

A large, abstract graphic in the background consisting of overlapping, semi-transparent geometric shapes (triangles and polygons) in shades of blue and white, creating a dynamic, layered effect.

Segmentos de Renta Variable y Renta Fija

Interfaz mensajes ISO/ 15 de febrero de 2020

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	BME Clearing IT
21 de noviembre de 2014	1.2	Change Request	BME Clearing IT
23 de marzo 2015	1.3	Change Request	BME Clearing IT
5 de junio 2015	1.4	Change Request	BME Clearing IT
27 de noviembre 2015	1.5	Change Request	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	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
6 de febrero de 2018	1.11	Cambios por la nueva estructura de cuentas	BME Clearing IT
15 de febrero de 2020	1.17	Cambios en mensajes MT518 y MT535 para el segmento de Renta Fija.	BME Clearing IT

Modificaciones realizadas en la última revisión

Principales cambios respecto a la documentación v1.11 publicada el 6 de febrero de 2018:

- Cambios para el segmento de Renta Fija:
 - Mensaje MT518: nuevo bloque B2, nuevo campo en bloque B y nuevo campo en bloque C.
 - Mensaje MT535: nuevo bloque B1a.

Tabla de contenido

1. INTRODUCCIÓN	5
1.2.Descripción de la Mensajería ISO15022	5
1.2.Estructura de los formatos ISO	5
1.3.Convenciones y terminología utilizadas en este documento	5
2. CABECERAS MENSAJERÍA ISO	8
3. BLOQUE DE DATOS	11
4. DATOS DE CONTROL	12
5. OPERACIONES REGISTRADAS EN LA ECC	13
5.1. Descripción del mensaje MT518: Comunicación de Operaciones registradas en la ECC	13
5.2.Información adicional del mensaje MT518: Comunicación de Operaciones registradas en la ECC	16
6. SALDOS EN CUENTAS DE POSICIÓN	22
6.1.Descripción del mensaje MT535: Comunicación de Saldos en Cuentas de Posición	22
6.2. Información adicional del mensaje MT535: Comunicación de saldos en Cuentas de Posición	24
7. COMUNICACIÓN DE ACTUALIZACIÓN DE OPERACIONES	29
7.1.Descripción del mensaje MT538: Comunicación de actualización de datos en Operaciones	29
7.2.Información adicional del mensaje MT538: Comunicación de actualización de datos en Operaciones	31
8. RETENCIÓN/LIBERACIÓN DE OPERACIONES	34
8.1.Descripción del mensaje MT530: Retención/Liberación de Operaciones	34
8.2.Información adicional del mensaje MT530: Retención/Liberación de Operaciones	35
9. RESULTADO DE OPERACIONES	37
9.1.Descripción del mensaje MT548: Resultado de Operaciones	37



9.2. Información adicional del mensaje MT548: Resultado de Operaciones 39

10. INFORMACIÓN DE SUPERVISIÓN 42

10.1. Descripción del mensaje MT598: Información de Supervisión 42

10.2. Información adicional del mensaje MT598: Información de Supervisión 42

11. COMUNICACIÓN DE MENSAJES NO ACEPTADOS 43

11.1. Descripción del mensaje MT598: Comunicación mensajes no aceptados 43

11.2. Información adicional del mensaje MT598: Comunicación mensajes no aceptados 43

1. Introducción

1.2.Descripción de la Mensajería ISO15022

Se definen los siguientes mensajes ISO para las siguientes funcionalidades:

- MT518 Comunicación de Operaciones registradas en la ECC
- MT535 Comunicación de saldos en Cuentas de Posición
- MT538 Comunicación de actualización de datos en Operaciones.
- MT530 Retención/Liberación de Operaciones
- MT548 Resultado de Operaciones
- MT598 Información de Supervisión
- MT598 Comunicación Mensajes no aceptados

1.2.Estructura de los formatos ISO

Los mensajes en formato ISO se admiten bajo la siguiente estructura:

- Datos de Cabecera, común a todos los mensajes ISO:
 - {1: Basic Header Block}
 - {2: Application Header Block}
 - {3: User Header Block}
- Datos específicos del mensaje (bloque 4, Text Block or Body)
- Datos de Control (Trailer Block, bloque 5)

1.3.Convenciones y terminología utilizadas en este documento

En la descripción de los diferentes formatos definidos en los siguientes apartados se utiliza la siguiente terminología:

(1)	(2)	M/O (3)	(4)	(5)	(6)
-----	-----	------------	-----	-----	-----

(1) Número de Campo

(2) Nombre de campos

(3) Indicador de campo requerido:

- a. **Mandatory** (Campo requerido)
- b. **Optional** (Campo opcional)

(4) Formato de campo / TAG según terminología SWIFT ISO15022:

a. Formato de campo:

- X(n) -> Campo alfanumérico con n posiciones fijas
- N(n) -> Campo numérico con n posiciones fijas

- b. TAG, en la descripción del formato de cada campo se ha utilizado la terminología y convecciones definidos por SWIFT en sus Handbooks.

A continuación se resumen los conceptos comúnmente más utilizados:

- Especificaciones sobre longitud de campos:

Nomenclatura	Significado
n	Máximo n caracteres
n!	n caracteres exactos
n*m	n líneas con un máximo de m caracteres cada una

- Especificaciones sobre los formatos de campos:

Nomenclatura	Significado
n	Números de 0 a 9
a	Letras mayúsculas de la A a la Z
x	Cualquier carácter permitido por SWIFT, incluye mayúsculas y minúsculas
c	Letras mayúsculas de la A a la Z y números del 0 al 9
d	Números de 0 al 9 con la coma como separador de decimales

- Convenciones adicionales:

Nomenclatura	Significado
[]	El campo descrito entre corchetes es opcional

(5) Valores Permitidos / Cualificador SWIFT ISO15022**(6) Observaciones / Formato SWIFT ISO15022**

Por ejemplo, para describir los bloques de las cabeceras de la mensajería ISO, se utilizará el siguiente formato:

	Nombre del campo	M/O	Formato TAG	Valores permitidos	Observaciones
1	Inicio Bloque	M	X(1)	{	

Para la descripción del contenido del bloque 4, el formato utilizado es:

	Nombre del campo	M/O	Formato	Valores permitidos	Observaciones
1	Referencia de mensaje	M	:20C:	:SEME//	16x

2. Cabeceras Mensajería ISO

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.

A continuación se describen el contenido de los diferentes bloques que componen la mensajería ISO:

El **bloque 1** se cumplimentará de la siguiente manera:

	NOMBRE DEL CAMPO	M/O	FORMATO TAG	VALORES PERMITIDOS	OBSERVACIONES
Descripción del Bloque 1					
1	Inicio Bloque	M	X(1)	{	
2	Tipo Bloque	M	X(2)	1:	
3	Tipo Aplicación	M	X(1)	F	
4	Servicio	M	X(2)	01	
					Dependiendo de si el mensaje es de entrada o salida, este campo identifica a:
					Entidad Origen
					Entidad Destino respectivamente
					Incluye el BIC 11 de la entidad emisora o receptora del mensaje:
5	Identificación Origen/Destino	M	X(12)		Las Posiciones 1 a 8 se corresponden con el BIC8 del emisor, las posiciones 10 a 12 coincide con el Branch Code.
					La Posición 9 se corresponde con el Terminal Lógico (SWIFT), este campo no será validado
					En envíos con destino a la ECC o enviados por la ECC, este campo siempre se cumplimentará con el BIC de la Entidad Participante propietaria del mensaje.
6	Numero de Sesión	M	N(4)		
7	Numero de Secuencia	M	N(6)		
8	Fin Bloque	M	X(1)	}	

El **bloque 2** se cumplimentará de dos maneras diferentes, en función de si el mensaje es emitido o recibido por una Entidad.

	NOMBRE DEL CAMPO	M/O	FORMATO TAG	VALORES PERMITIDOS	OBSERVACIONES
Descripción del Bloque 2					Entidad a Gate
1	Inicio Bloque	M	X(1)	{	

	NOMBRE DEL CAMPO	M/O	FORMATO TAG	VALORES PERMITIDOS	OBSERVACIONES
2	Tipo Bloque	M	X(2)	2:	
3	Sentido	M	X(1)	I	Entrada al Gate
4	Código de Mensaje	M	X(3)		Código que identifica el mensaje
5	Identificación Destino	M	X(12)		Incluye el BIC 11 del destinatario del mensaje: Las Posiciones 1 a 8 se corresponden con el BIC8 del receptor, las posiciones 10 a 12 coincide con el Branch Code. En comunicaciones con destino la ECC, el Branch Code se cumplimentará con el código de Segmento de la ECC (Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación") y en la última posición deberá informarse con el valor 'X'. La Posición 9 se corresponde con el Terminal Lógico (SWIFT), este campo no será validado
6	Prioridad	M	X(1)	N	Debe informarse a "N" No se tiene en cuenta pero ha de estar informado
7	Delivering Monitoring	O	X(1)		Es opcional, no se tiene en cuenta
8	Obsolescence Period	O	X(1)		Es opcional, no se tiene en cuenta
9	Fin Bloque	M	X(1)	}	

	NOMBRE DEL CAMPO	M/O	FORMATO TAG	VALORES PERMITIDOS	OBSERVACIONES
Descripción del Bloque 2				Gate a Entidad	
1	Inicio Bloque	M	X(1)	{	
2	Tipo Bloque	M	X(2)	2:	
3	Sentido	M	X(1)	O	Emitido por Gate
4	Código de Mensaje	M	X(3)		Código que identifica el mensaje
5	Hora local envío mensaje	M	X(4)	HHMM	
6	Fecha envío del mensaje	M	X(6)	AAMMDD	
7	Identificación Origen	M	X(12)		- Incluye el BIC 11 del emisor del mensaje: - Las Posiciones 1 a 8 se corresponden con el BIC8 de la Entidad Participante receptora, las posiciones 10 a 12 se corresponde con el Branch Code. - En comunicaciones de mensajes emitidos por la ECC, el Branch Code se cumplimentará con el

	NOMBRE DEL CAMPO	M/O	FORMATO TAG	VALORES PERMITIDOS	OBSERVACIONES
					código de Segmento de la ECC (Ver Tabla 1 del documento "Tablas de Codificación") y en la última posición se informará con el valor 'X'.
					- La Posición 9 se corresponde con el Terminal Lógico (SWIFT), este campo no será validado
12	Numero de Sesión	M	N(4)		
13	Numero de Secuencia	M	N(6)		
14	Fecha emisión del mensaje	M	N(6)	AAMMDD	
15	Hora emisión del mensaje	M	N(4)	HHMM	
16	Prioridad	M	X(1)	N	Debe informarse a "N" No se tiene en cuenta pero ha de estar informado
17	Fin Bloque	M	X(1)	}	

El **bloque 3** es requerido para identificar el usuario en los mensajes enviados por la Entidad a la ECC. En las respuestas de la ECC, se informará en este bloque el usuario de la Entidad en los mensajes destinados a un usuario concreto.

	NOMBRE DEL CAMPO	M/O	FORMATO TAG	VALORES PERMITIDOS	OBSERVACIONES
Descripción del Bloque 3					
1	Inicio Bloque	M/O	X(1)	{	En entrada a la ECC es obligatorio cumplimentar este bloque.
2	Tipo Bloque	M	X(2)	3:	
3	Usuario	M	{103:3!x}		Donde 3!x contendrá el código de usuario de la Entidad en la ECC. La codificación de usuarios en la ECC admite números. En mensajes de salida, destinado a todos los usuarios se informará con el valor XXX.
4	Prioridad	O	{113:4!a}		Es opcional, no se tiene en cuenta
5	Referencia Usuario	O	{108:16x}		Es opcional, no se tiene en cuenta
6	Indicador Validación	O	{119:8c}		Es opcional, no se tiene en cuenta
7	Fin Bloque	M	X(1)	}	

3. Bloque de datos

El **bloque 4** contendrá la información de negocio, siendo su estructura:

	NOMBRE DEL CAMPO	M/O	FORMATO TAG	VALORES PERMITIDOS	OBSERVACIONES
Descripción del Bloque 4					
1	Inicio Bloque	M	X(1)	{	
2	Tipo Bloque	M	X(2)	4:	
3	Delimitador de Campo <CRLF>				
4	Tag+Campo 1				
5	Delimitador de Campo <CRLF>				
6	Tag+Campo 2				
7	Delimitador de Campo <CRLF>				
8	Tag+Campo 3				
9	Delimitador de Campo <CRLF>				
10					
11					
12					
13					
14	Tag+Campo n				
15	Delimitador de Campo <CRLF>				
16	Fin Bloque	M	X(1)	}	

4. Datos de Control

El bloque 5 no se tendrá en cuenta, y si se informa se hará de acuerdo a las especificaciones formales definidas por SWIFT.

Cada bloque comenzará con la secuencia de caracteres {5: y terminará con el carácter}, en el caso de que dentro de uno de los bloques se activen campos encapsulados entre los caracteres de control {}, éstos deberán de estar cerrados de forma lógica. Por ejemplo si se comunica:

```
{5:{MAC:00000000}{PAC:00000000}{CHK:AC7190547265D}}
```

El Gate aceptará el bloque 5, pero si se comunica:

```
{5:{MAC:00000000{PAC:00000000}{CHK:AC7190547265D}}
```

Se devolverá el mensaje como erróneo, ya que falta cerrar el Tag MAC.

5. Operaciones registradas en la ECC

MT518 – COMUNICACIÓN DE OPERACIONES REGISTRADAS EN LA ECC	
Descripción	Este formato se empleará para comunicar el registro de Operaciones (según Tabla 4 del documento de “Tablas de Codificación”) en Cuentas de Posición
Emisor	ECC
Destinatarios	Entidades Participantes

5.1. Descripción del mensaje MT518: Comunicación de Operaciones registradas en la ECC

5.1.1. Bloque A: Inicio Datos Generales

	NOMBRE DEL CAMPO	M/O	TAG	CUALIFICADOR	FORMATO
	Bloque A Inicio Datos Generales	M	:16R:		GENL
1	Referencia de mensaje	M	:20C:	:SEME//	16x
2	Función y sub-función del mensaje	M	:23G:	NEWM PREA	[/4!c]
3	Fecha y hora de proceso	M	:98C:	:PREP//	8!n6!n
4	Tipo Transacción	M	:22F:	:TRTR//	4!c
	Sub-bloque A1.1 Inicio Link	M	:16R:		LINK
5	Número Operación	M	:20C:	:TRRF//	16x
	Sub-bloque A1.1 Fin Link	M	:16S:		LINK
	Sub-bloque A1.2 Inicio Link	O	:16R:		LINK
6	Número Operación previa	M	:20C:	:RELA//	16x
	Sub-bloque A1.2 Fin Link	O	:16S:		LINK
	Sub-bloque A1.3 Inicio Link	O	:16R:		LINK
7	Número Operación inicial	M	:20C:	:COMM//	16x
	Sub-bloque A1.3 Fin Link	O	:16S:		LINK
	Sub-bloque A1.4 Inicio Link	O	:16R:		LINK
8	Id. Ejecución	M	:20C:	:PROG//	16x
	Sub-bloque A1.4 Fin Link	O	:16S:		LINK
	Sub-bloque A1.5 Inicio Link	O	:16R:		LINK
9	Id. Orden Mercado	M	:20C:	:MAST//	16x
	Sub-bloque A1.5 Fin Link	O	:16S:		LINK
	Bloque A Fin Datos Generales	M	:16S:		GENL

5.1.2 Bloque B: Inicio Datos Operación

	Nombre del campo	M/O	TAG	Cualificador	Formato
	Bloque B Inicio Datos Operación	M	:16R:		CONFDET
10	Fecha Contratación	M	:98A:	:TRAD//	8!n
11	Fecha Teórica Liquidación	M	:98A:	:SETT//	8!n
12	Precio	M	:90A: :90B:	:DEAL//	4!c/15d 4!c/3!a15d
13	Plataforma de Negociación	O	:94B:	:TRAD//	EXCH/30x
14	Importe Efectivo	M	:19A:	:SETT//	[N]3!a15d
15	Sentido	M	:22H:	:BUSE//	SELL BUYI
16	Tipo de Pago	M	:22H:	:PAYM//	4!c
17	Indicador Posición	M	:22F:	:PROC//	4!c
	Bloque B1 Inicio Datos Participantes	M	:16R:		CONFPRTY
18	Miembro	M	:95R: :95P:	:4!c/BMCL/ :4!c//	34x 4!a2!a2!c[3!c]
19	Cuenta Compensación	M	:97A:	:SAFE//	35x
20	Información adicional	O	:70E:	:DECL//	4*35x
21	Indicador Capacidad	O	:22F:	:TRCA//	4!c
	Bloque B1 Fin Datos Participantes	M	:16S:		CONFPRTY
	Bloque B1 Inicio Datos Participantes	M	:16R:		CONFPRTY
22	Miembro Compensador	M	:95R: :95P:	:CLBR/BMCL/ :CLBR//	34x 4!a2!a2!c[3!c]
	Bloque B1 Fin Datos Participantes	M	:16S:		CONFPRTY
	Bloque B1 Inicio Datos Participantes	O	:16R:		CONFPRTY
23	Miembro Negociador	M	:95R: :95P:	:INBR/BMCL/ :INBR//	34x 4!a2!a2!c[3!c]
	Bloque B1 Fin Datos Participantes	O	:16S:		CONFPRTY
24	Cantidad de Valores	M	:36B:	:CONF//	4!c/15d
25	Código de valor	M	:35B:		ISIN1!e12!c
	Bloque B2 Inicio Datos Financieros	O	:16R:		FIA
26	Tipo de interés fijo	O	:92A:	:INTR//	[N]15d
	Bloque B2 Fin Datos Financieros	O	:16S:		FIA
27	UTI de la operación	O	:70E:	:TPRO//	4*35x
	Bloque B Fin Datos Operación	M	:16S:		CONFDET

5.1.3.

Bloque C: Inicio Datos Liquidación

	NOMBRE DEL CAMPO	M/O	TAG	CUALIFICADOR	FORMATO
	Bloque C Inicio Datos Liquidación	M	:16R:		SETDET

	NOMBRE DEL CAMPO	M/O	TAG	CUALIFICADOR	FORMATO
28	Código Operación ECC	M	:22F:	:REGT/BMCL/	4!c
29	Tipo de Instrucción	M	:22F:	:SETR/BMCL/	4!c
30	Ciclo de Liquidación	O	:22F:	:SETS/BMCL/	4!c
31	Tipo de SFT	O	:22F:	:REPT/BMCL/	4!c
	Bloque C1 Inicio Datos Participantes	M	:16R:		SETPRTY
32	Plaza de liquidación (DCV)	M	:95P:	:PSET//	4!a2!a2!c[3!c]
33	Número Operación Instrucción de liquidación DCV	O	:20C:	:PROC//	16x
34	Referencia Evento Corporativo	O	:70D:	:REGI//	6*35x
	Bloque C1 Fin Datos Participantes	M	:16S:		SETPRTY
	Bloque C1 Inicio Datos Participantes	M	:16R:		SETPRTY
35	Entidad Participante	M	:95R: :95P:	:4!c/BMCL/ :4!c//	34x 4!a2!a2!c[3!c]
36	Cuenta de Valores del participante	M	:97A:	:SAFE//	35x
	Bloque C1 Fin Datos Participantes	M	:16S:		SETPRTY
	Bloque C3 Inicio Datos Comisiones	O	:16R:		AMT
37	Importe Corretaje	M	:19A:	:EXEC//	[N]3!a15d
	Bloque C3 Fin Datos Comisiones	O	:16S:		AMT
	Bloque C Fin Datos Liquidación	M	:16S:		SETDET

5.1.4. Bloque E: Información adicional para vinculación de operaciones

	Nombre del campo	M/O	TAG	Cualificador	Formato
	Bloque E Inicio Información adicional para vinculación de operaciones	O	:16R:		REPO
38	Referencia vinculación operaciones	M	:20C:	:REPO//	16x
	Bloque E Fin Información adicional para vinculación de operaciones	O	:16S:		REPO

5.2. Información adicional del mensaje MT518: Comunicación de Operaciones registradas en la ECC

#	CAMPO	CONTENIDO
	Bloque A Inicio Datos Generales	GENL
		Referencia única del Mensaje
		Se informará con la siguiente estructura:
1	Referencia de mensaje	AAMMDD9999999999 Siendo AAMMDD la fecha de sesión, y 9999999999 un número único para la fecha sesión.
2	Función y sub-función del mensaje	Si la operación está retenida se informará como PREA En caso contrario, se informará como NEWM
3	Fecha y hora de proceso	Fecha y Hora informada por el emisor del mensaje Formato: AAAAMMDDHHMMSS
4	Tipo Transacción	Siempre se informa con el valor TRAD
	Sub-bloque A1.1 Inicio Link	LINK
5	Número Operación	Número de Operación de la ECC
	Sub-bloque A1.1 Fin Link	LINK
	Sub-bloque A1.2 Inicio Link	LINK Bloque opcional
6	Número Operación previa	Número de Operación previa.
	Sub-bloque A1.2 Fin Link	LINK
	Sub-bloque A1.3 Inicio Link	LINK Bloque opcional
7	Número Operación inicial	Número de Operación inicial.
	Sub-bloque A1.3 Fin Link	LINK
	Sub-bloque A1.4 Inicio Link	LINK Bloque opcional
8	Id. Ejecución	Para ejecuciones de Plataformas Multilaterales: Formato: AAMMDD9999999999 Donde: AAMMDD es la fecha ejecución 9999999999 es el número de ejecución Para Operaciones bilaterales (Iberclear): Se informa con la referencia case
	Sub-bloque A1.4 Fin Link	LINK
	Sub-bloque A.5 Inicio Link	LINK Bloque opcional
9	Id. Orden Mercado	Se informa para ejecuciones de Plataformas Multilaterales Formato: AAMMDD9999999999 Donde:

#	CAMPO	CONTENIDO
		AAMMDD es la fecha de la orden 999999999 es el número de orden Sólo aplica al Segmento de Renta Variable
	Sub-bloque A1.5 Fin Link	LINK
	Bloque A Fin Datos Generales	GENL
	Bloque B Inicio Datos Operación	CONFDET
10	Fecha Contratación	Fecha Contratación Formato: AAAAMMDD
11	Fecha Teórica de Liquidación	Fecha Teórica de Liquidación Formato: AAAAMMDD
12	Precio	Opción A (YIEL) para precios expresados en porcentaje: 4!c/15d Opción B (ACTU) para precios expresados en importes unitarios por acción: 4!c/3!a15d A ceros si no es informado en algunas Operaciones de ECC En el caso de que el importe efectivo sea negativo, el precio debe considerarse como negativo.
13	Plataforma de Negociación	Código MIC de la Plataforma de Negociación
14	Importe Efectivo	Importe Efectivo de la Operación [N]: carácter que indica signo negativo. Sólo se cumplimenta cuando el efectivo es negativo 3!a: código de la moneda. Se cumplimenta con "EUR" para euros 15d es el importe. Pueden utilizarse hasta 15 caracteres numéricos (incluyendo la coma y los decimales)
15	Sentido	Sentido (Signo de la posición de Valores) Se informará con: SELL para ventas BUYI para compras
16	Tipo de Pago	Valores informados: APMT: Contra pago FREE: Libre de pago
17	Indicador de Posición	Valores informados: - CLOP Close Position (el campo 6 referencia a la Operación que se cierra) - OPEP Open Position
	Bloque B1 Inicio Datos Participantes	CONFPTY

#	CAMPO	CONTENIDO
18	Miembro	En función del signo en Operación de Valores: Para Operaciones de sentido compra se informará con: • Opción R :BUYR/BMCL/34x (Código Miembro en la ECC) • Opción P: BUYR//Código BIC del Miembro • Para Operaciones de sentido venta se informará con: • Opción R: SELL/BMCL/34x (Código Miembro en la ECC) • Opción P: SELL//Código BIC del Miembro
19	Cuenta Compensación	Se informará con la Cuenta de Posición
20	Información adicional:	Para ejecuciones de Plataformas Multilaterales se cumplimentará de la siguiente manera: • En la primera línea se informará con la Referencia Cliente comunicada en la orden (16x), en caso de que no exista se informará con el valor NONE. • En la segunda línea se informará con la Referencia Externa (15x), en caso de que no exista se informará con el valor NONE. Para Operaciones bilaterales (Iberclear) se cumplimentará de la siguiente manera: • En la primera línea se informará con el CCV, en caso de que no exista se informará con el valor NONE. • En la segunda línea se informará con el Ordenante Participante, en caso de que no exista se informará con el valor NONE
21	Indicador Capacidad	Se corresponde con el indicador de capacidad informado en la orden de mercado Valores informados: Antes de MIFID-II: • PRIN : Cuenta Propia • MLTF: Ajena • MKTM: Especialista A partir de MIFID-II: • PRIN : MTCH • MLTF: AOTC • CPRN: DEAL Sólo aplica al Segmento de Renta Variable

#	CAMPO	CONTENIDO
	Bloque B1 Fin Datos Participantes	CONFPTY
	Bloque B1 Inicio Datos Participantes	CONFPTY
22	Miembro Compensador	Miembro Compensador
	Bloque B1 Fin Datos Participantes	CONFPTY
	Bloque B1 Inicio Datos Participantes	CONFPTY
23	Miembro Negociador	Miembro negociador Plataforma de Negociación
	Bloque B1 Fin Datos Participantes	CONFPTY
24	Cantidad de Valores	Cantidad de Valores de la Operación Deberá informarse de si los Valores se expresan en número de títulos o Importe Nominal. Se incluirá la cantidad o Importe Nominal de los Valores con un máximo de 15 caracteres numéricos, incluyendo la coma y los decimales Se cumplimentará: - FAMT(Importe Nominal) + Cantidad , con un máximo de dos decimales - UNIT(Títulos) + Cantidad, con un máximo de 14 decimales Si la cantidad no tiene decimales se incluirá una coma como último carácter Campo declarado como opcional. No informado en algunas Operaciones de ECC
25	Código de valor	Codificación ISIN
	Bloque B2 Inicio Datos Financieros	FIA
26	Tipo de interés fijo	Para operaciones del segmento de Renta Fija informará del tipo de interés fijo
	Bloque B2 Fin Datos Financieros	FIA
27	UTI de la operación	Para operaciones del segmento de Renta Fija contiene el UTI (52 posición), y se cumplimentará de la siguiente manera: En la primera línea se informará de los 35 primeros caracteres del UTI. En la segunda línea se informará del resto.
	Bloque B Fin Datos Operación	CONFDET
	Bloque C Inicio Datos Liquidación	SETDET
28	Código Operación	Código de Operación interna en la ECC: OPEX Se informa con el valor fijo OPE más el tipo de Operación interna de la ECC. Ver Tabla 4 del documento "Tablas de Codificación"

#	CAMPO	CONTENIDO
29	Tipo de Instrucción	Tipo de Instrucción de liquidación: IXXX Se informa con el valor fijo I más tres caracteres que indican el tipo de Instrucción de Liquidación: • DVP = Entrega contra pago • RVP = Recepción contra pago • DWP = Entrega con pago • DFP = Entrega libre de pago • RFP = Recepción libre de pago • PWD = Pago / cobro sin entrega de Valores • ROC = Instrucciones de pago sin entrega con efectivo cero • RWP = Recepción con pago En el caso de que no se informe el tipo de instrucción se informará el valor: NONE
30	Ciclo de Liquidación	Identificación del ciclo de liquidación: CLQX Contiene el número de ciclo liquidación en el que se envía la Instrucción a liquidar Se informa con el valor fijo CLQ más un carácter que identifica el Ciclo de Liquidación
31	Tipo de SFT	Para operaciones del segmento de Renta Fija iInformará del tipo de SFT: BUSE: Simultánea REPO: Repo NONE: No aplica
	Bloque C1 Inicio Datos Participantes	SETPRTY
32	Plaza de liquidación (DCV)	BIC del DCV
33	Número Operación Instrucción de liquidación DCV	Número Operación asignado por el DCV a la Instrucción de Liquidación
34	Referencia Evento Corporativo	En Ajustes por Eventos se informará en la primera línea con la referencia del Evento Corporativo
	Bloque C1 Fin Datos Participantes	SETPRTY
	Bloque C1 Inicio Datos Participantes	SETPRTY
35	Entidad Participante	Para Operaciones de sentido compra se informará con: REAG Participante que recibe: • Opción R :REAG/BMCL/34x (Código Entidad Participante en la ECC que recibe)

#	CAMPO	CONTENIDO
		- Opción P: REAG//Código BIC Entidad Participante que recibe. Para operaciones de sentido venta se informará con: DEAG Participante que entrega - Opción R DEAG/BMCL/34x (Código Entidad Participante en la ECC que entrega) - Opción P: DEAG//Código BIC Entidad Participante que entrega En caso de que no se informe la Entidad Participante se informará el valor: NONE con opción R.
36	Cuenta Valores Participante	Código de la Cuenta de Valores de la entidad participante en el DCV En el caso de que no se informe la Cuenta Valores Participante se informará el valor: NONE.
	Bloque C1 Fin Datos Participantes	SETPRTY
	Bloque C3 Inicio Datos Comisiones	AMT
37	Importe Corretaje	Importe Corretaje Miembro Negociador [N]: carácter que indica signo negativo. Sólo se cumplimenta cuando el efectivo es negativo 3!a: código de la moneda. Se cumplimenta con "EUR" para euros 15d es el importe. Pueden utilizarse hasta 15 caracteres numéricos (incluyendo la coma y los decimales)
	Bloque C3 Fin Datos Comisiones	AMT
	Bloque C Fin Datos Liquidación	SETDET
	Bloque E Inicio Información adicional para vinculación de operaciones	REPO Bloque opcional
38	Referencia vinculación operaciones	Si se trata de una operación de Neteo / Agregación contiene el Identificador de operación de la ECC correspondiente a la Instrucción de Liquidación. Si se trata de la ida y la vuelta de un repo contiene la referencia común que vincula ambas (sólo aplica al segmento de Renta Fija).
	Bloque E Fin Información adicional para vinculación de operaciones	REPO

6. Saldos en Cuentas de Posición

MT535 – COMUNICACIÓN DE SALDOS EN CUENTAS DE POSICIÓN	
Descripción	Este formato se empleará para comunicar los Saldos vivos por Fecha de Negociación (sólo RV), Fecha de Liquidación, Cuenta de Posición y Código de Valor
Emisor	ECC
Destinatarios	Entidades Participantes

6.1. Descripción del mensaje MT535: Comunicación de Saldos en Cuentas de Posición

6.1.1. Bloque A: Inicio Datos Generales

	NOMBRE DEL CAMPO	M/O	TAG	CUALIFICADOR	FORMATO
	Bloque A Inicio Datos Generales	M	:16R:		GENL
1	Num. Pag. Indicador Continuación	M	:28E:		5n/4!c
2	Referencia de Mensaje	M	:20C:	:SEME//	16x
3	Función y subfunción del Mensaje	M	:23G:	NEWM	[/4!c]
4	Fecha y Hora de Proceso	M	:98C:	:PREP//	8!n6!n
5	Fecha Teórica Liquidación	M	:98A:	:STAT//	8!n
6	Indicador de Frecuencia	M	:22F:	:SFRE/BMCL/	4!c
7	Indicador de Completo/Actualización	M	:22F:	:CODE//	COMP
8	Indicador de tipo Informe	M	:22F:	:STTY//	ACCT
9	Indicador tipo de Balance	M	:22F:	:STBA//	TRAD
10	Entidad Participante	M	:95R: :95P:	:ACOW/BMCL / :ACOW//	34x 4!a2!a2!c[3!c]
11	Cuenta Liquidación	M	:97A:	:SAFE//	35x
12	Indicador de actividad	M	:17B:	:ACTI//	Y
13	Indicador de Cuentas adicionales	M	:17B:	:CONS//	N
	Bloque A Fin Datos Generales	M	:16S:		GENL

6.1.2. Bloque B: Inicio Sub-Cuenta

	NOMBRE DEL CAMPO	M/O	TAG	CUALIFICADOR	FORMATO
	Bloque B Inicio Sub-Cuenta	M	:16R:		SUBSAFE
14	Miembro Compensador	M	:95R:	:ACOW/BMCL/	34x
15	Cuenta Compensación	M	:97A:	:SAFE//	35x
16	Plaza de liquidación (DCV)	M	:94F:	:SAFE//NCSD/	4!a2!a2!c[3!c]
	Sub-Bloque B1 Inicio Valor	M	:16R:		FIN
17	Código de valor	M	:35B:		ISIN1!e12!c
18	Total Títulos	M	:93B:	:AGGR//	4!c/[N]15d
	Sub-Bloque B1a Inicio Datos Financieros	O	:16R:		FIA
19	Tipo de SFT	M	:22F:	:FORM/BMCL/	4!c
	Sub-Bloque B1a Fin Datos Financieros	O	:16S:		FIA
	Sub-Bloque B1b Inicio Saldo Neto Comprador	O	:16R:		SUBBAL
20	Total Títulos	M	:93B:	:PENR//	4!c/[N]15d
21	Fecha Contratación	O	:98A:	:PRIC//	8!n
22	Importe Efectivo	O	:19A:	:BOOK//	[N]3!a15d
	Sub-Bloque B1b Fin Saldo Neto Comprador	O	:16S:		SUBBAL
	Sub-Bloque B1b Inicio Saldo Neto Vendedor	O	:16R:		SUBBAL
23	Total Títulos	M	:93B:	:PEND//	4!c/[N]15d
24	Fecha Contratación	O	:98A:	:PRIC//	8!n
25	Importe Efectivo	O	:19A:	:BOOK//	[N]3!a15d
	Sub-Bloque B1b Fin Saldo Neto Vendedor	O	:16S:		SUBBAL
	Sub-Bloque B1b Inicio Retención	O	:16R:		SUBBAL
26	Total Títulos retenidos	M	:93B:	:BLOK//	4!c/[N]15d
27	Fecha Contratación	M	:98A:	:PRIC//	8!n
28	Importe Efectivo retenido	O	:19A:	:BOOK//	[N]3!a15d
	Sub-Bloque B1b Fin Retención	O	:16S:		SUBBAL
	Sub-Bloque B1b Inicio Saldo Recepción por Ajustes	O	:16R:		SUBBAL
29	Total Títulos	M	:93B:	:PECA//	4!c/[N]15d

	NOMBRE DEL CAMPO	M/O	TAG	CUALIFICADOR	FORMATO
30	Fecha Contratación	O	:98A:	:PRIC//	8!n
31	Importe Efectivo	O	:19A:	:BOOK//	[N]3!a15d
	Sub-Bloque B1b Fin Saldo Recepción por Ajustes	O	:16S:		SUBBAL
	Sub-Bloque B1b Inicio Saldo Entrega por Ajustes	O	:16R:		SUBBAL
32	Total Títulos	M	:93B:	:PEDA//	4!c/[N]15d
33	Fecha Contratación	O	:98A:	:PRIC//	8!n
34	Importe Efectivo	O	:19A:	:BOOK//	[N]3!a15d
	Sub-Bloque B1b Fin Saldo Entrega por Ajustes	O	:16S:		SUBBAL
	Sub-Bloque B1b Inicio Otros Saldos	O	:16R:		SUBBAL
35	Total Títulos	M	:93B:	:OTHR//	4!c/[N]15d
	Sub-Bloque B1b1 Inicio Detalle Otros Saldos	O	:16R:		BREAK
36	Tipo Saldo	M	:13B:	:LOTS/BMCL/	30x
37	Títulos	O	:93B:	:LOTS//	4!c/[N]15d
38	Fecha Contratación	O	:98A:	:LOTS//	8!n
39	Importe Efectivo	O	:19A:	:BOOK//	[N]3!a15d
	Sub-Bloque B1b1 Fin Detalle Otros Saldos	O	:16S:		BREAK
	Sub-Bloque B1b Fin Otros Saldos	O	:16S:		SUBBAL
	Sub-Bloque B1 Fin Valor	M	:16S:		FIN
	Bloque B Fin Sub-Cuenta	M	:16S:		SUBSAFE

6.2. Información adicional del mensaje MT535: Comunicación de saldos en Cuentas de Posición

#	CAMPO	CONTENIDO
	Bloque A Inicio Datos Generales	GENL
1	Num. Pag. Indicador Continuación	Indica el número de pagina, seguido de un indicador: LAST : última página MORE: existen más paginas ONLY: no hay más paginas
2	Referencia de Mensaje	Referencia única del Mensaje

#	CAMPO	CONTENIDO
		Se informará con la siguiente estructura:
		AAMMDD9999999999
		Siendo AAMMDD la fecha de sesión, y 9999999999 un número único para la fecha sesión.
3	Función y subfunción del Mensaje	Se informará siempre como NEWM
4	Fecha y Hora de Proceso	Fecha y Hora informada por el emisor del mensaje Formato: AAAAMMDDHHMMSS
5	Fecha Teórica Liquidación	Fecha Teórica Liquidación Formato: AAAAMMDD
6	Indicador de Frecuencia	Se informará siempre con: ITDX (inicio de sesión) EODX (fin de sesión)
7	Indicador de Completo/Actualización	Se informará siempre con el valor COMP
8	Indicador de tipo Informe	Se informará siempre con el valor ACCT
9	Indicador tipo de Balance	Siempre se informa con el valor: TRAD
10	Entidad Participante	Entidad Participante (BIC) En el caso de que no se informe la Entidad Participante se informará el valor: NONE (opción R)
11	Cuenta Liquidación	Identificación de la Cuenta de Liquidación en el DCV: 35x Cuenta Valores En el caso de que no se informe la Participante se informará el valor: NONE.
12	Indicador de actividad	Siempre se informará con el valor Y
13	Indicador de Cuentas adicionales	Siempre se informará con el valor N
	Bloque A Fin Datos Generales	GENL
	Bloque B Inicio Sub-Cuenta	SUBSAFE
14	Miembro Compensador	Miembro Compensador de la Cuenta. Se informa con la codificación de la ECC
15	Cuenta Compensación	Identificación de la Cuenta de Posición en la ECC
16	Plaza de liquidación (DCV)	Código BIC DCV
	Sub-Bloque B1 Inicio Valor	FIN Bloque repetitivo

#	CAMPO	CONTENIDO
17	Código de valor	Codificación ISIN
18	Total Títulos	El contenido de este campo totaliza los títulos detallados en el mensaje, sólo se comunica a efecto de cuadro
		Deberá informarse de si los Valores se expresan en número de títulos o Importe Nominal. Se incluirá la cantidad o Importe Nominal de los Valores con un máximo de 15 caracteres numéricos, incluyendo la coma y los decimales
		Se cumplimentará: - FAMT(Importe Nominal) + Cantidad , con un máximo de dos decimales - UNIT(Títulos) + Cantidad, con un máximo de 14 decimales
		Si la cantidad no tiene decimales se incluirá una coma como último carácter
Sub-Bloque B1a Inicio Datos Financieros		FIA Bloque opcional
19	Tipo de SFT	Para operaciones del segmento de Renta Fija ilnformará del tipo de SFT: BUSE: Simultánea REPO: Repo NONE: No aplica
Sub-Bloque B1a Fin Datos Financieros		FIA Bloque opcional
Sub-Bloque B1b Inicio Saldo Neto Comprador		SUBBAL Bloque opcional
20	Total Títulos	Saldo Neto Comprador Valores/Nominal pendiente Liquidar
		Deberá informarse de si los Valores se expresan en número de títulos o Importe Nominal. Se incluirá la cantidad o Importe Nominal de los Valores con un máximo de 15 caracteres numéricos, incluyendo la coma y los decimales
		Se cumplimentará: - FAMT(Importe Nominal) + Cantidad , con un máximo de dos decimales - UNIT(Títulos) + Cantidad, con un máximo de 14 decimales
		Si la cantidad no tiene decimales se incluirá una coma como último carácter Cuando el saldo en títulos sea 0 este campo se informará con el valor 0,
21	Fecha Contratación	Fecha Contratación en formato AAAAMMDD Sólo aplica al Segmento de Renta Variable
22	Importe Efectivo	Importe Efectivo Neto Comprador Pendiente Liquidar
		[N]: carácter que indica signo negativo. Sólo se cumplimenta cuando el efectivo es negativo
		3!a: código de la moneda. Se cumplimenta con "EUR" para euros 15d es el importe. Pueden utilizarse hasta 15 caracteres numéricos (incluyendo la coma y los decimales)
Sub-Bloque B1b Fin Saldo Neto Comprador		SUBBAL
Sub-Bloque B1b Inicio		SUBBAL

#	CAMPO	CONTENIDO
	Saldo Neto Vendedor	Bloque opcional
23	Total Títulos	Saldo Neto Vendedor Valores/Nominal Pendiente Liquidar Regla de codificación idéntica a la descrita en el campo 19
24	Fecha Contratación	Fecha Contratación en formato AAAAMMDD Sólo aplica al Segmento de Renta Variable
25	Importe Efectivo	Importe Efectivo Neto Vendedor Pendiente Liquidar Regla de codificación idéntica a la descrita en el campo 21
	Sub-Bloque B1b Fin Saldo Neto Vendedor	SUBBAL
	Sub-Bloque B1b Inicio Retención	SUBBAL Bloque opcional Sólo aplica al Segmento de Renta Variable
26	Total Títulos retenidos	Total Valores/Nominal retenidos por Entidad Participante Regla de codificación idéntica a la descrita en el campo 19
27	Fecha Contratación	Fecha Contratación en formato AAAAMMDD
28	Importe Efectivo retenido	Importe Efectivo retenido por Entidad Participante Regla de codificación idéntica a la descrita en el campo 21
	Sub-Bloque B1b Fin Retención	SUBBAL
	Sub-Bloque B1b Inicio Saldo Recepción por Ajustes	SUBBAL Bloque opcional
29	Total Títulos	Entrega de Valores/Nominal por Ajustes: Posición por Ajuste de Eventos Regla de codificación idéntica a la descrita en el campo 19
30	Fecha Contratación	Fecha Contratación en formato AAAAMMDD Sólo aplica al Segmento de Renta Variable
31	Importe Efectivo	Importe efectivo de la Recepción de Valores/Nominal por Ajustes Regla de codificación idéntica a la descrita en el campo 21
	Sub-Bloque B1b Fin Saldo Recepción por Ajustes	SUBBAL
	Sub-Bloque B1b Inicio Saldo Entrega por Ajustes	SUBBAL Bloque opcional
32	Total Títulos	Recepción de Valores/Nominal por Ajustes: Posición por Ajuste de Eventos Regla de codificación idéntica a la descrita en el campo 19
33	Fecha Contratación	Fecha Contratación en formato AAAAMMDD Sólo aplica al Segmento de Renta Variable
34	Importe Efectivo	Importe efectivo de la Entrega de Valores/Nominal por Ajustes Regla de codificación idéntica a la descrita en el campo 21

#	CAMPO	CONTENIDO																				
	Sub-Bloque B1b Fin Saldo Entrega por Ajustes	SUBBAL																				
	Sub-Bloque B1b Inicio Otros Saldos	SUBBAL Bloque opcional																				
35	Total Títulos	El contenido de este campo totaliza los títulos detallados en el mensaje, sólo se comunica a efecto de cuadre Regla de codificación idéntica a la descrita en el campo 19																				
	Sub-Bloque B1b1 Inicio Detalle Otros Saldos	BREAK Este sub bloque se repetirá tantas veces como tipos de saldos existan																				
		Tipo de saldo informado:																				
		<table><tr><th>Tipo</th><th>Concepto</th></tr><tr><td>BCOM</td><td>Saldo Bruto Comprador</td></tr><tr><td>BVEN</td><td>Saldo Bruto Vendedor</td></tr><tr><td>FCOM</td><td>Fallido Comprador</td></tr><tr><td>FVEN</td><td>Fallido Vendedor</td></tr><tr><td>EFPA</td><td>Efectivo Pendiente Liquidar</td></tr><tr><td>CPNT</td><td>Saldo Operaciones Especiales Comprador</td></tr><tr><td>VPNT</td><td>Saldo Operaciones Especiales Vendedor</td></tr><tr><td>CDLV</td><td>Saldo Vencimiento de futuros y opciones Comprador</td></tr><tr><td>VDLV</td><td>Saldo Vencimiento de futuros y opciones Vendedor</td></tr></table>	Tipo	Concepto	BCOM	Saldo Bruto Comprador	BVEN	Saldo Bruto Vendedor	FCOM	Fallido Comprador	FVEN	Fallido Vendedor	EFPA	Efectivo Pendiente Liquidar	CPNT	Saldo Operaciones Especiales Comprador	VPNT	Saldo Operaciones Especiales Vendedor	CDLV	Saldo Vencimiento de futuros y opciones Comprador	VDLV	Saldo Vencimiento de futuros y opciones Vendedor
Tipo	Concepto																					
BCOM	Saldo Bruto Comprador																					
BVEN	Saldo Bruto Vendedor																					
FCOM	Fallido Comprador																					
FVEN	Fallido Vendedor																					
EFPA	Efectivo Pendiente Liquidar																					
CPNT	Saldo Operaciones Especiales Comprador																					
VPNT	Saldo Operaciones Especiales Vendedor																					
CDLV	Saldo Vencimiento de futuros y opciones Comprador																					
VDLV	Saldo Vencimiento de futuros y opciones Vendedor																					
36	Tipo de saldo																					
37	Títulos	Posición referida al tipo de saldo informado. Regla de codificación idéntica a la descrita en el campo 19																				
38	Fecha Contratación	Fecha Contratación en formato AAAAMMDD																				
39	Importe Efectivo	Importe Efectivo referido al tipo de saldo informado. Regla de codificación idéntica a la descrita en el campo 21																				
	Sub-Bloque B1b1 Fin Otros Saldos	BREAK																				
	Sub-Bloque B1b Fin Otros Saldos	SUBBAL																				
	Sub-Bloque B1 Fin Valor	FIN																				
	Bloque B Fin Sub-Cuenta	SUBSAFE																				

7. Comunicación de actualización de Operaciones

MT538 – COMUNICACIÓN DE ACTUALIZACIÓN DE DATOS EN OPERACIONES

Descripción	Este formato se empleará para comunicar la actualización de los valores disponibles y retenidos en operaciones registradas en la ECC
Emisor	ECC
Destinatarios	Entidades Participantes

7.1. Descripción del mensaje MT538: Comunicación de actualización de datos en Operaciones

7.1.1. Bloque A: Inicio Datos Generales

	NOMBRE DEL CAMPO	M/O	TAG	CUALIFICADOR	FORMATO
	Bloque A Inicio Datos Generales	M	:16R:		GENL
1	Num. Pag. Indicador Continuación	M	:28E:		5n/4!c
2	Referencia de Mensaje	M	:20C:	:SEME//	16x
3	Función y subfunción del Mensaje	M	:23G:	NEWM	[/4!c]
4	Fecha y Hora de Proceso	M	:98C:	:PREP//	8!n6!n
5	Fecha Inicio – Fecha Fin	M	:69A:	:STAT//	8!n/8!n
6	Indicador de Completo/Actualización	M	:22F:	:CODE//	DELT
7	Indicador de Frecuencia	M	:22F:	:SFRE//	INDA
8	Entidad Participante	M	:95R: :95P:	:ACOW/BMC/ :ACOW//	34x 4!a2!a2!c[3!c]
9	Cuenta Liquidación	M	:97A:	:SAFE//	35x
10	Indicador de actividad	M	:17B:	:ACTI//	Y
	Bloque A Fin Datos Generales	M	:16S:		GENL

7.1.2.Bloque B: Inicio Datos financieros

	NOMBRE DEL CAMPO	M/O	TAG	CUALIFICADOR	FORMATO
	Bloque B Inicio Datos Financieros	M	:16R:		FIN
11	Código de valor	M	:35B:		ISIN1!e12!c
	Sub-Bloque B2 Inicio Sub-Balance	M	:16R:		SUBBAL
12	Balance From	M	:93A:	:FROM//	4!c
	Sub-Bloque B2.1 Inicio Movimiento Intra-posición	M	:16R:		INPOS
	Sub-Bloque B2.1a Inicio Link a la operación	O/M	:16R:		LINK
13	Número de Operación en la ECC	M	:20C:	: PCTI//	16x
	Sub-Bloque B2.1a Fin Link a la operación	O/M	:16S:		LINK
14	Cantidad de valores	M	:36B:	:ESTT//	4!c/15d
15	Importe Efectivo	O	:19 A:	:COMT//	[N]3!a15d
16	Balance To	M	:93A:	:TOBA//	4!c
17	Fecha Teórica de Liquidación	M	:98A:	:SETT//	8!n
	Sub-Bloque B2.1 Fin Movimiento Intra-posición	M	:16S:		INPOS
	Sub-Bloque B2 Fin Sub-Balance	M	:16S:		SUBBAL
	Bloque B Fin Datos Financieros	M	:16R:		FIN

7.2. Información adicional del mensaje MT538: Comunicación de actualización de datos en Operaciones

#	CAMPO	CONTENIDO
	Bloque A Inicio Datos Generales	GENL
1	Num. Pag. Indicador Continuación	Indica el número de pagina, seguido de un indicador: ONLY: no hay más paginas
		Referencia única del Mensaje
		Se informará con la siguiente estructura:
2	Referencia de Mensaje	AAMMDD9999999999
		Siendo AAMMDD la fecha de sesión, y 9999999999 un número único para la fecha sesión.
3	Función y subfuncion del Mensaje	Se informará siempre como NEWM
4	Fecha y Hora de Proceso	Fecha y Hora informada por el emisor del mensaje Formato: AAAAMMDDHHMMSS
5	Fecha Inicio – Fecha Fin	Estas fechas se informarán con la Fecha en la que se registra la actualización de los datos de la operación. Formato: AAAAMMDD/AAAAMMDD
6	Indicador de Completo/Actualización	Se informará siempre con el valor : DELT: Mensaje relativo a actualización de datos de la operación
7	Indicador de Frecuencia	Se informará siempre con: INDA: información suministrada durante la sesión
8	Entidad Participante	Entidad Participante (BIC) En el caso de que no se informe la Entidad Participante se informará el valor: NONE (opción R)
9	Cuenta Liquidación	Identificación de la Cuenta de Liquidación en el DCV: 35x En el caso de que no se informe la Cuenta Liquidación se informará el valor: NONE
10	Indicador de actividad	Siempre se informará con el valor Y
	Bloque A Fin Datos Generales	GENL
	Bloque B Inicio Datos Financieros	FIN
11	Código de valor	Codificación ISIN
	Sub-Bloque B2 Inicio	SUBBAL

#	CAMPO	CONTENIDO
Sub-Balance		
12	Balance From	Actualización de información de operación. Siempre se informará con el valor AWAS.
	Sub-Bloque B2.1 Inicio Link a la operación	INPOS Bloque repetitivo
	Sub-Bloque B2.1a Inicio Link a la operación	LINK
13	Número de operación en la ECC	Número de operación a la que esta referida la actualización de datos.
	Sub-Bloque B2.1a Fin Link a la operación	LINK
14	Cantidad de valores	El contenido de este campo indica el número de valores o importe nominal. Deberá informarse de si los Valores se expresan en número de títulos o Importe Nominal. Se incluirá la cantidad o Importe Nominal de los Valores con un máximo de 15 caracteres numéricos, incluyendo la coma y los decimales Se cumplimentará: - FAMT(Importe Nominal) + Cantidad , con un máximo de dos decimales - UNIT(Títulos) + Cantidad, con un máximo de 14 decimales Si la cantidad no tiene decimales se incluirá una coma como último carácter
15	Importe Efectivo	El contenido de este campo indica el importe efectivo. [N]: carácter que indica signo negativo. Sólo se cumplimenta cuando el efectivo es negativo 3!a: código de la moneda. Se cumplimenta con "EUR" para euros 15d es el importe. Pueden utilizarse hasta 15 caracteres numéricos (incluyendo la coma y los decimales)
16	Balance To	Indica el tipo de información actualizada: AVAL: Información sobre el disponible en la operación BLOK Información sobre retención en la operación. Sólo aplica al Segmento de Renta Variable
17	Fecha Teórica de Liquidación	Fecha Teórica de Liquidación AAAAMMDD
	Sub-Bloque B2.1 Fin Link a la operación	INPOS

#	CAMPO	CONTENIDO
	Sub-Bloque B2 Fin Sub-Balance	SUBBAL
	Bloque B Fin Datos Financieros	FIN

8 Retención/Liberación de Operaciones

MT530 – RETENCIÓN/LIBERACIÓN DE OPERACIONES	
Descripción	Este formato se empleará para comunicar la Retención/Liberación total o parcial de Operaciones anotadas en Cuentas de Posición de la ECC
Emisor	Entidades Participantes
Destinatarios	ECC

Este capítulo sólo aplica al segmento de Renta Variable.

8.1.Descripción del mensaje MT530: Retención/Liberación de Operaciones

8.1.1.Bloque A: Inicio Datos Generales

	NOMBRE DEL CAMPO	M/O	TAG	CUALIFICADOR	FORMATO
	Bloque A Inicio Datos Generales	M	:16R:		GENL
1	Referencia de mensaje	M	:20C:	:SEME//	16x
2	Función y sub-función del mensaje	M	:23G:	NEWM	[/4!c]
3	Fecha y hora de proceso	M	:98C:	:PREP//	8!n6!n
4	Entidad Participante	M	:95R: :95P:	:ACOW/BMCL/ :ACOW//	34x 4!a2!a2!c[3!c]
5	Cuenta del Participante	M	:97A:	:SAFE//	35x
	Bloque A Fin Datos Generales	M	:16S:		GENL

8.1.2.Bloque B: Inicio Datos Solicitados

	NOMBRE DEL CAMPO	M/O	TAG	CUALIFICADOR	FORMATO
	Bloque B Inicio Datos Solicitados	M	:16R:		REQD
6	Número Operación	M	:20C:	:TRRF//	16x
7	Indicador de Retención/Liberación	M	:22F:	:SETT//	4!c
	Bloque B Fin Datos Solicitados	M	:16S:		REQD

8.1.3. Bloque C: Inicio Información Adicional

	NOMBRE DEL CAMPO	M/O	TAG	CUALIFICADOR	FORMATO
	Bloque C Inicio Información Adicional	M	:16R:		ADDINFO
8	Cantidad de Valores	M	:36B:	:SETT//	4!c/15d
9	Fecha Teórica de Liquidación	M	:98A:	:EFD//	AAAAMMDD
	Bloque C Fin Información Adicional	M	:16S:		ADDINFO

8.2. Información adicional del mensaje MT530: Retención/Liberación de Operaciones

# CAMPO	CONTENIDO
Bloque A Inicio Datos Generales	GENL
	Referencia única del mensaje
	Debe informarse con la siguiente estructura:
1 Referencia de mensaje	AAMMDDnnnnnnnnnn
	Siendo AAMMDD la fecha de sesión, y nnnnnnnnnn una cadena de 10 caracteres, de uso libre por la entidad que no debe repetirse para una fecha de sesión
2 Función y sub-función del mensaje	Se informará siempre como NEWM
3 Fecha y hora de proceso	Fecha y Hora informada por el emisor del mensaje Formato: AAAAMMDDHHMMSS
4 Entidad Participante	Identificación de la Entidad Participante
5 Cuenta del Participante	Identificación de la Cuenta de Valores de la Entidad participante
Bloque A Fin Datos Generales	GENL
Bloque B Inicio Datos Solicitados	REQD
6 Número Operación	Número de Operación de la ECC sobre la que va a efectuar la Retención/Liberación de títulos
7 Indicador de Retención/Liberación	Debe informarse con uno de estos Valores: - NPRES: Retención de Títulos - YPRES: Liberación de Títulos
Bloque B Fin Datos Solicitados	REQD
Bloque C Inicio Información Adicional	ADDINFO

# CAMPO	CONTENIDO
8 Cantidad de Valores	Cantidad de Valores de la Operación que se quieren Retener o Liberar Deberá informarse si los Valores se expresan en número de títulos o Importe Nominal. Se incluirá la cantidad o Importe Nominal de los Valores con un máximo de 15 caracteres numéricos, incluyendo la coma y los decimales Se cumplimentará: - FAMT(Importe Nominal) + Cantidad , con un máximo de dos decimales - UNIT (Títulos) + Cantidad, con un máximo de 14 decimales Si la cantidad no tiene decimales se incluirá una coma como último carácter
9 Fecha Teórica de Liquidación	Fecha Teórica de Liquidación
Bloque C Fin Información Adicional	ADDINFO

9. Resultado de Operaciones

MT548 – RESULTADO DE OPERACIONES

Descripción Este formato se empleará para contestar a las Entidades sobre el resultado de:

- Retención de Títulos
- Liberación de Títulos

Emisor ECC

Destinatarios Entidades Participantes

Este capítulo sólo aplica al segmento de Renta Variable.

9.1. Descripción del mensaje MT548: Resultado de Operaciones

9.1.1. Bloque A: Inicio Datos Generales

	NOMBRE DEL CAMPO	M/O	TAG	CUALIFICADOR	FORMATO
	Bloque A Inicio Datos Generales	M	:16R:		GENL
1	Referencia mensaje	M	:20C:	:SEME//	16x
2	Función y sub-función mensaje	M	:23G:	INST	
3	Fecha y hora de proceso	M	:98C:	:PREP//	8!n6!n
	Sub-bloque A1.1 Inicio Link	M	:16R:		LINK
4	Código formato relacionado	M	:13A:	:LINK//	3!c
5	Referencia del mensaje relacionado	M	:20C:	:RELA//	16x
	Sub-bloque A1.1 Fin Link	M	:16S:		LINK
	Sub-bloque A1.2 Inicio Link	O	:16R:		LINK
6	Numero Operación	M	:20C:	:TRRF//	16x
	Sub-bloque A1.2 Fin Link	O	:16S:		LINK
	Sub-bloque A2 Inicio Estado	M	:16R:		STAT
7	Código de estado	M	:25D:		4!c//4!c
	Sub-bloque A2.1 Inicio Motivo	O	:16R:		REAS
8	Motivo	M	:24B:	:REJT//NARR	
9	Descripción	O	:70D:	:REAS//	2*35x
	Sub-bloque A2.1 Fin Motivo	O	:16S:		REAS
	Sub-bloque A2 Fin Estado	M	:16S:		STAT
	Bloque A Fin Datos Generales	M	:16S:		GENL

9.1.2.Bloque B: Inicio Detalles Operación

	NOMBRE DEL CAMPO	M/O	TAG	CUALIFICADOR	FORMATO
	Bloque B Inicio Detalles Operación	O	:16R:		SETTRAN
10	Código de Valor	M	:35B:		ISIN1!e12!c
11	Cantidad de Valores	M	:36B:	:SETT//	4!c/15d
12	Importe efectivo	O	:19A:	:SETT//	[N]3!a15d
13	Entidad Participante	M	:95R: :95P:	:ACOW/BMCL/ :ACOW//	34x 4!a2!a2!c[3!c]
14	Cuenta de Valores de la Entidad Participante	M	:97A:	:SAFE//	35x
15	Indicador de Retención/Liberación	M	:22F:	:SETR/BMCL/	4!c
16	Indicador de entrega o recepción	M	:22H:	:REDE//	4!c DELI Entrega RECE Recepción
17	Indicador de libre o contra pago	M	:22H:	:PAYM//	4!c
18	Fecha Teórica Liquidación	M	:98A:	:SETT//	8!n
19	Fecha Contratación	O	:98A:	:TRAD//	8!n
	Bloque B1 Inicio Participantes ECC	M			SETPRTY
20	Miembro	M	:95R:		:4!c/BMCL/34x SELL o BUYR
21	Cuenta Compensación	M	:97A:	:SAFE//	35x
	Bloque B1 Fin Participantes ECC	M			SETPRTY
	Bloque B Fin Detalles Operación	O	:16S:		SETTRAN

9.2. Información adicional del mensaje MT548: Resultado de Operaciones

# CAMPO	CONTENIDO
Bloque A Inicio Datos Generales	GENL
	Referencia única del mensaje.
	Se informará con la siguiente estructura:
1 Referencia mensaje	AAMMDD9999999999
	Siendo AAMMDD la fecha de sesión, y 9999999999 un número único para la fecha sesión.
2 Función y sub-función mensaje	Siempre se informará con: INST: Nuevo mensaje informado del resultado de la gestión de Operaciones
3 Fecha y hora de proceso	Fecha y Hora informada por el emisor del mensaje Formato: AAAAMMDDHHMMSS
Sub-bloque A1.1 Inicio Link	LINK
4 Código formato relacionado	Indica a qué tipo de mensaje se está respondiendo, Valores posibles: 530
5 Referencia del mensaje relacionado	Se informará con el campo Referencia del Mensaje (20C) del mensaje al que se está respondiendo
Sub-bloque A1.1 Fin Link	LINK
Sub-bloque A1.2 Inicio Link	LINK Bloque opcional
6 Número Operación	Número de Operación de la ECC sobre la que se ha realizado la Retención/Liberación de títulos
Sub-bloque A1.2 Fin Link	LINK
Sub-bloque A2 Inicio Estado	STAT
7 Código de estado	Estado de la Operación: :TPRC//PACK: Aceptado por la ECC :TPRC//REJT: No aceptado por la ECC, ver información adicional el bloque REAS
Sub-bloque A2.1 Inicio Motivo	REAS Bloque opcional y repetitivo
8 Motivo	Siempre se informa con : :REJT//NARR Ver la descripción del error en campo 9
9 Descripción	Para motivo NARR, se trata de un texto que cumplimenta el estado de la Operación
Sub-bloque A2.1 Fin Motivo	REAS
Sub-bloque A2 Fin Estado	STAT

# CAMPO	CONTENIDO
Bloque A Fin Datos Generales	GENL
Bloque B Inicio Detalles Operación	SETTRAN Bloque opcional
10 Código de Valor	Codificación ISIN del Valor
11 Cantidad de Valores	Cantidad de Valores Retenidos/Liberados en la Operación Deberá informarse de si los Valores se expresan en número de títulos o Importe Nominal. Se incluirá la cantidad o Importe Nominal de los Valores con un máximo de 15 caracteres numéricos, incluyendo la coma y los decimales Se cumplimentará: - FAMT(Importe Nominal) + Cantidad , con un máximo de dos decimales - UNIT (Títulos) + Cantidad, con un máximo de 14 decimales Si la cantidad no tiene decimales se incluirá una coma como último carácter
12 Importe efectivo	Importe Efectivo Retenido o Liberado [N]: carácter que indica signo negativo. Sólo se cumplimenta cuando el efectivo es negativo 3!a: código de la moneda. Se cumplimenta con "EUR" para euros 15d es el importe. Pueden utilizarse hasta 15 caracteres numéricos (incluyendo la coma y los decimales)
13 Entidad Participante	Código BIC Entidad Participante
14 Cuenta de Valores de la Entidad Participante	Identificación de la Cuenta de Valores de la Entidad Participante en el DCV
15 Indicador de Retención/Liberación	Se informará con los siguientes valores: - NPRES: Retención de Títulos - YPRES: Liberación de Títulos
16 Indicador de entrega o recepción	Se informarán los siguientes valores, en función del sentido de la operación: DELI Entrega RECE Recepción
17 Indicador de libre o contra pago	Valores informados: APMT: Contra pago FREE: Libre de pago
18 Fecha Teórica Liquidación	Formato: AAAAMMDD
19 Fecha de Operación	Formato: AAAAMMDD
Bloque B1 Inicio Participantes ECC	SETPRTY
20 Miembro	Identificación del Miembro de la ECC propietario de la Cuenta de Posición Para Operaciones de sentido compra se informará con:

# CAMPO		CONTENIDO
		BUYR/BMCL/4!c Para Operaciones de sentido venta se informará con: SELL/BMCL/4!c
21	Cuenta Compensación	Se informará con la Cuenta de Posición: 3x
Bloque B1 Fin Participantes ECC		SETPRTY
Bloque B Fin Detalles Operación		SETTRAN

10. Información de Supervisión

MT598 – INFORMACIÓN DE SUPERVISIÓN	
Descripción	Este formato se empleará para comunicar a las Entidades Participantes, textos informativos en formato libre, emitidos por el Supervisor de la ECC.
Emisor	ECC
Destinatarios	Entidades Participantes

10.1. Descripción del mensaje MT598: Información de Supervisión

10.1.1. Estructura del Mensaje

	NOMBRE DEL CAMPO	M/O	TAG	CUALIFICADOR	FORMATO
1	Referencia mensaje	M	:20:		16x
2	Tipo Sub-mensaje	M	:12:		3!n
3	Texto	M	:77E:		73x [n*78x]

10.2. Información adicional del mensaje MT598: Información de Supervisión

# CAMPO	CONTENIDO
	Referencia única del mensaje.
	Se informará con la siguiente estructura:
1 Referencia mensaje	AAMMDD9999999999
	Siendo AAMMDD la fecha de sesión, y 9999999999 un número único para la fecha sesión.
2 Tipo Sub-mensaje	Siempre se informará con el valor 598.
	Texto informativo en formato libre, la primera línea tendrá como máximo 73 caracteres, el resto de líneas 78 caracteres.
3 Texto	El final de cada línea de texto acaba con un Cr+Lf. La segunda línea contendrá un código identificativo del tipo de información (Headline, tamaño máximo 10). Ver Tabla 16 del documento "Tablas de Codificación"

11. Comunicación de mensajes no aceptados

MT598 – COMUNICACIÓN DE MENSAJES NO ACEPTADOS	
Descripción	Este formato se empleará para comunicar a las Entidades Participantes, el rechazo de mensajes no aceptados.
Emisor	ECC
Destinatarios	Entidades Participantes

11.1. Descripción del mensaje MT598: Comunicación mensajes no aceptados

11.1.1. Estructura del Mensaje

	NOMBRE DEL CAMPO	M/O	TAG	CUALIFICADOR	FORMATO
1	Referencia mensaje	M	:20:		16x
2	Tipo Sub-mensaje	M	:12:		3!n
3	Texto	M	:77E:		73x [n*78x]

11.2. Información adicional del mensaje MT598: Comunicación mensajes no aceptados

# CAMPO	CONTENIDO
	Referencia única del mensaje.
	Se informará con la siguiente estructura:
1 Referencia mensaje	AAMMDD9999999999
	Siendo AAMMDD la fecha de sesión, y 9999999999 un número único para la fecha sesión.
2 Tipo Sub-mensaje	Siempre se informará con el valor 001.
3 Texto	Texto informativo en formato libre, la primera línea tendrá como máximo 73 caracteres, el resto de líneas 78 caracteres. El final de cada línea de texto acaba con un Cr+Lf. Para informar del
Línea 1 NOTIFICACION DE RECHAZO	Siempre se informará con el texto: "NOTIFICACION DE RECHAZO"
Línea 2 SEME-xxxxxxxxxxxxxxxx	Se informará con el texto "SEME:" más la referencia comunicada en el tag 20C::SEME del mensaje rechazado

# CAMPO	CONTENIDO
	SEME-16x En el caso de no existir dicha referencia, se informará a espacios.
Linea 3 MSG-xxx	Se informará con el texto "MSG:" más el código MT del mensaje rechazado: MSG-3!x En el caso de no existir dicha referencia, se informará a espacios.
Linea 4 FEC-AAAAMMDD HHMMSSCC	Se informará la fecha y hora de proceso: FEC-AAAAMMDD HHMMSSCC Fecha y hora de proceso separado por un espacio.
Linea 5 ERR-xxxxxxxxxx	Se informará con el texto "ERR:" más código de error: ERR-10x
Linea 6 TXT-xxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxx	Se informará con el texto "TXT:" más código de error: TXT-69x
Linea 7 a n	Reservadas para uso futuro



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



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

