



MEFFServer

DOCUMENTACIÓN DE USUARIO

BME CLEARING
S/MART v10.11.00

Febrero 2020

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.

© 2020 BME. Todos los derechos reservados.

Tabla de Contenidos

| | |
|--|-------------|
| 1. Introducción | 1 |
| 1.1 Antes de empezar | 1 |
| 1.1.1 Qué debe conocer | 1 |
| 1.1.2 Qué tipo de clientes pueden explotar la información proporcionada por MEFFServer | 1 |
| 1.1.3 Qué tipo de datos ofrece MEFFServer | 2 |
| 1.2 Entorno físico | 2 |
| 2. Inicio y Salida | 3 |
| 2.1 Inicio | 3 |
| 2.1.1 Para iniciar MEFFServer | 3 |
| 2.1.2 Para establecer una conexión con la sesión activa en el MeffServer | 3 |
| 2.1.3 Pausar y reanudar MEFFServer | 4 |
| 2.2 Salida | 5 |
| 2.2.1 Para salir completamente de MEFFServer | 5 |
| 2.2.2 Para desconectar la sesión sin salir de la aplicación | 5 |
| 3. Configuración de los datos | 6 |
| 3.1 Qué datos se pueden exportar | 6 |
| 3.1.1 Separadores de campos y de registros | 6 |
| 3.1.2 Sintaxis en los ficheros. Tipos de datos | 6 |
| 3.1.3 Ficheros de Datos | 7 |
| 3.2 Qué tablas se pueden generar | 8 |
| 3.2.1 Históricas | 9 |
| 3.2.2 Realtime | 9 |
| 3.2.3 Relación de Tablas | 10 |
| 4. Vínculos | 14 |
| 4.1 Información de los vínculos activos | 14 |
| 4.1.1 Pantalla de información | 14 |
| 4.2 Datos ofrecidos por MEFFServer | 15 |
| 4.2.1 Variables | 15 |
| 4.2.2 Selección de datos | 17 |
| 5. Otras Configuraciones | 19 |
| 5.1 Comunicaciones | 19 |
| 5.1.1 Gestión de errores de conexión | 19 |
| 5.2 Mensajes Cámara | 20 |
| 5.3 Estado de MEFFServer | 21 |
| Apéndice A Estructura de las tablas | A-1 |
| A.1 Valor especial NULL | A-1 |
| A.2 Datos de Liquidación | A-2 |
| A.2.1 Datos Generales | A-2 |
| A.2.2 Información Pública Diaria | A-16 |
| A.2.3 Datos Privados de Configuración | A-17 |
| A.2.4 Datos para Cálculo de Garantías | A-26 |
| A.2.5 Operaciones | A-34 |
| A.2.6 Gestión de Operaciones | A-37 |
| A.2.7 Posición Abierta | A-41 |
| A.2.8 Ejercicio – Vencimiento - Entrega | A-45 |
| A.2.9 Comisiones | A-54 |
| A.2.10 Resultados a nivel de Cuenta de Posición | A-58 |
| A.2.11 Resultados a nivel de Cuenta de Garantías | A-65 |
| A.2.12 Resultados por cuenta de colateral a nivel ECC | A-71 |
| A.2.13 Registro de detalle. Resultados a nivel de cuenta de posición | A-75 |
| A.2.14 Resultados para Miembros Compensadores | A-78 |
| A.2.15 Resultados para Agentes de Pago | A-80 |
| Apéndice B Datos Suministrados | B-82 |
| B.1 Datos de Feed | B-82 |
| B.2 Datos de Información General | B-83 |

1. Introducción

MEFFServer es el encargado de obtener los datos de mercado con el fin de procesar y almacenar la información recibida, para ponerla a disposición de aplicaciones cliente en distintos formatos y soportes. Ofrece tanto información en tiempo real como histórica.

Los datos de Liquidación pueden ofrecerse durante la sesión a otras aplicaciones mediante:

- Enlaces DDE (Dynamic Data Exchange)
- Tablas en una base de datos de tiempo real.

O para proceso después de la sesión a través de:

- Ficheros de traspaso.
- Tablas en una base de datos histórica.

En este manual se describe el modo de funcionamiento de la aplicación, así como las opciones de configuración, y las implicaciones de cada una de ellas.

1.1 Antes de empezar

1.1.1 Qué debe conocer

MEFFServer recibe información de uno o varios entornos, la procesa, y proporciona un sistema de información abierto, del que se pueden nutrir las aplicaciones cliente para ofrecer al usuario datos elaborados de la sesión.

Esta aplicación es exclusivamente un servidor de datos: obtiene datos de los entornos a los que se conecta, los procesa, y almacena esta información procesada en tablas. También puede ofrecer estos datos mediante vínculos DDE. Sin embargo, para poder explotar esta información, se necesitan aplicaciones cliente que elaboren la información y la proporcionen en otros formatos (listados, alarmas, etc.).

Dado que se maneja información de Sistema, para aprovechar al máximo la información que ofrece MEFFServer, es imprescindible conocer el funcionamiento del Sistema, así como los conceptos relacionados con negociación, liquidación y posiciones de carteras.

1.1.2 Qué tipo de clientes pueden explotar la información proporcionada por MEFFServer

MEFFServer ofrece los siguientes formatos de datos:

Vínculos DDE. Utilizando enlaces DDE (Dynamic Data Exchange), MEFFServer ofrece información en tiempo real que puede ser explotada por cualquier aplicación cliente de DDE.

- Tablas en una base de datos de tiempo real.
- Datos de traspaso en ficheros ASCII.
- Tablas en una base de datos histórica.

Teniendo en cuenta estos formatos de datos, las aplicaciones que vayan a explotar esta información deben comportarse como alguno de los siguientes tipos de aplicación:

- Clientes que inspeccionen la base de datos.
- Clientes DDE.
- Aplicaciones que accedan a los ficheros ASCII.

1.1.3 Qué tipo de datos ofrece MEFFServer

MEFFServer proporciona información de la sesión. Esta información puede ofrecerse en diferentes formatos (vínculos DDE, tablas Paradox y ficheros ASCII) y en diferentes momentos (realtime o históricos).

Se ofrece tanto información maestra como diaria. La diferencia entre los datos denominados maestros y los denominados diarios es que los maestros son aquéllos que no es probable que sufran cambios diariamente, ya que son los datos de ámbito general del Sistema, mientras que los diarios son los que dependen de la sesión y, por tanto, son diferentes para cada sesión.

La información que MEFFServer calcula y ofrece a modo de vínculos DDE puede ser organizada en los siguientes grupos:

- Liquidación. Datos referentes a Clearing., Riesgo, etc.
- Carteras. Datos referentes a Posiciones Abiertas.
- Registro. Datos referentes a Clearing., Riesgo, etc registrados
- Informes. Información en formato de listado dinámico.
- Feed. Mensajes de feed.
- Información general. Datos de la sesión (fecha, etc...)

La información que MEFFServer genera y ofrece a modo de tablas y ficheros se ha estructurado en:

- Realtime. Se genera la información de la sesión, tanto maestra como diaria, y se actualiza continuamente durante la sesión. Esta información es inicializada en cada nueva sesión.
- Históricos. Se genera toda la información (incluyendo datos de tesorería y liquidación), tanto de maestros como de diarios al final de la sesión, añadiendo la información a la de sesiones anteriores.

1.2 Entorno físico

MEFFServer recibe información del Sistema a través de un MeffAccess o servidor de comunicaciones de BMEClearing a través de la red TCP/IP.

2. Inicio y Salida

En este capítulo se explica cómo iniciar y salir de la aplicación.

MEFFServer es una aplicación que obtiene datos del Sistema. Para ello, debe configurarse la manera apropiada de conectarse para obtener esos datos. Se presupone que las comunicaciones de MEFFServer ya han sido configuradas correctamente. Si le interesa conocer más acerca de esta configuración, consulte más adelante en este manual "Configuración de las comunicaciones".

2.1 Inicio

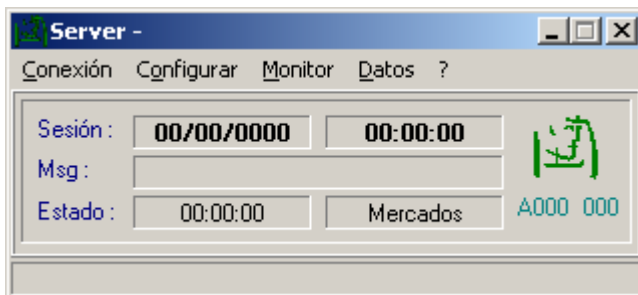
2.1.1 Para iniciar MEFFServer

Haga doble clic sobre el icono del programa MEFFWIN.EXE

Aparece la ventana que indica la carga del programa:



Seguidamente se muestra la pantalla principal de la aplicación:



Hasta este momento, se ha iniciado la aplicación MEFFServer, pero no se ha comenzado la recepción y el proceso de mensajes del HOST, por lo tanto, no se dispone aún de información de la sesión actual.

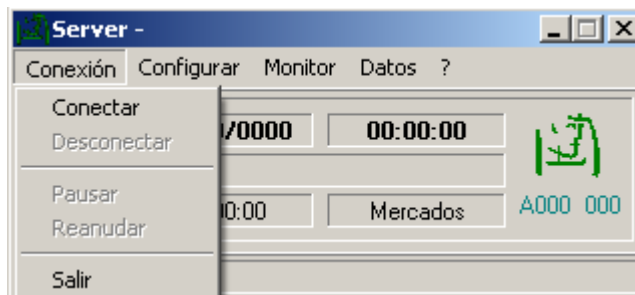
Nota En esta situación MEFFServer ya ofrece vínculos DDE, pero la información que sirve es la de la última sesión recibida correctamente.

Para poder disponer de la información de la sesión activa en tiempo real es necesario conectarse con el Sistema.

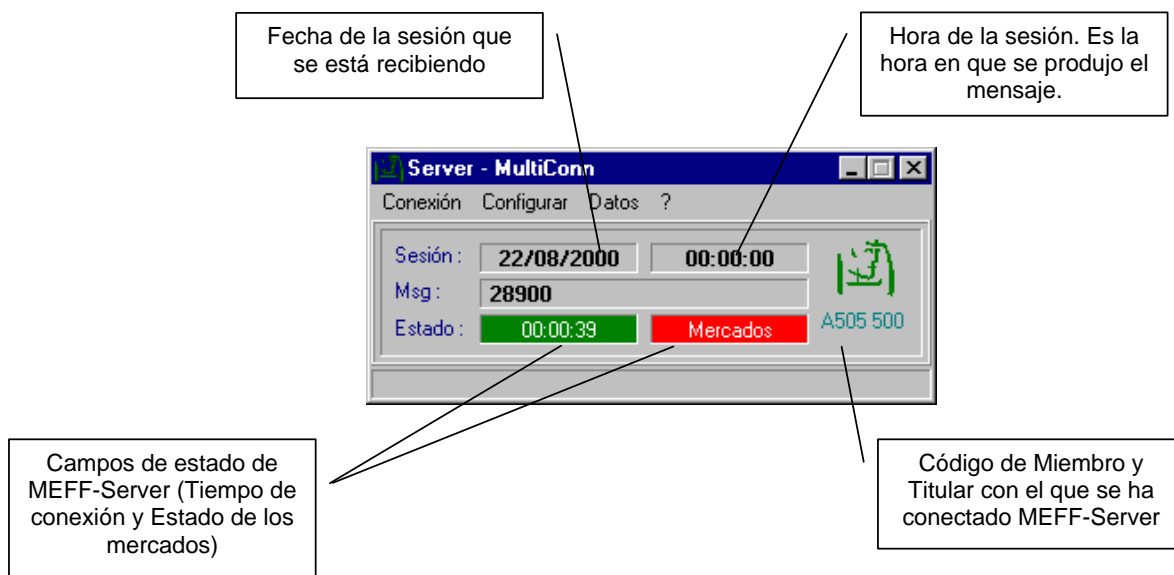
Esta conexión debe establecerse a través de un controlador de comunicaciones (MeffAccess)

2.1.2 Para establecer una conexión con la sesión activa en el MeffServer

Elija la opción "Conectar" del menú "Conexión".



Los datos de la ventana principal se actualizan una vez establecida la conexión.



2.1.3 Pausar y reanudar MEFFServer

MEFFServer permite pausar su actividad, congelando la situación del mercado existente en ese momento. Esta característica facilita el análisis puntual de la información en una situación estática de mercado.

Además, pausar la actividad de MEFFServer libera recursos del sistema. Esto puede ser conveniente en ocasiones cuando requiera recursos de su sistema para otros procesos.

2.1.3.1 Para pausar la actividad de MEFFServer

Seleccione la opción "Pausar" del menú "Conexión".

No se procesan nuevos datos, pero los vínculos continúan activos con la información de que disponían hasta el momento de la pausa.

Puede observar que los datos de la ventana principal no se renuevan.

Nota MEFFServer puede ser pausado en cualquier momento sin que esto signifique la pérdida ningún mensaje. Cuando se reanude la actividad de MEFFServer, se continuará a partir del último mensaje tratado antes de pausar.

2.1.3.2 Para reanudar la actividad de MEFFServer

Seleccione la opción "Reanudar" del menú "Conexión".

Al reanudar MEFFServer continúa con la adquisición y el tratamiento de los datos. Procesa los datos a la velocidad máxima hasta conseguir llegar a su estado normal (TIEMPO REAL).

2.2 Salida

2.2.1 Para salir completamente de MEFFServer

Seleccione la opción “Salir” del menú “Conexión”.

Puede haber ocasiones en las que le interese desconectar la sesión actual de MEFFServer sin salir completamente del programa. Por ejemplo, para cambiar la configuración.

2.2.2 Para desconectar la sesión sin salir de la aplicación

Seleccione la opción “Desconectar” del menú “Conexión”.

Nota Cuando se desconecta la sesión de MEFFServer, la consulta de vínculos DDE se permite, ofreciendo los datos hasta el momento de la desconexión.

3. Configuración de los datos

3.1 Qué datos se pueden exportar

MEFFServer permite exportar datos en formato ASCII para que puedan ser accesibles desde otras aplicaciones.

Estos ficheros se pueden obtener durante sesión o al final de la misma de forma automática si se han configurado.

Consultar documentos “MEFFStation - FD Liquidación” para obtener una descripción detallada de los ficheros.

3.1.1 Separadores de campos y de registros

El formato de estos ficheros es ASCII, donde cada fila representa un registro.

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.

3.1.2 Sintaxis en los ficheros. Tipos de datos

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 (ver definición de “String” arriba) que representa una divisa utilizando los valores definidos en la norma ISO 4217 Currency code (3 caracteres).
- **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

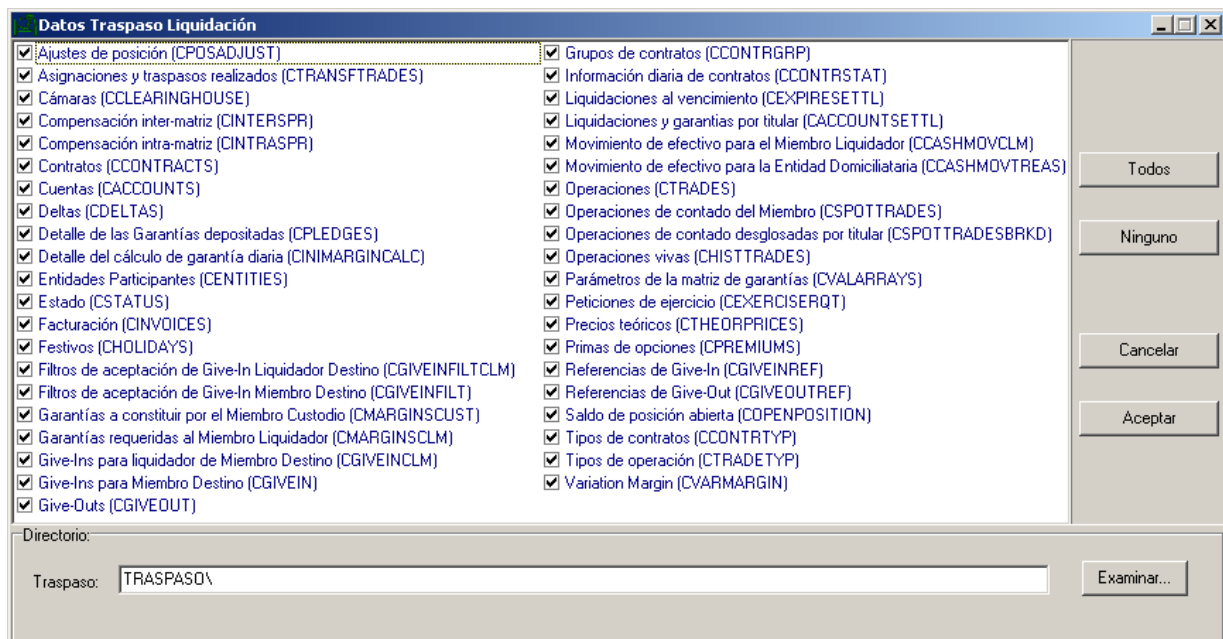
3.1.3 Ficheros de Datos

MEFFServer permite guardar en formato ASCII datos de la sesión activa. La actualización de estos ficheros se realiza automáticamente, en caso de que se haya configurado, al final de la sesión.

3.1.3.1 Ficheros de Datos al finalizar la sesión

Para configurar la generación de ficheros al finalizar la sesión se debe acceder a la opción “Datos traspaso Liquidación” del menú “Configurar”.

Aparecerá una ventana de configuración con los ficheros de traspaso de liquidación en función de la opción seleccionada:



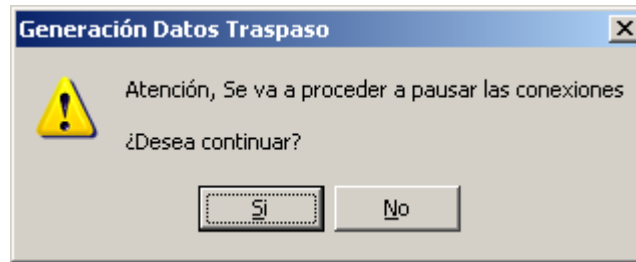
En esta ventana se configura qué ficheros de datos de traspaso se desea generar automáticamente al fin de cada una de las sesiones recibidas.

También aquí se configura el directorio donde se han de generar los ficheros. Para ello se puede escribir el directorio directamente o utilizar el explorador que se obtiene al pulsar el botón “Examinar”.

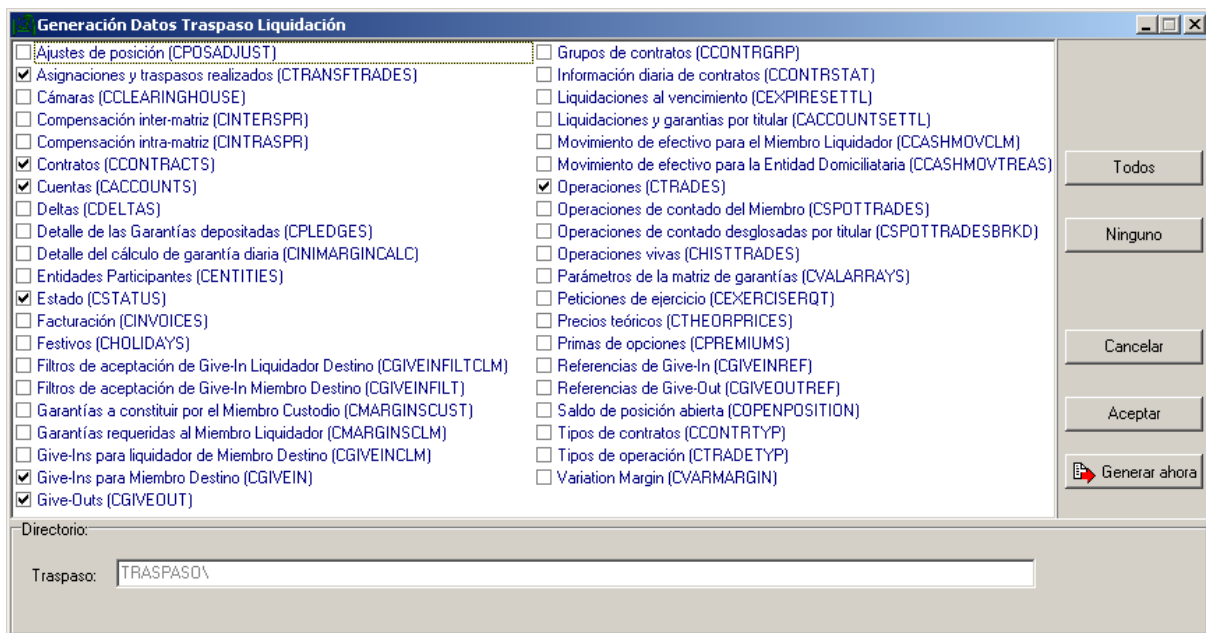
3.1.3.2 Ficheros de Datos durante sesión

Para solicitar los ficheros en un momento determinado de la sesión se debe acceder a la opción “Generar Datos Traspaso Liquidación” del menú “Datos”.

En este caso MEFFServer muestra una pantalla de aviso para indicar que se van a pausar las comunicaciones mientras se obtienen los ficheros.



Si se confirma que se desea continuar con la generación, MEFFServer muestra una pantalla con los diferentes ficheros de traspaso que se pueden generar. Aparecerán marcados los ficheros que se hubieran configurado la última vez:



Para obtener los ficheros se debe pulsar el botón “Generar ahora”. Los ficheros se generaran en el directorio indicado en “Traspaso”, este directorio se configura en las pantallas de Ficheros de Traspaso al finalizar la sesión tal y como se ha especificado anteriormente.

3.1.3.3 Ficheros de Datos de Liquidación

Todos los ficheros tienen como extensión el código de cámara correspondiente (genéricamente, “ch”).

La estructura de los ficheros de datos es única para cualquier Terminal de BME CLEARING (MEFFTop, MEFFServer,...). La descripción de estos ficheros se puede consultar en el documento “MEFFStation – FD Liquidación”.

3.2 Qué tablas se pueden generar

MEFFServer permite generar la información de la Sesión en tablas Paradox.

Estas tablas se almacenan en los directorios especificados en las ventanas de configuración y pueden ser consultadas desde cualquier aplicación.

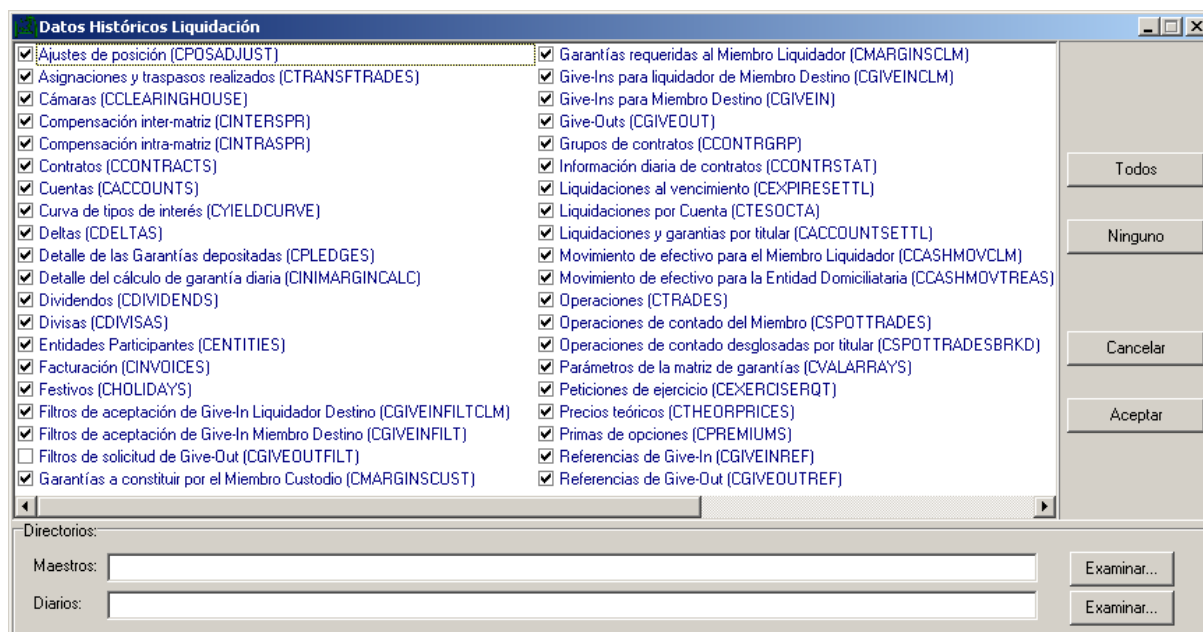
En el apéndice “Estructura de las tablas” se puede ver una descripción detallada de las mismas.

3.2.1 Históricas

En la ventana de configuración de Históricos se puede definir qué tablas se desea que se actualicen cada fin de Sesión para mantener tablas de datos Históricos en formato Paradox.

Para configurar las tablas de datos históricos: Seleccione la opción “Datos Históricos Liquidación...” del menú “Configurar”.

Aparecerá una ventana de configuración como:



Se permite la configuración de la información de datos maestros y diarios, así como la configuración de los diferentes directorios dónde se ubicarán.

3.2.2 Realtime

Es posible generar tablas con información de la sesión activa. Se puede disponer de estas tablas conforme se van generando. Estas tablas se denominan “Tablas de Realtime”, y están a disposición de los usuarios para consultas durante la sesión.

Las tablas se generan en formato Paradox. Se crean cada vez que se inicia MEFFServer y van aumentando a medida que la sesión avanza, permitiendo la posibilidad de consultar y listar en Tiempo Real con herramientas externas.

Para acceder a la configuración de las tablas en tiempo real: Seleccionar “Tablas en Sesión Liquidación ...” del menú “Configurar”.

Aparecerá una ventana de configuración como:

En esta ventana de configuración se especifican las tablas que se generarán durante la sesión. Se pueden generar en tiempo real tanto datos maestros como diarios.

En “Directorios: Realtime” se indica el lugar donde se crearán estas tablas.

3.2.3 Relación de Tablas

En los apéndices se dispone de la descripción detallada de las tablas Paradox. A continuación se detalla una relación de las tablas indicando si son de RealTime (RT), Maestros (M) o Históricas (H).

| Tabla | RT | M | H | Descripción |
|---------------------|----|---|---|---|
| CACCOUNTS.DB | √ | √ | | Información de las cuentas disponibles |
| CACCOUNTSETTL.DB | | | √ | Importes por titular de las liquidaciones y garantías diarias |
| CACCOUNTSETTLDET.DB | | | √ | Importes por subcuenta de las liquidaciones y garantías diarias |
| CBACKTESTING.DB | | | √ | Información de las Pruebas Retrospectivas |
| CCLEARINGHOUSE.DB | √ | √ | | Información genérica de la cámara |
| CCOLLATERALACCOUNTS | √ | √ | | Cuentas de colateral |
| CCONTRACTS.DB | √ | √ | | Información general de los contratos disponibles en la sesión |
| CCONTRGRP.DB | √ | √ | | Grupos de contratos |
| CCONTRREL.DB | √ | | √ | Códigos resultantes para cascada teórica |
| CCONTRRELDET | √ | | √ | Detalle de la relación entre contrato original y sus contratos resultantes, en caso de que en el grupo de contratos haya contratos cuya posición deba desglosarse en otros de nominal menor. Para Energía informa de las relaciones resultantes al realizar la cascada real. |

| Tabla | RT | M | H | Descripción |
|--------------------|----|---|---|---|
| CCONTRSTAT.DB | √ | | √ | Datos diarios de los contratos |
| CCONTRTYP.DB | √ | √ | | Tipos de contrato |
| CCACCOUNTSETTL.DB | √ | | √ | Liquidaciones y garantías por titular a nivel de Contrapartida Central |
| CCPCASHMOVCLM.DB | √ | | √ | Movimientos de efectivo para el Miembro Compensador a nivel de Contrapartida Central |
| CCPCASHMOVTREAS.DB | √ | | √ | Movimientos de efectivo para la Entidad Domiciliataria a nivel de Contrapartida Central |
| CCPPLEDGES.DB | √ | | √ | Detalle de las garantías depositadas a nivel de Contrapartida Central |
| CDELIVERABLES.DB | √ | | √ | Títulos entregables asociados a un contrato de derivados |
| CDELIVSETTL | √ | | √ | Liquidaciones debidas a entrega de gas, a nivel de cuenta de garantías |
| CDELTA.DB | √ | | √ | Deltas de los contratos |
| CDIVIDENDS.DB | √ | | √ | Dividendos previstos |
| CCCURRENCY.DB | √ | | √ | Divisas definidas en el sistema |
| CENTITIES.DB | √ | √ | | Información pública de las entidades que intervienen en la cámara |
| CEXERCISERQT.DB | √ | | √ | Información de las peticiones de ejercicio vigentes |
| CFEES.DB | | | √ | Comisiones por Miembro Negociador |
| CFEESBRKD.DB | | | √ | Detalle de comisiones por operaciones |
| CGIVEIN.DB | √ | | √ | Estado de los Give-In en que se participa como Miembro Destino |
| CGIVEINCLM.DB | √ | | √ | Estado de los Give-In en que se participa como Compensador del Miembro Destino |
| CGIVEINFILT.DB | √ | √ | | Filtros de aceptación Give-In establecidos por el Miembro Destino |
| CGIVEINFILTCLM.DB | √ | √ | | Filtros de aceptación Give-In establecidos por el Miembro Compensador del Miembro Destino |
| CGIVEINREF.DB | √ | √ | | Referencias de Give-In definidas en el sistema por el Miembro Destino |
| CGIVEOUT.DB | √ | | √ | Estado de los Give-Outs en que se participa como Miembro Origen |
| CGIVEOUTFILT.DB | √ | √ | | Filtros de solicitud Give-out establecidos por el Miembro Origen |
| CGIVEOUTREF.DB | √ | √ | | Referencias de Give-Out definidas en el sistema por el Miembro Origen |
| CHOLIDAYS.DB | √ | √ | | Calendario de festivos en los que la plataforma de liquidación está cerrada |

| Tabla | RT | M | H | Descripción |
|------------------------|----|---|---|---|
| CINIMARGINCALC.DB | | | √ | Información detallada del cálculo de la garantía diaria de cada titular |
| CINIMARGINCALCDET.DB | | | √ | Información detallada del cálculo de la garantía diaria de cada subcuenta |
| CINTERSPR.DB | √ | | √ | Tabla de compensaciones a aplicar en el cálculo de garantías para posiciones de signo contrario sobre contratos con diferentes código de matriz |
| CINTRASPR.DB | √ | | √ | Tabla de compensaciones a aplicar en el cálculo de garantías para posiciones de signo contrario sobre contratos con el mismo código de matriz |
| CMARGINACCOUNTS | √ | √ | | Cuentas de garantías |
| CMARGINOPENPOSITION | √ | | √ | Información de la posición abierta por cuenta de garantías y contrato (sólo aquellas que tienen posición) |
| COPENPOSITION.DB | √ | | √ | Información de la posición abierta por cuenta y contrato (sólo aquellas que tienen posición) |
| COPENPOSITIONCLM.DB | | | √ | Información de la posición abierta por Miembro Compensador y contrato (sólo aquellas que tienen posición) |
| CPHYSDEL | √ | | √ | Nominaciones de entrega física a nivel de EIC |
| CPHYSDELDET | √ | | √ | Detalle de obligaciones de entrega física |
| CPOSADJUST.DB | √ | | √ | Ajustes de posición realizados durante la sesión |
| CPREMIUMS.DB | √ | | √ | Prima asociada a una operación de opciones |
| CSPOTTRADES.DB | √ | | √ | Información acerca de las operaciones sobre acciones a realizar fuera de BME CLEARING, como consecuencia del ejercicio de opciones realizado en la sesión. Se envía al negociador y a todos sus posibles Compensadores. |
| CSPOTTRADESBRKD.DB | √ | | √ | Detalle a nivel titular de las operaciones sobre acciones a realizar fuera de BME CLEARING, como consecuencia del ejercicio de opciones realizado en la sesión |
| CSPOTTRADESBRKDDDET.DB | √ | | √ | Detalle a nivel subcuenta de las operaciones sobre acciones a realizar fuera de BME CLEARING, como consecuencia del ejercicio de opciones realizado en la sesión |
| CSTRESSTESTING.DB | | | √ | Información de las Pruebas de Resistencia |
| CTHEORPRICES.DB | √ | | √ | Precios teóricos de contratos |
| CTRADES.DB | √ | | √ | Información de todas las operaciones registradas |
| CTRADETYP.DB | √ | √ | | Información sobre los tipos de operación tratados en la cámara |
| CTRANSFTRADES.DB | √ | | √ | Asignaciones y Traspasos realizados |
| CUNDERLYINGS | √ | √ | | Información de los activos subyacentes |
| CVALARRAYS.DB | √ | | √ | Parámetros de cada una de las matrices de cálculo de garantía |

| Tabla | RT | M | H | Descripción |
|--------------------|----|---|---|--|
| CVALUATIONOTH.DB | √ | | √ | Detalle de la valoración de las operaciones o posiciones para aquellos productos que no tienen liquidación diaria de pérdidas y ganancias |
| CVARMARGIN.DB | √ | | √ | Detalle de la liquidación diaria de pérdidas y ganancias, formada por la valoración de posición a principio de día y de las operaciones del día a precio de valoración final |
| CVARMARGINPEND.DB | √ | | √ | Variation Margin pendiente (para agregar a garantías exigidas) |
| CVOLATILITYSKEW.DB | √ | | √ | Skew de volatilidad. No se informa de las opciones largas |
| CYIELDCURVE.DB | √ | | √ | Curva de tipos de interés |

4. Vínculos

MEFFServer se comporta como servidor DDE, ofreciendo información de la sesión activa a través de enlaces. Un vínculo es el enlace que hay entre el servidor de datos y otras aplicaciones, como hojas de cálculo y otros programas que pueden actuar como clientes DDE.

MEFFServer se asegura de que todos los datos enviados a otras aplicaciones son recibidos por éstas. Para ello exige la confirmación dato a dato por parte de la aplicación que mantiene el vínculo activo con él.

Normalmente, la confirmación de un dato enviado a otra aplicación se recibe inmediatamente, pero ello depende del proceso que la aplicación receptora (o cliente) efectúe con el mismo.

4.1 Información de los vínculos activos

4.1.1 Pantalla de información

MEFFServer dispone de una ventana de información sobre el estado de los vínculos en el sistema. Esta información puede ser de utilidad para controlar el sistema.

Para visualizar la ventana de información: Seleccione la opción “DDE” del menú “Monitor”.

Aparecerá la siguiente ventana de información:



| Servicio | MEFFWIN |
|----------------|---------|
| Comando | 0 |
| Cálculos | 0 |
| Enviados | 0 |
| Error | 0 |
| Links | 0 |
| Peticiones | 0 |
| Pokes | 0 |
| Var. Cambiando | 0 |
| Variables | 0 |

Esta ventana muestra información interna relativa a datos vinculados y a variables globales de MEFFServer. El significado de cada uno de los ítems se detalla en la siguiente tabla:

| Ítem | Descripción |
|------------|---|
| Comando | Número de comandos ejecutados. |
| Cálculos | Número total de cálculos realizados para los datos solicitados. |
| Enviados | Número de mensajes enviados. |
| Error | Número de errores registrados. |
| Links | Número total de vínculos correctos y activos. |
| Peticiones | Número de peticiones tratadas (vinculadas o no). |
| Pokes | Número de comandos recibidos |

| | |
|----------------|--|
| Var. Cambiando | Número de cambios que han tenido los valores de las variables. |
| Variables | Número de variables correctas y activas |

4.2 Datos ofrecidos por MEFFServer

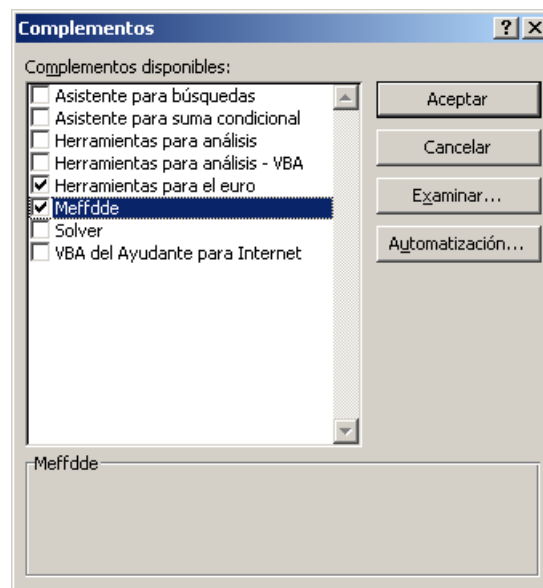
4.2.1 Variables

MEFFServer permite definir variables para facilitar la obtención de datos vinculados cuyos parámetros deben proporcionarse desde la aplicación cliente de forma variable.

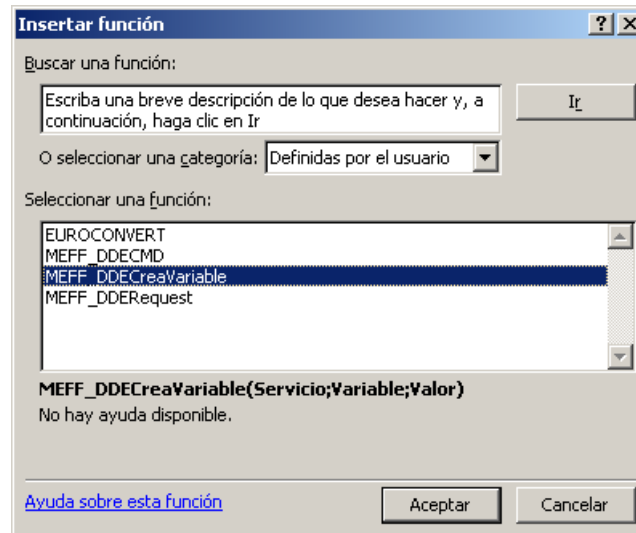
Cada una de estas variables se referencia mediante un nombre que el usuario decide. Posteriormente, es posible incluir en los vínculos entre MEFFServer y las otras aplicaciones dichas variables, de modo que al cambiar el valor de una variable, se actualicen los vínculos de datos que dependían de ella.

Para crear una variable desde Excel:

1. En el directorio de trabajo poner la dll MeffDDE.dll y la macro MeffDDE.xla
2. Abrir el Excel y en menú “Herramientas” opción “Complementos” seleccionar el botón de examinar y seleccionar MeffDDE.xla del directorio donde se haya instalado.



3. Comprobación: Si se selecciona del menú “Insertar” del Excel la opción “Insertar Función” en la categoría de “Definidas por el usuario” aparecen las nuevas funciones:



4. Desde una celda, seleccione la función `MEFF_DDECreVariable("MEFFWIN", Variable, Valor)` de la lista de funciones disponibles en Excel.

A continuación se explican estos argumentos:

- **"MEFFWIN"**: Es el nombre de la aplicación que proporciona los vínculos DDE. Depende del nombre del ejecutable del MeffServer (Suele ser MEFFWIN).
- **Variable**: Hace referencia al nombre que queremos dar a la variable.
- **Valor**: Hace referencia al valor que queremos asignar a la variable.

Todos estos argumentos pueden hacer referencia a direcciones de celdas donde estén los datos requeridos.

Ejemplo:

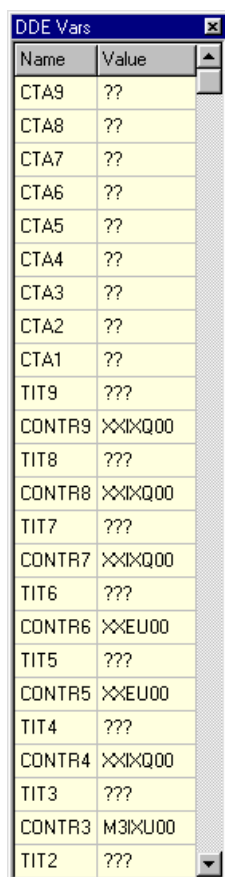
Escribimos en la celda B1:

`= MEFF_DDECreVariable (A1,B2,B3)`

donde la celda A1 contiene el texto MEFFWIN, la celda B2 contiene el texto Contr y la celda B3 contiene el texto IX10000D. Es decir, hemos creado una variable que se llama Contr y cuyo valor actual es IX10000D. En la medida que cambiemos la celda B3 la variable cambiará de valor.

Nota Cuando se abre una hoja de Excel que contiene variables es necesario darlas de alta. Una forma de hacerlo, es colocar el texto MEFFWIN en una celda aparte y que todas las funciones MEFF_DDECreVariable hagan referencia a esta celda. De este modo se pueden dar de alta las variables editando (manualmente o mediante una macro) la celda donde se encuentra el texto MEFFWIN.

Una vez realizados estos pasos, la lista de variables estará accesible en la opción “Variables DDE” del menú “Monitor”.



| Name | Value |
|--------|---------|
| CTA9 | ?? |
| CTA8 | ?? |
| CTA7 | ?? |
| CTA6 | ?? |
| CTA5 | ?? |
| CTA4 | ?? |
| CTA3 | ?? |
| CTA2 | ?? |
| CTA1 | ?? |
| TIT9 | ??? |
| CONTR9 | XXIXQ00 |
| TIT8 | ??? |
| CONTR8 | XXIXQ00 |
| TIT7 | ??? |
| CONTR7 | XXIXQ00 |
| TIT6 | ??? |
| CONTR6 | XXEU00 |
| TIT5 | ??? |
| CONTR5 | XXEU00 |
| TIT4 | ??? |
| CONTR4 | XXIXQ00 |
| TIT3 | ??? |
| CONTR3 | M3IXU00 |
| TIT2 | ??? |

4.2.2 Selección de datos

MEFFServer permite la visualización de todos los tópicos que ofrece a modo de vínculos. Así mismo, permite especificar los parámetros para cada tópico y muestra su valor actual.

Para mostrar la ventana de Selección de Datos: Elegir la opción “Datos Selección...” del menú “Datos”.

Aparecerá la siguiente ventana:

Para cada concepto, es indispensable informar en esta ventana los campos necesarios para realizar el cálculo. En el apartado valor se muestra el resultado si se ha seleccionado la casilla “Valor”.

Server - MultiConn Selección de Datos

Clase: Negociación

Concepto: Ask de Contrato

Mercado: M3 MEFF RV

Grupo: Futuros IBEX MINI

Contrato: MNZ05

☒ Valor

ASK,M3MNZ05

Para cada uno de los parámetros se debe seleccionar un valor concreto de la lista que ofrece MEFFServer. En ocasiones este valor puede ser un carácter comodín.

El hecho de estar visualizando un dato utilizando esta ventana, provoca que este dato sea depositado en el portapapeles de Windows con el fin de que esté disponible para otras aplicaciones.

Una vez se visualiza el dato deseado en pantalla, se puede "Pegar" directamente el valor en cualquier aplicación Windows que lo permita (una hoja de cálculo con enlaces DDE, por ejemplo).

Además, en algunas aplicaciones, se permite la "Vinculación" del valor mediante la opción "Pegar Vínculos" o "Paste Link".

Si se utiliza esta última modalidad, se relacionan los dos programas de forma que los cambios en tiempo real que se produzcan se enviarán a la aplicación en la que se ha "vinculado" el dato.

Para introducir una variable dentro de un vínculo es necesario cambiar la parte del vínculo que nos interesa, por la variable que hemos creado, con el símbolo "#" delante y detrás.

Conceptos

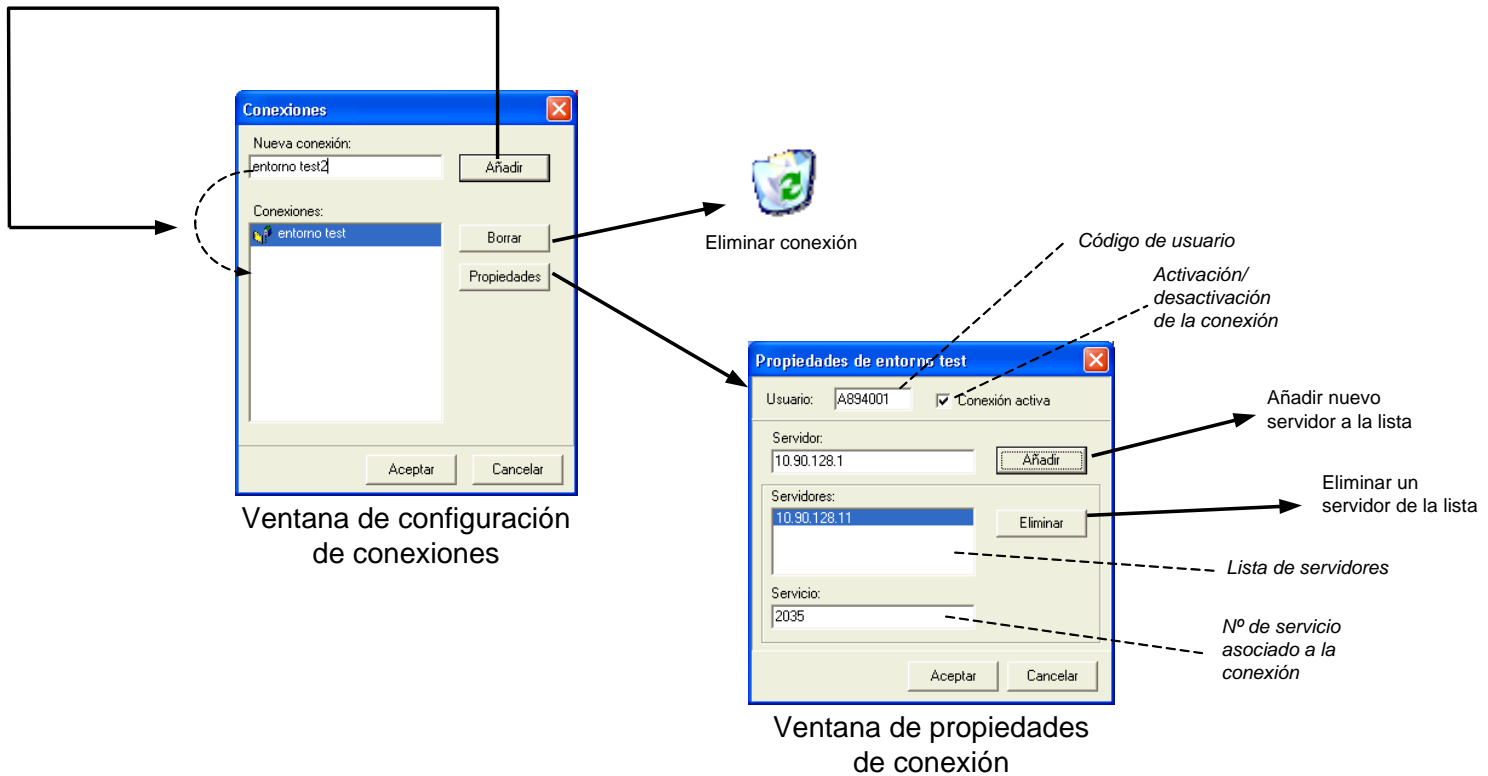
Los datos están organizados en clases. Dentro de cada clase hay una lista de conceptos (o tipos de dato). Estos conceptos son denominados tópicos.

En el apéndice "Datos Suministrados" se encuentra una lista detallada de los tópicos que sirve MEFFServer divididos en clases.

5. Otras Configuraciones

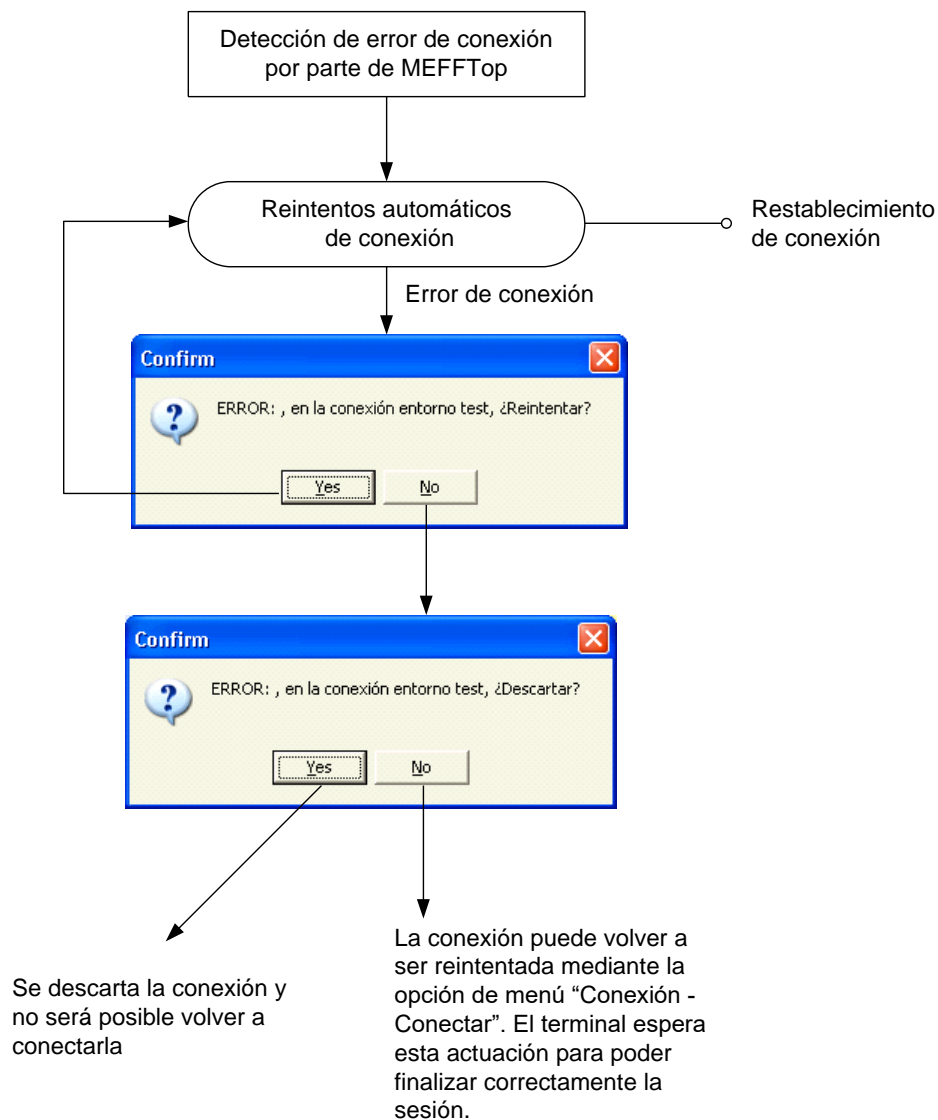
5.1 Comunicaciones

Para recibir la información del sistema es necesario configurar las comunicaciones. Para ello se debe seleccionar la opción "Comunicaciones" del menú "Configurar":



5.1.1 Gestión de errores de conexión

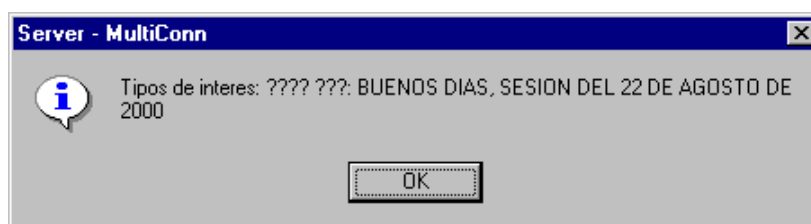
Cuando MEFFServer detecta un error en alguna de sus conexiones, lo notificará al usuario, que puede optar por reintentar o aceptar la desconexión. Si la desconexión es aceptada deberá decidir si desea descartar la conexión, de forma que MEFFServer no requiera esta conexión para finalizar correctamente, o no descartarla, de forma que MEFFServer considera necesaria la finalización de las sesiones asociadas a la conexión.



5.2 Mensajes Cámara

En el sistema existe un mecanismo de mensajería, que permite hacer llegar al operador mensajes tanto del Administrador de Mercado, como de la Cámara o del propio Sistema. MEFFServer recibe estos mensajes y se los enseña al usuario.

Los mensajes aparecen en una ventana como la siguiente:

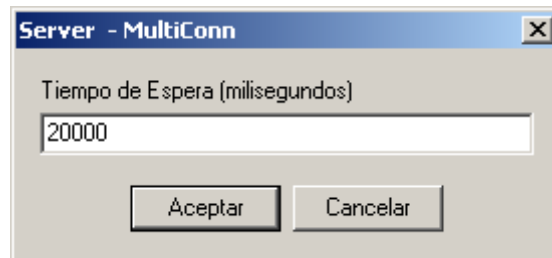


Cuando aparece una ventana de mensaje, MEFFServer pausa su actividad hasta que el usuario haga clic en el botón "Aceptar". De esta forma, el usuario no pierde ningún mensaje.

Se puede configurar el tiempo de permanencia de un mensaje.

Para configurar el tiempo de permanencia de la ventana de mensajes: Seleccionar la opción "Mensajes Cámara..." del menú "Configurar".

Aparecerá una ventana como la siguiente:



El tiempo de espera se configura en milisegundos. Si se introduce el valor cero (0), no aparecerán los mensajes.

5.3 Estado de MEFFServer

MEFFServer puede mostrar dos ventanas diferentes de reducidas dimensiones con la información de los Entornos y de las Conexiones. Estas ventanas se pueden activas seleccionando la opción "Estado de conexiones" o "Estado de Entornos" en el menú "Monitor".

Las ventanas permanecen siempre visibles y pueden desplazarse a cualquier otra posición de la pantalla. La posición de las ventanas se guarda para las siguientes ejecuciones de MEFFServer.

Su apariencia se presenta a continuación:

Monitor Entornos

| Monitor Entornos | | | | | |
|---------------------|------------|----------|--------|----------|--|
| Entorno | Fecha | Hora | Número | Conexión | |
| C2 - CAMARA MEFF RV | 21/11/2005 | 00:00:00 | 26600 | En línea | |
| M3 - MEFF RV | 21/11/2005 | 00:00:00 | 8200 | En línea | |

Monitor Conexiones

| Monitor de conexiones | | | | | |
|-----------------------|---------|----------|------------|----------|----------|
| Conexión | Usuario | 07:44:03 | Fecha | Mens-Rec | Estado |
| Llevant | A840002 | 07:44:02 | 21/11/2005 | 8200 | En Línea |
| Llevant_CL | A840002 | 07:44:02 | 21/11/2005 | 26600 | En Línea |

Apéndice A Estructura de las tablas

En este apéndice se describe la estructura de todas y cada una de las tablas que genera MEFFServer en las diferentes bases de datos de **REALTIME**, **MEFFHIST** y **MAESTROS**.

- En **REALTIME** se ubican las tablas que se mantienen durante la sesión. Son creadas al efectuar la conexión de MEFFServer y perduran hasta la siguiente conexión, momento en que vuelven a ser creadas.
- **MEFFHIST** contiene las tablas históricas. En cada final de sesión se añaden los nuevos registros a estas tablas.
- **MAESTROS** contiene las tablas de ámbito general del mercado. Se actualizan en cada final de sesión, modificando los contenidos ya existentes y añadiendo los nuevos registros.

A.1 Valor especial NULL

Cuando, por el tipo de información contenida en un registro, a un campo de tipo String no le corresponda ningún valor, este campo estará cumplimentado con el valor "-".

A.2 Datos de Liquidación

A.2.1 Datos Generales

Cámara

| | CCLEARINGHOUSE.DB |
|-----------------|-----------------------------------|
| Grupo | Datos generales |
| Descripción | Información genérica de la cámara |
| Grupo de tablas | RealTime - Maestro |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|---|----|-----------------------|------------|---|
| 1 | PK | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 2 | | Descripcion | String(75) | Texto descriptivo de la cámara |
| 3 | | FechaAct | Date | Fecha de actualización del registro |
| 4 | | ReglaCompensacion | Char | Regla de aplicación de spreads para matrices |
| 5 | | ReglaDepositos | Char | Método de cálculo de depósitos |
| 6 | | ReglaPresentDepositos | Char | Regla de presentación de depósitos de efectivo |
| 7 | | TipolInteres | Float | Tipo de interés por defecto |
| 8 | | CodigoBCE | String(6) | Código de la cámara en el Banco Central Europeo |

Divisas

| | CCCURRENCY.DB |
|-----------------|---------------------------------|
| Grupo | Datos generales |
| Descripción | Divisas definidas en el sistema |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Field | Type | Description |
|---|---|----------------|-----------|--|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | Currency | String(3) | Código de divisa. En los contratos de divisa es la divisa cotizada o segunda del par. |
| 4 | | SettlCurrency | String(3) | Divisa en la que se liquidan los cálculos |
| 5 | | ConversionRate | Float | Tipo de cambio de conversión a la divisa de liquidación |

Festivos

| | CHOLIDAYS.DB |
|-----------------|---|
| Grupo | Datos generales |
| Descripción | Calendario de festivos en los que la plataforma de liquidación está cerrada |
| Grupo de tablas | RealTime - Maestro |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|---|---|------------------|-----------|-------------------------------------|
| 1 | ↔ | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 2 | ↔ | Fecha | Date | Fecha del festivo |
| 3 | | FechaAct | Date | Fecha de actualización del registro |
| 4 | | RegistrationOpen | String(1) | Abierto a registro |

Entidades participantes

| | CENTITIES.DB |
|-----------------|---|
| Grupo | Datos generales |
| Descripción | Información pública de las entidades que intervienen en la cámara |
| Grupo de tablas | RealTime - Maestro |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|-------------|------------|--|
| 1 | ↔ | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 2 | ↔ | Codigo | String(4) | Código de la entidad participante en la cámara |
| 3 | | CodigoBCE | String(6) | Código de la entidad en el Banco Central Europeo |
| 4 | | Descripcion | String(75) | Nombre de la Entidad Participante |
| 5 | | NombreCorto | String(20) | Nombre corto |
| 6 | | CodSIBE | String(4) | Código de la entidad en SIBE |
| 7 | | Clase | Char | Tipo de participante Ver Tabla 8 en documento "Tablas de Codificación" |
| 8 | | FechaAlta | Date | Fecha de alta de la entidad |
| 9 | | FechaAct | Date | Fecha de actualización del registro |
| 10 | | CodigoExt | String(5) | Código del participante en la cámara origen |
| 11 | | NumIdentif | String(18) | Número de Identificación del participante. Sólo informado para ADM |
| 12 | | FechaBaja | Date | Fecha de baja de la entidad |
| 13 | | Pais | String(2) | País Codificación ISO 3166:1993 |
| 14 | | Estado | Char | Estado "S"=Baja Suspensiva "T"=Alta técnica, no operativa "A"=Operativo "B"=Baja |
| 15 | | CodIdioma | String(2) | Idioma Codificación ISO 639-2 |
| 16 | | CodBAFIN | String(8) | Código BAFIN para cámara Eurex |
| 17 | | LEI | String(20) | LEI de la Entidad |

Subgrupos de contratos

| | CCONTRGRP.DB |
|-----------------|---------------------|
| Grupo | Datos generales |
| Descripción | Grupos de contratos |
| Grupo de tablas | RealTime - Maestro |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|---|---|-------------|------------|---|
| 1 | ↔ | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 2 | ↔ | Grupo | String(2) | Grupo de contrato |
| 3 | | Descripcion | String(20) | Descripción del grupo de contratos |
| 4 | | FechaAct | Date | Fecha de actualización del registro |
| 5 | | CodPais | String(2) | País Codificación ISO 3166:1993 |
| 6 | | CodSector | String(3) | Código del sector "BNK"=Banca "BAS"=Recursos básicos "CNS" =Construcción "ENE" =Petróleo y energía "IGS" =Bienes y servicios industriales "MDI" =Medios de comunicación y publicidad "MIX" =Indices "NCG" =Bienes y servicios de consumo "RTS" =Retail "TEC" =Tecnología "TEL" =Telecomunicaciones "UTI" =Utilities "--"=No procede (p.e. Bonos) |
| 7 | | Subyacente | String(22) | Código de contrato de contado del grupo |
| 8 | | Activo | String (8) | Activo que identifica el grupo |

Tipos de contrato

| | CCONTRTYP.DB |
|-----------------|--------------------|
| Grupo | Datos generales |
| Descripción | Tipos de contrato |
| Grupo de tablas | RealTime - Maestro |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|-----------------|------------|---|
| 1 | ↔ | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 2 | ↔ | Grupo | String(2) | Grupo de contrato |
| 3 | ↔ | Tipo | String(4) | Tipo de contrato |
| 4 | | Descripcion | String(20) | Descripción del tipo de contrato |
| 5 | | Multiplicador | Float | Multiplicador que debe aplicarse al precio del contrato |
| 6 | | Nominal | Float | Nominal de los contratos de este tipo |
| 7 | | Divisa | String(3) | Código de divisa |
| 8 | | MetodoCalculo | Char | Método de cálculo de precios para contratos de este tipo "1"=Black-76 "2"=Binomial "3"=Black Scholes |
| 10 | | FechaAct | Date | Fecha de actualización del registro |
| 11 | | NumeroDecimales | SmallInt | Número de decimales |
| 12 | | TipoOpcion | Char | Tipo de opción "A"=Americana "E"=Europea "V"=Europea automática |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|-------------------|------------|---|
| 13 | | SubTipo | String(2) | Subtipo "C"=Cotizaciones "I"=Índices "R"=Rollover "X"=Externos "FA"=Futuros sobre acciones "FF"=Futuros RentaFija "FI"=Futuros sobre índice "FS"=Futuros sobre índice sectorial "OA"=Opciones sobre acciones "OI"=Opciones sobre índice "OS"=Opciones sobre índice sectorial "OF"=Opciones Renta Fija |
| 14 | | EntornoAnotacion | String(1) | "P" – Propio (S/MART) "S" – SIBE como sistema externo |
| 15 | | TipoLiquidacion | String(1) | "N" – No se liquidan "D" – Se liquidan mediante Variation Margin Diario "V" – Se liquidan mediante Variation Margin a Vencimiento; hay que añadir a las garantías el variation margin no liquidado "P" - Se liquidan mediante pago de Prima Diario |
| 16 | | FamiliaProducto | String(5) | Ver Tabla 20 en documento "Tablas de Codificación" |
| 17 | | IdentificacionAll | String(12) | Identificador All |
| 18 | | TipoCotizacion | SmallIn | 1 = Precio 2= Rentabilidad |
| 19 | | TipoProducto | String(1) | Tipo de producto "E"= Strategy "F"=Future "M"=Forward "O"=Option "R"=Roll-over "W"=Swap "S"=Spot "X"=Other |
| 20 | | IndFlexible | String(1) | Para indicar si es estándar o no "Y" – No estándar "N" - Estándar |
| 21 | | MetodoLiq | String(1) | Metodo de liquidación "P" – física "C" - cash |
| 22 | | PutCall | String(1) | Tipo de opción "P" – Put "C" - Call |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|----------------|-----------|---|
| 23 | | Periodicidad | String(1) | "Y" – Anual "S" – Temporada "Q" – Trimestral "M" – Mensual "m" – Resto de mes "K" – Semanal (L-D) "K" – Resto de semana "B" – Semanal (L-V) "E" – Semanal (S-D) "D" – Diario |
| 24 | | TipoAjuste | String(1) | Tipo de ajuste "E" – Sólo extraordinarios "T" – Todos |
| 25 | | CFICodeOficial | String(6) | CFICode oficial EMIR Reporting Ver Tabla 10 en documento "Tablas de Codificación" |
| 26 | | UnitOfMeasure | Char(20) | Unidad de medida del multiplicador |
| 27 | | BaseCurrency | Char(3) | Divisa en la que se expresa el nominal de los contratos de este tipo |
| 28 | | SettlCurrency | Char(3) | Divisa a la que se convertirán las liquidaciones de estos contratos |

Contratos

| | CCONTRACTS.DB |
|-----------------|---|
| Grupo | Datos generales |
| Descripción | Información general de los contratos disponibles en la sesión |
| Grupo de tablas | RealTime - Maestro |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|---------------------|------------|---|
| 1 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 2 | → | Contrato | String(22) | Código de contrato |
| 3 | → | Grupo | String(2) | Grupo de contrato |
| 4 | → | Tipo | String(4) | Tipo de contrato |
| 5 | → | Strike | Float | Precio de ejercicio |
| 6 | → | FechaVencimiento | Date | Fecha de vencimiento del contrato |
| 7 | | FechaFinNeg | Date | Fecha de fin de negociación |
| 8 | | Subyacente | String(22) | Código del contrato subyacente a efectos de ejercicio |
| 9 | | SubyacenteCalculos | String(22) | Código del contrato subyacente para el cálculo de garantías |
| 10 | | CodigoComp | String(3) | Código de matriz de garantías |
| 11 | | StdLargo | Char | Códigos: A..Z y 0..9 |
| 12 | | IdVencimiento | String(8) | Identificador del vencimiento Formatos: YYYYMM YYYYMMDD YYYYMMwW (YYYY=año, MM=mes, DD=día, w="w", W=semana) |
| 13 | | ISIN | String(12) | Código ISIN del contrato |
| 14 | | FechaAct | Date | Fecha de actualización del registro |
| 15 | | FechaAlta | Date | Fecha de alta del contrato |
| 16 | | VersionNumber | Char | Versión del contrato (0 si no ha sufrido ajustes) |
| 17 | | ForwardMaturityDate | Date | Para los contratos con diferimiento, es la fecha teórica de vencimiento del forward. En general, D+3. |
| 18 | | SpotMaturityDate | Date | Para los contratos con diferimiento, es la fecha teórica de vencimiento del spot. En general, D+2. |

Tipos de operación

| | CTRADETYP.DB |
|-----------------|--|
| Grupo | Datos generales |
| Descripción | Información sobre los tipos de operación tratados en la cámara |
| Grupo de tablas | RealTime - Maestro |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|------------------------|------------|--|
| 1 | ↔ | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 2 | ↔ | TipoOperacion | Char | Tipo de operación Ver Tabla 12 en documento "Tablas de Codificación" |
| 3 | | Descripcion | String(20) | Descripción del tipo de operación |
| 4 | | FechaAct | Date | Fecha de actualización del registro |
| 5 | | ActPrecioVolumenUltima | Char | Proviene de negociación "S"=Sí "N"=No |
| 6 | | ProvieneNegociación | Char | Proviene de negociación "S"=Sí "N"=No |
| 7 | | ActVolContrato | Char | Actualiza volumen contrato "S"=Sí "N"=No "R"=Resta |
| 8 | | SeEnviaDistribuidores | Char | Se envía a distribuidores "S"=Sí "N"=No |
| 9 | | VisualizaTickerOper | Char | Se visualiza en el ticker de operador "M"=Mercado (se pinta Tipo de Orden) "O"=Se pinta "Tr" + Tipo Operación "A"=Se pinta "Ap" + Tipo Operación "N"=No se visualiza (excepto ADM) |
| 10 | | Intermediada | Char | Intermediada "S"=Sí "N"=No |
| 11 | | AcumulaVolGeneral | Char | Acumula volumen general "S"=Sí "N"=No "R"=Resta |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|----------------|------|--|
| 12 | | ClaseOperacion | Char | <p>Clase de operación</p> <p>"N"=Negociación electrónica</p> <p>"A"=Negociación Telefónica fuera de horario de Mercado</p> <p>"H"=Negociación Telefónica en horario de Mercado</p> <p>"J"=Grandes Operaciones</p> <p>"L"=Operaciones delta</p> <p>"V"=Vencimiento</p> <p>"E"=Ejercicio</p> <p>"T"=Traspasos</p> <p>"G"=Give-up</p> <p>"D"=Asignación de diaria</p> <p>"P"=Ajuste de posición</p> |

Activos subyacentes

| | CUNDERLYINGS.DB |
|-----------------|--|
| Grupo | Datos generales |
| Descripción | Información de los activos subyacentes |
| Grupo de tablas | RealTime - Maestro |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|--------------------|------------|---|
| 1 | ↔ | Camara | String(2) | Código de grupo de contratos |
| 2 | ↔ | Contrato | String(22) | Código de contrato |
| 3 | | ISIN | String(12) | Código ISIN del activo subyacente |
| 4 | | Descripcion | String(20) | Descripción del activo subyacente |
| 5 | | EntornoActivoSuby | String(2) | Código de grupo de contratos en que está listado el activo subyacente |
| 6 | | CFICode | String(6) | Codificación de instrumentos financieros según el estándar ISO 10962. |
| 7 | | TipoActivo | String(3) | Tipo de activo |
| 8 | | Divisa | String(3) | Divisa del activo |
| 9 | | FechaVencimiento | Date | Fecha de vencimiento del activo |
| 10 | | FechaUltimaSubasta | Date | Fecha de última subasta del activo |
| 11 | | FechaInicioCupon | Date | Fecha en la que el activo empieza a devengar cupón. Sólo para bonos y obligaciones |
| 12 | | NumeroCupones | Integer | Número de cupones anuales. Sólo para bonos y obligaciones |
| 13 | | Cupon | Float | Cupón en porcentaje del nominal. Sólo para bonos y obligaciones |
| 14 | | MetCalCuponCorrido | String(1) | Método de cálculo del cupón corrido, dependiendo de la forma de estimar el número de días entre las fechas de pago de cupón entre las que está comprendida la fecha de cálculo. Sólo para bonos y obligaciones Base real: Se tiene en cuenta el número de días real entre las fechas de pago de cupón |
| 15 | | FechaAct | Date | Fecha actualización del registro |

Códigos resultantes para cascada teórica

| | CCONTRREL.DB |
|-----------------|---|
| 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. |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|---|---|-------------------|------------|---|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de grupo de contratos |
| 3 | → | Contrato | String(22) | Código de contrato original |
| 4 | | NoContratos | Integer | Número de relaciones que se definen a continuación. Máximo 31. |
| 5 | | ContratoFinal_1 | String(22) | Código de contrato resultante |
| 6 | | FechaIniPeriodo_1 | Date | Fecha inicial del contrato. En Energía es la fecha inicial del período de entrega del contrato resultante. |
| 7 | | FechaFinPeriodo_1 | Date | Fecha final del contrato. En Energía es la fecha final del período de entrega del contrato resultante. |
| | | ContratoFinal_n | String(22) | Se repiten los campos ContratoFinal_n, FechaIniPeriodo_n y FechaFinPeriodo_n para n=2..31 |
| | | FechaIniPeriodo_n | Date | Se repiten los campos ContratoFinal_n, FechaIniPeriodo_n y FechaFinPeriodo_n para n=2..31 |
| | | FechaFinPeriodo_n | Date | Se repiten los campos ContratoFinal_n, FechaIniPeriodo_n y FechaFinPeriodo_n para n=2..31 |

Detalle de códigos resultantes para cascada teórica

| | CCONTRREDET.DB |
|-----------------|---|
| Grupo | Datos generales |
| Descripción | Detalle de la relación entre contrato original y sus contratos resultantes, en caso de que en el grupo de contratos haya contratos cuya posición deba desglosarse en otros de nominal menor. Para Energía informa de las relaciones resultantes al realizar la cascada real. |
| Grupo de tablas | RealTime -Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|--------------------|------------|---|
| 1 | ↔ | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | ↔ | Camara | String(2) | Código de grupo de contratos |
| 3 | ↔ | Contrato | String(22) | Código de contrato original |
| 4 | | FechaVencimiento | Date | Fecha de vencimiento |
| 5 | | FechaCascada | Date | Fecha de cascada real |
| 6 | | Multiplicador | Amt | Nominal del contrato |
| 7 | | UnidadMedidaMul | Char(20) | Unidad de medida del multiplicador |
| 8 | | FechaIniPeriodo | Date | Fecha inicial del contrato. En Energía es la fecha inicial del período de entrega del contrato inicial. |
| 9 | | FechaFinPeriodo | Date | Fecha final del contrato. En Energía es la fecha final del período de entrega del contrato inicial. |
| 10 | | NoContratos | Int | Número de relaciones que se definen a continuación. Máximo 31. |
| 11 | | ContratoFinal_1 | String(22) | Código de contrato resultante |
| 12 | | FechaVencimiento_1 | Date | Fecha de vencimiento |
| 13 | | Multiplicador_1 | Float | Nominal del contrato |
| 14 | | FechaIniPeriodo_1 | Date | Fecha inicial del contrato. En Energía es la fecha inicial del período de entrega del contrato resultante. |
| 15 | | FechaFinPeriodo_1 | Date | Fecha final del contrato. En Energía es la fecha final del período de entrega del contrato resultante. |
| | | ContratoFinal_n | String(22) | |
| | | FechaVencimiento_n | Date | |
| | | Multiplicador_n | Float | |
| | | FechaIniPeriodo_n | Date | |
| | | FechaFinPeriodo_n | Date | |

A.2.2 Información Pública Diaria

Información diaria de contratos

| | CCONTRSTAT.DB |
|-----------------|---------------------------------|
| Grupo | Información diaria de contratos |
| Descripción | Datos diarios de los contratos |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|-------------------------|------------|--|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | Contrato | String(22) | Código de contrato |
| 4 | | Alto | Float | Precio alto de la sesión |
| 5 | | Bajo | Float | Precio bajo de la sesión |
| 6 | | First | Float | Primer precio de la sesión |
| 7 | | Last | Float | Último precio de la sesión |
| 8 | | Cierre | Float | Precio de cierre de la sesión |
| 9 | | VolatCierre | Float | Volatilidad de cierre para la sesión. Este campo no está informado para las opciones largas |
| 10 | | DeltaCierre | Float | Delta de cierre al cierre de la sesión. Este campo no está informado para las opciones largas |
| 11 | | Open | Float | Precio de apertura de la sesión |
| 12 | | VolatApertura | Float | Volatilidad al cierre de de la sesión anterior |
| 13 | | DeltaApertura | Float | Delta al cierre de la sesión anterior |
| 14 | | VolumenRegistrado | Integer | Volumen total registrado |
| 15 | | NumOperaciones | Integer | Número de operaciones registradas |
| 16 | | OpenInterest | Integer | Posición abierta |
| 17 | | AccruedInterest | Float | Cupón corrido incorporado al precio de liquidación de la sesión. Sólo para bonos y obligaciones |
| 18 | | RentabilidadCierre | Price | Rentabilidad Sólo para contratos que cotizan por tasa de interés |
| 19 | | ForwardPrice | Price | Precio de referencia (forward) para D+1 (solo se informa para contratos con diferimiento) |
| 20 | | PreviousDayForwardPrice | Price | Precio de referencia (forward) al cierre de la sesión anterior (solo se informa para contratos con diferimiento) |

A.2.3 Datos Privados de Configuración

Cuentas de garantías

| | CMARGINACCOUNTS.DB |
|-----------------|---------------------------------|
| Grupo | Datos privados de configuración |
| Descripción | Cuenta de garantías |
| Grupo de tablas | RealTime - Maestro |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|------------------|------------|--|
| 1 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 2 | → | MiembroGarantias | String(4) | Miembro de la cuenta de garantías |
| 3 | → | CuentaGarantias | String(12) | Cuenta de garantías |
| 5 | | Compensador | String(4) | Miembro Compensador |
| 6 | | MiembroColateral | String(4) | Miembro cuenta de colateral |
| 7 | | CuentaColateral | String(12) | Cuenta de colateral |
| 8 | | TipoGarantia | String(2) | IM: Initial Margin IF: individual Fund DF: Default Fund EM: Extraordinary margins |
| 9 | | FechaAct | Date | Fecha de actualización del registro |
| 10 | | TipoCalculo | String(1) | G: Bruto N: Neto P: Bruto punta (compra o venta) - Sólo CRCC |

Cuentas de colateral

| | CCOLLATERALACCOUNTS.DB |
|-----------------|---------------------------------|
| Grupo | Datos privados de configuración |
| Descripción | Cuenta de colateral |
| Grupo de tablas | RealTime - Maestro |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|----------------------|------------|--|
| 1 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 2 | → | MiembroColateral | String(4) | Miembro de la cuenta de garantías |
| 3 | → | CuentaColateral | String(12) | Cuenta de garantías |
| 4 | | Compensador | String(4) | Miembro Compensador |
| 5 | | AgentePagos | String(4) | Agente de pagos |
| 6 | | GrupoMovEfectivo | String(8) | Grupo de movimientos de efectivo asociados al Agente de Pagos. |
| 7 | | TipoAjusteEfectivo | String(1) | Tipo ajuste Efectivo N: Buffer Y: Ajuste efectivo automático D: ajuste sólo déficit A: No aplica |
| 8 | | IndicadorReinversion | String(1) | Indicador de reinversión (S/N) |
| 9 | | RefEstructuraCuenta | String(12) | Referencia estructura de cuenta |
| 10 | | TipoEstructura | String(2) | Tipo de estructura ver Tabla 19 en documento "Tablas de Codificación" |
| 11 | | Modelo | String(1) | Modelo P – p-t-p A – agency N – No Aplica |
| 12 | | ClearingIndirecto | String(1) | Indicador de Clearing Indirecto (S/N) |
| 13 | | FechaAct | Date | Fecha de actualización del registro |

Cuentas de posición

| | CACCOUNTS.DB |
|-----------------|--|
| Grupo | Datos privados de configuración |
| Descripción | Información de las cuentas disponibles |
| Grupo de tablas | RealTime - Maestro |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|--------------------------|----------------------|---|
| 1 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 2 | → | Miembro | String(4) | Miembro al que pertenece la cuenta |
| 3 | → | CuentaPosicion | String(5) | Cuenta de posición |
| 4 | | CuentaPosicionResidual | String(5) | Cuenta posición residual |
| 5 | | FechaAct | Date | Fecha de actualización del registro |
| 6 | | Estado | Char | Estado de vigencia de la cuenta |
| 7 | | FechaUltModif | Date | Fecha de la última modificación |
| 8 | | FechaAltaCuenta | Date | Fecha de alta de la cuenta |
| 9 | | MiembroECCDestino | String(4) | Miembro ECC destino para entrega de acciones |
| 10 | | RefAsignacion | String(18) | Referencia asignación para entrega de acciones |
| 11 | | Mnemotecnico | String(10) | Mnemotécnico para entrega de acciones |
| 12 | | RVPositionAccount | String(5) | Cuenta de posición ECC para entrega de acciones |
| 13 | | CodCliente | String(16) | Código de cliente para entrega de acciones |
| 14 | | MiembroGarantias | String(4) | Miembro de la cuenta de garantías |
| 15 | | CuentaGarantias | String(12) | Cuenta de garantías |
| 16 | | AgentePagos | String(4) | Agente de pagos |
| 17 | | Compensador | String(4) | Miembro Compensador |
| 18 | | Clase | Char | Clase de la cuenta de posición ver Tabla 18 en documento "Tablas de Codificación" |
| 19 | | TipoPersona | String(2) | Tipo de persona Ver Tabla 17 en documento "Tablas de Codificación" |
| 20 | | EntAuth | Char | Código de entidad autorizada |
| 21 | | RiskReducingPosIndicator | Char | En los segmentos con derivados sobre commodities sujetos a MiFID II, indica si por defecto las posiciones incluidas en esta cuenta de posición reducen o aumentan riesgo S=Si N=No Blancos |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|---------------|------------|--|
| 22 | | PropClient | Char | Tipo de cuenta de posición desde el punto de vista del miembro de mercado C=Cliente P=Propia |
| 23 | | EICCode | String(16) | |
| 24 | | TipoAnotacion | String (1) | Tipo de anotación G: Bruto N:Neto |
| 25 | | TitEICCode | String(1) | Titularidad EICCode S=Si N=No |

Referencias de Give-Out

| | CGIVEOUTREF.DB |
|-----------------|---|
| Grupo | Datos privados de configuración |
| Descripción | Referencias de Give-Out definidas en el sistema por el Miembro Origen |
| Grupo de tablas | RealTime - Maestro |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|--------------------|------------|---|
| 1 | ↔ | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 2 | ↔ | MiembroGiveOut | String(4) | Miembro Origen, que configura las referencias del Give-Out |
| 3 | ↔ | MnemonicGiveOut | String(10) | Mnemotécnico al que se ha asociado un Miembro Destino y una referencia de Give-Up |
| 4 | | MiembroGiveIn | String(4) | Miembro Destino del Give-Up asociado al mnemotécnico del registro |
| 5 | | RefGiveUp | String(18) | Referencia de Give-Up. Es una referencia común para Miembros Origen y Destino que tiene como objeto identificar la operación |
| 6 | | OperadorGiveOut | String(3) | Operador que modificó el filtro por última vez |
| 7 | | FechaModif | Date | Fecha de modificación |
| 8 | | HoraModif | Time | Hora de modificación |
| 9 | | FechaAct | Date | Fecha de actualización del registro |
| 10 | | GiveOutInternalRef | String(18) | Referencia asignada por el Miembro Origen para uso interno y que se asocia al mnemónico de give-out. Una misma referencia interna puede estar asociada a más de un mnemónico. |

Referencias de Give-In

| | CGIVEINREF.DB |
|-----------------|---|
| Grupo | Datos privados de configuración |
| Descripción | Referencias de Give-In definidas en el sistema por el Miembro Destino |
| Grupo de tablas | RealTime - Maestro |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|----------------------|------------|--|
| 1 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 2 | → | MiembroGiveIn | String(4) | Miembro Destino, que configura las referencias de Give-In |
| 3 | → | MiembroGiveOut | String(4) | Miembro Origen del Give-Up |
| 4 | → | RefGiveUp | String(18) | Referencia de Give-Up. Es una referencia común para Miembros Origen y Destino que tiene como objeto identificar la operación |
| 5 | | MnemonicGiveIn | String(10) | Mnemotécnico asignado por el Miembro Destino a la combinación de Miembro Origen y referencia de Give-Up del registro. Puede no estar informado |
| 6 | | CuentaPosicionGiveIn | String(5) | Cuenta de posición destino en la que debe registrarse el Give-In en caso de ser aceptado |
| 7 | | OperadorGiveIn | String(3) | Operador que modificó el filtro por última vez |
| 8 | | FechaModif | Date | Fecha de modificación |
| 9 | | HoraModif | Time | Hora de modificación |
| 10 | | FechaAct | Date | Fecha de actualización del registro |

Filtros de solicitud de Give-Out para Miembro Origen

| | CGIVEOUTFILT.DB |
|-----------------|--|
| Grupo | Datos privados de configuración |
| Descripción | Filtros de solicitud Give-out establecidos por el Miembro Origen |
| Grupo de tablas | RealTime - Maestro |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|---|---|-----------------------|------------|---|
| 1 | ↔ | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 2 | ↔ | MiembroGiveOut | String(4) | Miembro Origen, que configura los filtros de Give-out |
| 3 | ↔ | CuentaPosicionGiveOut | String(5) | Cuenta de posición Origen del Give-Up |
| 4 | | MnemonicGiveOut | String(10) | Mnemotécnico al que se ha asociado un Miembro Destino y una referencia de Give-Up |
| 5 | | OperadorGiveOut | String(3) | Operador que modificó el filtro por última vez |
| 6 | | FechaModif | Date | Fecha de modificación |
| 7 | | HoraModif | Time | Hora de modificación |
| 8 | | FechaAct | Date | Fecha de actualización del registro |

Filtros de aceptación de Give-In para Miembro Destino

| | CGIVEINFILT.DB |
|-----------------|---|
| Grupo | Datos privados de configuración |
| Descripción | Filtros de aceptación Give-In establecidos por el Miembro Destino |
| Grupo de tablas | RealTime - Maestro |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|-----------------|------------|--|
| 1 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 2 | → | MiembroGiveIn | String(4) | Miembro Destino, que configura los filtros de Give-In |
| 3 | → | MiembroGiveOut | String(4) | Miembro Origen del Give-Up, para el cual, junto con la referencia, se define el filtro |
| 4 | → | RefGiveUp | String(18) | Referencia para la que, junto con el código de Miembro Origen del Give-Up, se define el filtro |
| 5 | | NomMaxOperacion | Float | Importe máximo para un Give-In que será aceptado automáticamente para ese Miembro Origen y referencia |
| 6 | | NomMaxSesion | Float | Importe acumulado máximo por sesión de Give-Ins que serán aceptados automáticamente para ese Miembro Origen y referencia |
| 7 | | OperadorGiveIn | String(3) | Operador que modificó el filtro por última vez |
| 8 | | FechaModif | Date | Fecha de modificación |
| 9 | | HoraModif | Time | Hora de modificación |
| 10 | | FechaAct | Date | Fecha de actualización del registro |

Filtros de aceptación de Give-In para Compensador de Miembro Destino

| | CGIVEINFILTCLM.DB |
|-----------------|---|
| Grupo | Datos privados de configuración |
| Descripción | Filtros de aceptación Give-In establecidos por el Miembro Compensador del Miembro Destino |
| Grupo de tablas | RealTime - Maestro |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|----------------------|-----------|---|
| 1 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 2 | → | Compensador | String(4) | Miembro Compensador del destino del Give-In |
| 3 | → | MiembroGiveIn | String(4) | Miembro Destino del Give-In |
| 4 | → | CuentaPosicionGiveIn | String(5) | Cuenta de posición Destino del Give-In |
| 5 | | NomMaxOperacion | Float | Importe máximo para un Give-In que será aceptado de forma automática para ese Miembro Destino y cuenta |
| 6 | | NomMaxSesion | Float | Importe acumulado máximo por sesión de Give-Ins que serán aceptados automáticamente para ese Miembro Destino y cuenta |
| 7 | | OperadorLiquidador | String(3) | Operador que modificó el filtro por última vez |
| 8 | | FechaModif | Date | Fecha de modificación |
| 9 | | HoraModif | Time | Hora de modificación |
| 10 | | FechaAct | Date | Fecha de actualización del registro |

A.2.4 Datos para Cálculo de Garantías

Parámetros de la matriz de garantías

| | CVALARRAYS.DB |
|-----------------|---|
| Grupo | Datos para cálculo de garantías |
| Descripción | Parámetros de cada una de las matrices de cálculo de garantía |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|----------------|-----------|--|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | Matriz | String(3) | Código de la matriz de garantías |
| 4 | → | StdLargo | Char | Tipo de vencimiento Códigos: A..Z y 0..9 |
| 5 | | NumCols | SmallInt | Número de columnas (<=41) |
| 6 | | TipoFluc | Char | Tipo de fluctuación de precios "P"=Porcentaje "T"=Por precio |
| 7 | | FluctUpL | Float | Fluctuación de crecimiento (izquierda) |
| 8 | | FluctDownR | Float | Fluctuación de decrecimiento (derecha) |
| 9 | | AplicVola | Char | Forma de aplicar la variación de la volatilidad "P"=Porcentual "A"=Aditiva |
| 10 | | DeltaVola | Float | Variación de volatilidad |
| 11 | | Grupo | String(2) | Grupo de contrato referencia para compensación entre subyacentes distintos |
| 12 | | Tipo | String(4) | Tipo de contrato referencia para compensación entre subyacentes distintos |
| 13 | | DeltaGarantias | Float | Delta a partir de la cual aplican las garantías para grandes posiciones |
| 14 | | NumColsLPos | SmallInt | Número de Columnas para grandes posiciones |

Compensación intra-matriz

| | CINTRASPR.DB |
|-----------------|---|
| 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 |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|---|---|----------------|-----------|--|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | Matriz | String(3) | Código de la matriz de garantías |
| 5 | | Factor | Float | Factor |
| 6 | | MinDif | Float | Valor mínimo |
| 7 | | Spread | Float | Spread |
| 8 | | HayVtosDiarios | Char | S = La distancia entre vencimientos se cuenta en días. N = La distancia entre vencimientos se cuenta en meses |

Compensación inter-matriz

| | CINTERSPR.DB |
|-----------------|---|
| 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 diferentes código de matriz |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|-----------|-----------|---|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | Prioridad | String(3) | Prioridad |
| 4 | | Matriz1 | String(3) | Código de matriz 1 |
| 5 | | Dto1 | Float | Descuento en grupo de compensación 1 |
| 6 | | Factor1 | Integer | Multiplicador de compensación 1 |
| 7 | | Matriz2 | String(3) | Código de matriz 1 |
| 8 | | Dto2 | Float | Descuento en grupo de compensación 2 |
| 9 | | Factor2 | Integer | Multiplicador de compensación 2 |
| 10 | | TipoDto | Char | Tipo de descuento que se aplica "D"=Divisa "P"=Porcentaje |

Precios teóricos

| | CTHEORPRICES.DB |
|-----------------|---------------------------------|
| Grupo | Datos para cálculo de garantías |
| Descripción | Precios teóricos de contratos |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|---|---|-----------|------------|--|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | Contrato | String(22) | Código de contrato |
| 4 | | Columnas | SmallIn | Número de precios presentes en el registro para cada signo |
| 5 | | PrecioT_1 | Float | Precio tomo 1 |
| 6 | | PrecioD_1 | Float | Precio doy 1 |
| | | PrecioT_n | Float | Se repiten los campos PrecioT_n y PrecioD_n para n= 2..47 2..57 |
| | | PrecioD_n | Float | Se repiten los campos PrecioT_n y PrecioD_n para n= 2..47 2..57 |

Deltas

| | CDELTA.S.DB |
|-----------------|---------------------------------|
| Grupo | Datos para cálculo de garantías |
| Descripción | Deltas de los contratos |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|---|---|----------|------------|--|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | Contrato | String(22) | Código de contrato |
| 4 | | Columnas | SmallIn | Número de deltas presentes en el registro para cada signo |
| 5 | | DeltaT_1 | Float | Delta tomo 1 |
| 6 | | DeltaD_1 | Float | Delta doy 1 |
| | | DeltaT_n | Float | Se repiten los campos DeltaT_n y DeltaD_n para n= 2..47 2..57 |
| | | DeltaD_n | Float | Se repiten los campos DeltaT_n y DeltaD_n para n= 2..47 2..57 |

Skew de volatilidad

| | CVOLATILITYSKEW.DB |
|-----------------|---|
| Grupo | Datos para cálculo de garantías |
| Descripción | Skew de volatilidad. Sólo contiene las opciones largas en el caso de Server-ADM |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|-----------------|------------|---|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | Contrato | String(22) | Código de contrato |
| 4 | → | Vencimiento | Date | Fecha de vencimiento del contrato |
| 5 | → | Instrumento | Char | Instrumento "C"=Call "P"=Put "?"=Ambas |
| 6 | | VolaATM | Float | Volatilidad ATM en tanto por ciento |
| 7 | | NumTramos | SmallInt | Número de tramos que se definen en el registro ≤8 |
| 8 | | DivisorPtosPorc | SmallInt | Indica a que porcentaje se aplica cada incremento de volatilidad |
| 9 | | VolaMaxima | Float | Volatilidad máxima en tanto por ciento |
| 10 | | VolaMinima | Float | Volatilidad mínima en tanto por ciento |
| 11 | | PorVariSup_1 | Float | Tamaño del tramo, en tanto por ciento, para P_Ejercicio ≥ P_Subyacente |
| 12 | | PuntPorSup_1 | Float | Número de puntos porcentuales de incremento/decremento de volatilidad para P_Ejercicio ≥ P_Subyacente |
| 13 | | PorVarInf_1 | Float | Tamaño del tramo, en tanto por ciento, para P_Ejercicio < P_Subyacente |
| 14 | | PuntPorInf_1 | Float | Número de puntos porcentuales de incremento/decremento de volatilidad para P_Ejercicio < P_Subyacente |
| | | PorVariSup_n | Float | Se repiten los campos PorVariSup_n, PuntPorSup_n, PorVarInf_n y PuntPorInf_n para n=2..8 |
| | | PuntPorSup_n | Float | Se repiten los campos PorVariSup_n, PuntPorSup_n, PorVarInf_n y PuntPorInf_n para n=2..8 |
| | | PorVarInf_n | Float | Se repiten los campos PorVariSup_n, PuntPorSup_n, PorVarInf_n y PuntPorInf_n para n=2..8 |
| | | PuntPorInf_n | Float | Se repiten los campos PorVariSup_n, PuntPorSup_n, PorVarInf_n y PuntPorInf_n para n=2..8 |

Dividendos

| | CDIVIDENDS.DB |
|-----------------|---------------------------------|
| Grupo | Datos para cálculo de garantías |
| Descripción | Dividendos previstos |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|---------------|------------|---|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | Contrato | String(22) | Código de contrato |
| 4 | | NumDividendos | Integer | Número de dividendos contenidos en el registro <=42 |
| 5 | | FechaDiv_1 | Date | Fecha prevista 1 |
| 6 | | Importe_1 | Float | Importe estimado 1 |
| 7 | | Confirmado_1 | Char | Confirmado 1 "S"=Sí "N"=No |
| 8 | | FechaDiv_2 | Date | Fecha prevista 2 |
| 9 | | Importe_2 | Float | Importe estimado 2 |
| 10 | | Confirmado_2 | Char | Confirmado 2 |
| | | FechaDiv_n | Date | Se repiten los campos FechaDiv, Importe y Confirmado para los valores n=3..42 |
| | | Importe_n | Float | Se repiten los campos FechaDiv, Importe y Confirmado para los valores n=3..42 |
| | | Confirmado_n | Char | Se repiten los campos FechaDiv, Importe y Confirmado para los valores n=3..42 |

Curva de tipos de interés

| | CYIELDCURVE.DB |
|-----------------|---------------------------------|
| Grupo | Datos para cálculo de garantías |
| Descripción | Curva de tipos de interés |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|---|---|-------------|-----------|--|
| 1 | ↔ | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | ↔ | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | ↔ | TipoCalculo | Char | Tipo de cálculo para el que se utilizan los tipos de interés. "2"=Garantías "3"=Actuaización efectivo compras "4"=Actualización efectivo ventas |
| 4 | | NumTramos | Integer | Número de tramos que se definen en el registro ≤50 |
| 5 | | Dialnicio_1 | Integer | Día de inicio del tramo 1. El día final se obtiene restando uno al inicio del siguiente tramo. |
| 6 | | Tipolnt_1 | Float | Tipo de interés del tramo 1 |
| | | Dialnicio_n | Integer | Se repiten los campos Dialnicio_n y Tipolnt_n para n=2..50 |
| | | Tipolnt_n | Float | Se repiten los campos Dialnicio_n y Tipolnt_n para n=2..50 |

A.2.5 Operaciones

Operaciones

| | CTRADES.DB |
|-----------------|--|
| Grupo | Operaciones |
| Descripción | Información de todas las operaciones registradas |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|----------------|------------|--|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | NumOperacion | Integer | Número de registro de cámara de la operación |
| 4 | → | Signo | Char | Signo "1"=Compra "2"=Venta |
| 5 | | Miembro | String(4) | Miembro al que pertenece la cuenta |
| 6 | | Operador | String(3) | Identificador del usuario que realizó la operación. En el caso de Give-Ins aceptados automáticamente, el valor de este campo es "SYS" |
| 7 | | CuentaPosicion | String(5) | Cuenta de posición |
| 8 | | Contrato | String(22) | Código de contrato |
| 9 | | TipoOperacion | Char | Tipo de operación Ver Tabla 12 en documento "Tablas de Codificación" |
| 10 | | Precio | Float | Precio de la operación |
| 11 | | Volumen | Integer | Volumen |
| 12 | | Referencia | String(18) | Referencia Si es una operación procedente de una orden, es la referencia de la orden Si es una aplicación, es la referencia introducida por el miembro intermediario Si es una asignación de cuenta diaria o un traspaso, es la referencia informada en la operación de procedencia |
| 13 | | AbreCierra | Char | Información relevante sólo para cuentas que anoten posición en bruto: indica si la operación abre o cierra posición abierta "O"=Abre "C"=Cierra |
| 14 | | ComiNeg | Float | Comisión de negociación. El importe se liquida con la cámara en la fecha de liquidación indicada en el campo SettleDate. |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|---------------------|------------|---|
| 15 | | ComiLiq | Float | Comisión de liquidación. El importe se liquida con la cámara en la fecha de liquidación indicada en el campo SettlDate. |
| 16 | | Divisa | String(3) | Divisa en la que se expresan los importes del registro |
| 17 | | FechaLiquidacion | Date | Fecha de liquidación |
| 18 | | FechaRegistro | Date | Fecha de registro en la cámara |
| 19 | | HoraRegistro | Time | Hora de registro en la cámara |
| 20 | | NumOpProcedencia | Integer | Número de registro de cámara de la operación de procedencia. Si se trata de la operación inicial es su propio número de registro de cámara |
| 21 | | NumOpInicial | Integer | Número de registro de cámara de la operación inicial. Si se trata de la operación inicial es su propio número de registro de cámara (TradeID) |
| 22 | | Compensador | String(4) | Miembro Compensador de la cuenta donde se realizó la operación |
| 23 | | MiembroInter | String(4) | Si es una operación intermediada introducida desde el sistema de Negociación, contiene el código de Miembro que la introduce. Para cualquier otra operación introducida desde el sistema de Negociación estos campos se informan a blancos. Si es una operación de clearing (Asignación de Cuenta Diaria, Give-up, ...) el Miembro intermediario se cumplimentará con el código del miembro negociador de la operación inicial. |
| 24 | | OperadorInter | String(3) | Si es una operación intermediada introducida desde el sistema de Negociación, contiene el código de Operador que la introduce. Para cualquier otra operación introducida desde el sistema de Negociación estos campos se informan a blancos. Si es una operación de clearing (Asignación de Cuenta Diaria, Give-up, ...) el Operador intermediario se cumplimentará con el código del operador negociador de la operación inicial. |
| 25 | | FechaRegOpelInicial | Date | Fecha de registro en la cámara de la operación inicial |
| 26 | | MercadoNeg | String(2) | Código del mercado donde fue negociada la operación inicial |
| 27 | | NRegNeg | String(12) | Número de registro de mercado de la operación inicial |
| 28 | | NumOrdenSistema | String(12) | Número de orden sistema de la operación inicial |
| 29 | | TipoOperacionIni | Char | Tipo de la Operación de la operación inicial. |
| 30 | | FechaEjecucion | Date | Fecha de ejecución si proviene de sistema de negociación. Si la operación se registra en cámara esta fecha es igual a la fecha operación inicial. |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|------------------|------------|--|
| 31 | | HoraEjecucion | String(15) | Hora de ejecución si proviene de sistema de negociación. Si la operación se registra en cámara esta hora es igual a la hora operación inicial. |
| 32 | | EfectivoOpe | Amt | Nominal / Efectivo de la transacción |
| 33 | | RefOriPrimaria | String(18) | Referencia original primaria de la operación. En un repo, es la referencia común a las 2 patas del mismo. |
| 34 | | RefOriSecundaria | String(18) | Referencia original secundaria de la operación. En un repo, es la referencia correspondiente a la ida o la vuelta del mismo. |
| 35 | | UTI | String(52) | Identificador de la operación para la notificación |
| 36 | | VolumenVivo | Integer | Volumen vivo de la operación. Número de contratos asociados a la operación, habiendo descontado aquellos que han sido traspasados |
| 37 | | NumOpPosterior | Integer | Número de registro de liquidación de la operación posterior (operaciones precio medio). |
| 38 | | Rentabilidad | Float | |
| 39 | | MarketID | String(4) | Operating MIC, para operaciones que procedan de una plataforma de negociación |
| 40 | | MarketSegmentID | String(4) | Segment MIC, para operaciones que procedan de una plataforma de negociación |
| 41 | | PremiumMargin | Amt | |
| 42 | | FTL | Date | |

A.2.6 Gestión de Operaciones

Asignaciones y traspasos realizados

| | CTransfTrades.DB |
|-----------------|-------------------------------------|
| Grupo | Gestión de operaciones |
| Descripción | Asignaciones y Traspasos realizados |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|-----------------------|------------|---|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | IdTransaccion | Integer | Identificador del traspaso |
| 4 | | Miembro | String(4) | Miembro que realiza la asignación o el traspaso |
| 5 | | Operador | String(3) | Operador de liquidación que solicitó la acción |
| 6 | | Contrato | String(22) | Código de contrato |
| 7 | | NumOperacionOri | Integer | Número de registro de cámara de la operación original |
| 8 | | Signo | Char | Signo de la operación "1"=Compra "2"=Venta |
| 9 | | CuentaPosicionOrigen | String(5) | Cuenta de posición origen |
| 10 | | NumOperacion | Integer | Número de registro de cámara de la operación |
| 11 | | CuentaPosicionDestino | String(5) | Cuenta de posición destino |
| 12 | | Precio | Float | Precio |
| 13 | | Volumen | Integer | Volumen traspasado |
| 14 | | TipoOperacion | Char | Tipo de operación Ver Tabla 12 en documento "Tablas de Codificación" |
| 15 | | HoraRegistro | Time | Hora de registro en la cámara |
| 16 | | FechaLiq | Date | Fecha de liquidación |
| 17 | | EfectivoOpe | Amt | Nominal / Efectivo de la transacción |

Give-Outs

| | CGIVEOUT.DB |
|-----------------|---|
| Grupo | Gestión de operaciones |
| Descripción | Estado de los Give-Outs en que se participa como Miembro Origen |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|----------------------|------------|---|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | IdTransaccion | Integer | Identificador del Give-Up |
| 4 | | Estado | Char | Estado del Give-Up Ver Tabla 11 en documento "Tablas de Codificación" |
| 5 | | Miembro | String(4) | Miembro Origen |
| 6 | | Operador | String(3) | Código de operador |
| 7 | | Contrato | String(22) | Código de contrato |
| 8 | | NumOperacionOri | Integer | Número de registro de cámara de la operación para la que se ha solicitado el Give-Out |
| 9 | | Signo | Char | Signo de la operación de la que se ha solicitado el Give-Out "1"=Compra "2"=Venta |
| 10 | | CuentaPosicionOrigen | String(5) | Cuenta de posición origen |
| 11 | | NumOperacion | Integer | Número de registro de cámara de la operación de Give-Up. Sólo debe ser tenido en cuenta cuando el Give-Up se haya aceptado. |
| 12 | | Precio | Float | Precio |
| 13 | | Volumen | Integer | Número de contratos a traspasar |
| 14 | | MnemonicGiveOut | String(10) | Mnemotécnico del Give-Out |
| 15 | | MiembroGiveln | String(4) | Miembro Destino |
| 16 | | RefGiveUp | String(18) | Referencia de Give-Up |
| 17 | | HoraRegistro | Time | Hora en que el Give-Out pasa a este estado |
| 18 | | FechaLiq | Date | Fecha de liquidación |
| 19 | | GiveOutInternalRef | String(18) | Referencia asignada por el Miembro Origen para uso interno y que se asocia al mnemónico de give-out. Una misma referencia interna puede estar asociada a más de un mnemónico. |
| 20 | | EfectivoOpe | Amt | Nominal / Efectivo de la transacción |

Give-Ins para Miembro Destino

| | CGIVEIN.DB |
|-----------------|--|
| Grupo | Gestión de operaciones |
| Descripción | Estado de los Give-In en que se participa como Miembro Destino |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|----------------|------------|---|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | IdTransaccion | Integer | Identificador del Give-Up |
| 4 | | Estado | Char | Estado del Give-Up Ver Tabla 11 en documento "Tablas de Codificación" |
| 5 | | Miembro | String(4) | Miembro Destino |
| 6 | | Operador | String(3) | Operador de Miembro Destino que actuó aceptando o rechazando el Give-Up. En el caso de Give-Ins aceptados automáticamente, el valor de este campo es "SYS". |
| 7 | | Contrato | String(22) | Código de contrato |
| 8 | | NumOperacion | Integer | Número de registro de cámara de la operación de Give-Up. Sólo debe ser tenido en cuenta cuando el Give-Up se haya aceptado. |
| 9 | | Signo | Char | Signo de la operación de la que se ha solicitado el Give-Up "1"=Compra "2"=Venta |
| 10 | | CuentaPosicion | String(5) | Cuenta de posición destino |
| 11 | | Precio | Float | Precio |
| 12 | | Volumen | Integer | Número de contratos a traspasar |
| 13 | | MnemonicGiveIn | String(10) | Mnemotécnico asignado por el Miembro Destino a la combinación del Miembro Origen y referencia de Give-Up del registro |
| 14 | | MiembroOrigen | String(4) | Miembro Origen |
| 15 | | OperadorOrigen | String(3) | Operador del Miembro Origen que solicitó el Give-Up |
| 16 | | RefGiveUp | String(18) | Referencia de Give-Up |
| 17 | | HoraRegistro | Time | Hora en la que el Give-In pasa a este estado |
| 18 | | FechaLiq | Date | Fecha de liquidación. Sólo debe ser tenido en cuenta cuando el Give-Up se haya aceptado |
| 19 | | EfectivoOpe | Amt | Nominal / Efectivo de la transacción |

Give-Ins para Compensador de Miembro Destino

| | CGIVEINCLM.DB |
|-----------------|--|
| Grupo | Gestión de operaciones |
| Descripción | Estado de los Give-In en que se participa como Compensador del Miembro Destino |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|-----------------------|------------|---|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | IdTransaccion | Integer | Identificador del Give-Up |
| 4 | | Estado | Char | Estado del Give-Up Ver Tabla 11 en documento "Tablas de Codificación" |
| 5 | | Miembro | String(4) | Miembro Compensador del Miembro Destino del Give-Up |
| 6 | | Operador | String(3) | Operador del Miembro Destino que actuó aceptando o rechazando el Give-Up. En el caso de Give-Ups aceptados automáticamente, el valor de este campo es "SYS" |
| 7 | | MiembroDestino | String(4) | Miembro Destino |
| 8 | | OperadorDestino | String(3) | Operador del Miembro Destino que aceptó el Give-Up. En el caso de Give-Ins aceptados automáticamente, el valor de este campo es "SYS" |
| 9 | | Contrato | String(22) | Código de contrato |
| 10 | | NumOperacion | Integer | Número de registro de cámara de la operación de Give-Up. Sólo debe ser tenido en cuenta cuando el Give-Up se haya aceptado. |
| 11 | | Signo | Char | Signo de la operación de la que se ha solicitado el Give-Up "1"=Compra "2"=Venta |
| 12 | | CuentaPosicionDestino | String(5) | Cuenta de posición destino |
| 13 | | Precio | Float | Precio |
| 14 | | Volumen | Integer | Número de contratos a traspasar |
| 15 | | MiembroOrigen | String(4) | Miembro Origen |
| 16 | | RefGiveUp | String(18) | Referencia de Give-Up |
| 17 | | HoraRegistro | Time | Hora en que el Give-Up pasa a este estado |
| 18 | | FechaLiq | Date | Fecha de liquidación. Sólo debe ser tenido en cuenta cuando el Give-Up se haya aceptado |
| 19 | | EfectivoOpe | Amt | Nominal / Efectivo de la transacción |

A.2.7 Posición Abierta

Saldo de posición abierta por cuenta de posición

| | COPENPOSITION.DB |
|-----------------|--|
| Grupo | Posición abierta |
| Descripción | Información de la posición abierta por cuenta de posición y contrato (sólo aquellas que tienen posición) |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|---|---|----------------|------------|---|
| 1 | ↔ | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | ↔ | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | ↔ | Miembro | String(4) | Miembro al que pertenece la cuenta de posición |
| 4 | ↔ | CuentaPosicion | String(5) | Cuenta de posición |
| 5 | ↔ | Contrato | String(22) | Código de contrato |
| 6 | | LongPosition | Integer | Posición compradora para la combinación de cuenta y contrato del registro |
| 7 | | ShortPosition | Integer | Posición vendedora para la combinación de cuenta y contrato del registro |
| 8 | | Compensador | String(4) | Miembro compensador |

Saldo de posición abierta por cuenta de garantías

| | CMARGINOPENPOSITION.DB |
|-----------------|---|
| Grupo | Posición abierta |
| Descripción | Información de la posición abierta por cuenta de garantías y contrato (sólo aquellas que tienen posición) |
| Grupo de tablas | Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|---|---|------------------|------------|--|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | MiembroGarantias | String(4) | Miembro de la cuenta de garantías |
| 4 | → | CuentaGarantias | String(12) | Cuenta de garantías |
| 5 | → | Contrato | String(22) | Código de contrato |
| 6 | | LongPosition | Integer | Posición compradora para la combinación de cuenta de garantías y contrato del registro |
| 7 | | ShortPosition | Integer | Posición vendedora para la combinación de cuenta de garantías y contrato del registro |
| 8 | | Compensador | String(4) | Miembro compensador |

Saldo de posición abierta por Miembro Compensador

| | COPENPOSITIONCLM.DB |
|-----------------|---|
| Grupo | Posición abierta |
| Descripción | Información de la posición abierta por Miembro Compensador y contrato (sólo aquellas que tienen posición) |
| Grupo de tablas | Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|---|---|-------------|------------|--|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | Compensador | String(4) | Miembro Compensador |
| 6 | → | Contrato | String(22) | Código de contrato |
| 7 | | Position | Integer | Posición neta (con signo positivo para compras y negativo para ventas) |
| 8 | | UTI | String(52) | Identificador de la posición para la notificación |

Ajustes de posición

| | CPOSADJUST.DB |
|-----------------|--|
| Grupo | Posición abierta |
| Descripción | Ajustes de posición realizados durante la sesión |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|----------------|------------|---|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | NumOperacion | Integer | Número de registro de cámara |
| 4 | | Miembro | String(4) | Miembro al que pertenece la cuenta de posición |
| 5 | | CuentaPosicion | String(5) | Cuenta de posición |
| 6 | | Contrato | String(22) | Código de contrato |
| 7 | | Operador | String(3) | Código de operador |
| 8 | | Volumen | Integer | Número de contratos en que se ajusta la posición |
| 9 | | Signo | Char | Indica si se realiza una reducción o incremento de posición. "1"=Reducción "2"=Incremento |
| 10 | | HoraRegistro | Time | Hora del ajuste de posición |
| 11 | | Compensador | String(4) | Miembro compensador |

A.2.8 Ejercicio – Vencimiento - Entrega

Títulos entregables

| | CDELIVERABLES.DB |
|-----------------|--|
| Grupo | Ejercicio – Vencimiento - Entrega |
| Descripción | Información acerca los posibles títulos entregables asociados a un contrato de derivados |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|----------------|------------|---|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | Contrato | String(22) | Código de contrato de derivados que genera la obligación de entrega |
| 4 | → | CodigoCSD | Char | Código del Depositario Central de Valores en el que está constituida la garantía Ver tabla 9 en documento "Tablas de Codificación" |
| 5 | → | Entregable | String(16) | Código de título entregable empleado por la cámara |
| 6 | | NumOrden | Integer | Número de orden de emisión del entregable |
| 7 | | ISINEntregable | String(12) | Código ISIN del título entregable |
| 8 | | FechaVto | Date | Fecha de vencimiento y de entrega |
| 9 | | Factor | Float | Factor de conversión. Aplica a la entrega de bonos |
| 10 | | Cupon | Float | Cupón corrido. Aplica a la entrega de bonos |
| 11 | | Field1 | String(20) | BME CLEARING: Este campo no aplica. CRCC: * Si el activo está depositado en DECEVAL: este campo corresponde al Código ISIN ANNA. String(12) * Si el activo está depositado en DCV: este campo corresponde al Código título que identifica al activo en DCV. String(3) |
| 12 | | Field2 | String(20) | BME CLEARING: Este campo no aplica. CRCC: * Si el activo está depositado en DECEVAL: este campo corresponde al Código Depósito donde se encuentra el ISIN.String(10) * Si el activo está depositado en DCV: este campo corresponde al Número de emisión que identifica al activo en DCV. String(7) |
| 13 | | NemotecnicoBVC | String(35) | Nemotécnico del título en la BVC |
| 14 | | CFICode | String(6) | Código CFI |

Peticiones de Ejercicio

| | CEXERCISERQT.DB |
|-----------------|---|
| Grupo | Ejercicio – Vencimiento - Entrega |
| Descripción | Información de las peticiones de ejercicio vigentes |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|---|---|----------------|------------|--|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | Miembro | String(4) | Miembro al que pertenece la cuenta de posición |
| 4 | → | CuentaPosicion | String(5) | Cuenta de posición |
| 5 | → | Contrato | String(22) | Código de contrato |
| 6 | | Operador | String(3) | Código de operador |
| 7 | | Volumen | Integer | Número de contratos a ejercer. Este valor no debe ser tenido en cuenta cuando se trata de una petición de no ejercer |
| 8 | | Ejercitar | Char | Indica si el registro se refiere a una petición expresa de ejercer o de no ejercer, o si se desea el ejercicio automático por el sistema. "S"=Ejercer "N"=No Ejercer "A"=Automático |

Operaciones de contado del Miembro

| | CSPOTTRADES.DB |
|-----------------|--|
| Grupo | Ejercicio – Vencimiento - Entrega |
| Descripción | Información acerca de las operaciones de entregas a realizar fuera de BME CLEARING: - Vencimiento del Bono. |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|---------------------------|------------|--|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | Miembro | String(4) | Miembro |
| 4 | → | Contrato | String(22) | Código de título entregable |
| 5 | → | IndEjerc | Char | Indica si la entrega proviene de ejercicio anticipado o al vencimiento "A"=Anticipado / "V"=Vencimiento |
| 6 | → | Contraparte | String(4) | Miembro Contrapartida |
| 7 | → | Signo | Char | Signo de la operación de contado. "1"=Compra / "2"=Venta |
| 8 | → | Precio | Float | Precio de referencia |
| 9 | → | Compensador | String(4) | Miembro Compensador |
| 10 | → | IndicadorCapacidad | Char | Indicador de capacidad |
| 11 | → | IndicadorCapacidadContrap | Char | Indicador de capacidad |
| 12 | → | NumOperacion | Integer | Referencia de case de las operaciones de entrega para la entrega del Bono. En el resto de casos vale cero. |
| 13 | | Volumen | Integer | |
| 14 | | SibeMiembro | String(4) | Código del Miembro en el mercado en el que se realiza la entrega |
| 15 | | SibeContraparte | String(4) | Código del Miembro contrapartida en el mercado en el que se realiza la entrega |
| 16 | | FechaContado | Date | Fecha de registro de la operación |
| 17 | | ImporteEfectivo | Amt | En entrega de valores de renta variable, corresponde al importe efectivo de la operación. En entrega de valores de renta fija es el importe efectivo de la entrega = nº contratos * (precio de liquidación en tanto por 1 * nominal de un contrato * factor de conversión + cupón corrido). |
| 18 | | Divisa | String(3) | Divisa en la que se expresan los importes del registro |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|---------|-------|---|
| 19 | | Nominal | Float | Sólo informado para productos de renta fija: valor nominal. |

Operaciones de contado desglosadas por cuenta de garantías

| | CSPOTTRADESBRKD.DB |
|-----------------|--|
| Grupo | Ejercicio – Vencimiento - Entrega |
| Descripción | Detalle a nivel cuenta garantías de las operaciones a realizar fuera de BME CLEARING: - Vencimiento del Bono. |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|------------------|------------|--|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | MiembroGarantias | String(4) | Miembro al que pertenece la cuenta de garantías |
| 4 | → | CuentaGarantias | String(12) | Cuenta de garantías |
| 5 | → | Contrato | String(22) | Código de título entregable |
| 6 | → | IndEjerc | Char | Indica si la entrega proviene de ejercicio anticipado o al vencimiento "A"=Anticipado / "V"=Vencimiento |
| 7 | → | Precio | Float | Precio de referencia |
| 8 | → | Signo | Char | Signo de la operación de contado. "1"=Compra / "2"=Venta |
| 9 | → | NumOperacion | Integer | Número de operación de entrega. En BME CLEARING siempre cero. |
| 10 | → | MiembroEntrega | String(4) | Miembro que actúa como Titular de Cuenta en el Depositario Central de Valores en el que se realiza la entrega. |
| 11 | | Volumen | Integer | |
| 12 | | FechaContado | Date | Fecha de registro de la operación |
| 13 | | Compensador | String(4) | |
| 14 | | CodCSD | Char | Código del Depositario Central de Valores en el que está constituida la garantía Ver tabla 9 en documento "Tablas de Codificación" |
| 15 | | ImporteEfectivo | Float | En entrega de valores de renta variable, corresponde al importe efectivo de la operación. En entrega de valores de renta fija es el importe efectivo de la entrega = nº contratos * (precio de liquidación en tanto por 1 * nominal de un contrato * factor de conversión + cupón corrido). |
| 16 | | Divisa | String(3) | Divisa en la que se expresan los importes del registro |
| 17 | | Nominal | Float | Sólo informado para productos de renta fija: valor nominal. |

Operaciones de contado desglosadas por cuenta de posición

| | CSPOTTRADESBRKDDDET.DB |
|-----------------|--|
| Grupo | Ejercicio – Vencimiento - Entrega |
| Descripción | Detalle a nivel de cuenta de posición de las operaciones a realizar fuera de BME CLEARING: <ul style="list-style-type: none">- Sobre acciones, como consecuencia de las deltas, vencimiento de futuros y ejercicio de opciones realizado en la sesión. |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|-------------------|------------|---|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | Miembro | String(4) | Miembro al que pertenece la cuenta de posición |
| 4 | → | CuentaPosicion | String(5) | Cuenta de posición |
| 5 | → | Contrato | String(22) | Código de contrato |
| 6 | → | IndEjerc | Char | Indica si la entrega proviene de ejercicio anticipado o al vencimiento "A"=Anticipado "V"=Vencimiento (opciones) "F"=Vencimiento (futuros) |
| 7 | → | Precio | Float | Precio de referencia |
| 8 | → | Signo | Char | Signo de la operación de contado. "1"=Compra "2"=Venta |
| 9 | → | NumOperacion | Integer | BME Clearing: Número de registro para clave única (acciones) Número de operación de entrega. |
| 10 | | Volumen | Integer | Número de acciones |
| 11 | | FechaContado | Date | Fecha de registro de la operación de contado |
| 12 | | Compensador | String(4) | |
| 13 | | CodCSD | Char | Código del Depositario Central de Valores en el que está constituida la garantía Ver tabla 9 en documento "Tablas de Codificación" |
| 14 | | ImporteEfectivo | Float | Importe efectivo de la operación. |
| 15 | | Divisa | String(3) | Divisa en la que se expresan los importes del registro |
| 16 | | IndCapacidad | String(1) | |
| 17 | | CodSibeMiembro | String(4) | |
| 18 | | CtaCompensacion | String(3) | |
| 19 | | CodCliente | String(16) | |
| 20 | | MiembroECCDestino | String(4) | |
| 21 | | RefAsignacion | String(18) | |
| 22 | | Mnemotecnico | String(10) | |
| 23 | | CodSibeContrap | String(4) | |

Detalle de entrega física de gas

| | CPHYSEDET.DB |
|-----------------|---|
| Grupo | Ejercicio – Vencimiento - Entrega |
| Descripción | Detalle de obligaciones de entrega física |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|-------------------|------------|--|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | Miembro | String(4) | Miembro cuenta posición |
| 4 | → | CuentaPosicion | String(5) | Cuenta de posición |
| 5 | → | Infraestructura | String(10) | "PVB"=Punto Virtual de Balance Español |
| 6 | → | Contrato | String(22) | Código de contrato de derivados que genera la obligación de entrega |
| 7 | → | FechaEntrega | Date | Fecha de entrega |
| 8 | → | PrecioLiquidacion | Float | Precio de liquidación |
| 9 | | EICCode | String(16) | |
| 10 | | Compensador | String(4) | Miembro compensador |
| 11 | | Signo | Char | Signo "1"=Compra "2"=Venta |
| 12 | | Quantity | Integer | Número de contratos a entregar |
| 13 | | QuantityToDeliver | Float | Cantidad a entregar |
| 14 | | UnitOfMeasure | Char(20) | Unidad de medida de la cantidad a entregar |
| 15 | | DeliveryAmt | float | Importe efectivo antes de impuestos |
| 16 | | Divisa | String(3) | Divisa Ver tabla 1 en el documento "Tablas de Codificación" |
| 17 | | TaxRate | Float | % Impuesto |
| 18 | | TaxAmount | float | Importe impuesto |
| 19 | | GrossDeliveryAmt | float | Importe Efectivo con impuestos incluidos |
| 20 | | NominationStatus | Char | Estado de la nominación "P"=Previsión "N"=Notificación "A"=Aceptada "I"=Cartera inhabilitada |

Nominaciones para entrega física de gas a nivel de EIC

| | CPHYSDEL.DB |
|-----------------|---|
| Grupo | Ejercicio – Vencimiento - Entrega |
| Descripción | Nominaciones de entrega física a nivel de EIC |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|-------------------|------------|--|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | Compensador | String(4) | Miembro compensador |
| 4 | → | Miembro | String(4) | Miembro cuenta posición |
| 5 | → | Infraestructura | String(10) | "PVB"=Punto Virtual de Balance Español |
| 6 | → | EICCode | String(16) | |
| 7 | → | FechaEntrega | Date | Fecha de entrega |
| 8 | → | ContractType | Char | "N"=No intradía |
| 9 | | Signo | Char | Signo "1"=Compra "2"=Venta |
| 10 | | QuantityToDeliver | float | Cantidad a entregar |
| 11 | | UnitOfMeasure | Char(20) | Unidad de medida de la cantidad a entregar |
| 12 | | NominationStatus | char | Estado de la nominación "P"=Previsión "N"=Notificación "A"=Aceptada |

A.2.9 Comisiones

Detalle de Comisiones

| | CFEESBRKD.DB |
|-----------------|---------------------------------------|
| Grupo | Comisiones |
| Descripción | Detalle de comisiones por operaciones |
| Grupo de tablas | Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|--------------------|-----------|---|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | NumOperacion | Integer | Número de registro de cámara de la operación |
| 4 | → | Signo | Char | Signo "1"=Compra "2"=Venta |
| 5 | → | FechaUltimoCalculo | Date | En caso de cargo de comisiones, esta fecha copresponde a la fecha de la sesión actual. En caso de devolución, este campo indica la última fecha en la que se calcularon comisiones para esta operación |
| 6 | → | GrupoComision | String(2) | Grupo de comisión asociado al subyacente, instrumento y tipo de cuenta Ver tabla 15 en documento "Tablas de Codificación" |
| 7 | | TipoComision | String(2) | Tipo de comisión Ver tabla 16 en documento "Tablas de Codificación" |
| 8 | | ConceptoComision | char | Concepto de comisión 1=Por contrato 2=CAP 3=FLOOR 4=POR MWh 5=Por efectivo 6=Efectivo/plazo |
| 9 | | Divisa | String(3) | Divisa en la que se expresan los importes del registro |
| 10 | | FechaRegistro | Date | Fecha de registro en la cámara |
| 11 | | FechaOpProcedencia | Date | Fecha de la operación de procedencia. Este campo facilita el seguimiento de comisi0ones en caso de give-outs o traspasos que cierran |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|---------------------|------------|--|
| 12 | | Compensador | String(4) | Miembro Compensador |
| 13 | | Miembro | String(4) | Miembro |
| 14 | | CuentaPosicion | String(5) | Cuenta de posición |
| 15 | | Contrato | String(22) | Código de contrato |
| 16 | | Precio | Float | Precio de la operación |
| 17 | | NumeroOrdenSistema | String(12) | Numero de orden sistema. Informado en caso de que la operación inicial provenga de una orden o un quote |
| 18 | | Volumen | Integer | Volumen |
| 19 | | VolumenVivo | Integer | Volumen vivo de la operación |
| 20 | | AbreCierra | Char | Información relevante sólo para cuentas de posición que anoten posición en bruto: indica si la operación abre o cierra posición abierta "O"=Abre "C"=Cierra |
| 21 | | ComisionPorConcepto | Float | Comisión a aplicar para este concepto |
| 22 | | TotalComision | Float | Total de comisión. Puede ser cero En caso de aplicar los conceptos de CAP o FLOOR para una transacción formada por varias operaciones, el total de comisión estará informado en una de las operaciones. |
| 23 | | TipoOperacion | Char | Tipo de operación Ver Tabla 12 en documento "Tablas de Codificación" |
| 24 | | Referencia | String(18) | Referencia Si es una operación procedente de una orden, es la referencia de la orden Si es una aplicación, es la referencia introducida por el miembro intermediario Si es una asignación de cuenta diaria o un traspaso, es la referencia informada en la operación de procedencia |
| 25 | | NumOpProcedencia | Integer | Número de registro de cámara de la operación de procedencia. Si se trata de la operación inicial es su propio número de registro de cámara |
| 26 | | CantidadPorConcepto | Integer | Cantidad sobre la que hay que aplicar la tarifa |
| 27 | | NumeroDias | Integer | Número de días entre la fecha valor de la ida y la vuelta de la simultánea |
| 28 | | ImporteEfectivo | Float | Importe efectivo de la operación |
| 29 | | ImporteFijo | Float | |
| 30 | | ComiNeg | Float | Importe de la comisión por negociación |
| 31 | | ComiLiq | Float | Importe de la comisión por liquidación |

Comisiones

| | CFEES.DB |
|-----------------|-----------------------------------|
| Grupo | Comisiones |
| Descripción | Comisiones por Miembro Negociador |
| Grupo de tablas | Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|-----------------------|-----------|---|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | FechaRegistro | Date | Fecha de registro en la cámara |
| 4 | → | FechaUltimoCalculo | Date | En caso de cargo de comisiones, esta fecha copresponde a la fecha de la sesión actual. En caso de devolución, este campo indica la última fecha en la que se calcularon comisiones para esta operación |
| 5 | → | GrupoComision | String(2) | Grupo de comisión asociado al subyacente, instrumento y tipo de cuenta Ver tabla 15 en documento "Tablas de Codificación" |
| 6 | → | TipoComision | String(2) | Tipo de comisión Ver tabla 16 en documento "Tablas de Codificación" |
| 7 | → | ConceptoComision | char | Concepto de comisión 1=Por contrato 2=CAP 3=FLOOR 4=POR MWh 5=Por efectivo 6=Efectivo/plazo |
| 8 | → | Compensador | String(4) | Miembro Compensador |
| 9 | → | Miembro | String(4) | Miembro |
| 10 | → | Divisa | String(3) | Divisa en la que se expresan los importes del registro |
| 11 | | TotalVolumenVivo | Integer | Total volumen vivo de las operaciones agregadas. Puede ser cero |
| 12 | | TotalNumTransacciones | Integer | Total número de transacciones. Puede ser cero |
| 13 | | TotalNumLineas | Integer | Total número de registros en CFEESBRKD que componen este registro agregado. Puede ser cero |
| 14 | | CantidadPorConcepto | Integer | Cantidad a la que se aplica este concepto |
| 15 | | ComisionPorConcepto | Float | Comisión que se aplica para este concepto |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|---------------|------------|--|
| 16 | | TotalComision | Float | Total de comisión. Puede ser cero |
| 17 | | Texto | String(30) | Texto informativo |
| 18 | | ImporteFijo | Float | |
| 19 | | ComiNeg | Float | Importe de la comisión por negociación |
| 20 | | ComiLiq | Float | Importe de la comisión por liquidación |

A.2.10 Resultados a nivel de Cuenta de Posición

Primas de opciones

| | CPREMIUMS.DB |
|-----------------|--|
| Grupo | Resultados a nivel de Cuenta de Posición |
| Descripción | Prima asociada a una operación de opciones |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|----------------|------------|--|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | NumOperacion | Integer | Número de registro de cámara de la operación |
| 4 | → | Signo | Char | Signo de la operación "1"=Compra "2"=Venta |
| 5 | | Miembro | String(4) | Miembro al que pertenece la cuenta de posición |
| 6 | | CuentaPosicion | String(5) | Cuenta de posición |
| 7 | | Contrato | String(22) | Código de contrato |
| 8 | | Prima | Float | Prima resultante de la opción |
| 9 | | Divisa | String(3) | Divisa en la que está expresada la prima |
| 10 | | Compensador | String(4) | Miembro compensador |

Variation Margin

| | CVARMARGIN.DB |
|-----------------|--|
| Grupo | Resultados a nivel de Cuenta de Posición |
| Descripción | Detalle de la liquidación diaria de pérdidas y ganancias, formada por la valoración de posición a principio de día y de las operaciones del día a precio de valoración final |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|-------------------|------------|---|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | Miembro | String(4) | Miembro al que pertenece la cuenta de posición |
| 4 | → | CuentaPosicion | String(5) | Cuenta de posición |
| 5 | → | Contrato | String(22) | Código de contrato |
| 6 | → | TradelInd | Char | Indica si se está valorando una operación, la posición abierta al inicio de la sesión o una operación de diferimiento "1"=Posición abierta al inicio de la sesión "2"=Operación liquidada en la sesión en curso "4"=Operación para Rollover Mark-to-Market |
| 7 | → | NumOperacion | Integer | Si TradelInd = 2 o 4, es el número de registro de cámara de la operación |
| 8 | → | Signo | Char | Signo "1"=Compra "2"=Venta |
| 9 | | Volumen | Integer | Volumen |
| 10 | | Precio | Float | Precio de valoración inicial. Si TradelInd=1 es el precio de cierre de la sesión anterior. Si TradelInd=2 o 4 es el precio de la operación CRCC: Para los productos con cotización por rentabilidad este precio es la rentabilidad |
| 11 | | InitialValue | Float | Valoración inicial de la posición / operación referida en el registro. Es el resultado de multiplicar el precio de valoración inicial por el volumen y el multiplicador del contrato. |
| 12 | | PrecioLiquidacion | Float | Precio de valoración final. Si la sesión no ha finalizado es el precio de la última operación del contrato. Si la sesión ha finalizado es el precio de liquidación del contrato. CRCC: Para los productos con cotización por rentabilidad este precio es la rentabilidad |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|-------------------|-----------|---|
| 13 | | Valor | Float | Valoración final de la posición / operación referida en el registro. Es el resultado de multiplicar el precio de valoración final por el volumen y el multiplicador del contrato. Tiene signo positivo para las compras y negativo para las ventas. |
| 14 | | VariationMargin | Float | Pérdidas y ganancias generadas por la posición / operación referida en el registro. Es la diferencia entre la valoración final y la valoración inicial. |
| 15 | | Divisa | String(3) | Divisa en la que se expresan los importes del registro |
| 16 | | FechaInitialValue | Date | Fecha de cálculo del campo InitialValue |
| 17 | | Compensador | String(4) | Miembro compensador |

Variation Margin Pendiente

| | CVARMARGINPEND.DB |
|-----------------|--|
| Grupo | Resultados a nivel de Cuenta de Posición |
| Descripción | <p>Para forwards y swaps (liquidación por diferencias a vencimiento) es el detalle de la diferencia de valoración de las operaciones entre precio de operación y precio de valoración actual-</p> <p>Esta tabla contiene los mismos campos y en el mismo orden que la tabla CVARMARGIN</p> |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|-------------------|------------|--|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | Miembro | String(4) | Miembro al que pertenece la cuenta de posición |
| 4 | → | CuentaPosicion | String(5) | Cuenta de posición |
| 5 | → | Contrato | String(22) | Código de contrato |
| 6 | → | TradelInd | Char | "3"=Operación para valoración |
| 7 | → | NumOperacion | Integer | Número de registro de cámara de la operación |
| 8 | → | Signo | Char | <p>Signo</p> <p>"1"=Compra</p> <p>"2"=Venta</p> |
| 9 | | Volumen | Integer | Volumen |
| 10 | | Precio | Float | <p>Precio de valoración inicial. Si TradelInd=3 es el precio de la operación</p> <p>CRCC: Para los productos con cotización por rentabilidad este precio es la rentabilidad</p> |
| 11 | | InitialValue | Float | <p>Valoración inicial de la posición / operación referida en el registro.</p> <p>En operaciones (simples y repos) de deuda se actualiza, además, este valor efectivo según el tipo de interés.</p> <p>Es el resultado de multiplicar el precio de valoración inicial por el volumen y el multiplicador del contrato.</p> <p>Tiene signo positivo para las compras y negativo para las ventas</p> |
| 12 | | PrecioLiquidacion | Float | <p>Precio de valoración final. Si la sesión no ha finalizado es el precio de la última operación del contrato. Si la sesión ha finalizado es el precio de liquidación del contrato.</p> <p>CRCC: Para los productos con cotización por rentabilidad este precio es la rentabilidad</p> |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|--------------------|-----------|---|
| 13 | | Valor | Float | Valoración final de la posición / operación referida en el registro. Es el resultado de multiplicar el precio de valoración final por el volumen y el multiplicador del contrato. Tiene signo positivo para las compras y negativo para las ventas. |
| 14 | | Diferencia | Float | Pérdidas y ganancias generadas por la posición / operación referida en el registro. Es la diferencia entre la valoración final y la valoración inicial. |
| 15 | | Divisa | String(3) | Divisa en la que se expresan los importes del registro |
| 16 | | FechalInitialValue | Date | Fecha de cálculo del campo InitialValue |
| 17 | | Compensador | String(4) | Miembro compensador |

Valoración para productos sin liquidación diaria de variation margin

| | CVALUATIONOTH.DB |
|-----------------|---|
| Grupo | Resultados a nivel de Cuenta de Posición |
| Descripción | Detalle de la valoración de las operaciones o posiciones para aquellos productos que no tienen liquidación diaria de pérdidas y ganancias |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|-------------------|------------|---|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | Miembro | String(4) | Miembro al que pertenece la cuenta de posición |
| 4 | → | CuentaPosicion | String(5) | Cuenta de posición |
| 5 | → | Contrato | String(22) | Código de contrato |
| 6 | → | TradelInd | Char | Indica si se está valorando una operación o la posición abierta al inicio de la sesión "1"=Posición abierta al inicio de la sesión "2"=Operación liquidada en la sesión en curso |
| 7 | → | NumOperacion | Integer | Si TradelInd = 2, es el número de registro de cámara de la operación |
| 8 | → | Signo | Char | Signo "1"=Compra "2"=Venta |
| 9 | | Volumen | Integer | Volumen |
| 10 | | Precio | Float | Precio de valoración inicial. Si TradelInd=1 es el precio de cierre de la sesión anterior,. Si TradelInd=2 es el precio de la operación CRCC: Para los productos con cotización por rentabilidad este precio es la rentabilidad |
| 11 | | InitialValue | Float | Valoración inicial de la posición / operación referida en el registro. Es el resultado de multiplicar el precio de valoración inicial por el volumen y el multiplicador del contrato. |
| 12 | | PrecioLiquidacion | Float | Precio de valoración final. Si la sesión no ha finalizado es el precio de la última operación del contrato. Si la sesión ha finalizado es el precio de liquidación del contrato. CRCC: Para los productos con cotización por rentabilidad este precio es la rentabilidad |
| 13 | | Valor | Float | Valoración final de la posición / operación referida en el registro. Es el resultado de multiplicar el precio de valoración final por el volumen y el multiplicador del contrato. Tiene signo positivo para las compras y negativo para las ventas. |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|-------------------|-----------|---|
| 14 | | VariationMargin | Float | Pérdidas y ganancias generadas por la posición / operación referida en el registro. Es la diferencia entre la valoración final y la valoración inicial. |
| 15 | | Divisa | String(3) | Divisa en la que se expresan los importes del registro |
| 16 | | FechaInitialValue | Date | Fecha de cálculo del campo InitialValue |
| 17 | | Compensador | String(4) | Miembro compensador |

A.2.11 Resultados a nivel de Cuenta de Garantías

Detalle del cálculo de garantía diaria

| | CINIMARGINCALC.DB |
|-----------------|---|
| Grupo | Resultados a nivel de Cuenta de Garantías |
| Descripción | Información detallada del cálculo de la garantía diaria de cada titular |
| Grupo de tablas | Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|--------------------|------------|---|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | MiembroGarantias | String(4) | Miembro al que pertenece la cuenta de garantías |
| 4 | → | CuentaGarantias | String(12) | Cuenta de garantías |
| 5 | → | Matriz | String(3) | Código de matriz de garantías |
| 6 | | GarantiaPosNeta | Float | Garantía posición neta |
| 7 | | GarantiaTimeSpread | Float | Garantía time-spread |
| 8 | | Escenario | Integer | Escenario |
| 9 | | DeltaPosCompra | Float | Delta posición abierta compradora |
| 10 | | DeltaPosVenta | Float | Delta posición abierta vendedora |
| 11 | | DeltaNeta | Float | Delta neta |
| 12 | | DeltaGrupo | Float | Delta a aplicar en cada grupo de compensación |
| 13 | | DtoSpread | Float | Descuento por spreads obtenido en las compensaciones |
| 14 | | DeltaFinal | Float | Delta final |
| 15 | | GarantiaGrupo | Float | Grantía Grupo (previa a la compensación de subyacentes) |
| 16 | | GarantiaFinal | Float | Garantía final |
| 17 | | Divisa | String(3) | Divisa en la que están expresados los importes de este registro |
| 18 | | GarantiaGrupoNeta | Float | Garantía grupo tras la compensación de subyacentes |
| 19 | | VarMarginPendiente | Float | Ajuste de garantía por VariationMargin no liquidado |
| 20 | | EscenarioIni | Integer | Escenario más desfavorable sin tener en cuenta escenarios de grandes posiciones |
| 21 | | DeltaNetaIni | Float | Delta neta sin tener en cuenta escenarios de grandes posiciones |
| 22 | | Compensador | String(4) | Miembro compensador |
| 23 | | PrimaGarantia | Float | |

Liquidaciones y garantías por cuenta de garantías y divisa liquidable

| | CACCOUNTSETTL.DB |
|-----------------|---|
| Grupo | Resultados a nivel de Cuenta de garantías |
| Descripción | Importes por titular de las liquidaciones y garantías diarias |
| Grupo de tablas | Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|----------------------|------------|---|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | MiembroGarantias | String(4) | Miembro al que pertenece la cuenta de garantías |
| 4 | → | CuentaGarantias | String(12) | Cuenta de garantías |
| 5 | → | Divisa | String(3) | Divisa en la que se expresan los importes del registro |
| 6 | | InitialMargin | Float | Garantías diarias a constituir el día hábil siguiente a SessionDate Ver nota (1) |
| 7 | | InitialMarginPledged | Float | Valoración del colateral depositado por el titular |
| 8 | | InitialMarginDif | Float | Diferencia entre las garantías diarias exigidas y el colateral depositado |
| 9 | | VariationMargin | Float | Pérdidas y ganancias generadas |
| 10 | | ComiNeg | Float | Comisiones de negociación Ver nota(2) |
| 11 | | ComiLiq | Float | Comisiones de liquidación Ver nota (2) |
| 12 | | Primas | Float | Primas de opciones |
| 13 | | Compensador | String(4) | Miembro Compensador |
| 15 | | GrossDeliveryAmt | Float | Importe a liquidar por entrega física de gas |
| 16 | | DeferralFee | Float | Comisión de diferimiento |

(1) Con la entrada en vigor de las Condiciones Generales de Opciones sobre acciones (ver Comunicados 17/06 y 26/06), este campo ya no incluye el riesgo post-ejercicio

(2) Con la entrada en vigor de las comisiones mínimas por transacción, los campos de comisión de negociación y liquidación ya no estarán informados a nivel de operación.

Información de las Pruebas Retrospectivas

| | CBACKTESTING.DB |
|-----------------|--|
| Grupo | Resultados a nivel de Cuenta de garantías |
| Descripción | Importes por titular de los resultados de pruebas retrospectivas |
| Grupo de tablas | Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|------------------|------------|---|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | Compensador | String(4) | Miembro Compensador |
| 4 | → | MiembroGarantias | String(4) | Miembro al que pertenece la cuenta de garantías |
| 5 | → | CuentaGarantias | String(12) | Cuenta de garantías |
| 6 | → | Divisa | String(3) | Divisa en la que se expresan los importes del registro |
| 7 | | CurrentPosValue | Float | Valor de la posición que se está analizando al cierre de la sesión más antigua analizada. |
| 8 | | InitialMargin | Float | Initial Margin de la sesión más antigua analizada. |
| 9 | | MaximumRisk | Float | Máxima Pérdida |
| 10 | | UncoveredRisk | Float | Pérdida no cubierta por el Initial Margin |
| 11 | | 1DayRisk | Float | Pérdida a 1 día |
| 12 | | 2DayRisk | Float | Pérdida a 2 días |
| 13 | | 3DayRisk | Float | Pérdida a 3 días |
| 14 | | 4DayRisk | Float | Pérdida a 4 días |
| 15 | | 5DayRisk | Float | Pérdida a 5 días |

Información de las Pruebas de Resistencia

| | CSTRESSTESTING.DB |
|-----------------|--|
| Grupo | Resultados a nivel de Cuenta de garantías |
| Descripción | Importes por titular de los resultados de pruebas de resistencia |
| Grupo de tablas | Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|---------------------|------------|--|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | Compensador | String(4) | Miembro Compensador |
| 4 | → | MiembroGarantias | String(4) | Miembro al que pertenece la cuenta de garantías |
| 5 | → | CuentaGarantias | String(12) | Cuenta de garantías |
| 6 | → | Divisa | String(3) | Divisa en la que se expresan los importes del registro |
| 7 | | WorstScenario | int | Peor escenario del Miembro Compensador |
| 8 | | WorstScenarioMargin | Float | Garantía exigida con parámetros peor escenario |
| 9 | | InitialMargin | Float | Garantía por posición (sin tener en cuenta Variation Margin ni Garantías por Grandes Posiciones) |
| 10 | | StressTestRisk | Float | Riesgo en situación de Stress Test |

Liquidación de entregas de gas por cuenta de garantías

| | CDELIVSETTL.DB |
|-----------------|--|
| Grupo | Resultados a nivel de Cuenta de garantías |
| Descripción | Liquidaciones debidas a entrega de gas, a nivel de cuenta de garantías |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|-------------------|------------|--|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | MiembroGarantias | String(4) | Miembro al que pertenece la cuenta de garantías |
| 4 | → | CuentaGarantias | String(12) | Cuenta de garantías |
| 5 | → | Divisa | String(3) | Divisa en la que se expresan los importes del registro |
| 6 | → | Infraestructura | String(10) | "PVB"=Punto Virtual de Balance Español |
| 7 | → | FechaEntrega | Date | Fecha de entrega |
| 8 | | Signo | Char | Signo "1"=Compra "2"=Venta |
| 9 | | QuantityToDeliver | float | Cantidad a entregar |
| 10 | | UnitOfMeasure | Char(20) | Unidad de medida de la cantidad a entregar |
| 11 | | DeliveryAmt | float | Importe efectivo antes de impuestos |
| 12 | | TaxRate | | % Impuesto |
| 13 | | TaxAmount | float | Importe impuesto |
| 14 | | GrossDeliveryAmt | float | Importe Efectivo incluidos impuestos |
| 15 | | Compensador | String(4) | Miembro compensador |

A.2.12 Resultados por cuenta de colateral a nivel ECC

Liquidaciones y garantías por cuenta de colateral a nivel de Contrapartida Central

| | CCPACCOUNTSETTL.DB |
|-----------------|---|
| Grupo | Resultados por cuenta de colateral a nivel de Contrapartida Central |
| Descripción | Importes por cuenta de colateral de las liquidaciones y garantías diarias |
| Grupo de tablas | Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|----------------------|------------|---|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | CCPCode | String(2) | Código de contrapartida central |
| 3 | → | Compensador | String(4) | Miembro Compensador |
| 4 | → | MiembroColateral | String(4) | Miembro al que pertenece la cuenta de colateral |
| 5 | → | CuentaColateral | String(12) | Cuenta de colateral |
| 6 | → | Divisa | String(3) | Divisa en la que se expresan los importes del registro |
| 7 | | InitialMargin | Float | Garantías diarias a constituir el día hábil siguiente a SessionDate |
| 8 | | InitialMarginPledged | Float | Valoración del colateral depositado por la cuenta de colateral |
| 9 | | InitialMarginDif | Float | Diferencia entre las garantías diarias exigidas y el colateral depositado |
| 10 | | VariationMargin | Float | Pérdidas y ganancias generadas |
| 11 | | Primas | Float | Primas de opciones |
| 12 | | GrossDeliveryAmt | Float | Importe a liquidar por entrega física de gas |
| 13 | | DeferralFee | Float | Comisión de diferimiento |

Detalle de las Garantías depositadas a nivel de Contrapartida Central

| | CCPPLEDGES.DB |
|-----------------|--|
| Grupo | Resultados por cuenta de colateral a nivel de Contrapartida Central |
| Descripción | Valoración de los activos depositados como garantías en la fecha de la sesión, detalladas por activo y destino |
| Grupo de tablas | RealTime - Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|-------------------|-------------|---|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | CCPCCode | String(2) | Código de contrapartida central |
| 3 | → | Compensador | String(4) | Miembro Compensador |
| 4 | → | MiembroColateral | String(4) | Miembro al que pertenece la cuenta de colateral (puede estar en blanco para garantías depositadas por el Compensador) |
| 5 | → | CuentaColateral | String(12) | Cuenta de colateral |
| 6 | → | CodigoActivo | String(12) | Código del activo entregado. En BME CLEARING este campo corresponde al código ISIN del activo. Nótese que el código ISIN para el Euro es "EU0009656420" |
| 7 | → | ModoMatGarant | Char | Modo de materialización de garantías Ver Tabla 6 en documento "Tablas de Codificación" |
| 8 | → | Divisa | String(3) | Divisa en la que se expresan los importes del registro |
| 9 | → | CodigoCSD | Char | Código del Depositario Central de Valores en el que está constituida la garantía Ver tabla 15 en documento "Tablas de Codificación" |
| 10 | | TipoActivo | String(3) | Tipo de activo entregado Ver Tabla 2 en documento "Tablas de Codificación" |
| 11 | | DescripActivo | String(40) | Descripción del activo entregado |
| 12 | | NombreDepositario | String(20) | Nombre del Depositario Central del activo Ver Tabla 9 en documento "Tablas de Codificación" |
| 13 | | Haircut | Float | Coefficiente que se aplica al precio en la valoración del activo. En tanto por ciento. |
| 14 | | PrecioActivo | Float | Precio del activo al cierre. Para los bonos y obligaciones incluye cupón corrido. |
| 15 | | Nominal | Float | Valor nominal del activo entregado. Si es un repo, es su nominal |
| 16 | | Importe | Float | Valor del activo: Nominal * Precio * Haircut. Si es un repo, es su nominal valorado a precio de mercado |
| 17 | | CFICode | String(6) | Codificación de instrumentos financieros según el estándar ISO 10962 |
| 18 | | Field1 | String (20) | BME CLEARING: Reservado para uso futuro CRCC: * Si el activo está depositado en DECEVAL, este campo corresponde al Código Isin unido. String(12) * Si el activo está depositado en DCV, este campo corresponde al Código título. String(3) |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|--------|------------|---|
| 19 | | Field2 | String(20) | BME CLEARING: Reservado para uso futuro CRCC: * Si el activo está depositado en DECEVAL, este campo corresponde al Código Fungible. String(10) * Si el activo está depositado en DCV, este campo corresponde al Número de Emisión. String(7) |
| 20 | | Field3 | String(20) | Reservado para uso futuro |
| 21 | | Field4 | String(20) | Reservado para uso futuro |

A.2.13 Registro de detalle. Resultados a nivel de cuenta de posición

Estas tablas sólo estarán cumplimentadas para los Miembros que hayan contratado el servicio de Registro de Detalle ofrecido por BME CLEARING.

Detalle del cálculo de garantía diaria por cuenta de posición

| | CINIMARGINCALCDET.DB |
|-----------------|--|
| Grupo | Registro de detalle. Resultados a nivel de cuenta de posición |
| Descripción | Información detallada del cálculo de la garantía diaria de cada cuenta de posición |
| Grupo de tablas | Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|--------------------|-----------|---|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | Miembro | String(4) | Miembro al que pertenece la cuenta de posición |
| 4 | → | CuentaPosicion | String(5) | Cuenta de posición |
| 5 | → | Matriz | String(3) | Código de matriz de garantías |
| 6 | | GarantiaPosNeta | Float | Garantía posición neta |
| 7 | | GarantiaTimeSpread | Float | Garantía time-spread |
| 8 | | Escenario | Integer | Escenario |
| 9 | | DeltaPosCompra | Float | Delta posición abierta compradora |
| 10 | | DeltaPosVenta | Float | Delta posición abierta vendedora |
| 11 | | DeltaNeta | Float | Delta neta |
| 12 | | DeltaGrupo | Float | Delta a aplicar en cada grupo de compensación |
| 13 | | DtoSpread | Float | Descuento por spreads obtenido en las compensaciones |
| 14 | | DeltaFinal | Float | Delta final |
| 15 | | GarantiaGrupo | Float | Garantía Grupo (previa a la compensación de subyacentes) |
| 16 | | GarantiaFinal | Float | Garantía final |
| 17 | | Divisa | String(3) | Divisa en la que están expresados los importes de este registro |
| 18 | | GarantiaGrupoNeta | Float | Garantía grupo tras la compensación de subyacentes |
| 19 | | VarMarginPendiente | Float | Ajuste de garantía por VariationMargin no liquidado |
| 20 | | EscenarioIni | Integer | Escenario más desfavorable sin tener en cuenta escenarios de grandes posiciones |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|---------------|-------|---|
| 21 | | DeltaNetaIni | Float | Delta neta sin tener en cuenta escenarios de grandes posiciones |
| 22 | | PrimaGarantia | Float | |

Liquidaciones y garantías por subcuenta

| | CACCOUNTSETTLDET.DB |
|-----------------|--|
| Grupo | Registro de detalle. Resultados a nivel de cuenta de posición |
| Descripción | Importes por cuenta de posición de las liquidaciones y garantías diarias |
| Grupo de tablas | Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|------------------|-----------|---|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | Camara | String(2) | Código de cámara |
| 3 | → | Miembro | String(4) | Miembro al que pertenece la cuenta de posición |
| 4 | → | CuentaPosicion | String(5) | Cuenta de posición |
| 5 | → | Divisa | String(3) | Divisa en la que se expresan los importes del registro |
| 6 | | InitialMargin | Float | Garantías diarias a constituir el día hábil siguiente a SessionDate |
| 7 | | VariationMargin | Float | Pérdidas y ganancias generadas |
| 8 | | Primas | Float | Primas de opciones |
| 9 | | GrossDeliveryAmt | Float | Importe a liquidar por entrega física de gas |
| 10 | | DeferralFee | Float | Comisión de diferimiento |

A.2.14 Resultados para Miembros Compensadores

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

| | CCPCASHMOVCLM.DB |
|-----------------|---|
| Grupo | Resultados para Miembros Compensadores |
| Descripción | Información del movimiento de efectivo a realizar en la liquidación multilateral por un Miembro Compensador desglosado por Miembro y concepto. Incluye conceptos diarios y mensuales. |
| Grupo de tablas | Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|--------------|------------|--|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | CCPCCode | String(2) | Código de contrapartida central |
| 3 | → | Camara | String(2) | Código de Cámara |
| 4 | → | Compensador | String(4) | Miembro Compensador |
| 5 | → | Negociador | String(4) | Miembro al que es atribuible el cargo o abono que se detalla en el registro (puede ir en blanco) |
| 6 | → | Concepto | String(2) | Concepto de movimiento de efectivo Ver Tabla 4 en documento "Tablas de Codificación" |
| 7 | → | Divisa | String(3) | Divisa en la que se expresan los importes del registro |
| 8 | → | MetodoPago | String(2) | Método de pago Ver Tabla 5 en documento "Tablas de Codificación" |
| 9 | → | CashMovGroup | String(8) | Grupo de movimientos de efectivo asociados al Agente de Pagos. |
| 10 | | DescConcepto | String(50) | Descripción del concepto (si el código de concepto es "99") |
| 11 | | Importe | Float | Importe del movimiento de efectivo resultante (cargo si es < 0, abono si es > 0) |
| 12 | | FechaValor | Date | Fecha valor del movimiento de efectivo |

A.2.15 Resultados para Agentes de Pago

Movimientos de efectivo para la Entidad Domiciliataria a nivel de Contrapartida Central

| | CCPCASHMOVTREAS.DB |
|-----------------|---|
| Grupo | Resultados para Agentes de Pago |
| Descripción | Movimientos de efectivo a realizar por el Agente de Pagos |
| Grupo de tablas | Histórico |

| # | * | Campo | Tipo | Descripción |
|----|---|-----------------|-----------|---|
| 1 | → | Fecha | Date | Fecha de sesión |
| 2 | → | CCPCCode | String(2) | Código de contrapartida central |
| 3 | → | AgentePagos | String(4) | Agente de Pagos |
| 4 | → | Compensador | String(4) | Miembro Compensador al que corresponde el movimiento de efectivo |
| 5 | → | Divisa | String(3) | Divisa en la que se expresan los importes del registro |
| 6 | → | MetodoPago | String(2) | Método de pago Ver Tabla 5 en documento "Tablas de Codificación" |
| 7 | → | TipoLiquidacion | char | BME CLEARING: Este campo no aplica. Valor siempre 1 CRCC: Indica si el importe corresponde a conceptos de liquidación que están exentos de impuestos (valor 1) o sujetos a impuestos (valor 2) |
| 8 | → | CashMovGroup | String(8) | Grupo de movimientos de efectivo asociados al Agente de Pagos. |
| 9 | | Importe | Float | Importe del movimiento de efectivo resultante (carga si es < 0, abono si es > 0) |
| 10 | | FechaValor | Date | Fecha valor del movimiento de efectivo |

Apéndice B Datos Suministrados

En este apéndice se ofrece una lista con los códigos de los datos ofrecidos por MEFFServer.

Los datos que proporciona MEFFServer están divididos en clases, de cara a facilitar su localización.

Cuando en los parámetros se incluye el código de contrato, se podrá usar indistintamente el código interno de 8 caracteres o el código de 22 caracteres.

Las clases existentes son:

- **Feed**

Mensajes de Feed a modo de Ticker, con información en un estado semi elaborado.

- **Información general**

Datos diversos relacionados con la sesión en curso y las características intrínsecas de los contratos.

B.1 Datos de Feed

Todos estos datos constan de varios campos. El carácter separador de los mismos es el ASCII 9 (tabulador).

| Dato | Descripción | Parámetros (negrita aceptan comodines "?") |
|-------------|---------------------------------------|---|
| FEEDOPEGEN | Operaciones Generales (6 campos) | Entorno+Contrato |
| FEEDOPPRO | Operaciones Propias (15 campos) | Cámara+Contrato +Miembro + CuentaPosicion |
| FEEDMS | Mensajes del Administrador (2 campos) | Entorno |

B.2 Datos de Información General

| Dato | Descripción | Parámetros (negrita aceptan comodines "?") |
|-------------|--|---|
| CIERRE | Precio de cierre de la sesión | Entorno+Contrato |
| CIERREANT | Precio de cierre de la sesión anterior | Entorno+Contrato |
| CODVENC1 | Código del contrato de un Vencimiento | <i>Entorno+Grupo+Tipo+Vencimiento</i> |
| CODVENC11 | Código del contrato Primer Vencimiento | <i>Entorno+Grupo+Tipo</i> |
| DECDIVCAM | Número de Decimales Divisa Cámara | <i>Entorno</i> |
| EXPDATE | Fecha Vencimiento | <i>Entorno+Contrato</i> |
| FECHASESI | Fecha de la Sesión | Entorno |
| HORASESI | Hora de la Sesión | Entorno |
| NOMINAL | Nominal de Contrato | <i>Entorno+Contrato</i> |
| NOPER | Número de Operaciones | Entorno+ Contrato |
| NUMDEC | Número de Decimales del Contrato | <i>Entorno+Contrato</i> |
| NUMVENC1 | Número de Vencimiento | <i>Entorno+Contrato</i> |
| OINTNETULTI | Open Interest última sesión | Entorno+Contrato |
| OPENINT | Open Interest | Entorno+Contrato |
| STRIKE | Precio Ejercicio Opción | <i>Entorno+Contrato Opciones</i> |
| SUBYACENTE | Contrato Subyacente | <i>Entorno+Contrato Opciones</i> |
| TICKVAL | Valor del Tick | <i>Entorno+Contrato</i> |
| TIPOINTMER | Tipo de Interés del Entorno | <i>Entorno</i> |
| ULTIMSESI | Fecha de la Sesión Anterior | Entorno |
| VOLATCIERRE | Volatilidad del Contrato a Cierre de la Sesión | Entorno+Contrato |