



MEFFServer

DOCUMENTACIÓN DE USUARIO

BME CLEARING
S/MART v11.20

Octubre 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-18
A.2.3 Datos Privados de Configuración	A-19
A.2.4 Datos para Cálculo de Garantías	A-28
A.2.5 Operaciones	A-36
A.2.6 Gestión de Operaciones	A-39
A.2.7 Posición Abierta	A-43
A.2.8 Ejercicio – Vencimiento - Entrega	A-47
A.2.9 Comisiones	A-56
A.2.10 Resultados a nivel de Cuenta de Posición	A-60
A.2.11 Resultados a nivel de Cuenta de Garantías	A-67
A.2.12 Resultados por cuenta de colateral a nivel ECC	A-74
A.2.13 Registro de detalle. Resultados a nivel de cuenta de posición	A-78
A.2.14 Resultados para Miembros Compensadores	A-81
A.2.15 Resultados para Agentes de Pago	A-83
Apéndice B Datos Suministrados	B-85
B.1 Datos de Feed	B-85
B.2 Datos de Información General	B-86

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

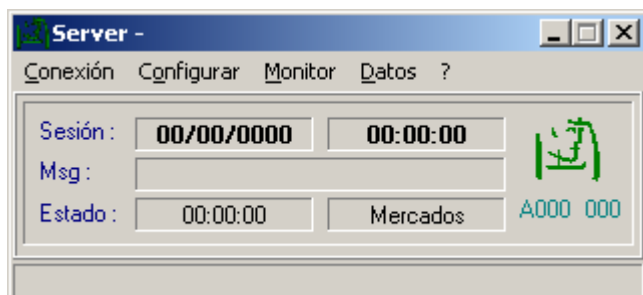
2.1.1 Para iniciar MEFFServer

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.

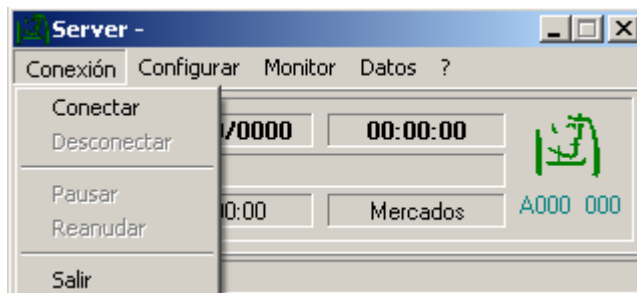
Nota En esta situación MEFFServer ya ofrece vínculos DDE, pero la información que sirve es la de la última sesión recibida correctamente.

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

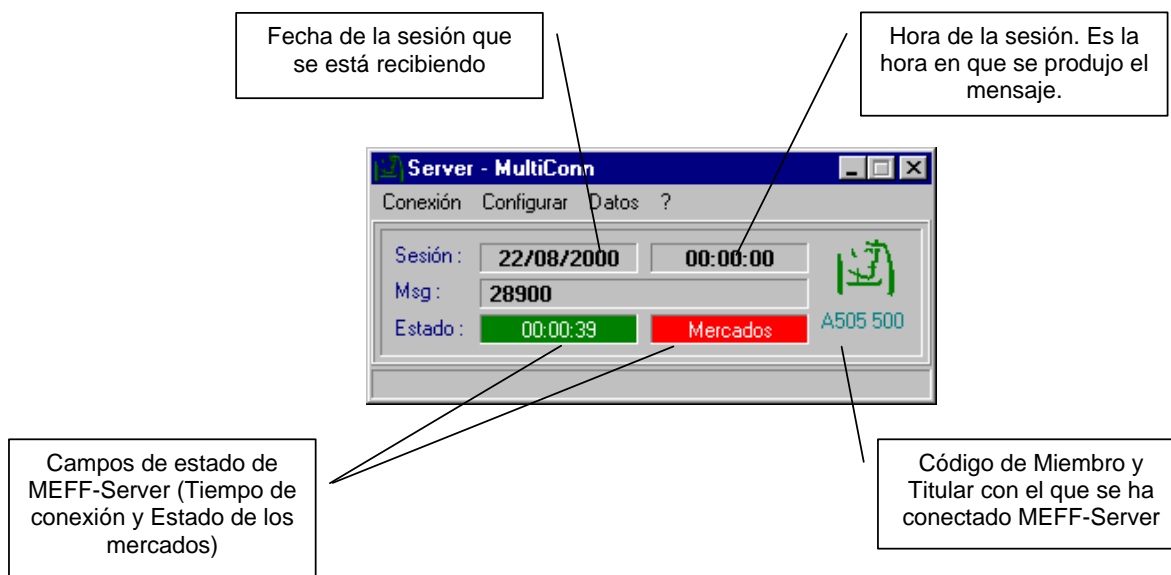
Esta conexión debe establecerse a través de un controlador de comunicaciones (MeffAccess)

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

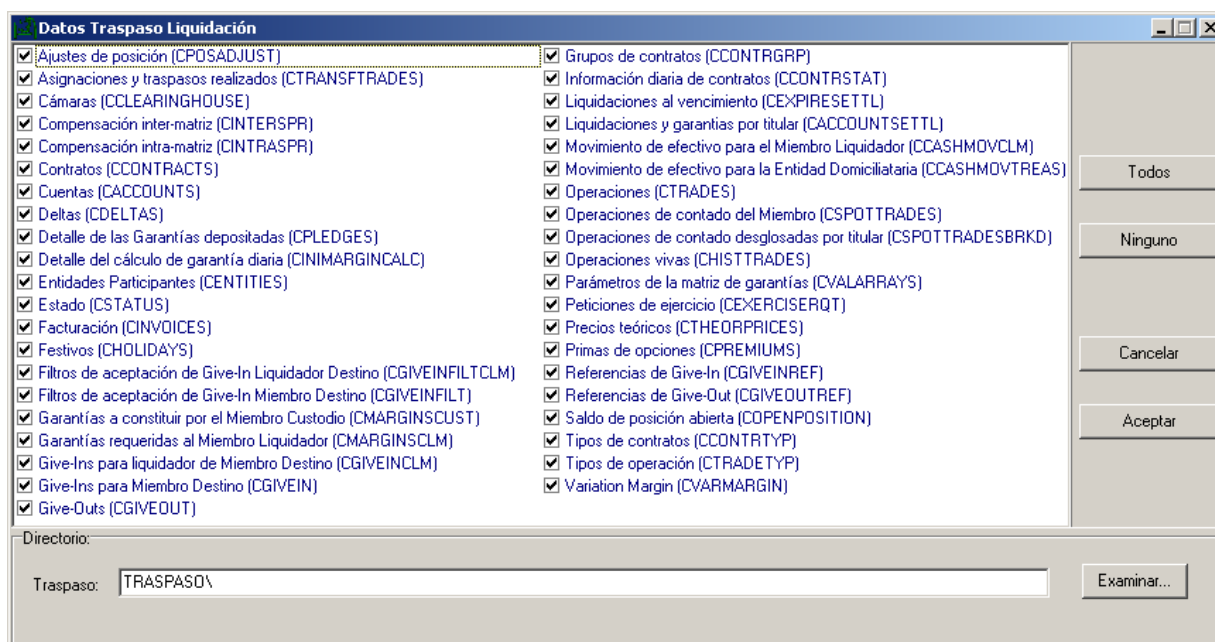
3.1.3 Ficheros de Datos

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:



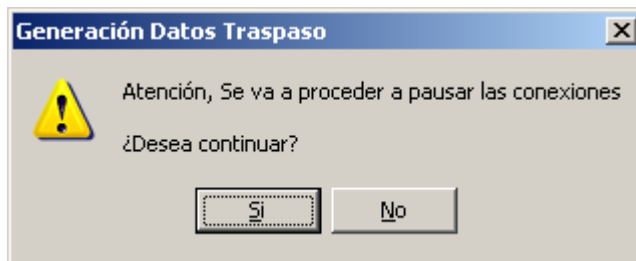
En esta ventana se configura qué ficheros de datos de traspaso se desea generar automáticamente al fin de cada una de las sesiones recibidas.

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”.

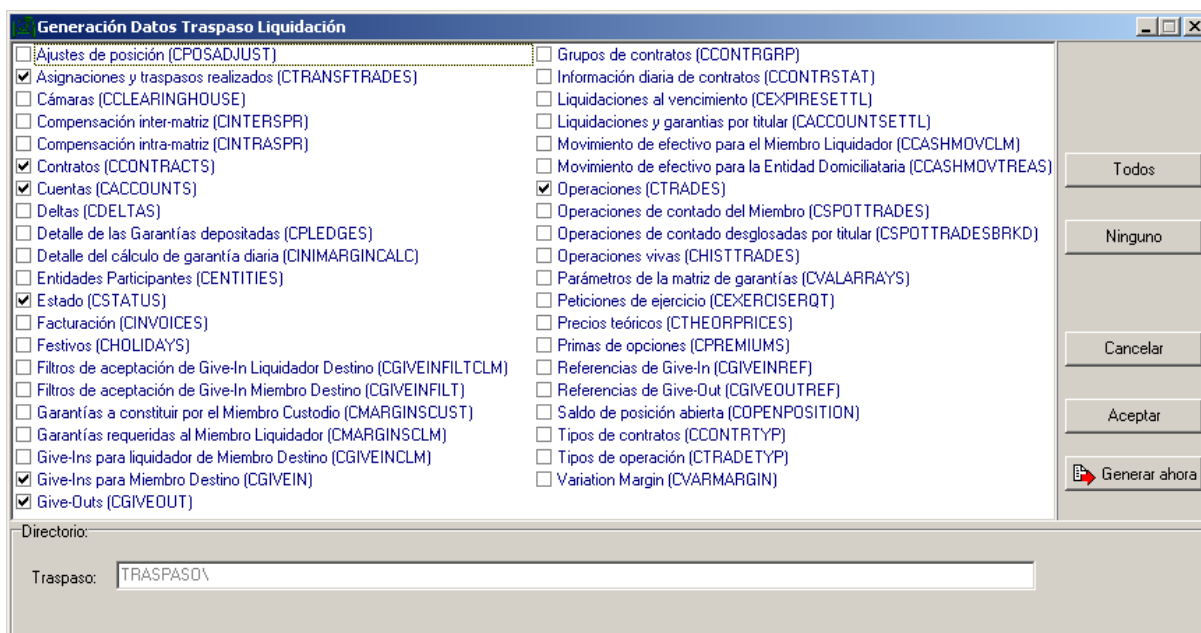
3.1.3.2 Ficheros de Datos durante sesión

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.

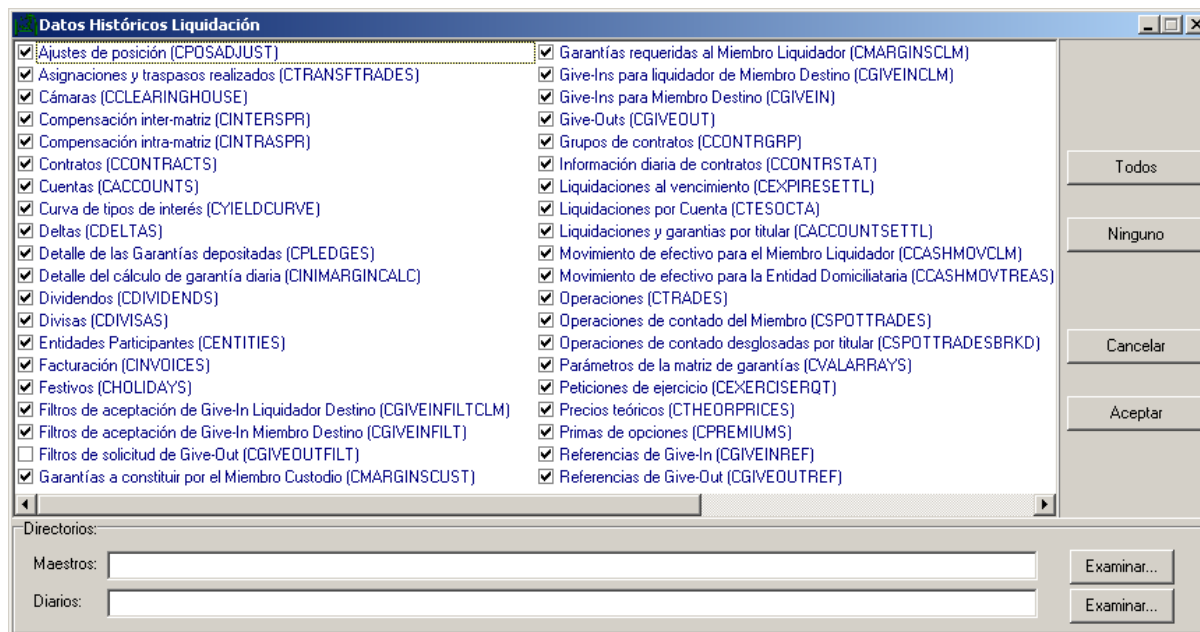
En el apéndice “Estructura de las tablas” se puede ver una descripción detallada de las mismas.

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.

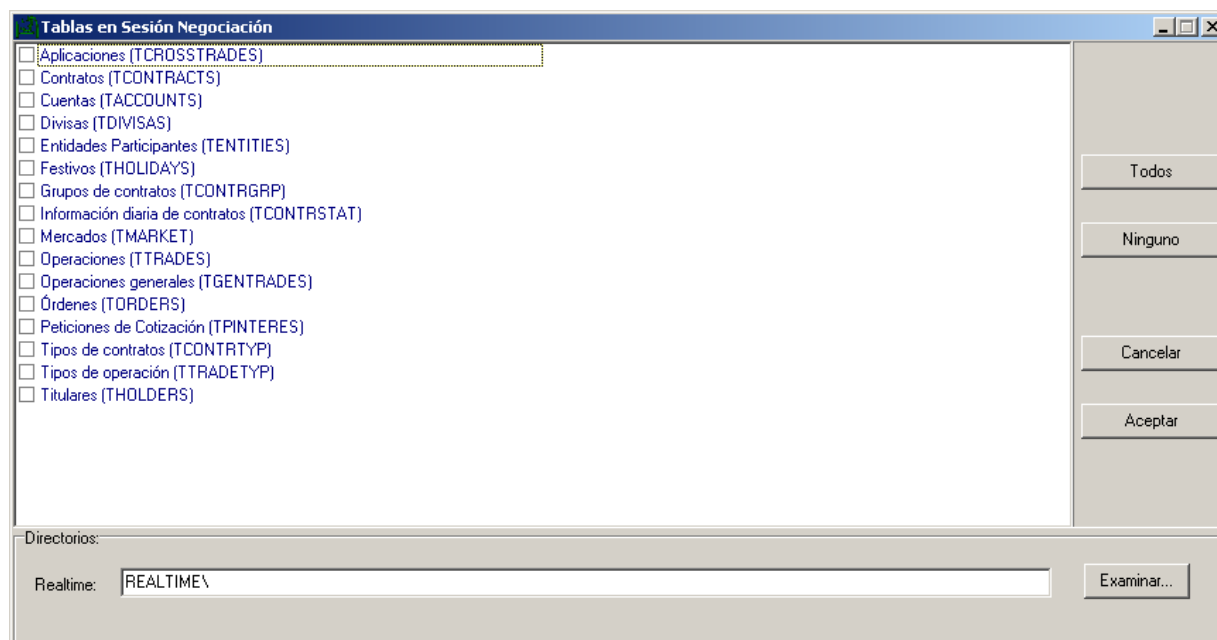
3.2.2 Realtime

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
CCPACCOUNTSETTL.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
CDELTAS.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

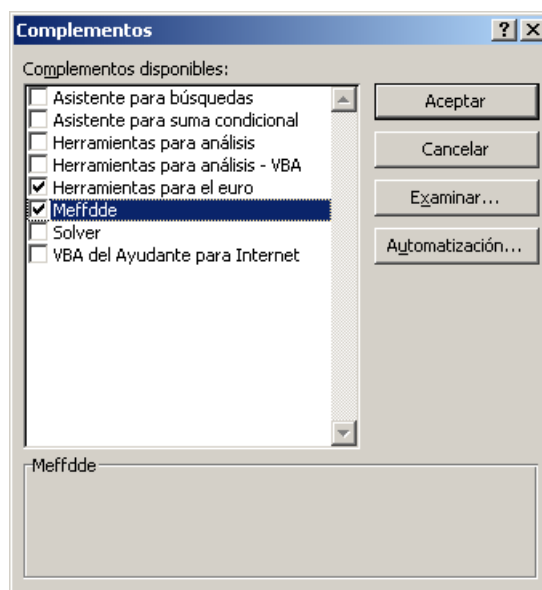
4.2.1 Variables

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

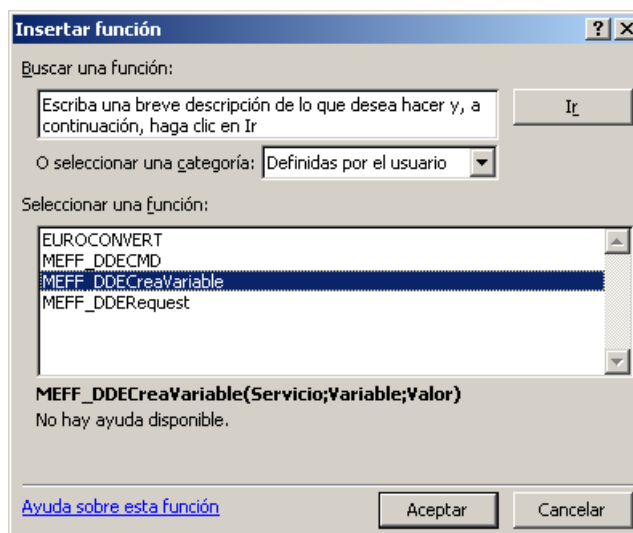
Cada una de estas variables se referencia mediante un nombre que el usuario decide. Posteriormente, es posible incluir en los vínculos entre MEFFServer y las otras aplicaciones dichas variables, de modo que al cambiar el valor de una variable, se actualicen los vínculos de datos que dependían de ella.

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:



- Desde una celda, seleccione la función `MEFF_DDECreaVariable("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:

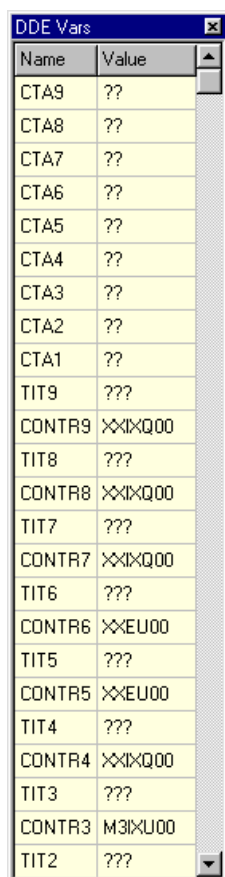
Escribimos en la celda B1:

= MEFF_DDECreaVariable (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 IX1000D. Es decir, hemos creado una variable que se llama Contr y cuyo valor actual es IX1000D. 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_DDECreaVariable 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”.



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

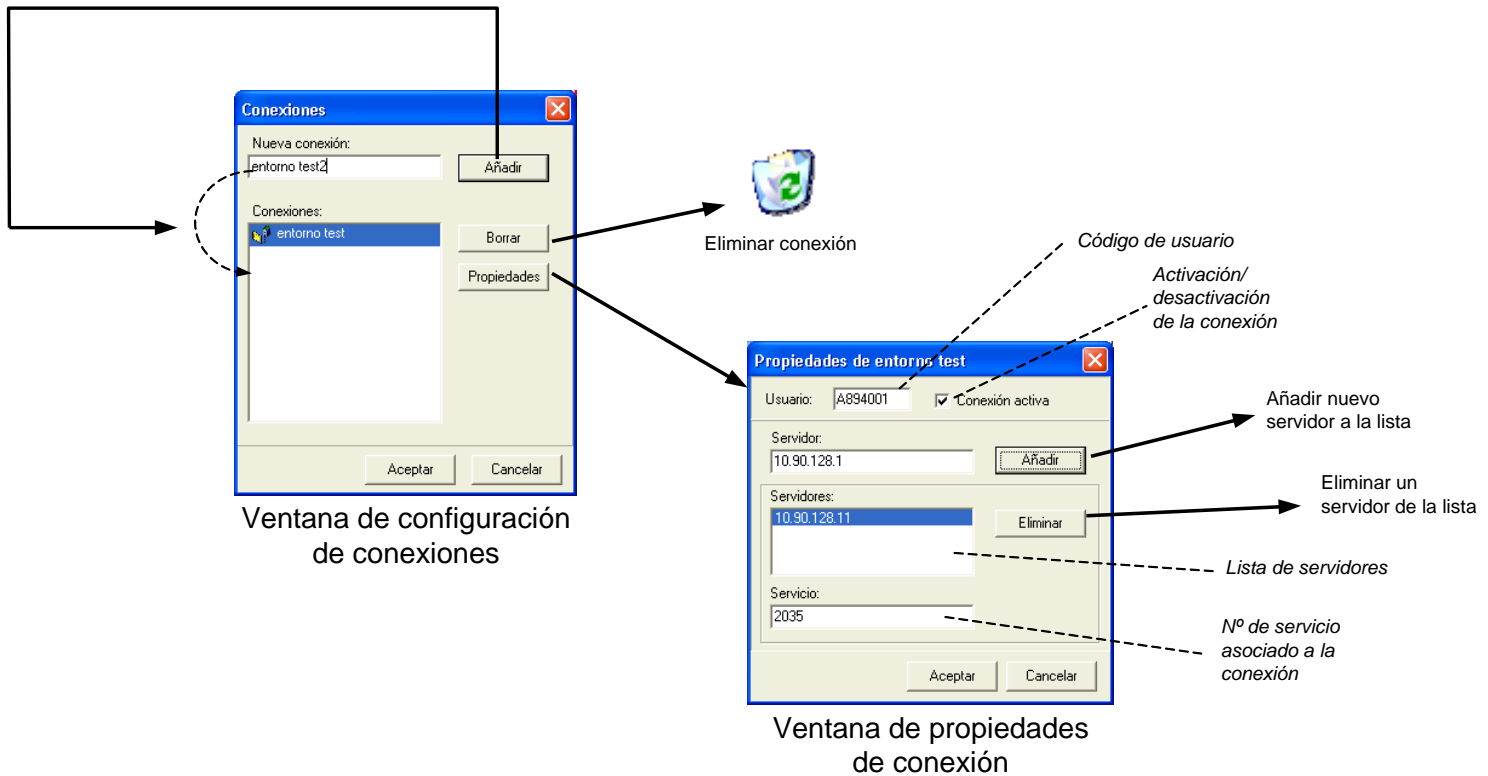
Los datos están organizados en clases. Dentro de cada clase hay una lista de conceptos (o tipos de dato). Estos conceptos son denominados tópicos.

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

5. Otras Configuraciones

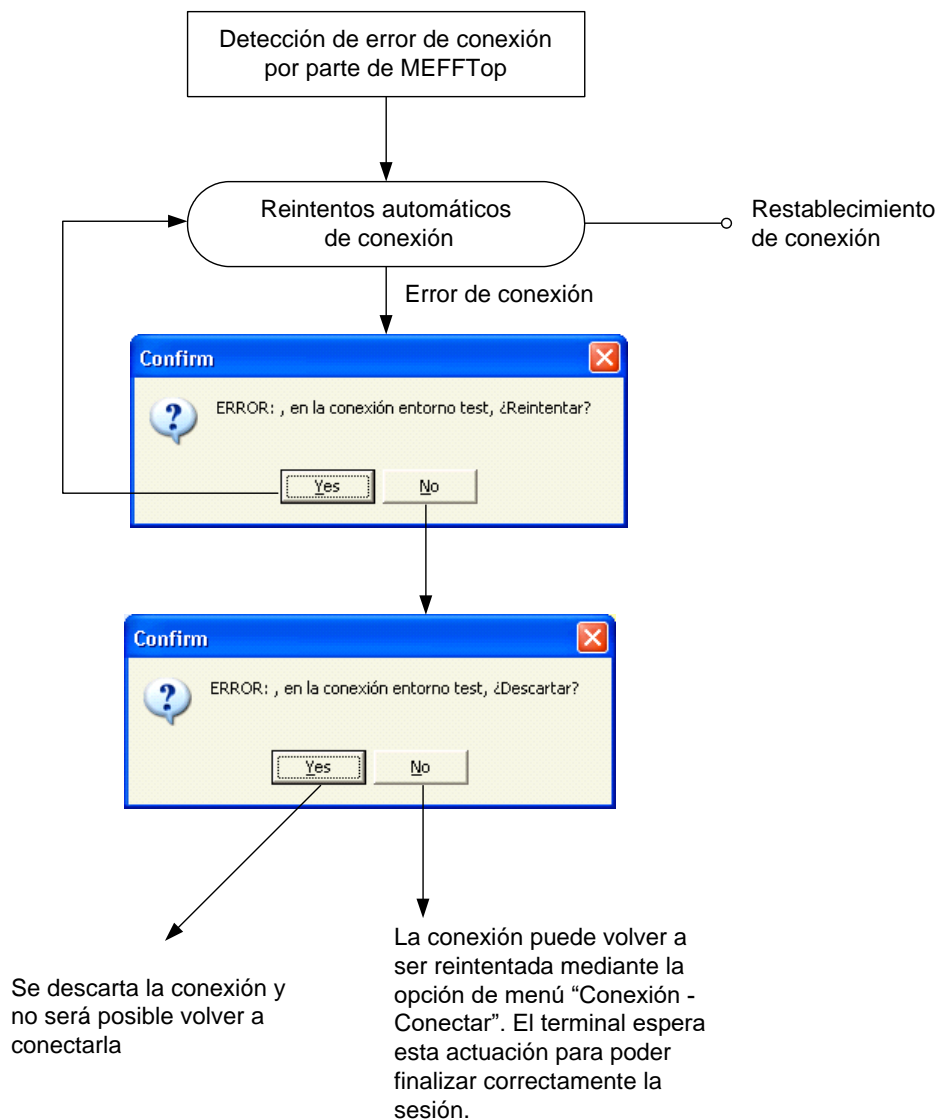
5.1 Comunicaciones

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

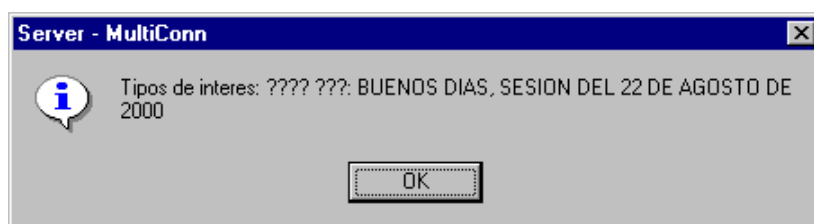
Cuando MEFFServer detecta un error en alguna de sus conexiones, lo notificará al usuario, que puede optar por reintentar o aceptar la desconexión. Si la desconexión es aceptada deberá decidir si desea descartar la conexión, de forma que MEFFServer no requiera esta conexión para finalizar correctamente,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

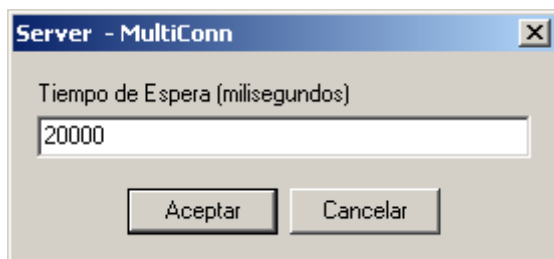


Cuando aparece una ventana de mensaje, MEFFServer pausa su actividad hasta que el usuario haga clic en el botón "Aceptar". De esta forma, el usuario no pierde ningún mensaje.

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

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

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	↔	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		Tipolnteres	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	SmallIn	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.
19		ClosingPositionType	String(1)	Indica si la posición se podrá cerrar por parte de las contrapartidas en una fecha anterior a la fecha de vencimiento. M: En mercado C: Por comprador V: Por vendedor A: Por ambos
20		BuyReferenceRate	String(1)	Tipo de referencia financiación en compras. S: €STR F: Fis Analytics M: Coste de préstamo MEFF 0: Cero ' ': No aplica En FLEX sólo se informará uno de los dos lados (compras o ventas), el correspondiente a la contrapartida financiada.

#	*	Campo	Tipo	Descripción
21		BuyReferenceRateMarkup	float	Markup sobre tipo de referencia en compras En porcentaje con signo y 4 decimales
22		SellReferenceRate	String(1)	Tipo de referencia financiación en ventas S: €STR F: Fis Analytics M: Coste de préstamo MEFF 0: Cero ' ': No aplica En FLEX sólo se informará uno de los dos lados (compras o ventas), el correspondiente a la contrapartida financiada.
23		SellReferenceRateMarkup	float	Markup sobre tipo de referencia en ventas En porcentaje con signo y 4 decimales
24		DividendPercentageApplied	float	Porcentaje flujo de liquidación de dividendos En porcentaje sin signo y 2 decimales..
25		DividendDateOffset	int	Diferencial de fecha de pago/ cobro del flujo de dividendo ordinario 0 indica fecha exdate 999 indica fecha efectiva de pago
26		RetailArrayCode	String(3)	Código de matriz de garantías para el cálculo de minoristas
27		RetailExpirySpan	char	Tipo de vencimiento usado para el cálculo de garantías para minoristas

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	Clase de operación "N"=Negociación electrónica "A"=Negociación Telefónica fuera de horario de Mercado "H"=Negociación Telefónica en horario de Mercado "J"=Grandes Operaciones "L"=Operaciones delta "V"=Vencimiento "E"=Ejercicio "T"=Traspasos "G"=Give-up "D"=Asignación de diaria "P"=Ajuste de posición

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

CCONTRRELDET.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
10		MarginBufferPercentage	Float	Buffer en porcentaje sobre el total exigido con criterio institucional o minorista
11		RegulatorMargin	String(1)	N = No afectado por Restricciones Regulatorias S = Sí afectado por Restricción Regulatoria

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		Compensador	String(4)	Miembro Compensador
17		Clase	Char	Clase de la cuenta de posición ver Tabla 18 en documento "Tablas de Codificación"
18		TipoPersona	String(2)	Tipo de persona Ver Tabla 17 en documento "Tablas de Codificación"
19		EntAuth	Char	Código de entidad autorizada
20		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
21		PropClient	Char	Tipo de cuenta de posición desde el punto de vista del miembro de mercado C=Cliente P=Propia
22		EICCode	String(16)	
23		TipoAnotacion	String (1)	Tipo de anotación G: Bruto N:Neto
24		TitEICCode	String(1)	Titularidad EICCode S=Si N=No
25		TypeEntity	String(1)	N – No Aplica I – Cliente Institucional M – Cliente minorista B – Proveedor Liquidez

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	SmallIn	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
15		RegulatorMarginPercentage	Float	Porcentaje de Garantía Mínima establecida por el Regulador

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..57
		PrecioD_n	Float	Se repiten los campos PrecioT_n y PrecioD_n para n= 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..57
		DeltaD_n	Float	Se repiten los campos DeltaT_n y DeltaD_n para n= 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	SmallIn	Número de tramos que se definen en el registro <=8
8		DivisorPtosPorc	SmallIn	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		Tipoint_1	Float	Tipo de interés del tramo 1
		Dialnicio_n	Integer	Se repiten los campos Dialnicio_n y Tipoint_n para n=2..50
		Tipoint_n	Float	Se repiten los campos Dialnicio_n y Tipoint_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 SettIDate.
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

	CTRAFTRADES.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		MiembroGiveIn	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
9		LongCashAmount	Amt	Importe efectivo comprador para la combinación de cuenta de posición y contrato del registro
10		ShortCashAmount	Amt	Importe efectivo vendedor para la combinación de cuenta de posición y contrato del registro

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
9		LongCashAmount	Amt	Importe efectivo comprador para la combinación de cuenta de garantías y contrato del registro
10		ShortCashAmount	Amt	Importe efectivo vendedor para la combinación de cuenta de garantías y contrato del registro

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
9		CashAmount	Amt	Importe efectivo neto (con signo positivo para compras y negativo para ventas)

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 = n ^o 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

	GPHYSDELDET.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

	GPHYSDEL.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 coproporciona 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 comisiones 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 copropone 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	↔	ComisionPorConcepto	Float	Comisión que se aplica para este concepto
12		TotalVolumenVivo	Integer	Total volumen vivo de las operaciones agregadas. Puede ser cero
13		TotalNumTransacciones	Integer	Total número de transacciones. Puede ser cer
14		TotalNumLineas	Integer	Total número de registros en CFEESBRKD que componen este registro agregado. Puede ser cero
15		CantidadPorConcepto	Integer	Cantidad a la que se aplica este concepto

#	*	Campo	Tipo	Descripción
15		ComisionPorConcepto	Float	Comisión que se aplica para este concepto
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	↔	Tradelnd	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 Tradelnd = 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 Tradelnd=1 es el precio de cierre de la sesión anterior. Si Tradelnd=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	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. Esta tabla contiene los mismos campos y en el mismo orden que la tabla CVARMARGIN
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	↔	Tradelnd	Char	"3"=Operación para valoración
7	↔	NumOperacion	Integer	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 Tradelnd=3 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. En operaciones (simples y repos) de deuda se actualiza, además, este valor efectivo según el ipo de interés. Es el resultado de multiplicar el precio de valoración inicial por el volumen y el multiplicador del contrato. Tiene signo positivo para las compras y negativo para las ventas
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		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		FechaInitialValue	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	→	CalculationType	String(1)	<p>1: Cálculo Ordinario 2: Cálculo con Restricciones Regulatorias</p> <p>Este campo junto con el campo ArrayCode determina el criterio utilizado para el cálculo de garantías:</p> <ul style="list-style-type: none"> - CalculationType = 1 y ArrayCode institucional: Garantías BME CLEARING - CalculationType = 2 y ArrayCode institucional: Garantías BME CLEARING excluyendo los contratos xRolling sobre acciones - CalculationType = 2 y retail ArrayCode: Garantías por posiciones en xRolling sobre acciones bajo restricciones regulatorias.
7		GarantiaPosNeta	Float	Garantía posición neta
8		GarantiaTimeSpread	Float	Garantía time-spread
9		Escenario	Integer	Escenario
10		DeltaPosCompra	Float	Delta posición abierta compradora
11		DeltaPosVenta	Float	Delta posición abierta vendedora
12		DeltaNeta	Float	Delta neta
13		DeltaGrupo	Float	Delta a aplicar en cada grupo de compensación
14		DtoSpread	Float	Descuento por spreads obtenido en las compensaciones
15		DeltaFinal	Float	Delta final
16		GarantiaGrupo	Float	Grantía Grupo (previa a la compensación de subyacentes)
17		GarantiaFinal	Float	Garantía final
18		Divisa	String(3)	Divisa en la que están expresados los importes de este registro
19		GarantiaGrupoNeta	Float	Garantía grupo tras la compensación de subyacentes
20		VarMarginPendiente	Float	Ajuste de garantía por VariationMargin no liquidado
21		EscenarioIni	Integer	Escenario más desfavorable sin tener en cuenta escenarios de grandes posiciones
22		DeltaNetaIni	Float	Delta neta sin tener en cuenta escenarios de grandes posiciones
23		Compensador	String(4)	Miembro compensador

#	*	Campo	Tipo	Descripción
24		PrimaGarantia	Float	
25		IMIncreased	Amt	IM calculado bajo el criterio determinado por CalculationType and Arraycode, incrementado por MarginBufferPercentage

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	↔	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 (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	↔	TipoCalculo	String(1)	<p>1: Cálculo Ordinario 2: Cálculo con Restricciones Regulatorias</p> <p>Este campo junto con el campo ArrayCode determina el criterio utilizado para el cálculo de garantías:</p> <ul style="list-style-type: none"> - CalculationType = 1 y ArrayCode institucional: Garantías BME CLEARING - CalculationType = 2 y ArrayCode institucional: Garantías BME CLEARING excluyendo los contratos xRolling sobre acciones - CalculationType = 2 y retail ArrayCode: Garantías por posiciones en xRolling sobre acciones bajo restricciones regulatorias
7		GarantiaPosNeta	Float	Garantía posición neta
8		GarantiaTimeSpread	Float	Garantía time-spread
9		Escenario	Integer	Escenario
10		DeltaPosCompra	Float	Delta posición abierta compradora
11		DeltaPosVenta	Float	Delta posición abierta vendedora
12		DeltaNeta	Float	Delta neta
13		DeltaGrupo	Float	Delta a aplicar en cada grupo de compensación
14		DtoSpread	Float	Descuento por spreads obtenido en las compensaciones
15		DeltaFinal	Float	Delta final

#	*	Campo	Tipo	Descripción
16		GarantiaGrupo	Float	Garantía Grupo (previa a la compensación de subyacentes)
17		GarantiaFinal	Float	Garantía final
18		Divisa	String(3)	Divisa en la que están expresados los importes de este registro
19		GarantiaGrupoNeta	Float	Garantía grupo tras la compensación de subyacentes
20		VarMarginPendiente	Float	Ajuste de garantía por VariationMargin no liquidado
21		EscenarioIni	Integer	Escenario más desfavorable sin tener en cuenta escenarios de grandes posiciones
22		DeltaNetaIni	Float	Delta neta sin tener en cuenta escenarios de grandes posiciones
23		PrimaGarantia	Float	
24		IMIncreased	Amt	IM calculado bajo el criterio determinado por CalculationType and Arraycode, incrementado por MarginBufferPercentage

Liquidaciones y garantías por subcuenta

	CACCOUNTSETTLEDET.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	↔	CCPCode	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 (cargo 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
CODVENCI	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>
NUMVENCI	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