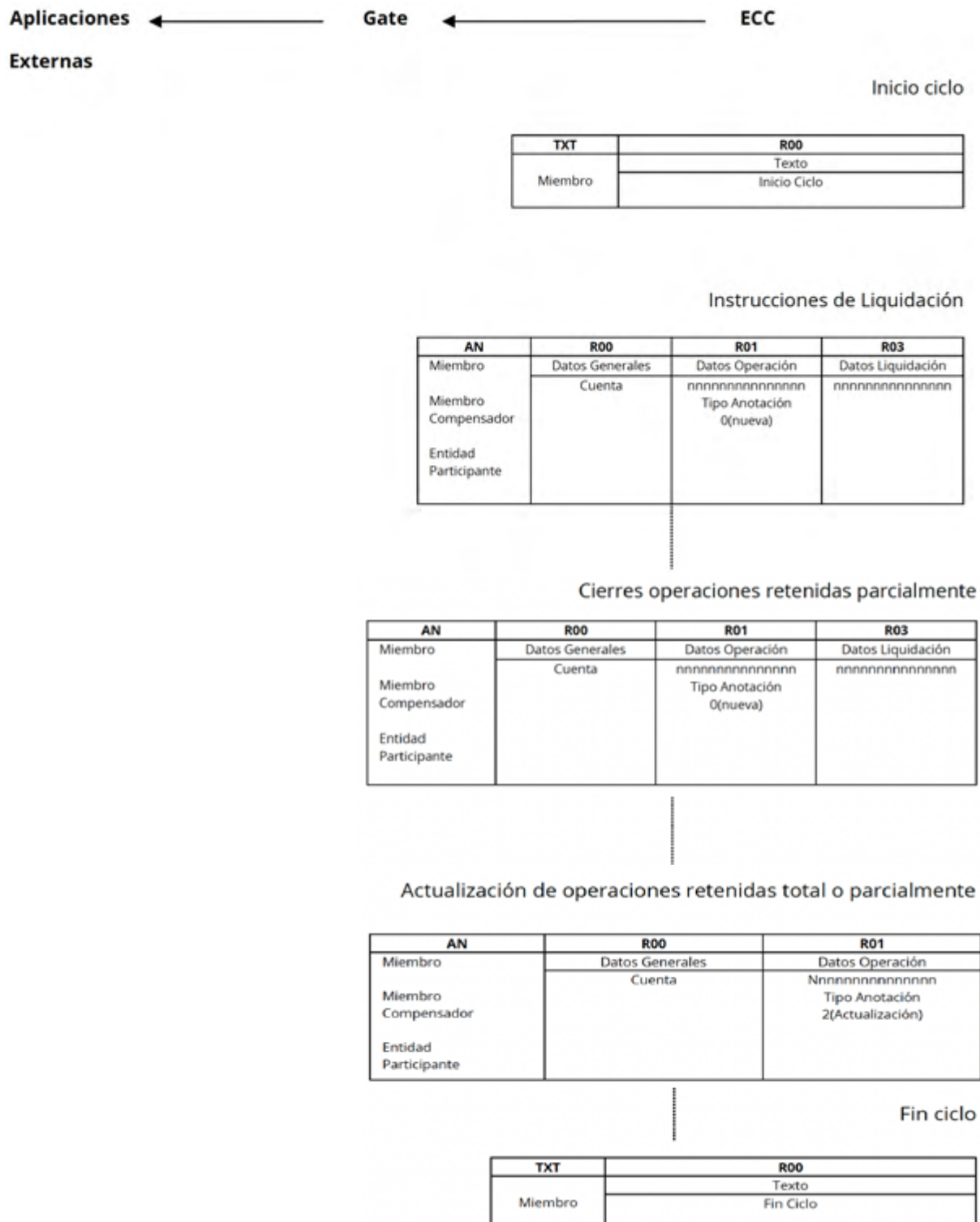
EMISOR	RECEPTOR	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
ECC	Miembro Miembro Compensador Entidad Participante	TXT	R00	Texto Informativo Inicio Ciclo
ECC	Miembro Miembro Compensador Entidad Participante	AN	R00+R01+R03	Instrucciones de Liquidación (Operación tipo "3")
ECC	Miembro Miembro Compensador Entidad Participante	AN	R00+R01	Cierre de operaciones retenidas parcialmente (Operación tipo "N")
ECC	Miembro Miembro Compensador Entidad Participante	AN	R00+R01	Actualización de operaciones retenidas total o parcialmente
ECC	Miembro Miembro Compensador Entidad Participante	TXT	R00	Texto Informativo Fin Ciclo

Durante la sesión D+1, para la 2ª y posteriores ventanas de agregación:

EMISOR	RECEPTOR	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
ECC	Miembro Miembro Compensador Entidad Participante	TXT	R00	Texto Informativo Inicio Ciclo
ECC	Miembro Miembro Compensador Entidad Participante	AN	R00+R01+R03	Instrucciones de Liquidación (Operación tipo "3")
ECC	Miembro Miembro Compensador Entidad Participante	AN	R00+R01	Cierre de operaciones liberadas (Operación tipo "N")
ECC	Miembro Miembro Compensador Entidad Participante	AN	R00+R01	Actualización de operaciones liberadas total o parcialmente
ECC	Miembro Miembro Compensador Entidad Participante	TXT	R00	Texto Informativo Fin Ciclo

8.1 Flujos de mensajes

8.1.1 Flujo en la compensación y obtención de Instrucciones de Liquidación Primer ciclo



8.2 Definición de mensajes

La definición detallada del mensaje AN se describe en el capítulo "Seguimiento de la Operativa".

9. Liquidaciones y fallidos

Durante la sesión, la ECC informará de las Instrucciones liquidadas en el DCV a lo largo de la sesión de liquidación.

Para las Instrucciones no liquidadas, se intentará su liquidación hasta la fecha en que, si esto no es posible, se inicie el procedimiento de recompra.

9.1 Liquidación de Instrucciones

Al final del primer ciclo de liquidación y luego en tiempo real, la ECC enviará la información de las Instrucciones que hayan sido liquidadas en el DCV:

- La ECC generará operaciones de liquidación referenciadas a las Instrucciones liquidadas, de modo que el saldo vivo para Garantías disminuya.
- La ECC generará mensajes de actualización de operaciones, formato AN, para las Instrucciones liquidadas.

A continuación se relacionan los mensajes utilizados, junto con el emisor y receptor de los mismos:

EMISOR	RECEPTOR	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
ECC	Miembro Miembro Compensador Entidad Participante	AN	R00+R01+R03	Liquidación de Instrucciones (Operación tipo "B")
ECC	Miembro Miembro Compensador Entidad Participante	AN	R00+R01	Actualización de la operación liquidada

9.2 Procedimiento de Recompra (Buy-in)

La gestión de recompras se realizará siguiendo el procedimiento indicado en las Circulares emitidas por BME Clearing que correspondan a esta temática.

La ECC compra los valores, pudiendo liquidar la instrucción compradora afectada. El vendedor fallido recibirá un cargo en efectivo por la diferencia entre el efectivo inicial y el efectivo de la recompra.

La ECC notificará la anotación de una operación (tipo operación '6' recompra), mediante el formato AN. Una vez liquidada la operación de "recompra", la ECC informará una actualización de la operación de recompra, formato AN.

A continuación se relacionan los mensajes utilizados, junto con el emisor y receptor de los mismos:

EMISOR	RECEPTOR	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
ECC	Miembro Miembro Compensador Entidad Participante	AN	R00+R01+R03	Recompra (Buy-in) (Operación tipo "6")
ECC	Miembro Miembro Compensador Entidad Participante	AN	R00+R01	Actualización de la operación por: Liquidación de recompra

9.3 Liquidación de Efectivo

Si no es posible realizar la recompra, se realizará la liquidación en efectivo de las Instrucciones pendientes:

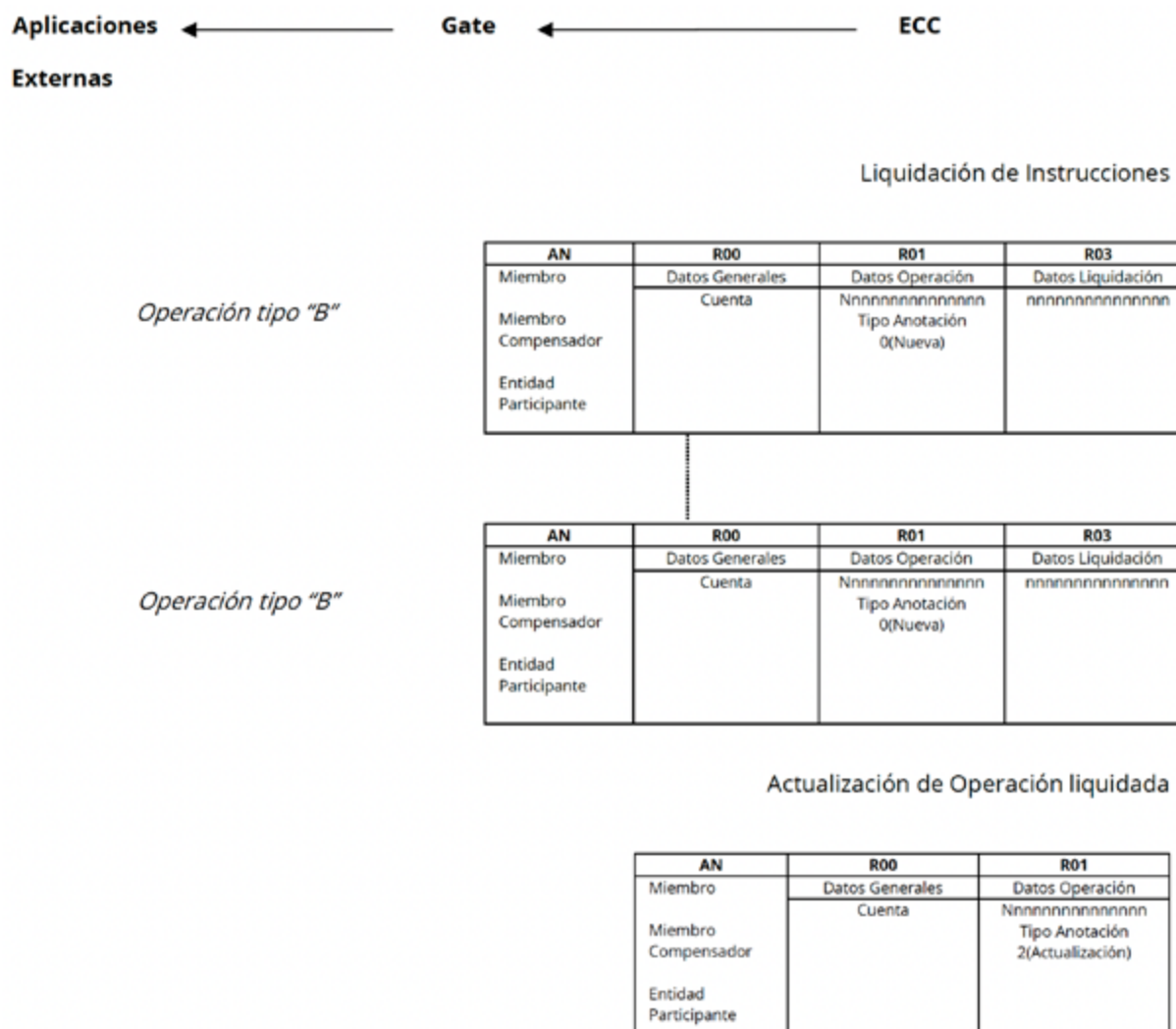
- Se enviarán Instrucciones en efectivo al comprador y vendedor afectados.
- Una vez liquidada las instrucciones en efectivo, la ECC informará una actualización de la instrucción de efectivo, formato AN.

A continuación se relacionan los mensajes utilizados, junto con el emisor y receptor de los mismos:

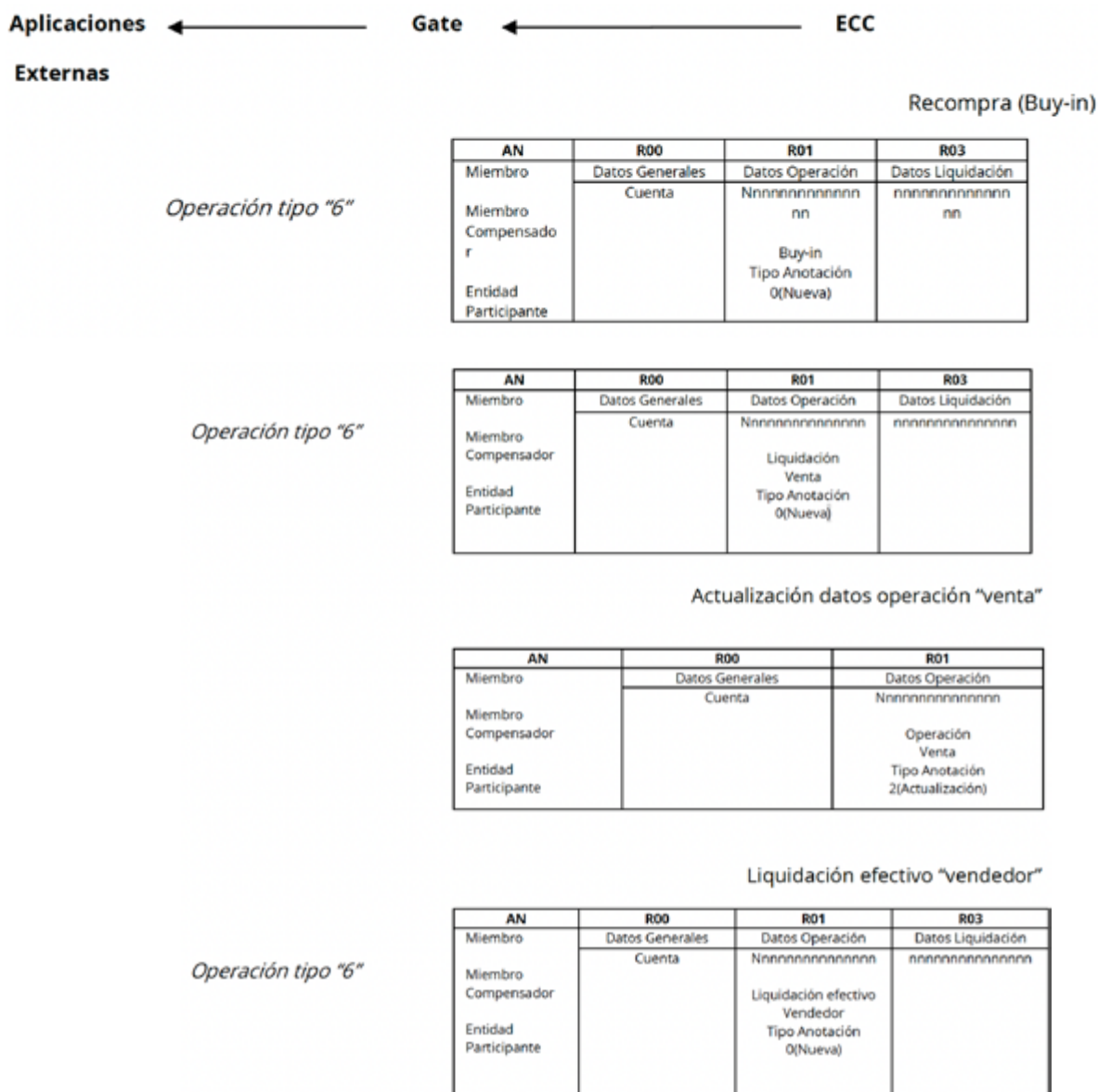
EMISOR	RECEPTOR	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
ECC	Miembro Miembro Compensador Entidad Participante	AN	R00+R01+R03	Liquidación en efectivo (Operación tipo “7”)
ECC	Miembro Miembro Compensador Entidad Participante	AN	R00+R01	Actualización de la operación: Liquidación en efectivo

9.4 Flujos de mensajes

9.4.1 Flujo en la Liquidación de Instrucciones



9.4.2 Flujo en la Recompra (Buy-in)



Este flujo se complementa con los mensajes AN, generados por la ECC, notificando el registro de nuevas operaciones por liquidaciones de operaciones de recompra, liquidación de efectivo y de la compra afectada, todas estas operaciones son de tipo de operación "B". La actualización de las operaciones liquidadas se informará con los mensajes AN.

9.4.3 Flujo en Liquidación en efectivo



Liquidación operación compra

Operación tipo "7"

AN	R00	R01	R03
Miembro	Datos Generales	Datos Operación	Datos Liquidación
Miembro Compensador	Cuenta	Nnnnnnnnnnnnnnnnn	nnnnnnnnnnnnnnnn
Entidad Participante		Liquidación Compra Tipo Anotación 0(Nueva)	

Actualización datos operación "compra"

AN	R00	R01
Miembro	Datos Generales	Datos Operación
Miembro Compensador	Cuenta	Nnnnnnnnnnnnnnnnn
Entidad Participante		Operación Compra Tipo Anotación 2(Actualización)

Liquidación operación venta

Operación tipo "7"

AN	R00	R01	R03
Miembro	Datos Generales	Datos Operación	Datos Liquidación
Miembro Compensador	Cuenta	Nnnnnnnnnnnnnnnnn	nnnnnnnnnnnnnnnn
Entidad Participante		Liquidación Venta Tipo Anotación 0(Nueva)	

Actualización datos operación "venta"

AN	R00	R01
Miembro	Datos Generales	Datos Operación
Miembro Compensador	Cuenta	Nnnnnnnnnnnnnnnnn
Entidad Participante		Operación Venta Tipo Anotación 2(Actualización)

Liquidación en efectivo operación compra

Operación tipo "7"

AN	R00	R01	R03
Miembro	Datos Generales	Datos Operación	Datos Liquidación
Miembro Compensador	Cuenta	Nnnnnnnnnnnnnnnnn	nnnnnnnnnnnnnnnn
Entidad Participante		Liquidación en efectivo Compra Tipo Anotación 0(Nueva)	

Operación tipo "7"

Liquidación en efectivo operación venta

AN	R00	R01	R03
Miembro	Datos Generales	Datos Operación	Datos Liquidación
Miembro Compensador	Cuenta	Nnnnnnnnnnnnnnnnn	nnnnnnnnnnnnnnnn
Entidad Participante		Liquidación en efectivo Venta Tipo Anotación 0(Nueva)	

Este flujo se complementa con los mensajes AN, generados por la ECC, notificando el registro de nuevas operaciones (tipo de operación "B") por liquidación de operaciones en efectivo. La actualización de las operaciones liquidadas se informará con los mensajes AN.

9.5 Definición de mensajes

La definición detallada del mensaje AN se describe en el capítulo "Seguimiento de la Operativa".

10. Eventos Corporativos

Los eventos corporativos sólo afectarán a instrucciones fallidas. La ECC informará a las aplicaciones cliente de las Instrucciones de Liquidación generadas como consecuencia de un evento. La ECC informará de las instrucciones que a su vez le son enviadas por el DCV.

En función del tipo de evento, los ajustes generados por compraventas fallidas serán diferentes:

- Para eventos de distribución (Market Claims) se generarán nuevas instrucciones.
- Para eventos de reorganización (Transformations) se cancelarán las instrucciones fallidas pendientes y se generarán nuevas.

A continuación se relacionan los mensajes utilizados, junto con el emisor y receptor de los mismos:

EMISOR	RECEPTOR	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
ECC	Miembro Miembro Compensador Entidad Participante	AN	R00+R01+R03	Ajustes por Eventos Corporativos

10.1 Flujos de mensajes

10.1.1 Flujo en Evento Corporativo de Distribución (Market Claim)



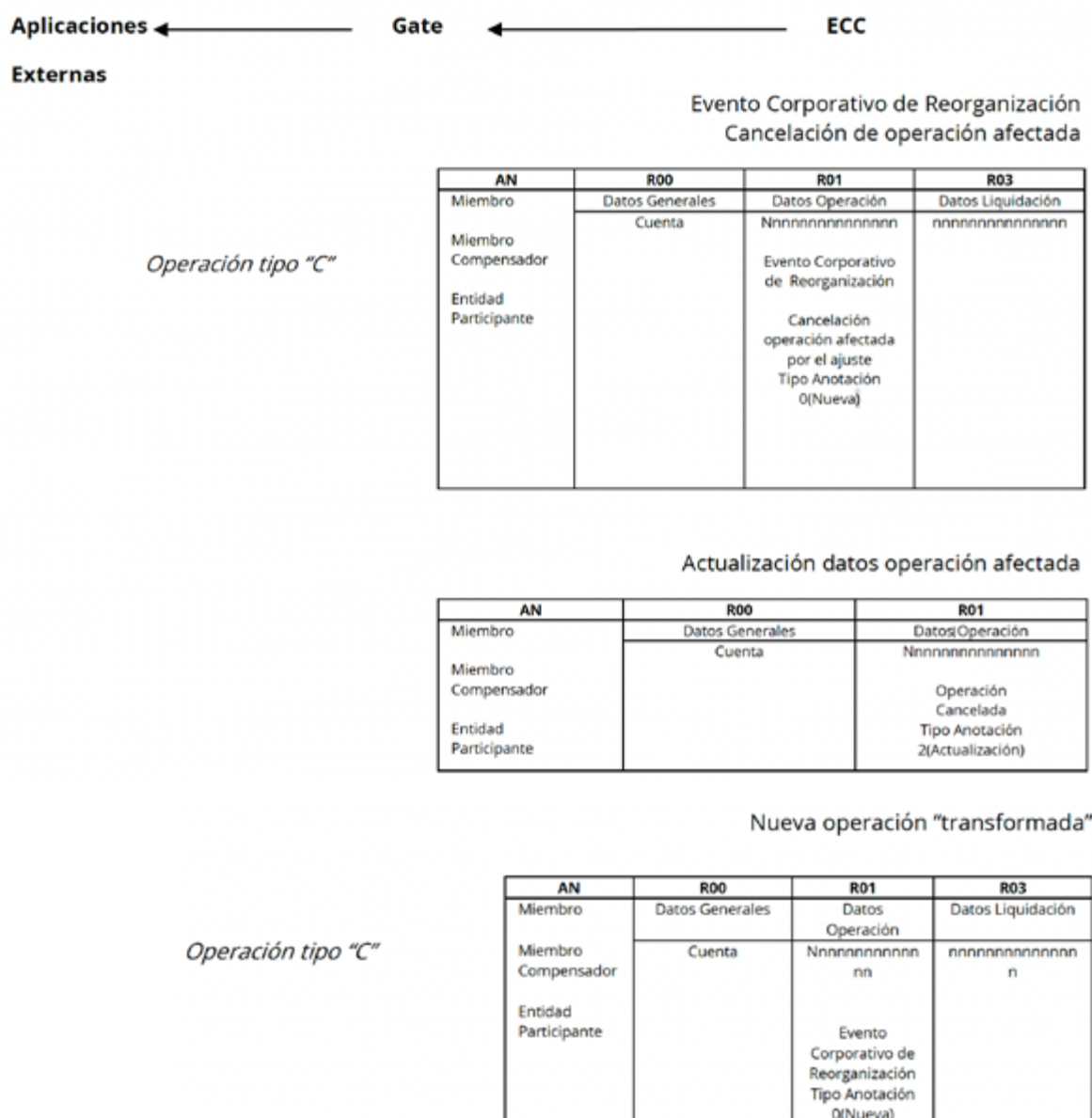
Evento Corporativo de Distribución

Operación tipo "C"

AN	R00	R01	R03
Miembro	Datos Generales	Datos Operación	Datos Liquidación
Miembro Compensador	Cuenta	Nnnnnnnnnnnnnnnnn	nnnnnnnnnnnnnnnnnn
Entidad Participante		Evento Corporativo de Distribución Tipo Anotación 0(Nueva)	

Este flujo se complementa con los mensajes AN, generados por la ECC, notificando el registro de nuevas operaciones (tipo de operación "B") por liquidaciones de operaciones de ajuste por eventos de distribución. La actualización de las operaciones liquidadas se informará con los mensajes AN.

10.1.2 Flujo en Evento Corporativo de Reorganización (Transformation)



Este flujo se complementa con los mensajes AN, generados por la ECC, notificando el registro de nuevas operaciones (tipo de operación "B") por liquidación de operaciones de ajuste por eventos de reorganización. La actualización de las operaciones liquidadas se informará con los mensajes AN.

10.2 Definición de mensajes

La definición detallada del mensaje AN se describe en el capítulo "Seguimiento de la Operativa".

11. Información de Valores

En este apartado se describe la funcionalidad ofrecida por la ECC para informar a todos sus Miembros acerca de los Valores admitidos en la ECC, mediante el mensaje VA.

Esta información es emitida por la ECC:

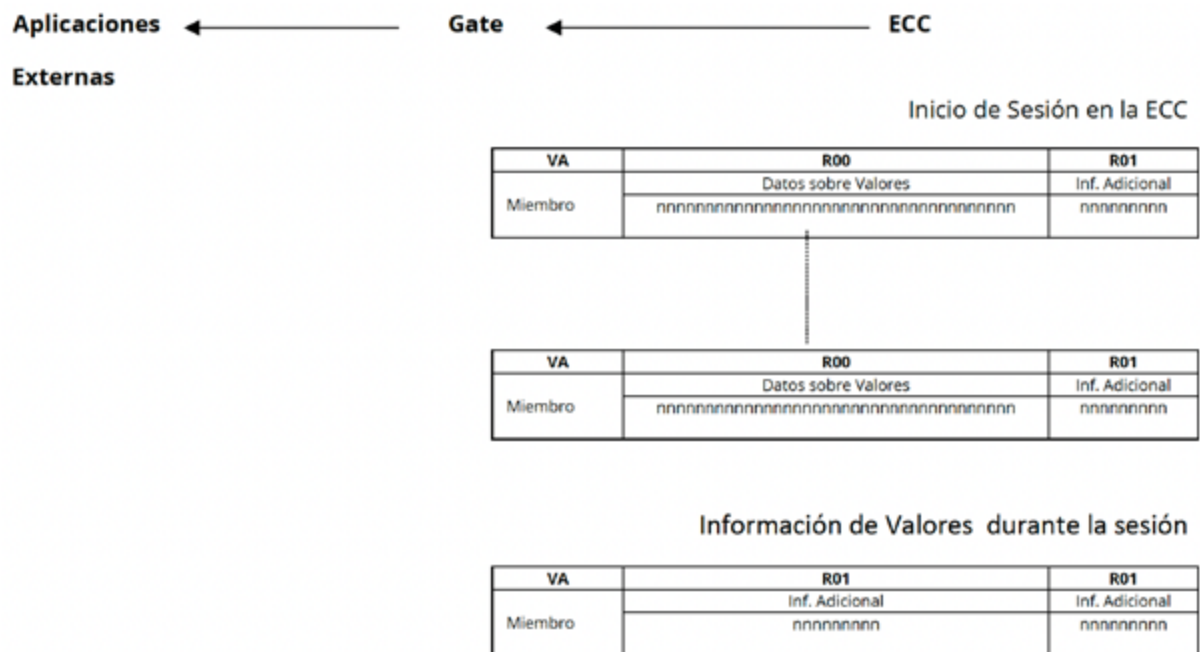
- Al inicio de cada sesión
- Durante la sesión, en el caso de que se produjera alguna modificación sobre Valores.

La información se difunde a todos los Miembros de la ECC.

A continuación se relacionan los mensajes utilizados, junto con el emisor y receptor de los mismos:

EMISOR	RECEPTOR	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
ECC	Miembro	VA	R00+nR01	Información de Valores

11.1 Flujo de mensajes



11.2 Definición de mensajes

11.2.1 Tipo de registro VA - Información de Valores

VA – INFORMACIÓN DE VALORES	
Descripción	Este formato se empleará para Comunicar información sobre los Valores de la ECC
Emisor	ECC
Destinatarios	Miembros ECC

El registro VA se compone de los siguientes bloques:

BLOQUE	DESCRIPCIÓN/CONTENIDO
R00	Información general del Valor
R01	Información adicional del Valor

En la siguiente tabla se describe con más detalle la estructura del registro VA:

	R00	R01	OBSERVACIONES
Información de Valores	1	n	

Longitud del registro: Variable

T=tipo / L=longitud / E=enteros / D=decimales

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
DATOS CABECERA						
1	Cabecera mensajería Propietaria	A	100			
Datos de Control Bloques						
2	Número de Registros R00	N	2	2		Información general del Valor
3	Número de Registros R01	N	2	2		Información adicional del Valor
FIN DATOS CABECERA						
INFORMACION GENERAL DEL VALOR (R00)						
4	Código de Valor	A	12			ISIN
5	Divisa	A	3			Codificación ISO4217
6	Descripción del Valor	A	80			
7	Descripción corta del Valor	A	22			
8	Código Contratación	A	5			Código de Valor utilizado para la contratación
9	Grupo de Valores	A	2			Ver Tabla 2 del documento "Tablas de Codificación"
10	Tipo de Producto	A	5			Ver Tabla 3 del documento "Tablas de Codificación"
11	Fecha Emisión	A	8			AAAAMMDD
12	Precio Ejercicio	N	13	7	6	Sólo para activos de Renta Variable Sólo se informa para Warrants En el resto de caso a espacios

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
13	Unidad de Contratación	N	18	12	6	Sólo para activos de Renta Variable Numero de acciones equivalentes a cada Valor
14	Estilo Ejercicio	A	1			Sólo para activos de Renta Variable Valores informados: A=Americano E=Europeo B=Bermudas O=Otros
15	Factor conversión	N	18	12	6	Sólo para activos de Renta Variable Factor multiplicativo para convertir unidades de precio a unidades monetarias
16	Ind. Call/Put	A	1			Sólo para activos de Renta Variable Valores informados: 0=Call 1=Put
17	Entidad Emisora/Gestora	A	11			Código de entidad emisora del Valor o de la Gestora
18	Cupón	N	5	2	3	Cupón en porcentaje del nominal. Sólo para activos de Renta Fija.
19	Fecha inicio devengo	A	8			AAAAMMDD Fecha en la que el activo empieza a devengar cupón. Sólo para activos de Renta Fija.
20	Grupo de compensación	A	12			Grupo de compensación del activo. Sólo para activos de Renta Fija.
21	CFICode	A	6			Clasificación del valor usado como colateral (estándar ISO 10692 Código CFI, 6 caracteres alfabéticos). Sólo para activos de Renta Fija.
22	Jurisdicción del Emisor	A	2			Jurisdicción del Emisor (código de país según estándar ISO 3166). Sólo para activos de Renta Fija.
FIN INFORMACION GENERAL DEL VALOR (R00)						
INFORMACION ADICIONAL DEL VALOR (R01)						

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
						Indica el tipo de información adicional suministrada: 100 = Barrera (turbo warrants) / Barrera inferior (Inlines) 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
23	Tipo Información Adicional	A	3			
24	Precio	N	13	7	6	Sólo se informa para los tipos de información: 100, 104, 105 y 122 En el resto de casos a espacios
25	Número de decimales	N	6	6	0	Sólo se informa para el tipo de información 114 En el resto de caso a espacios
26	Cod. DCV	A	11			Sólo se informa para el tipo de información 120 En el resto de caso a espacios
27	Fecha Ultimo día Negociación	A	8			Sólo se informa para el tipo de información 101 En el resto de caso a espacios
28	Periodicidad cupón	N	2	2	0	Sólo se informa para el tipo de información 201. Sólo para activos de Renta Fija. Contiene el nº de cupones al año. En el resto de caso a espacios

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
29	Método cálculo cupón corrido	A	1			Sólo se informa para el tipo de información 215. Sólo para activos de Renta Fija. Contiene el método de cálculo del c.corrido: 1=Actual/Actual 2=Actual/360 3 = Actual/365 En el resto de caso a espacios
30	Índice Base	N	8	3	5	Sólo se informa para el tipo de información 216. Sólo para activos de Renta Fija. Contiene el Índice Base.
31	Calidad del colateral	A	5			Sólo se informa para el tipo de información 217. Sólo para activos de Renta Fija. Contiene la calidad del colateral: 'INVG'-Grado de inversión 'NIVG'-Grado de especulación 'NOTR'-Sin Rating 'NOAP' - No aplica
32	LEI emisor	A	20			Sólo se informa para el tipo de información 218. Sólo para activos de Renta Fija. Contiene el LEI emisor
33	Tipo de colateral	A	5			Sólo se informa para el tipo de información 219. Sólo para activos de Renta Fija. Contiene el tipo de colateral: '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
FIN INFORMACION ADICIONAL DEL VALOR (R01)						

12. Información Precios de Valores

En este apartado se describe la funcionalidad ofrecida por la ECC para informar a todos sus miembros acerca de precios de cierre de los Valores admitidos en la ECC, mediante el mensaje PV.

Esta información es emitida por la ECC:

- Al inicio de cada sesión
- Al final de cada sesión.

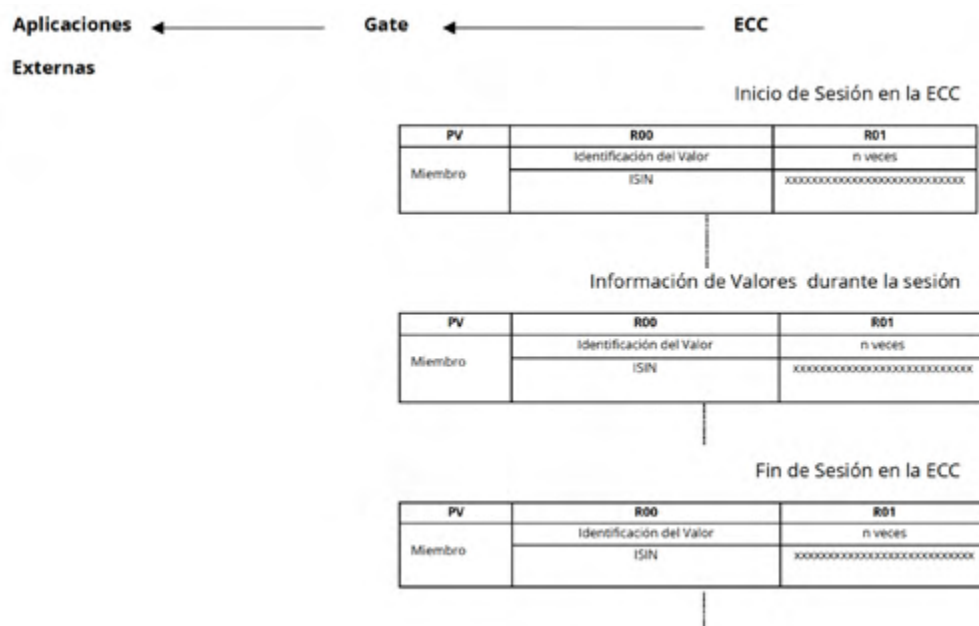
La información se difunde a todos los miembros de la ECC.

A continuación se relacionan los mensajes utilizados, junto con el emisor y receptor de los mismos:

ORIGEN	DESTINO	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
ECC	Miembro	PV	R00+nR01	Precios de Cierre de Valores

12.1 Flujo de mensajes

El flujo de mensajes de información de precios es:



12.2 Definición de mensajes

12.2.1 Tipo de registro PV - Información de precios

PV – INFORMACIÓN DE PRECIOS	
Descripción	Este formato se empleará para informar a los Miembros de la ECC los precios de cierre de los Valores admitidos en la ECC
Emisor	ECC
Destinatarios	Miembros ECC

El registro PV se compone de varios bloques:

BLOQUE	DESCRIPCIÓN/CONTENIDO
R00	Identificación del Valor
R01	Precio de cierre del Valor

En la siguiente tabla se describe con más detalle la estructura del registro PV:

	R00	R01	OBSERVACIONES
Información de precios	1	n	

Longitud del registro: Variable

T=tipo / L=longitud / E=enteros / D=decimales

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
DATOS CABECERA						
1	Cabecera mensajería Propietaria	A	100			
Datos de Control Bloques						
2	Número de Registros R00	N	2	2		Identificación del Valor
3	Número de Registros R01	N	2	2		Precio de cierre del Valor
FIN DATOS CABECERA						
IDENTIFICACION DEL VALOR (R00)						
4	Código de Valor	A	12			ISIN
5	Código Contratación	A	5			Código de Valor utilizado para la contratación
IDENTIFICACION DEL VALOR (R00)						
PRECIOS DEL VALOR (R01)						
6	Tipo Información de Precios	A	1			Indica el tipo de información de precios suministrada: 5=Precio de Cierre Igual al precio de referencia para el segmento de Renta Fija
7	Precio	N	13	7	6	Se informa para tipo de información 5
8	Tipo de precio de cierre	A	1			Se informa para tipo de información 5 Valores informados: 1: Precio de cierre es el de la sesión actual 4: Precio de cierre es el de la sesión anterior
9	Cupón corrido	N	8	2	6	Cupón corrido porcentaje. Sólo para activos de Renta Fija.
FIN PRECIOS DEL VALOR (R01)						

13. Información de Supervisión

La ECC difunde a sus miembros mensajes informativos, tipo texto, emitidos por el supervisor de la ECC. Estos mensajes son emitidos a todos los miembros durante la sesión, mediante el mensaje TXT.

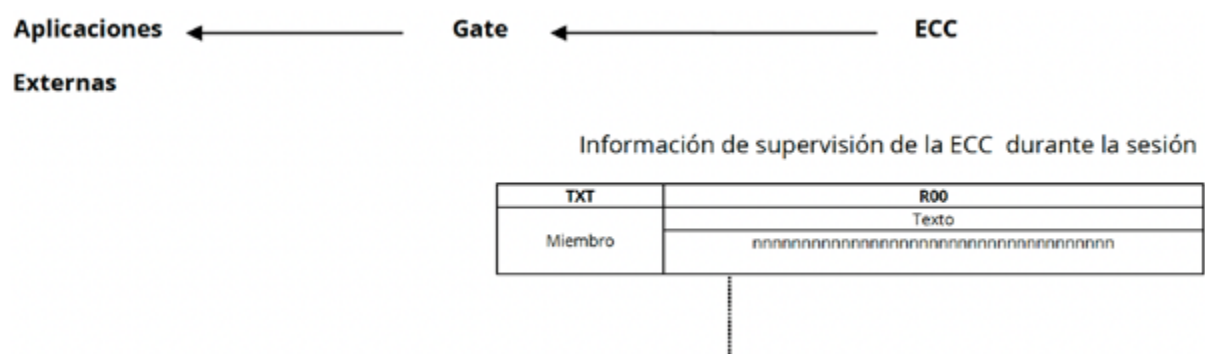
La información se difunde a todos los Miembros de la ECC.

A continuación se relacionan los mensajes utilizados, junto con el emisor y receptor de los mismos:

EMISOR	RECEPTOR	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
ECC	Miembro	TXT	R00	Texto Informativo

13.1 Flujo de mensajes

El flujo de mensajes de información de supervisión es:



13.2 Definición de mensajes

13.2.1 Tipo de registro TXT - Información de Supervisión

TXT – INFORMACIÓN DE SUPERVISIÓN	
Descripción	Este formato se empleará para comunicar mensajes informativos, tipo texto, emitidos por el Supervisor de la ECC a los Miembros de la ECC
Emisor	ECC
Destinatarios	Miembros ECC

El registro TXT se compone de varios bloques:

BLOQUE	DESCRIPCIÓN/CONTENIDO
R00	Texto Informativo

En la siguiente tabla se describe con más detalle la estructura del registro TXT:

	R00	OBSERVACIONES
Texto informativo a Miembros	1	

Longitud del registro: Variable

T=tipo / L=longitud / E=enteros / D=decimales

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
DATOS CABECERA						
	Cabecera mensajería Propietaria	A	100			
Datos de Control Bloques						
1	Número de Registros R00	N	2	2		Texto Informativo
FIN DATOS CABECERA						

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
TEXTO INFORMATIVO (R00)						
2	Texto Informativo	A	78			Texto emitido por el Supervisor de la ECC
3	Headline	A	10			Código identificativo del tipo de información. Ver Tabla 16 del documento “Tablas de Codificación”
FIN TEXTO INFORMATIVO (R00)						

14. Información de fin de sesión

La ECC difunde a sus miembros la conclusión de la sesión en curso, mediante el mensaje FS.

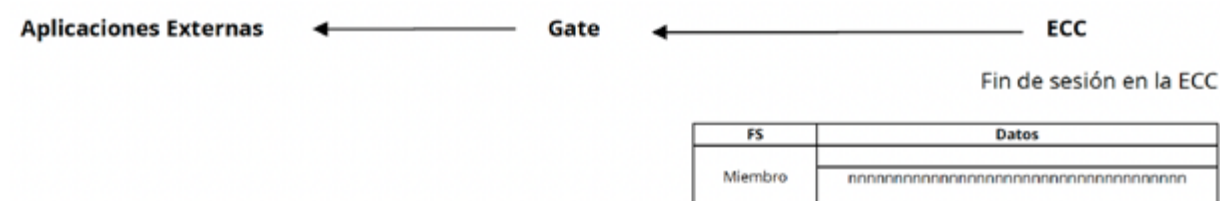
La información se difunde a todos los miembros de la ECC.

A continuación se relacionan los mensajes utilizados, junto con el emisor y receptor de los mismos:

EMISOR	RECEPTOR	MENSAJE	ESTRUCTURA	CONTENIDO
ECC	Miembro	FS		Fin de Sesión

14.1 Flujo de mensajes

El flujo de mensajes de información de supervisión es:



14.2 Definición de mensajes

14.2.1 Tipo de registro FS - Fin de sesión on-line

Longitud del registro: 150

T=tipo / L=longitud / E=enteros / D=decimales

#	DESCRIPCIÓN	T	L	E	D	OBSERVACIONES
DATOS CABECERA						
	Cabecera mensajería Propietaria	A	100			
2	Fecha Sesión	A	8			AAAAMMDD
3	Hora Fin Sesión Online	A	9			HHMMSSMMM Hora local del Host
4	Reservado	A	34			
FIN DATOS CABECERA						

Este mensaje se enviará una sola vez a cada Aplicación Externa que esté conectada on-line con el Gate, será el último mensaje online que el Gate difunda para la sesión.

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.