

Circular C-DF-10/2023

Contratos admitidos en BME CLEARING

BME CLEARING

Circular General

Fecha de entrada en vigor: 21 de diciembre de 2023

Sustituye a: C-DF-06/2023

Contratos admitidos en BME CLEARING. Codificación y Especificaciones Técnicas.

Esta Circular contiene la codificación y especificaciones de los contratos listados en BME CLEARING. Se modifica por un cambio en la codificación de los contratos después de un ajuste por hecho corporativo.

1. CONTRATOS CON VENCIMIENTO ESTÁNDAR

FUTUROS								
NOMBRE	MERCADO	CÓDIGO PRODUCTO*	TICK	DECIMALES NEGOCIACIÓN	DECIMALES REGISTRO	ÚLTIMO DÍA NEGOCIACIÓN	PRECIO LIQUIDACIÓN A VENCIMIENTO	VENCIMIENTOS ABIERTOS
ACCIONES POR DIFERENCIA	BME	FxxxmyC	0,01	2	6	Tercer Viernes	Precio Oficial Cierre Viernes	2 mensuales y 4 trimestrales
ACCIONES POR ENTREGA	BME	FxxxmyP	0,01	2	6	Tercer viernes	Precio Oficial Cierre Viernes	2 mensuales y 4 trimestrales
FUTUROS SOBRE DIVIDENDOS ACCIONES	BME	FxxxDmy	0,001	3	6	Tercer Viernes	Suma de los dividendos brutos pagados desde el lunes posterior al tercer viernes de diciembre anterior, hasta la Fecha de Vencimiento (ambas fechas inclusive).	2 mensuales, 3 trimestrales y al menos 5 anuales**
FUTUROS SOBRE DIVIDENDOS ACCIONES PLUS	BME	FxxxDDmy	0,001	3	6	Tercer Viernes	Suma de los dividendos brutos pagados desde el lunes posterior al tercer viernes de diciembre anterior, hasta la Fecha de Vencimiento (ambas fechas inclusive).	2 mensuales, 3 trimestrales, y al menos 5 anuales**
IBEX 35	BME	FIBXmy	1	0	2	Tercer Viernes	Media aritmética del Índice IBEX 35® entre las 16:15 y 16:45 de la Fecha de Vencimiento.	2 mensuales, 10 trimestrales y 5 semestrales (5 años)
MINI IBEX 35	BME	FMIXmy	5	0	2	Tercer Viernes	Media aritmética del Índice IBEX 35® entre las 16:15 y 16:45 de la Fecha de Vencimiento.	2 mensuales, 10 trimestrales y 5 semestrales (5 años)
MICRO IBEX 35	BME	FMICmy	1	0	2	Viernes	Media aritmética del Índice IBEX 35® entre las 16:15 y 16:45 de la Fecha de Vencimiento si la fecha de vencimiento es igual a la fecha de vencimiento de un Contrato estándar mensual. Para el resto de los casos, el Precio de Liquidación a Vencimiento será el Precio de Cierre del índice IBEX 35.	Al menos 2 mensuales****

FUTUROS								
NOMBRE	MERCADO	CÓDIGO PRODUCTO*	TICK	DECIMALES NEGOCIACIÓN	DECIMALES REGISTRO	ÚLTIMO DÍA NEGOCIACIÓN	PRECIO LIQUIDACIÓN A VENCIMIENTO	VENCIMIENTOS ABIERTOS
IBEX 35 IMPACTO DIV	BME	FIXDmy	1	0	2	Tercer Viernes Diciembre	Valor del Índice IBEX 35® IMPACTO DIV a cierre de sesión, calculado por Sociedad de Bolsas.	3 mensuales y al menos 5 anuales**.
IBEX 35 BANCOS	BME	FIBBmy	1	0	2	Tercer Viernes	Media aritmética del Índice IBEX 35® BANCOS entre las 16:15 y 16:45 de la Fecha de Vencimiento.	2 mensuales, 10 trimestrales y 5 semestrales (5 años)
IBEX 35 ENERGÍA	BME	FIBUmy	1	0	2	Tercer Viernes	Media aritmética del Índice IBEX 35® ENERGÍA entre las 16:15 y 16:45 de la Fecha de Vencimiento.	2 mensuales, 10 trimestrales y 5 semestrales (5 años)
BONO 10	BME	FB10my	0,01	2	5	Dos días laborables antes del vencimiento	Valor teórico	3 trimestrales

Explicación del código de producto:

- La primera letra (F) indica que es un Futuro.
- Las tres siguientes letras (xxx) identifican el Activo Subyacente (Anexo 1).
- La letra (D) indica que son Futuros sobre Dividendos Acciones y (DD) Futuros sobre Dividendos de Acciones Plus, ambos serán solo sobre los siguientes subyacentes BBVA, IBE, ITX, REP, SAN, TEF, GAS, POP, ABE y CAB.
- A continuación, se identifica el mes (m) (Anexo 2) y el último dígito del año de vencimiento (y).
- La letra (C) indica que el contrato se liquida por diferencias y la letra (P) que se liquida por entrega.

Si el contrato estuviera ajustado, a continuación de la letra C, P o el número de año aparecerá el nuevo multiplicador. El primer ajuste que sufra el contrato irá solo con el nuevo multiplicador, a partir del segundo y sucesivos se le irá añadiendo una letra consecutivamente empezando por la B.

** Se podrán abrir vencimientos hasta 7 años, o vencimientos mensuales intermedios, a petición de los Miembros y siempre que BME Clearing y MEFF así lo consideren.

*** FMICWnmy: Codificación de los contratos en el caso de existir vencimientos semanales. Así, un futuro con vencimiento en el primer viernes será W1. No existirá la codificación W3, ya que el tercer viernes se corresponde al vencimiento estándar mensual (no semanal).

**** Podrán abrirse vencimientos semanales distintos al tercer viernes, a petición de los Miembros y siempre que BME Clearing y MEFF así lo consideren.

OPCIONES								
NOMBRE	MERCADO	CÓDIGO PRODUCTO*	TICK	DECIMALES NEGOCIACIÓN	DECIMALES REGISTRO	ÚLTIMO DÍA NEGOCIACIÓN	PRECIO LIQUIDACIÓN VENCIMIENTO	VENCIMIENTOS ABIERTOS
ACCIONES	BME	(C/P)xxxttssssmy	0,01	2	6	Tercer Viernes	Precio Oficial Cierre Viernes	2 MENS, 10 TRIM y 5 SEM (5 años)
ACCIONES SEMANALES	BME	(C/P)xxxttsssswwmy	0,01	2	6	Viernes	Precio Oficial de Cierre del Viernes	4 semanales incluyendo la tercera semana del mes
MINI IBEX	BME	(C/P)IBXssssmy	1	0	2	Tercer Viernes	Precio de Liquidación del Futuro IBEX 35	2 MEN, 10 TRIM y 5 SEM (5 años)
MINI IBEX SEMANALES	BME	(C/P)IBXsssswwmy	1	0	2	Viernes	Precio Oficial de Cierre del Viernes	4 semanales incluyendo la tercera semana del mes

Explicación del código de producto:

- (C) indica contrato Call, (P) contrato Put.
- (xxx) indica el Activo Subyacente (Anexo 1).
- (tt) es el tipo de opción (AM) para opciones de estilo Americano o (EU) para estilo Europeo.
- A continuación 5 posiciones (ssss) para el Precio de Ejercicio (expresado en céntimos sin coma decimal para Opciones sobre Acciones y en puntos de índice para Opciones Mini IBEX).
- (ww) para opciones semanales: w1 primera semana del mes, w2 segunda semana del mes, w4 cuarta semana del mes, w5 quinta semana del mes (solo sobre los siguientes subyacentes BBVA, IBE, ITX, REP, SAN y TEF).
- (m) es el mes de vencimiento (Anexo 3).
- (yy) dos posiciones que indican los dos últimos dígitos del año de vencimiento.
- Si el contrato estuviera ajustado a continuación se indicaría el nuevo multiplicador. Ejemplo: Call de Gamesa de estilo americano Precio de Ejercicio 8.50, Vencimiento junio 2014 y ajustada con multiplicador 104: CGAMAM 850M14104.

2. CONTRATOS NO ESTÁNDAR

- Futuros sobre el IBEX 35 y sobre acciones con cualquier Fecha de Vencimiento, hasta el máximo vencimiento estándar admitido a negociación.
- Opciones sobre acciones liquidadas por entrega, con cualquier Fecha de vencimiento y cualquier Precio de Ejercicio y de estilo americano o europeo.
- Opciones sobre el IBEX 35 y Opciones sobre acciones liquidadas por diferencias, con cualquier Fecha de vencimiento y cualquier Precio de Ejercicio y de estilo europeo.

A continuación se describe la codificación de los contratos no estándar:

CONTRATOS NO ESTÁNDAR									
CONTRATOS	TIPO	SUBYACENTE	ESTILO OPCIÓN	STRIKE	DÍA	MES	AÑO	TIPO LIQUIDACIÓN	SÓLO EN CASO DE AJUSTE
Futuros no estándar	F	xxx			dd	m	y	C/P	multiplicador
Opciones no estándar	C/P	xxx	EU/AM	sssss	dd	m	yy	C/P	multiplicador

Explicación del código de producto:

- (F) contrato de futuro, (C) contrato Call, (P) contrato Put.
- (xxx) es el activo subyacente (Anexo 1).
- En Opciones sobre Acciones (EU) define el contrato de Opción de estilo europeo y (AM) define el contrato de Opción de estilo americano.
- A continuación 5 posiciones (sssss) para el Precio de Ejercicio (expresado en céntimos sin coma decimal para Opciones sobre Acciones y en puntos de índice para Opciones Mini IBEX).
- Dos posiciones (dd) para indicar el día de vencimiento.
- Una posición (m) para indicar el mes (Anexo 2)
- Una (y) o dos posiciones (yy) para indicar los últimos dígitos del año de vencimiento.
- Una posición para indicar el tipo de liquidación del contrato: (P) indica que el contrato se liquida por entrega, y (C) indica que el contrato se liquida por diferencias.
- Si el contrato estuviera ajustado, a continuación aparecería el nuevo multiplicador ó 100 en el caso de ajustes que no impliquen modificación del multiplicador.

3. CONTRATOS XROLLING FX

XROLLING FX							
NOMBRE	MERCADO	SUBYACENTE	CÓDIGO PRODUCTO*	TICK**	DECIMALES NEGOCIACIÓN	DECIMALES REGISTRO**	NOMINAL POR CONTRATO***
Euro/Dólar Australiano	BME	sxxxxxx	EURAUD	0,00001	5	5	10.000 EUR
Euro/Franco Suizo	BME	sxxxxxx	EURCHF	0,00001	5	5	10.000 EUR
Euro/Libra	BME	sxxxxxx	EURGBP	0,00001	5	5	10.000 EUR
Euro/ Yen	BME	sxxxxxx	EURJPY	0,001	3	3	10.000 EUR
Euro/ Dólar US	BME	sxxxxxx	EURUSD	0,00001	5	5	10.000 EUR
Libra/Franco Suizo	BME	sxxxxxx	GBPCHF	0,00001	5	5	10.000 GBP
Libra/ Dólar US	BME	sxxxxxx	GBPUSD	0,00001	5	5	10.000 GBP
Dólar US/Real Brasileño	BME	sxxxxxx	USDBRL	0,00001	5	5	10.000 USD
Dólar US/ Dólar Canadiense	BME	sxxxxxx	USDCAD	0,00001	5	5	10.000 USD
Dólar US/Franco Suizo	BME	sxxxxxx	USDCHF	0,00001	5	5	10.000 USD
Dólar US/Yen	BME	sxxxxxx	USDJPY	0,001	3	3	10.000 USD
Dólar US/Peso Mexicano	BME	sxxxxxx	USDMXN	0,0001	4	4	10.000 USD
Dólar Australiano/Yen	BME	sxxxxxx	AUDJPY	0,0001	4	4	10.000 AUD
Dólar Australiano/ Dólar US	BME	sxxxxxx	AUDUSD	0,00001	5	5	10.000 AUD
Dólar Neozelandés/Dólar US	BME	sxxxxxx	NZDUSD	0,00001	5	5	10.000 NZD
Euro/Peso Mexicano	BME	sxxxxxx	EURMXN	0,0001	4	4	10.000 EUR
Euro/Real Brasileño	BME	sxxxxxx	EURBRL	0,00001	5	5	10.000 EUR

Explicación del código de producto:

- (xxxxxx) indica el código ISO (3 caracteres) de la divisa Base, en primer lugar y de la divisa cotizada (Anexo 3). Ejemplo: xRolling FX Euro/Dólar americano: EURUSD.
- El nominal del contrato vendrá expresado en número de unidades de Divisa Base por contrato y el precio en número de unidades de Divisa Cotizada necesarias para adquirir una unidad de Divisa Base.

** 6 posiciones significativas. Ej. EUR/JPY: 3 posiciones enteras y 3 posiciones decimales

*** El nominal del contrato estará siempre expresado en unidades de la divisa base (la primera del par)

4. CONTRATOS XROLLING ACCIONES

XROLLING ACCIONES							
NOMBRE	CÓDIGO PRODUCTO(1)	TICK	DECIMALES REGISTRO	PRECIO LIQUIDACIÓN A VENCIMIENTO	VENCIMIENTOS ABIERTOS	NOMINAL POR CONTRATO	UNIDAD DE REGISTRO
ACCIONES	XRSxxxx	El mismo que el subyacente	4	Precio de cierre de la acción subyacente del mercado de referencia	Un único vencimiento perpetuo	100 acciones	0,01 contratos

(1) Explicación del código de producto:

- Las 3 primeras letras (XRS) indican que es un contrato xRolling Acciones
- Las 4 siguientes letras (xxxx) identifican el Activo Subyacente. En el momento de la publicación de esta circular, la codificación del Mercado de Referencia se puede encontrar en el siguiente enlace <http://www.bmerv.es/docs/SBolsas/InformesSB/listadodevalores.pdf>

Ver Anexo 4 con lista de subyacentes disponibles para este producto.

Dado que existe una dependencia respecto a la disponibilidad de datos de tipo de préstamo para realizar los cálculos de liquidación de estos productos, BME Clearing se reserva la potestad de interrumpir el registro de aquellos subyacentes para los que durante un intervalo razonable de sesiones no se disponga de esta información. Para más información sobre este concepto de liquidación, ver Circular Flujos de Diferimiento Futuros xRolling Acciones.

ANEXO 1 TABLA DE SUBYACENTES FUTUROS Y OPCIONES

NOMBRE	CÓDIGO MEFF	CÓDIGO SIBE	FUTUROS SOBRE ACCIONES	OPCIONES SOBRE ACCIONES	OPCIONES SEMANALES	FUTUROS SOBRE DIVIDENDO	FUTUROS SOBRE DIVIDENDO PLUS
ACCIONA	ANA	ANA	Sí	Sí	No	No	No
ACCIONA Ener. Ren.	ANE	ANE	Sí	Sí	No	No	No
ACERINOX	ACX	ACX	Sí	Sí	No	No	No
ACS	ACS	ACS	Sí	Sí	No	No	No
AENA	AEN	AENA	Sí	Sí	No	No	No
ALMIRALL	ALM	ALM	Sí	Sí	No	No	No
AMADEUS	AMS	AMS	Sí	Sí	No	No	No
APPLUS	APP	APPS	Sí	Sí	No	No	No
ARCELORMITTAL	MTS	MTS	Sí	Sí	No	No	No
ATRESMEDIA	A3T	A3M	Sí	Sí	No	No	No
BANKINTER	BKT	BKT	Sí	Sí	No	No	No
BBVA	BBV	BBVA	Sí	Sí	Sí	Sí	Sí
CAIXABANK	CAB	CABK	Sí	Sí	No	Sí	Sí
CELLNEX	CLN	CLNX	Sí	Sí	No	No	No
CIE	CIE	COIE	Sí	Sí	No	No	No
COLONIAL	COL	COL	Sí	Sí	No	No	No
EBRO FOODS	EBR	EBRO	Sí	Sí	No	No	No
ENAGAS	ENA	ENG	Sí	Sí	No	No	No
ENCE	ENC	ENC	Sí	Sí	No	No	No
ENDESA	ELE	ELE	Sí	Sí	No	No	No
FCC	FCC	FCC	Sí	Sí	No	No	No
FERROVIAL	FRR	FER	Sí	Sí	No	No	No
FLUIDRA	FDR	FDR	Sí	Sí	No	No	No
GRIFOLS	GRF	GRF	Sí	Sí	No	No	No
IAG	IAG	IAG	Sí	Sí	No	No	No
IBERDROLA	IBE	IBE	Sí	Sí	Sí	Sí	Sí
INDITEX	ITX	ITX	Sí	Sí	Sí	Sí	Sí
INDRA	IDR	IDR	Sí	Sí	No	No	No
MAPFRE	MAP	MAP	Sí	Sí	No	No	No
MELIA	MEL	MEL	Sí	Sí	No	No	No
MERLIN	MRL	MRL	Sí	Sí	No	No	No
NATURGY	GAS	NTGY	Sí	Sí	No	Sí	Sí
OHL	OHL	OHL	Sí	Sí	No	No	No
PHARMA MAR	PHM	PHM	Sí	Sí	No	No	No
REDEIA	REE	RED	Sí	Sí	No	No	No
REPSOL	REP	REP	Sí	Sí	Sí	Sí	Sí

NOMBRE	CÓDIGO MEFF	CÓDIGO SIBE	FUTUROS SOBRE ACCIONES	OPCIONES SOBRE ACCIONES	OPCIONES SEMANALES	FUTUROS SOBRE DIVIDENDO	FUTUROS SOBRE DIVIDENDO PLUS
ROVI	ROV	ROVI	Sí	Sí	No	No	No
SABADELL	SAB	SAB	Sí	Sí	No	No	No
SACYR	SVO	SCYR	Sí	Sí	No	No	No
SANTANDER	SAN	SAN	Sí	Sí	Sí	Sí	Sí
SOLARIA	SLR	SLR	Sí	Sí	No	No	No
TECNICAS REUNIDAS	TRE	TRE	Sí	Sí	No	No	No
TELEFONICA	TEF	TEF	Sí	Sí	Sí	Sí	Sí
UNICAJA	UNI	UNI	Sí	Sí	No	No	No
VIDRALA	VID	VID	Sí	Sí	No	No	No
VISCOFAN	VIS	VIS	Sí	Sí	No	No	No

ANEXO 2 CODIFICACIÓN VENCIMIENTOS

MES	CÓDIGO
ENERO	F
FEBRERO	G
MARZO	H
ABRIL	J
MAYO	K
JUNIO	M
JULIO	N
AGOSTO	Q
SEPTIEMBRE	U
OCTUBRE	V
NOVIEMBRE	X
DICIEMBRE	Z

ANEXO 3

CODIFICACIÓN DIVISAS	CÓDIGO
EURO	EUR
DÓLAR ESTADOUNIDENSE	USD
LIBRA ESTERLINA	GBP
FRANCO SUIZO	CHF
YEN JAPONÉS	JPY
DÓLAR CANADIENSE	CAD
DÓLAR AUSTRALIANO	AUD
DÓLAR NEOZELANDÉS	NZD
PESO MEXICANO	MXN
REAL BRASILEÑO	BRL

ANEXO 4 TABLA SUBYACENTES xROLLING ACCIONES

SUBYACENTE	CÓDIGO	SUBYACENTE	CÓDIGO
ACCIONA	ANA	GRIFOLS	GRF
ACCIONA ENERGIA	ANE	GRIFOLS B	GRF.P
ACERINOX	ACX	IAG	IAG
ACS	ACS	IBERDROLA	IBE
AENA	AENA	INDITEX	ITX
ALMIRALL	ALM	INDRA	IDR
AMADEUS	AMS	LABORAT. ROVI	ROVI
APPLUS SERVICES	APPS	LINEA DIRECTA	LDA
ARCELORMITTAL	MTS	LOGISTA	LOG
AUDAX RENOV.	ADX	MAPFRE	MAP
AUXIL. FF.CC	CAF		
BANKINTER	BKT	MELIA	MEL
BBVA	BBVA	MERLIN	MRL
CAIXABANK	CABK	NATURGY	NTGY
CELLNEX	CLNX	OHL	OHL
CIE AUTOMOTIVE	COIE	PHARMA MAR	PHM
COLONIAL	COL	PROSEGUR	PSG
DURO FELGUERA	MDF	REDEIA	RED
EBRO FOODS	EBRO	REPSOL	REP
ENAGAS	ENG	SACYR	SCYR
ENCE	ENC	SABADELL	SAB
ENDESA	ELE	SANTANDER	SAN
FAES	FAE		
FERROVIAL	FER	SOLARIA	SLR
FLUIDRA	FDR	TECNICAS REUNIDAS	TRE
G. CATALANA OCCIDENTE	GCO	TELEFONICA	TEF
GESTAMP	GEST	VISCOFAN	VIS
GREENERGY	GRE		

2023 Bolsas y Mercados Españoles, Sociedad Holding de Mercados y Sistemas Financieros S. A. Todos los derechos reservados.

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