



MEFF Website

FICHEROS DE DATOS

MEFF / BME CLEARING
v10.08

28 de marzo de 2019

La información contenida en este documento está sujeta a modificaciones sin previo aviso. A menos que se indique lo contrario, las compañías, los nombres y los datos utilizados en los ejemplos son ficticios. Ninguna parte de este documento puede ser reproducida o transmitida de ninguna forma, ni por cualquier medio, ya sea electrónico o mecánico, con ningún propósito, sin la previa autorización por escrito.

© 2019 BME. Todos los derechos reservados.

Tabla de Contenidos

1. Introducción	1
1.1 Alcance	1
1.2 Estructura del documento	1
1.3 Convenciones utilizadas en este documento	2
1.3.1 Definición de ficheros	2
1.3.2 Sintaxis en los ficheros. Tipos de datos	3
1.3.3 Separadores de campos y de registros	3
1.4 Futuras versiones de este documento	4
1.4.1 Nuevos campos	4
1.4.2 Campos eliminados	4
1.4.3 Nuevos ficheros	4
1.4.4 Resaltando cambios	4
2. Ficheros de Negociación	5
2.1 Información diaria de contratos	5
2.2 Operaciones generales	6
2.3 Contratos disponibles en D+1	8
3. Ficheros de Liquidación	10
3.1 Datos Generales	10
3.1.1 Festivos	10
3.1.2 Subgrupos de contratos	10
3.1.3 Tipos de contrato	11
3.1.4 Contratos	12
3.1.5 Parametrización para cálculo de comisiones por diferimiento	13
3.2 Información Pública Diaria	15
3.2.1 Información diaria de contratos	15
3.2.2 Divisas	16
3.3 Datos para Cálculo de Garantías	17
3.3.1 Curva de tipos de interés	17
3.3.2 Skew de volatilidades	17
3.3.3 Parámetros de la matriz de garantías	18
3.3.4 Compensación intra-matriz	19
3.3.5 Compensación inter-matriz	20
3.3.6 Códigos resultantes para cascada teórica	21
3.3.7 Precios teóricos	21
3.3.8 Deltas	22
3.4 Datos para Cálculo de Garantías – modelo de escenarios	23
3.4.1 Parametrización del modelo de cálculo de garantías por posición	23
3.4.2 Parametrización correspondiente al ajuste por tamaño de la posición	24
3.4.3 Buffer (Factor de riesgo) y factor de decaimiento	24
3.4.4 Parametrización del modelo de cálculo de Stress	25
3.4.5 Escenarios en el cálculo de garantías por posición y de Stress Test	26
3.4.6 Calendario de sesiones en que no se aplica ajuste técnico	27
3.4.7 Garantías por 1 contrato	27

Índice de Ficheros

CCONTRACTS.ch	12
CCONTRGRP.ch	10
CCONTRREL.ch	21
CCONTRSTAT.ch	15
CCONTRTYP.ch	11
CCURRENCY.ch	16
CDEFERRALFEEPAR.ch	13
CDELTA.ch	22
CHOLIDAYS.ch	10
CIMFACTORS.ch	24
CIMSINGLEPOSITION.ch	27
CINTERSPR.ch	20
CINTRASPR.ch	19
CLIQUIDITYMARGIN.ch	24
CMARGINPARAMETERS.ch	23
CROLLINGCALENDAR.ch	27
CSCENARIOS.ch	26
CSTRESSTESTPARAMETERS.ch	25
CTHEORPRICES.ch	21
CVALARRAYS.ch	18
CVOLATILITYSKEW.ch	17
CYIELDCURVE.ch	17
MCONTRACTS.mk	8
TCONTRSTAT.mk	5
TGENTRADES.mk	6

1. Introducción

1.1 Alcance

Este documento tiene como objetivo la descripción técnica de datos disponibles en la Website de MEFF y de BME CLEARING.

Esta información será suministrada en ficheros planos cuya definición se encuentra más adelante en este documento.

1.2 Estructura del documento

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

En los capítulos restantes se define cada uno de los ficheros.

1.3 Convenciones utilizadas en este documento

1.3.1 Definición de ficheros

Para cada fichero contenido en este documento se presentan dos tablas como las descritas a continuación.

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

	(1)
<i>Grupo</i>	(2)
<i>Descripción</i>	(3)

(1) – Nombre del fichero tal y como es generado. Todos los ficheros tienen como extensión el código del entorno correspondiente.

(2) - Grupo al que pertenece el fichero

(3) – Descripción del fichero

La segunda tabla describe el formato y contenido de los campos que componen cada uno de los registros del fichero.

#	*	<i>Campo</i>	<i>Tipo</i>	<i>Valores válidos</i>	<i>Descripción</i>
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)

(1) - Número de campo dentro del registro. Cuando incluye una "N" el campo contiene el número de veces que se repiten los campos inmediatamente consecutivos, en los que aparece una "R" en esta columna.

(2) - Contiene "↔" cuando el campo forma parte de la clave del fichero

(3) – Nombre del campo

(4) – Tipo del campo según lo descrito en el siguiente apartado

(5) – Valores válidos o rango de valores

(6) – Descripción del campo

1.3.2 Sintaxis en los ficheros. Tipos de datos

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

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

- **int:** Secuencia de dígitos sin separadores de miles ni decimales y opcionalmente con signo (caracteres ASCII “-“ y “0” – “9”. El carácter signo utiliza un byte (es decir, int es “99999” mientras que int negativo es “-99999”. Téngase en cuenta que valores int pueden representar cifras que empiecen por ceros (es decir “00023” = “23”).
- **float:** Secuencia de dígitos, opcionalmente con coma decimal y signo (caracteres ASCII “-“ , “0” – “9 y “,”); la ausencia de la coma decimal en el valor del campo debe interpretarse como la representación “float” de un valor entero. Todos los campos float tendrán como máximo **quince dígitos significativos (no se tendrán en cuenta ni el signo ni la coma decimal)**. El número de decimales usados será un factor de las necesidades del negocio. Téngase en cuenta que los valores float pueden representar cifras que empiecen por ceros (es decir “00023” = “23”) y pueden contener u omitir ceros al final después de la coma decimal (es decir “23,0” = “23,0000” = “23”).
 - **Qty:** Campo float capaz de almacenar un número completo (sin decimales) de “contratos”.
 - **Price:** Campo float que representa un precio. Téngase en cuenta que el número de decimales puede variar.
 - **Amt:** Campo float que representa un importe. Téngase en cuenta que el número de decimales puede variar.
- **char:** campo de un único carácter. Puede contener cualquier carácter alfanumérico o de puntuación excepto el delimitador. Todos los campos char son sensibles a mayúsculas/minúsculas (es decir, **m** ≠ **M**) y están delimitados por comillas (“”).
- **String:** Cadena de caracteres alfanuméricos. Puede incluir cualquier carácter alfanumérico o de puntuación excepto el delimitador. Todos los campos String son sensibles a mayúsculas/minúsculas (es decir, **ref** ≠ **Ref**) y están delimitados por comillas (“”). La anotación “String(n)” se utiliza para indicar el máximo número de caracteres en el campo String. En algunos casos, “n” implica el número exacto de caracteres y, en este caso se especificará concretamente bajo la columna “Valores válidos”.
 - **Currency:** Campo String que representa una divisa utilizando los valores definidos en la norma ISO 4217 Currency code (3 caracteres).
Ver “Tabla 1 – Códigos de divisa” en documento “Tablas de Codificación”.
 - **LocalDate:** Fecha local en formato AAAAMMDD.
Valores válidos: AAAA = 0000-9999, MM = 01-12, DD = 01-31.
 - **LocalTime:** Hora local de generación del fichero en formato HH:MM:SS
Valores válidos: HH = 00-23, MM = 00-59, SS = 00-59
 - **LongLocalTime:** Local time of file generation in HH:MM:SS.XXXXXX format
Valid values: HH = 00-23, MM = 00-59, SS = 00-59, XXXXXX=000000-999999

1.3.3 Separadores de campos y de registros

Todos los campos están separados por el carácter punto y coma (“;”).

Todos los registros de cada uno de los ficheros están delimitados por los caracteres CR, LF.

1.4 Futuras versiones de este documento

1.4.1 Nuevos campos

Cualquier nuevo campo se incluirá siempre al final del fichero afectado, de forma que afecte lo mínimo posible a aquellos sistemas que hayan sido desarrollados tomando como referencia los ficheros incluidos en este documento.

1.4.2 Campos eliminados

Cualquier campo que sea eliminado de un fichero será sustituido por un campo "FILLER" sin contenido, lo que facilitará la compatibilidad entre la versión anterior y la nueva en la que se elimine el campo. En cada caso, se especificará la vigencia de la compatibilidad entre versiones.

1.4.3 Nuevos ficheros

Debe tenerse en cuenta que este documento puede ser modificado en un futuro para incluir nuevos ficheros.

1.4.4 Resaltando cambios

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

2. Ficheros de Negociación

2.1 Información diaria de contratos

	TCONTRSTAT.mk
Grupo	Información Pública Diaria
Descripción	Datos diarios de los contratos en relación a la sesión de negociación
Destinatarios	Todos los operadores del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	↔	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	↔	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	↔	ContractCode	String(22)		Código de contrato
4		HighPrice	Price		Precio alto de la sesión
5		LowPrice	Price		Precio bajo de la sesión
6		FirstPrice	Price		Primer precio de la sesión
7		LastPrice	Price		Último precio de la sesión
8		ClosingPrice	Price		Precio de cierre en la sesión
9		ClosingVolatility	float		Volatilidad de cierre al cierre de la sesión. Este campo no está informado para opciones largas.
10		ClosingDelta	float		Delta de cierre al cierre de la sesión. Este campo no está informado para opciones largas.
11		PreviousDayClosingPrice	Price		Precio de cierre en la sesión anterior. Puede no estar informado, en caso de que sea el primer día de negociación del contrato.
12		PreviousDayClosingVolatility	float		Volatilidad de cierre al cierre de la sesión anterior. Este campo no está informado para opciones largas. Puede no estar informado en caso de que sea el primer día de negociación del contrato.
13		PreviousDayClosingDelta	float		Delta de cierre al cierre de la sesión anterior. Este campo no está informado para opciones largas. Puede no estar informado en caso de que sea el primer día de negociación del contrato.
14		TotalTrdVolume	Qty		Volumen total negociado
15		NumberOfTrades	int		Número de operaciones negociadas
16		SessionHighBid	Price		Precio de la orden de compra más alta
17		SessionLowOffer	Price		Precio de la orden de venta más baja
18		ForwardPrice	Price		Precio de referencia (forward) para D+1 (solo se informa para contratos de divisa)

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
19		PreviousDayForwardPrice	Price		Precio de referencia (forward) al cierre de la sesión anterior (solo se informa para contratos con diferimiento)

2.2 Operaciones generales

TGENTRADES.mk	
Grupo	Negociación
Descripción	Información pública de todas las operaciones realizadas en la sesión

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	↔	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	↔	ContractGroup	String(2)	Ver tabla 18 en documento "Tablas de codificación"	Código de grupo de contratos
3	↔	TradeExecID	String(12)		Número de registro de negociación
4		ContractCode	String(22)		Código de contrato
5		ExecTime	LongLocal Time		Hora de ejecución
6		TradePrice	Price		Precio
7		Quantity	Qty		Volumen
8		TradeType	char		Tipo de operación
9		MarketID	String(4)		Operating MIC
10		MarketSegmentID	String(4)		Segment MIC
11		Market Mechanism	Char	0: Continuous Auction 3: Quote Driven Market. 4: Dark Order Book. 1: Off Book (including Voice or Messaging Trading). 5: Periodic Auction 6: Request for Quotes.	Mecanismo de negociación
12		ISINCode	String(12)		Código ISIN del contrato a efectos informativos. Puede no estar presente.
13		PublishTime	LocalTime		Hora de publicación

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
14		Post-TransparencyFlags	String(59)	BENC NPFT LRGS ILQD SIZE TPAC XFPH CANC AMND LMTF FULF DATF FULA VOLO FULV FWAF FULJ IDAF VOLW COAF	Flags de posttransparencia, separados por comas.
15		PreviousTradeExecID	String(12)		En caso de retrocesión, corrección y en las operaciones de las patas de una estrategia. Para las operaciones correspondientes a patas de una estrategia este campo contiene el Número de Registro de Negociación de la operación en la estrategia.
16		ExecDate	LocalDate		Fecha de ejecución
17		PublishDate	LocalDate		Fecha de publicación

2.3 Contratos disponibles en D+1

MCONTRACTS.mk	
Grupo	Datos Generales
Descripción	Información general de los contratos disponibles en la sesión D+1

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	↔	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	↔	ContractGroup	String(2)	Ver tabla 18 en documento "Tablas de codificación"	Código de grupo de contratos
3	↔	ContractCode	String(22)		Código de contrato
4		ContractSubgroupCode	String(2)	Ver tabla 20 en documento "Tablas de codificación" o contenido del fichero TCONTRGRP.mk	Subgrupo de contrato
5		ContractTypeCode	String(4)		Tipo de contrato
6		StrikePrice	Price		Precio de ejercicio
7		MaturityDate	LocalDate		Fecha de vencimiento
8		TradingStartDate	LocalDate		Fecha de inicio de negociación
9		TradingEndDate	LocalDate		Fecha de fin de negociación
10		TSBuyingContractCode	String(22)		Código del contrato comprador Time Spread (para la orden de compra)
11		TSSellingContractCode	String(22)		Código del contrato vendedor Time Spread (para la orden de compra)
12		TSZeroBase	Price		Base cero para cotización de Time Spread
13		MaturityMonthYear	String(8)	Ver NOTA en la descripción.	Identificador del vencimiento. NOTA: - YYYYMM: mensuales y trimestrales - YYYYMMDD: No estándar - YYYYMMwW: semanales Siendo: YYYY=año, MM=mes, DD=día, w="w", W=semana
14		ISINCode	String(12)		Código ISIN del contrato a efectos informativos. Puede no estar presente.
15		StartMaturityMonthYear	LocalDate		Fecha de inicio de entrega (contratos de energía)
16		EndMaturityMonthYear	LocalDate		Fecha de fin de entrega (contratos de energía)

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
17		AssetClass	Char(4)	COMM: commodities CRDT: Credit CURR: currency EQUI: equities INTR: Interest rate EMAL: Emission allowances	
18		Base product	Char(4)	Ver Reglamento Delegado UE 2017/585	Sólo para AssetClass=COMM
19		Sub-product	Char(4)	Ver Reglamento Delegado UE 2017/585	
20		Further subproduct	Char(4)	Ver Reglamento Delegado UE 2017/585	
21		SSTI-pre	Amt		
22		LIS-pre	Amt		
23		SSTI-post	Amt		
24		LIS-post	Amt		
25		VersionNumber	Char		Versión del contrato (0 si no ha sufrido ajustes)

3. Ficheros de Liquidación

3.1 Datos Generales

3.1.1 Festivos

CHOLIDAYS.ch	
Grupo	Datos Generales
Descripción	Calendario de festivos de liquidación

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	↔	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	↔	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	↔	HolidayDate	LocalDate		Fecha del festivo
4		RegistrationOpen	Char	S/N	Abierto a registro

3.1.2 Subgrupos de contratos

CCONTRGRP.ch	
Grupo	Liquidación
Descripción	Subgrupos de contratos Su contenido es equivalente a las tablas 20 y 21 del documento "Tablas de Codificación"

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	↔	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	↔	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	↔	ContractSubgroupCode	String(2)	Ver tabla 20 en documento "Tablas de codificación" o contenido del fichero CCONTRGRP.ch	Subgrupo de contrato
4		ContractSubgroupDescription	String(20)		Descripción del subgrupo de contratos
5		ContractSubgroupUnderlying	String(22)	Ver tabla 21 en documento "Tablas de codificación"	Código de contrato de contado del subgrupo

3.1.3 Tipos de contrato

CCONTRTYP.ch	
Grupo	Liquidación
Descripción	Tipos de contratos

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	↔	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2		ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	↔	ContractSubgroupCode	String(2)	Ver tabla 20 en documento "Tablas de codificación" o contenido del fichero CCONTRGRP.ch	Código de subgrupo de contratos
4	↔	ContractTypeCode	String(4)		Tipo de contrato
5		ContractTypeDescription	String(20)		Descripción del tipo de contrato
6		PriceMultiplier	float		Multiplicador que debe aplicarse al precio del contrato
7		Nominal	Amt		Nominal de los contratos de este tipo
8		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que se expresa el precio de los contratos de este tipo
9		CalcMethod	char	"1"=Black-76 "2"=Binomial "3"=Black Scholes	Método de cálculo de precios para los contratos de este tipo
10		InternalCode	String(6)		
11		ContractFamily	String(5)	ver Tabla 28 en documento "Tablas de Codificación"	
12		All	String(12)		Identificador All
13		PriceType	Int	1 = Precio 2= Rentabilidad	
14		SecurityType	String(1)	"E"= Strategy "F"=Future "M"=Forward "O"=Option "R"=Roll-over "W"=Swap "X"=Other	Tipo de producto
15		FlexibleIndicator	String(1)	"Y" – No estándar "N" - Estándar	Para indicar si es estándar o no
16		ExerciseStyle	String(1)	"A" - Americano "E" - Europeo	Tipo de Ejercicio
17		SettMethod	String(1)	"P" – física "C" - cash	Método de liquidación

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
18		PutorCall	String(1)	"P" – Put "C" - Call	Tipo de opción
19		Periodicity	String(1)	"Y" – Anual "S"- Semestral "Q" – Trimestral "M" – Mensual "m" – Balance del mes "K" – Semanal (L-D) "k" – Balance de la semana "B" – Semanal (L-V) "E" – Semanal (S-D) "D" – Diario	
20		AdjustmentsRule	String(1)	"E" – Sólo extraordinarios "T" - Todos	Tipo de ajuste
21		CFICode	String(6)	ver Tabla 16 en documento "Tablas de Codificación"	CFICode oficial EMIR Reporting
22		UnitOfMeasure	Char(20)		Unidad de medida del multiplicador
23		BaseCurrency	Char(3)	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que se expresa el nominal de los contratos de este tipo
24		SettlCurrency	Char(3)	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa a la que se convertirán las liquidaciones de estos contratos

3.1.4 Contratos

CCONTRACTS.ch	
Grupo	Datos Generales
Descripción	Información general de los contratos disponibles en la sesión

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	↔	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2		ContractGroup	String(2)	Ver tabla 17 en documento "Tablas de codificación"	Código de grupo de contratos
3	↔	ContractCode	String(22)		Código de contrato

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
4		ContractSubgroupCode	String(2)	Ver tabla 20 en documento "Tablas de codificación" o contenido del fichero CCONTRGRP.ch	Subgrupo del contrato
5		ContractTypeCode	String(4)		Tipo del contrato
6		StrikePrice	Price		Precio de ejercicio
7		MaturityDate	LocalDate		Fecha de vencimiento
8		TradingEndDate	LocalDate		Fecha de fin de negociación
9		ExerciseUnderlyingContractCode	String(22)		Código de contrato subyacente a efectos de ejercicio
10		MarginUnderlyingContractCode	String(22)		Código de contrato subyacente para el cálculo de garantías
11		ArrayCode	String(3)		Código de matriz de garantías
12		FILLER	String(2)		Filler (contenido no relevante)
13		FILLER	String(2)		Filler (contenido no relevante)
14		ExpirySpan	char	Códigos:A..Z, 0..9	Tipo de vencimiento usado para el cálculo de garantías
15		MaturityMonthYear	String(8)	Formatos: YYYYMM YYYYMMDD YYYYMMwW (YYYY=año, MM=mes, DD=día, w="w", W=semana	Identificador del vencimiento
16		ISINCode	String(12)		Código ISIN del contrato a efectos informativos. Puede no estar presente.
17		StartMaturityMonthYear	LocalDate		Fecha de inicio de entrega para los contratos de energía
18		EndMaturityMonthYear	LocalDate		Fecha de fin de entrega para los contratos de energía
19		VersionNumber	Int		Versión del contrato (0 si no ha sufrido ajustes)
20		ForwardMaturityDate	LocalDate		Para los contratos con diferimiento, es la fecha teórica de vencimiento del forward. En general, D+3.
21		SpotMaturityDate	LocalDate		Para los contratos con diferimiento, es la fecha teórica de vencimiento del spot. En general, D+2.

3.1.5 Parametrización para cálculo de comisiones por diferimiento

	CDEFERRALFEEDPAR.ch
Grupo	Datos Generales
Descripción	Parámetros para el cálculo de la comisión por diferimiento

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	↔	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	↔	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	↔	ContractCode	String(22)		Código de contrato
4		FloorMarkUp	Amt		Mark-up floor
5		CapMarkUp	Amt		Mark-up cap
6N		NumberOfTranches	int	<=15	Número de tramos que se definen a continuación. Máximo 15
7R		TrancheThreshold	float		Umbral del tramo
8R		BuyMarkUp	float		Mark-up compra tramo
9R		SellMarkUp	float		Mark-up venta tramo

3.2 Información Pública Diaria

3.2.1 Información diaria de contratos

CCONTRSTAT.ch	
Grupo	Información Pública Diaria
Descripción	Datos diarios de los contratos del grupo de contratos
Destinatarios	Todos los usuarios del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	↔	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	↔	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	↔	ContractCode	String(22)		Código de contrato
4		HighPrice	Price		Precio alto de la sesión
5		LowPrice	Price		Precio bajo de la sesión
6		FirstPrice	Price		Primer precio de la sesión
7		LastPrice	Price		Último precio de la sesión
8		SettlPrice	Price		Precio de liquidación en la sesión
9		SettlVolatility	float		Volatilidad de liquidación al cierre de la sesión. Este campo no está informado para opciones largas.
10		SettlDelta	float		Delta de liquidación al cierre de la sesión. Este campo no está informado para opciones largas.
11		PreviousDaySettlPrice	Price		Precio de liquidación en la sesión anterior. Puede no estar informado en caso de que sea el primer día de liquidación del contrato.
12		PreviousDaySettlVolatility	float		Volatilidad de liquidación al cierre de la sesión anterior. Este campo no está informado para opciones largas. Puede no estar informado en caso de que sea el primer día de liquidación del contrato.
13		PreviousDaySettlDelta	float		Delta de liquidación al cierre de la sesión anterior. Este campo no está informado para opciones largas. Puede no estar informado en caso de que sea el primer día de liquidación del contrato.
14		TotalRegVolume	Qty		Volumen total registrado
15		NumberOfTrades	int		Número de operaciones registrado
16		OpenInterest	Qty		Posición abierta
17		AccruedInterest	Price		Cupón corrido incorporado al precio de liquidación de la sesión. Sólo para bonos y obligaciones

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
18		Yield	Price		
19		ForwardPrice	Price		Precio de referencia (forward) para D+1 (solo se informa para contratos de divisa)
20		PreviousDayForwardPrice	Price		Precio de referencia (forward) al cierre de la sesión anterior (solo se informa para contratos con diferimiento)

3.2.2 Divisas

CCCURRENCY.ch	
Grupo	Información pública diaria
Descripción	Divisas utilizadas en la cámara, tipos de cambio a la divisa de liquidación

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	↔	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	↔	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	↔	Currency	String(3)	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Código de divisa. En los contratos de divisa es la divisa cotizada o segunda del par.
4		SettlCurrency	String(3)	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que se liquidan los cálculos
5		ConversionRate	Price		Tipo de cambio de conversión a la divisa de liquidación

3.3 Datos para Cálculo de Garantías

3.3.1 Curva de tipos de interés

CYIELDCURVE.ch	
Grupo	Liquidación
Descripción	Información sobre tipos de interés utilizados en el cálculo de precios teóricos, por tramos

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	↔	SessionDate	LocalDate		Fecha de la sesión
2		ContractGroup	String(2)	Ver tabla 18 en documento "Tablas de codificación"	Código de grupo de contratos
3	↔	CalcType	char	"2"=Garantía "3"=Actualización efectivo compras "4"=Actualización efectivo ventas	Tipo de cálculo
4	↔	DayRangeStart	int	>=0 y <= 99999	Número de días a partir del cual debe aplicarse el tipo de interés especificado. Es menor o igual que DayRangeEnd
5		DayRangeEnd	int	>=0 y <= 99999	Número de días hasta el que debe aplicarse el tipo de interés especificado. Es mayor o igual que DayRangeStart
6		YieldCurveRate	float		Tipo de interés de la curva de tipos para el plazo correspondiente. En tanto por ciento.

3.3.2 Skew de volatilidades

CVOLATILITYSKEW.ch	
Grupo	Liquidación
Descripción	Curva de volatilidades utilizada en el cálculo de precios teóricos

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	↔	SessionDate	LocalDate		Fecha de la sesión
2	↔	ContractGroup	String(2)	Ver tabla 18 en documento "Tablas de codificación"	Código de grupo de contratos
3	↔	Underlying	String(22)		Código de subyacente (contrato de contado)
4	↔	MaturityDate	LocalDate		Fecha de vencimiento

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
5	↔	InstrumentType	char	"C"=Call "P"=Put "?"=Todos (Call y Put)	Indicador que informa si el registro se refiere a las opciones call, opciones put, o ambas
6		VolatilityATM	float		Volatilidad At The Money. En tanto por ciento.
7		Divisor	int		Divisor de puntos porcentuales. Indica a que porcentaje se aplica cada incremento de volatilidad
8		MinimumVolatility	float		Volatilidad mínima. En tanto por ciento.
9		MaximumVolatility	float		Volatilidad máxima. En tanto por ciento.
10N		NumberOfRanges	int	<=8	Número de rangos que contiene este registro. Seguirán cuatro campos como los que se describen a continuación por cada rango
11R		VariationPercentage1	float		Porcentaje de variación para precio de ejercicio >= precio del subyacente. Se expresa como un porcentaje sobre el precio de referencia y es acumulativo. Por ejemplo si para el primer tramo es un 10% y para el segundo tramo es un 15%, esto quiere decir que es un 10+15 % sobre el precio de referencia. En tanto por ciento.
12R		VariationPoints1	float		Puntos porcentuales de incremento / decremento para precio de ejercicio >= precio del subyacente
13R		VariationPercentage2	float		Porcentaje de variación para precio de ejercicio < precio del subyacente. Se expresa como un porcentaje sobre el precio de referencia y es acumulativo. Por ejemplo si para el primer tramo es un 10% y para el segundo tramo es un 15%, esto quiere decir que es un 10+15 % sobre el precio de referencia. En tanto por ciento.
14R		VariationPoints2	float		Puntos porcentuales de incremento / decremento para precio de ejercicio < precio del subyacente

3.3.3 Parámetros de la matriz de garantías

CVALARRAYS.ch	
Grupo	Datos para Cálculo de Garantías
Descripción	Parámetros de cada una de las matrices de cálculo de garantía

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	↔	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
2		ContractGroup	String(2)	Ver tabla 18 en documento "Tablas de codificación"	Código de grupo de contratos
3	↔	ArrayCode	String(3)		Código de matriz de garantías
4	↔	FILLER	String(2)		Filler (contenido no relevante)
5	↔	ExpirySpan	char	Códigos:A..Z, 0..9	Tipo de vencimiento
6		NumberOfColumns	int	<=41	Número de columnas
7		PriceFluctuationType	char	"P"=Porcentual "T"=Por precio	Tipo de fluctuación de precios
8		PriceIncFluctuation	float		Fluctuación de crecimiento (izquierda)
9		PriceDecFluctuation	float		Fluctuación de decrecimiento (derecha)
10		VolatilityVariationType	char	"P"=Porcentual "T"=Aditiva	Forma de aplicar la variación de la volatilidad
11		VolatilityVariation	float		Variación de volatilidad
12		ContractSubgroupCode	String(2)		Subgrupo de contrato referencia para compensación entre subyacentes distintos
13		ContractTypeCode	String(4)		Tipo de contrato referencia para compensación entre subyacentes distintos
14		LargePosThreshold	float		Delta a partir de la cual aplican las garantías para grandes posiciones.
15		FILLER	Int		

3.3.4 Compensación intra-matriz

CINTRASPR.ch	
Grupo	Datos para Cálculo de Garantías
Descripción	Tabla de compensaciones a aplicar en el cálculo de garantías para posiciones de signo contrario sobre contratos con el mismo código de matriz

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	↔	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2		ContractGroup	String(2)	Ver tabla 18 en documento "Tablas de codificación"	Código de grupo de contratos
3	↔	ArrayCode	String(3)		Código de matriz de garantías
4	↔	FILLER	String(2)		Filler (contenido no relevante)
5		FILLER	String(2)		Filler (contenido no relevante)
6		FILLER	String(4)		Filler (contenido no relevante)
7		FILLER	String(2)		Filler (contenido no relevante)
8		FILLER	String(2)		Filler (contenido no relevante)
9		FILLER	String(4)		Filler (contenido no relevante)

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
10		FILLER	String(2)		Filler (contenido no relevante)
11		Factor	float		Factor
12		MinimumValue	float		Valor mínimo
13		Spread	float		Spread
14	↔	FILLER	String(2)		Filler (contenido no relevante)
15		DayCalc	char	"S"=La distancia entre vencimientos se cuenta en días "N"=La distancia entre vencimientos se cuenta en meses	

3.3.5 Compensación inter-matriz

CINTERSPR.ch	
Grupo	Datos para Cálculo de Garantías
Descripción	Tabla de compensaciones a aplicar en el cálculo de garantías para posiciones de signo contrario sobre contratos con diferente código de matriz

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	↔	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2		ContractGroup	String(2)	Ver tabla 18 en documento "Tablas de codificación"	Código de grupo de contratos
3	↔	OffsetPriority	String(3)		Prioridad
4		ArrayCode1	String(3)		Código de matriz 1
5		FILLER	String(2)		Filler (contenido no relevante)
6		FILLER	String(4)		Filler (contenido no relevante)
7		FILLER	String(2)		Filler (contenido no relevante)
8		FILLER	String(2)		Filler (contenido no relevante)
9		GroupOffsetDiscount1	Amt		Descuento en grupo de compensación 1
10		OffsetMultiplier1	float		Multiplicador de compensación 1
11		ArrayCode2	String(3)		Código de matriz 2
12		FILLER	String(2)		Filler (contenido no relevante)
13		FILLER	String(4)		Filler (contenido no relevante)
14		FILLER	String(2)		Filler (contenido no relevante)
15		FILLER	String(2)		Filler (contenido no relevante)
16		GroupOffsetDiscount2	Amt		Descuento en grupo de compensación 2
17		OffsetMultiplier2	float		Multiplicador de compensación 2
18		FILLER	Amt		Filler (contenido no relevante)

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
19		DiscountType	char	"D"=Divisa "P"=Porcentaje	Tipo de descuento que se aplica

3.3.6 Códigos resultantes para cascada teórica

CCONTRREL.ch	
Grupo	Datos Generales
Descripción	Relación entre contrato original y sus contratos resultantes, en caso de en el grupo de contratos haya contratos cuya posición deba desglosarse en otros de nominal menor. Para Energía informa de las relaciones resultantes de aplicar la cascada teórica.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	↔	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	↔	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	↔	ContractCode	String(22)		Código de contrato original
4N		NumberOfRelatedContracts	Int		Número de relaciones que se definen a continuación. Máximo 31.
5R		RelatedContractCode	String(22)		Código de contrato resultante
6R		ContractInitialDate	LocalDate		Fecha inicial del contrato. En Energía es la fecha inicial del período de entrega del contrato resultante.
7R		ContractFinalDate	LocalDate		Fecha final del contrato. En Energía es la fecha final del período de entrega del contrato resultante.

3.3.7 Precios teóricos

CTHEORPRICES.ch	
Grupo	Liquidación
Descripción	Precios teóricos de los contratos utilizados para el cálculo de garantías

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	↔	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2		ContractGroup	String(2)	Ver tabla 18 en documento "Tablas de codificación"	Código de grupo de contratos
3	↔	ContractCode	String(22)		Código de contrato
4	↔	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Indica si el registro contiene precios teóricos para posiciones compradoras o vendedoras
5N		NumberOfTheoreticalPrices	int		Número de precios teóricos contenidos en el registro. A continuación se encuentran tantos campos como indique éste

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
6R		TheoreticalPrice	Price		Precio teórico

3.3.8 Deltas

CDELTA.ch	
Grupo	Liquidación
Descripción	Deltas de los contratos utilizadas para el cálculo de garantías

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	↔	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2		ContractGroup	String(2)	Ver tabla 18 en documento "Tablas de codificación"	Código de grupo de contratos
3	↔	ContractCode	String(22)		Código de contrato
4	↔	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Indica si el registro contiene deltas para posiciones compradoras o vendedoras
5N		NumberOfDeltas	int		Número de deltas contenidas en el registro. A continuación se encuentran tantos campos como indique éste
6R		Delta	float		Delta

3.4 Datos para Cálculo de Garantías – modelo de escenarios

3.4.1 Parametrización del modelo de cálculo de garantías por posición

CMARGINPARAMETERS.ch	
Grupo	Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios
Descripción	Información de la parametrización del modelo de cálculo de garantías por posición (modelo de escenarios)

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	→	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	→	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3		MporHouse	Int		Número de días Mpor House
4		MporClient	Int		Número de días Mpor Cliente
5		HvarCI	float	Porcentaje, expresado en tanto por uno: 5% sería 0,05 (4 decimales)	Nivel de confianza HVAR
6		EsCI	float	Porcentaje, expresado en tanto por uno: 5% sería 0,05 (4 decimales). Debería corresponder a la media de los 18 peores escenarios	Nivel de confianza ES
7		LookBackPeriod	Int		Es el número de escenarios históricos que se utilizan en el cálculo del IM. Se aplicará el mismo para HVaR y ES. En principio 2520.
8		NonScaledScenariosNumberFV	Int		Número de escenarios no escalados a realizar full valuation (no aplica a FX RSF)
9		ScaledScenariosNumberFV	Int		Número de escenarios escalados a realizar full valuation (no aplica a FX RSF)
10		IMbaseBuffer	float		Multiplicador sobre el IM Base
11		IMFloorFactor	float	Porcentaje, expresado en tanto por uno: 20% sería 0.20 (4 decimales)	Multiplicador sobre el IM Base para obtener la garantía mínima
12		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa de los datos de riesgo a continuación o "Divisa Cálculo Garantías"
13		DaysSmoothingParam	Int		N (DaySmoothingParam) corresponde al valor a computar en el smoothing parameter definido como $2/(N+1)$. El valor por defecto es 10.

3.4.2 Parametrización correspondiente al ajuste por tamaño de la posición

CLIQDITYMARGIN.ch	
Grupo	Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios
Descripción	Información para cada par de divisas de la parametrización correspondiente al ajuste por tamaño de la posición en condiciones normales y de stress de mercado. (modelo de escenarios)

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	↔	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	↔	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	↔	ContractSubgroupCode	String(2)	ver Tabla 20 en documento "Tablas de Codificación" o contenido del fichero CCONTRGRP.ch	Código de subgrupo de contratos
4		ContractSubgroupDescription	String(20)	Ver tabla 21 en documento "Tablas de codificación"	Descripción del subgrupo de contratos
5		QuantityMax	Int		Volumen Maximo en mercado
6N		NumberOfIntervals	Int		Número de intervalos que se definen a continuación. Máximo 10.
7R		QuantityInterval	Int		El valor de este campo por QuantityMax marca la frontera con el siguiente tramo de volumen máximo de mercado (habitualmente 5 intervalos)
8R		Surcharge	float		Sobrecoste por iliquidez expresado en la divisa cotizada

3.4.3 Buffer (Factor de riesgo) y factor de decaimiento

CIMFACTORS.ch	
Grupo	Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios
Descripción	Información para cada par de divisas del factor de riesgo soberano y decay factor que aplica (modelo de escenarios)

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	↔	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	↔	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
3	↔	ContractSubgroupCode	String(2)	ver Tabla 20 en documento "Tablas de Codificación" o contenido del fichero CCONTRGRP.ch	Código de subgrupo de contratos
4		ContractSubgroupDescription	String(20)	Ver tabla 21 en documento "Tablas de codificación"	Descripción del subgrupo de contratos
5		RiskFactorBuffer	float		Factor multiplicativo que aplica al cálculo de retornos.
6		DecayFactorSpot	float		Valor entre 0 y 1 usado en el método EWMA.
7		DecayFactorSwapPoints	float		Valor entre 0 y 1 usado en el método EWMA.

3.4.4 Parametrización del modelo de cálculo de Stress

CSTRESSTESTPARAMETERS.ch	
Grupo	Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios
Descripción	Información de la parametrización del modelo de cálculo de Stress Test (modelo de escenarios)

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	↔	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	↔	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3		StressHistPeriod	Int		Número de escenarios históricos usados para calcular el Stress Test: "-1" = todos los escenarios "1, 2,...,n" = número de escenarios a utilizar en el cálculos
4		StressHypoPeriod	Int		Número de escenarios hipotéticos usados para calcular el Stress Test: "-1" = todos los escenarios "1, 2,...,n" = número de escenarios a utilizar en el cálculos
5		StressNivelConfidenceHist	float	Porcentaje, expresado en tanto por uno: 5% sería 0,05 (4 decimales)	Nivel de confianza para escenarios históricos para el cálculo del stress test (1 -> El peor; 0 -> El menos malo)
6		StressNivelConfidenceHypo	float	Porcentaje, expresado en tanto por uno: 5% sería 0,05 (4 decimales)	Nivel de confianza para escenarios hipotéticos para el cálculo del stress test (1 -> El peor; 0 -> El menos malo)
7		StressNumScenariosDDBB	Int		Número de peores escenarios que se grabarán en base de datos como resultado del Stress Test

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
8		StressAvgHist	char	N"= No, "S"= Sí	Promediar o no las pérdidas y ganancias generadas por escenarios históricos que correspondan al nivel de confianza establecido. "N"= No, "S"= Sí
9		StressAvgHypo	char	N"= No, "S"= Sí	Promediar o no las pérdidas y ganancias generadas por escenarios hipotéticos que correspondan al nivel de confianza establecido. "N"= No, "S"= Sí
10		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa de los datos de riesgo a continuación o "Divisa Cálculo Stress Test"

3.4.5 Escenarios en el cálculo de garantías por posición y de Stress Test

CSCENARIOS.ch	
Grupo	Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios
Descripción	Información de los escenarios históricos, históricos escalados e hipotéticos utilizados por el algoritmo de cálculo de garantías por posición y de Stress Test (modelo de escenarios)

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	↔	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	↔	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
4	↔	ContractSubgroupCode	String(2)	ver Tabla 20 en documento "Tablas de Codificación" o contenido del fichero CCONTRGRP.ch	Código de subgrupo de contratos
3	↔	ContractTypeCode	String(4)		Tipo de contrato
5	↔	ScenarioType	String(4)		Puede ser un escenario histórico (HIST) o un escenario hipotético (HYPO)
6	↔	ScenarioID	String(18)		Fecha del escenario para Históricos Nombre del escenario para Hipotéticos
7		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que se expresan los retornos
8		ReturnShiftNonScalated	float	Porcentaje, expresado en tanto por uno: 5% sería 0,05 (como máximo 15 decimales)	Retorno no escalado

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
9		ReturnShiftScalated	float	Porcentaje, expresado en tanto por uno: 5% sería 0,05 (como máximo 15 decimales)	Retorno escalado

3.4.6 Calendario de sesiones en que no se aplica ajuste técnico

CROLLINGCALENDAR.ch	
Grupo	Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios
Descripción	Calendario, a nivel de subyacente, de las sesiones en las que no se deberá generar el ajuste técnico para la posición abierta

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	↔	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	↔	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	↔	ContractSubgroupCode	String(2)	ver Tabla 20 en documento "Tablas de Codificación" o contenido del fichero CCONTRGRP.ch	Código de subgrupo de contratos
4		ContractSubgroupDescription	String(20)	Ver tabla 21 en documento "Tablas de codificación"	Descripción del subgrupo de contratos
5N		NumberOfHolidays	Int	<=40	Número de días festivos que se definen a continuación. Máximo 40
5R		HolidayDate	LocalDate		Fecha de la sesión en que no se aplica ajuste técnico a los contratos de este subgrupo de contratos.

3.4.7 Garantías por 1 contrato

CIMSINGLEPOSITION.ch	
Grupo	Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios
Descripción	Importe de garantías requeridas por una posición de un 1 contrato

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	↔	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	↔	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
3	↔	ContractSubgroupCode	String(2)	ver Tabla 20 en documento "Tablas de Codificación" o contenido del fichero CCONTRGRP.ch	Código de subgrupo de contratos
4		ContractSubgroupDescription	String(20)	Ver tabla 21 en documento "Tablas de codificación"	Descripción del subgrupo de contratos
5		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa de los datos de riesgo a continuación o "Divisa Cálculo Garantías"
6		InitialMarginLongOnecontract	Amt		Initial Margin requerido por una posición de un 1 contrato comprado
7		InitialMarginShortOnecontract	Amt		Initial Margin requerido por una posición de un 1 contrato vendido
8	↔	ContractTypeCode	String(4)		Tipo de contrato