



ClearGate

ESPECIFICACIONES DE LA INTERFAZ FIX

Versión C1.9

18 de noviembre de 2024

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.

© 2022 BME. Todos los derechos reservados.

Modificaciones realizadas en la última revisión

Este documento está actualizado con el título “ClearGate – Especificaciones de la Interfaz FIX”, pero en él se detalla el mismo contenido que en el anterior documento “MEFFGate Liquidación – Especificaciones de la Interfaz FIX”.

El contenido aplica tanto a Derivados Financieros y Productos de Energía liquidados por BME Clearing, como a los nuevos Productos de Derivados Crypto que serán pronto añadidos en la ECC (para liquidar la actividad de LMAX). Estos nuevos productos, siendo contratos de derivados comunes, no requieren de cambios en la documentación, tan solo pequeñas modificaciones marcadas en verde.

A continuación, se detallan las principales modificaciones realizadas en la versión C1.9 (respecto de la versión C1.8 del 10 de octubre de 2019):

- Ampliación de los cálculos de garantías de una cartera:
 - Ver capítulo "14 - Cálculo de garantías de una ".
 - Nuevos valores del PartyRole[452] en la mensajería de garantías y liquidaciones: 38=Position account, 100=Margin account, 101=Collateral account.
- Posiciones netas en una pareja Demandante de xRolling-Proveedor de Liquidez
 - Ver capítulo “7 - Seguimiento y Gestión de la Posición”.
 - Nuevos valores de PartyRole[452] relacionados con xRolling RFQ: 60 (Introducing Broker) para el demandante de xRolling y 35 (Liquidity Provider) para el proveedor de liquidez.
 - Nuevo tipo de Request For Positions y de Position Report de tipo 7 (Net positions) para las posiciones netas en una pareja Demandante de xRolling-Proveedor de Liquidez.
- Nuevos EventTypes 167 a 173 en Security List para campos propios de xRolling sobre acciones.
- Nuevo Tipos de producto en tag SecurityType [167] para xRolling.
- Nuevos tags TradeType [828] y TradeSubType [829] en el mensaje “Trade Capture Report”, para indicar el Tipo de Operación.
- Nuevo EventType 104 en el mensaje “Trade Capture Report”. Contiene el Tipo de Cuenta.
- Nuevo EventType 105 en el mensaje “Trade Capture Report”. Contiene el identificador utilizado por la aplicación cliente cuando se solicita una asignación.
- Nuevo Status Give-Up en mensaje “Confirmation”

Tabla de Contenidos

1.	Introducción	1
1.1	Ámbito de este manual	1
1.2	Información pública e información privada	2
1.3	Organización del manual	3
1.4	Formato de las tablas de definición de mensajes	4
1.5	Documentos relacionados	4
2.	Decisiones de Implementación	5
2.1	Descripción	5
2.2	Campos ignorados	5
2.3	Campos no soportados	5
2.4	Longitud del tipo String	5
2.5	Máxima longitud de mensaje	5
2.6	Encriptación	5
2.7	Identificación del protocolo ClearGate FIX	5
3.	Sesión FIX.....	7
3.1	Introducción	7
3.2	Sesión FIX y sesión de comunicación	7
3.3	Identificación de la sesión FIX	7
3.4	Software cliente y sesiones FIX	8
3.5	Sincronización de la sesión FIX	8
3.6	Sincronización a nivel de aplicación	10
3.7	Alta disponibilidad	11
3.8	Campo PossResend	11
3.9	Mensajes administrativos que el cliente FIX debe gestionar	11
3.10	Lista de mensajes	11
3.11	Flujo de mensajes	12
3.12	Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4	15
3.13	Definición de mensajes	16
3.13.1	Standard Message Header	16
3.13.2	Standard Message Trailer	18
3.13.3	Logon (Msg Type = A)	19
3.13.4	Logout (Msg Type = 5)	20
3.13.5	Heartbeat (Msg Type = 0)	21
3.13.6	Test Request (Msg Type = 1)	22
3.13.7	Resend Request (Msg Type = 2)	23
3.13.8	Sequence Reset (Msg Type = 4)	24
3.13.9	Reject (Msg Type = 3)	25
4.	Convenciones generales en los mensajes de aplicación	26
4.1	Identificación de operaciones	26
4.1.1	SecondaryExecID	26
4.1.2	SecondaryTradeReportID	26
4.2	Bloque Parties	26
4.3	Symbol y SecurityID	28
4.4	Bloque Instrument	29
4.4.1	Activo subyacente (campo SecurityID)	29
4.4.2	Código de contrato (campo Symbol)	29
4.5	Formato de Error (Campo Text)	29
5.	Mensajes Genéricos del Nivel de Aplicación.....	30
5.1	Introducción	30
5.2	Estado de la comunicación	30
5.3	Cambio de password de conexión al ClearGate	30
5.4	Rechazo de mensajes de aplicación	30
5.5	Lista de mensajes	30
5.6	Flujo de mensajes	31
5.7	Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4	31
5.8	Definición de mensajes	32
5.8.1	Network Counterparty System Status Request (Msg Type = BC)	32
5.8.2	Network Counterparty System Status Response (Msg Type = BD)	33
5.8.3	User Request (Msg Type = BE)	34

5.8.4	User Response (Msg Type = BF)	35
5.8.5	Business Message Reject (MsgType = j)	36
6.	Información de Contratos	37
6.1	Introducción	37
6.2	Información estática de contratos	38
6.2.1	Descripción	38
6.2.2	Solicitud de información de contratos	38
6.2.3	Recepción de la definición de contratos	38
6.2.4	Finalización de las suscripciones	38
6.2.5	Lista de mensajes	38
6.2.6	Flujo de mensajes	39
6.2.7	Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4	40
6.3	Información dinámica de contratos	41
6.3.1	Descripción	41
6.3.2	Solicitud de información	41
6.3.3	Recepción de información	41
6.3.4	Lista de mensajes	41
6.3.5	Flujo de mensajes	42
6.3.6	Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4	43
6.4	Definición de mensajes	44
6.4.1	Security List Request (Msg Type = x)	44
6.4.2	Security List (Msg Type = y)	45
6.4.3	Market Data Request (Msg Type = V)	50
6.4.4	Market Data Request Reject (Msg Type = Y)	51
6.4.5	Market Data Snapshot Full Refresh (Msg Type = W)	52
7.	Seguimiento y Gestión de la Posición	53
7.1	Introducción	53
7.2	Consulta de posición abierta	53
7.2.1	Consulta por miembro negociador y/o liquidador	53
7.3	Consulta de posiciones netas en la relación Demandante de xRolling-Proveedor de liquidez	54
7.4	Ajustes de posición	55
7.5	Lista de mensajes	55
7.6	Flujo de mensajes	56
7.7	Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4	59
7.8	Definición de mensajes	60
7.8.1	Request For Positions (Msg Type = AN)	60
7.8.2	Request For Positions Ack (Msg Type = AO)	62
7.8.3	Position Report (Msg Type = AP)	63
7.8.4	Trade Capture Report (Msg Type = AE)	66
7.8.5	Position Maintenance Request (Msg Type = AL)	71
7.8.6	Position Maintenance Report (Msg Type = AM)	73
8.	Consulta de operaciones	76
8.1	Introducción	76
8.2	Consulta por miembro negociador y/o liquidador	76
8.3	Lista de mensajes	78
8.4	Flujo de mensajes	78
8.5	Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4	79
8.6	Definición de mensajes	80
8.6.1	Trade Capture Report Request (Msg Type = AD)	80
8.6.2	Trade Capture Report Request Ack (Msg Type = AQ)	81
9.	Gestión de Operaciones	82
9.1	Introducción	82
9.2	Asignación de cuenta diaria y traspaso	82
9.3	Asignación de operaciones a precio medio	82
9.4	Give-up (Miembro Origen)	82
9.5	Give-up (Miembro Destino)	83
9.6	Give-up (Liquidador de la cuenta destino)	83
9.7	Campo AllocID	84
9.8	Campo SecondaryAllocID	85
9.9	Seguimiento de operaciones mediante los mensajes Trade Capture Report	85
9.10	Lista de mensajes	86
9.11	Flujo de mensajes	86
9.12	Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4	93

9.13	Definición de mensajes	94
9.13.1	<i>Allocation Instruction (Msg Type = J)</i>	94
9.13.2	<i>Allocation Instruction Ack (Msg Type = P)</i>	97
9.13.3	<i>Confirmation (Msg Type = AK)</i>	98
9.13.4	<i>Confirmation Ack (Msg Type = AU)</i>	101
9.13.5	<i>Business Message Reject (MsgType = j)</i>	101
10.	Petición de Ejercicio.....	102
10.1	Introducción.....	102
10.2	Escenario 1: Opciones americanas, antes del día de vencimiento	102
10.3	Escenario 2: Día de vencimiento	102
10.4	Lista de mensajes	103
10.5	Flujo de mensajes	104
10.6	Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4	106
10.7	Definición de mensajes	107
11.	Comunicación de Eventos.....	108
11.1	Introducción.....	108
11.2	Lista de mensajes	108
11.3	Flujo de mensajes	108
11.4	Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4	109
11.5	Definición de mensajes	110
11.5.1	<i>News (Msg Type = B)</i>	110
12.	Gestión de Referencias y Filtros de Give-up.....	111
12.1	Introducción.....	111
12.2	Campo RegistID	111
12.3	Mantenimiento de referencias de Give-out por Miembro Origen	113
12.3.1	<i>Descripción</i>	113
12.3.2	<i>Lista de mensajes</i>	113
12.3.3	<i>Flujo de mensajes</i>	113
12.3.4	<i>Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4</i>	114
12.3.5	<i>Definición de mensajes</i>	115
12.4	Mantenimiento de referencias de Give-in por Miembro Destino	117
12.4.1	<i>Descripción</i>	117
12.4.2	<i>Lista de mensajes</i>	117
12.4.3	<i>Flujo de mensajes</i>	117
12.4.4	<i>Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4</i>	118
12.4.5	<i>Definición de mensajes</i>	119
12.5	Mantenimiento de filtros de Give-in por Miembro Destino	121
12.5.1	<i>Descripción</i>	121
12.5.2	<i>Lista de mensajes</i>	121
12.5.3	<i>Flujo de mensajes</i>	121
12.5.4	<i>Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4</i>	122
12.5.5	<i>Definición de mensajes</i>	123
12.6	Mantenimiento de filtros de Give-in por Miembro Liquidador	127
12.6.1	<i>Descripción</i>	127
12.6.2	<i>Lista de mensajes</i>	127
12.6.3	<i>Flujo de mensajes</i>	127
12.6.4	<i>Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4</i>	128
12.6.5	<i>Definición de mensajes</i>	129
12.7	Mantenimiento de peticiones automáticas de Give-out	132
12.7.1	<i>Descripción</i>	132
12.7.2	<i>Lista de mensajes</i>	132
12.7.3	<i>Flujo de mensajes</i>	132
12.7.4	<i>Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4</i>	133
12.7.5	<i>Definición de mensajes</i>	134
12.8	Consulta de referencias y filtros de Give-up.....	136
12.8.1	<i>Descripción</i>	136
12.8.2	<i>Lista de mensajes</i>	136
12.8.3	<i>Flujo de mensajes</i>	136
12.8.4	<i>Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4</i>	137
12.8.5	<i>Definición de mensajes</i>	138
13.	Entregas de Futuros sobre Bono.....	140
13.1	Introducción.....	140
13.2	Lista de entregables	140

ClearGate - Especificaciones de la Interfaz FIX

13.3	Notificación de entregas	140
13.4	Operaciones de compra-venta a realizar.....	141
13.5	Lista de mensajes	141
13.6	Flujo de mensajes	142
13.7	Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4	144
13.8	Definición de mensajes	145
14.	Cálculo de garantías de una cuenta o de una cartera simulada.....	146
14.1	Introducción.....	146
14.1.1	<i>Garantías por posición en cartera simulada</i>	<i>146</i>
14.1.2	<i>Garantías por posición en cuentas de posición y cuentas de garantías</i>	<i>146</i>
14.1.3	<i>Obtención de cálculos de liquidaciones a fin de día</i>	<i>146</i>
14.2	Lista de mensajes	146
14.3	Flujo de mensajes	146
14.4	Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4	147
14.5	Definición de mensajes	148
14.5.1	<i>Margin Requirement Inquiry (Msg Type = CH)</i>	<i>148</i>
14.5.2	<i>Margin Requirement Report (Msg Type = CJ)</i>	<i>150</i>
Apéndice A	Campos de Usuario.....	A-1
Apéndice B	Tablas de valores	B-2
B.1	Tipos de producto en tag SecurityType [167]	B-2

1. Introducción

1.1 Ámbito de este manual

Este documento contiene la definición de la interfaz ofrecida por la ECC para el desarrollo de aplicaciones relacionadas con el ámbito de liquidación. Dicha interfaz está basada en el estándar FIX Protocol (Financial Information eXchange), en su versión 4.4. Para una información detallada del estándar, consúltese el documento de referencia 1 (ver 1.5) o la página www.fixprotocol.org.

La interfaz sigue, tanto como es posible, las especificaciones de FIX 4.4. En la mayoría de los casos la estructura y semántica de los mensajes es idéntica al estándar.

En algunos casos se han realizado extensiones del protocolo, por ejemplo para cubrir funcionalidades que no han sido consideradas por el estándar. Dichas extensiones están claramente detalladas en el documento.

En otros casos el estándar es ambiguo, o indica que los detalles deben ser acordados mutuamente entre las partes. En estos casos el manual contiene una descripción detallada que elimina las posibles ambigüedades.

Todas las acotaciones y adaptaciones del estándar se han llevado a cabo siguiendo las recomendaciones especificadas por el propio estándar.

Para evitar posibles duplicidades como fuente de información, este documento no incluye explicaciones de aquellos aspectos que cumplen exactamente con el estándar. Para cualquier tema que no esté explícitamente detallado en este manual, debe considerarse la documentación del estándar como fuente de información.

El propósito de este documento es servir de base para los Miembros e ISVs que deseen desarrollar software que se comunique con la Cámara mediante la interfaz FIX del servidor ClearGate.

1.2 Información pública e información privada

Las funcionalidades cubiertas por ClearGate se agrupan en información pública e información privada.

En la siguiente tabla se presentan las funciones públicas y los mensajes relacionados.

Función pública	Mensajes relacionados	Msg Type
Obtención de información de contratos	Security List Request	x
	Security List	y
	Market Data Request	V
	Market Data Request Reject	Y
	Market Data – Snapshot / Full Refresh	W

En la siguiente tabla se presentan las funciones privadas y los mensajes relacionados.

Función Privada	Mensajes relacionados	Msg Type
Seguimiento y gestión de la posición	Request For Positions	AN
	Request For Positions Ack	AO
	Position Report	AP
	Trade Capture Report	AE
	Position Maintenance Request	AL
	Position Maintenance Report	AM
Consulta de operaciones	Trade Capture Report Request	AD
	Trade Capture Report Request Ack	AQ
	Trade Capture Report	AE
Gestión de operaciones	Allocation Instruction	J
	Allocation Instruction Ack	P
	Confirmation	AK
	Confirmation Ack	AU
	Trade Capture Report	AE
Petición de ejercicio	Position Maintenance Request	AL
	Position Maintenance Report	AM
	Request For Positions	AN
	Request For Positions Ack	AO
	Position Report	AP
	Trade Capture Report	AE
Liquidaciones y cálculo y simulación de garantías	Margin Requirement Inquiry	CH
	Margin Requirement Report	CJ
Envío de mensajes al supervisor de la cámara y recepción de mensajes del mismo	News	B
Gestión de referencias y filtros de Give-up	Registration Instructions	o
	Registration Instructions Response	p

1.3 Organización del manual

El presente manual está organizado en dos partes diferenciadas. En la primera parte, formada por los primeros cuatro capítulos, se describen aspectos genéricos de esta interfaz.

Éste, el primer capítulo, describe el ámbito del documento, presenta la estructura del mismo e introduce los documentos relacionados.

En el capítulo 2 “Decisiones de Implementación”, se presentan aquellas acotaciones o restricciones derivadas de la implementación del protocolo que define este manual.

El capítulo 3 “Sesión FIX” describe aquellos aspectos relacionados con el nivel de sesión, incluyendo la descripción detallada de los mensajes correspondientes.

El capítulo 4 “Convenciones generales en los mensajes de aplicación” describe con detalle aspectos concretos que afectan a la mayoría de mensajes descritos en este manual.

Dado su contenido genérico, que afecta a todos los mensajes, se recomienda una lectura previa de los capítulos 2, 3 y 4 antes de pasar al resto de capítulos.

La segunda parte del manual, formada por el resto de capítulos, describe las diferentes funcionalidades soportadas por ClearGate. En cada uno de estos capítulos se trata una funcionalidad concreta, describiendo aquellos aspectos particulares que son de interés.

En cada uno de estos capítulos están presentes, entre otros, los siguientes apartados:

- **Introducción.** Presenta una breve descripción de la funcionalidad abordada en el capítulo
- **Lista de mensajes.** Relaciona los diferentes mensajes que implementan la funcionalidad tratada en el capítulo
- **Flujo de mensajes.** Describe los diferentes escenarios de intercambio de mensajes que se pueden dar. Incluye los correspondientes diagramas de flujo de mensajes
- **Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4.** Detalla las acotaciones y adaptaciones del protocolo estándar para adaptarlo a sus requerimientos
- **Definición de mensajes.** Contiene una tabla para cada mensaje del capítulo, que describe de forma detallada los campos que lo conforman

Finalmente, y a modo de apéndice, se presenta una tabla donde se describen los campos de usuario de FIX usados en el protocolo.

1.4 Formato de las tablas de definición de mensajes

Tal y como se explica en el apartado anterior, en los capítulos en que sea necesario se incluye una tabla por cada mensaje, que describe de forma detallada los campos que lo conforman.

Estas tablas contienen un campo por fila y presentan las siguientes columnas:

Columna	Significado
Tag	Número de campo. Los campos añadidos al mensaje en esta implementación presentan un asterisco ("*") a continuación de este número
Nombre	Nombre del campo según el estándar FIX
Req	"S" indica que el campo es requerido, "N" significa que el campo es opcional. "S*" significa que el campo es requerido en esta implementación, pero opcional en el estándar FIX 4.4
Valores válidos	Valores válidos del campo en el contexto del mensaje. Puede ser una lista de valores, o un rango de valores numéricos, p.ej. ">=3, <= 10". En esta columna también se indica el valor por defecto del campo. Para evitar confusiones con los términos, en los valores asociados a códigos se ha respetado la descripción del valor original de FIX, y por tanto no se ha traducido
Formato	Tipo de dato del campo. Es uno de los tipos definidos por FIX, o uno de estos tipos con alguna restricción adicional. String(n) es un tipo String con un máximo de n caracteres, o en algunos casos con exactamente n caracteres. Para más información sobre el tipo String consúltese 2.4
Descripción	Descripción del campo en el contexto del mensaje

1.5 Documentos relacionados

#	Título	Autor
1	Financial Information Exchange Protocol (FIX) 4.4 with errata 20030618	FIX Committee
2	Financial Information Exchange Protocol (FIX) 5.0 Service Pack 2 (9 December 2013) EP98-222 enhancing FIX 5.0 SP2	FIX Committee

2. Decisiones de Implementación

2.1 Descripción

En este capítulo se presentan las decisiones de implementación tomadas por la ECC. Aquí se detallan aquellos aspectos que el estándar deja abiertos y que han sido definidos en esta implementación.

2.2 Campos ignorados

En algunos casos, el contenido de ciertos campos de los mensajes de entrada puede ser ignorado por ClearGate. Cuando éste es el caso, está claramente explicitado en la descripción del campo.

2.3 Campos no soportados

Los campos que no están soportados en un mensaje no se han incluido en la descripción del mismo.

Los mensajes enviados a ClearGate no deben contener campos no soportados. Los mensajes enviados por ClearGate nunca contienen campos no soportados.

Ningún campo requerido ha sido declarado no soportado.

2.4 Longitud del tipo String

El estándar FIX no impone ninguna restricción de longitud máxima sobre el tipo String. En esta implementación la longitud máxima es de 255 caracteres.

En algunos campos se ha fijado una longitud máxima inferior a este valor. En estos casos el tipo se presenta como String(n), donde "n" es el número máximo de caracteres del campo. En ciertos casos "n" indica la longitud exacta del campo, en dicho caso será explícitamente mencionado en la columna de valores válidos.

2.5 Máxima longitud de mensaje

La longitud máxima de los mensajes enviados o recibidos por ClearGate es de 4096 bytes.

2.6 Encriptación

ClearGate no usa la encriptación que define el estándar FIX (mediante los campos SecureData and SecureDataLen de la cabecera del mensaje). La encriptación está implementada mediante el uso de SSL (*Secure Socket Layer*).

2.7 Identificación del protocolo ClearGate FIX

ClearGate implementa una funcionalidad adicional que permite que ambas partes se pongan de acuerdo en la versión de ClearGate FIX que van a usar.

No debe confundirse la versión del protocolo FIX (en este caso "4.4"), con la versión del protocolo ClearGate FIX ("C1.9" en esta edición).

El protocolo ClearGate FIX es la acotación y adaptación que la ECC realiza del estándar para cubrir las necesidades concretas de su negocio. Todas las acotaciones y adaptaciones realizadas por la ECC se han llevado a cabo siguiendo las recomendaciones especificadas por el propio estándar.

Podrá existir más de una versión del protocolo ClearGate FIX dentro de una misma versión de FIX. Asimismo, podrá darse que una versión del protocolo ClearGate FIX sea conforme con más de una versión del protocolo FIX.

En la configuración de usuarios ClearGate se puede indicar cuál es la versión del protocolo ClearGate FIX que proporcionará ClearGate por defecto. El cliente también puede indicar en el campo

ProprietaryFixProtocolVersion, del mensaje Logon, la versión del protocolo ClearGate FIX que desea usar. Este campo es una adición de la ECC y se ha implementado como opcional.

Si la versión solicitada por el cliente no está disponible en el servidor ClearGate en uso, éste responde con un mensaje Logout con el correspondiente mensaje explicativo.

3. Sesión FIX

3.1 Introducción

El nivel de sesión FIX garantiza la entrega de mensajes, entre ambas partes, de forma completa y sin errores. ClearGate implementa la mayoría de las funcionalidades del nivel de sesión definidas en el estándar FIX 4.4.

3.2 Sesión FIX y sesión de comunicación

Tal y como se explica en el estándar, existen dos tipos de sesión:

- **Sesión de comunicación.** Se inicia cuando una petición de inicio de sesión (mensaje Logon) es aceptada. Termina cuando finaliza la comunicación, preferiblemente con el intercambio de mensajes Logout
- **Sesión FIX.** Está compuesta por un conjunto de mensajes bidireccionales identificados por una secuencia de números consecutivos. Una sesión FIX se inicia cuando la secuencia de números de ambas partes se reinicia con el valor 1. No existe una forma explícita de finalizar una sesión FIX; una sesión se acaba cuando se inicia una nueva. Una sesión FIX puede abarcar más de una sesión de comunicación

Además de los dos tipos de sesión enumerados, debe considerarse el concepto de sesión de Cámara. Una sesión de Cámara empieza cada día en el momento en que el servidor ClearGate, siguiendo el procedimiento definido por la ECC, carga de nuevo los datos y acepta conexiones para dicha sesión de Cámara.

El cliente debe iniciar una nueva sesión FIX en la primera conexión de la sesión de Cámara.

Dado que ClearGate no soporta el servicio 24 horas, el campo ResetSeqNumFlag no es necesario en el mensaje Logon.

3.3 Identificación de la sesión FIX

Una vez se ha establecido una sesión de comunicación, ClearGate identifica la sesión FIX asociada a partir de cuatro campos del mensaje de Logon enviado por el iniciador:

- SenderCompID
- SenderSubID
- TargetCompID
- TargetSubID

SenderCompID identifica al miembro y SenderSubID identifica al operador. TargetCompID junto con TargetSubID identifican al Grupo de contratos de liquidación..

No puede existir más de una sesión FIX concurrente con los mismos valores en estos cuatro campos.

Los campos SenderCompID, SenderSubID, TargetCompID y TargetSubID están presentes en todos los mensajes FIX. Todos los mensajes pertenecientes a una misma sesión FIX deben mantener los mismos valores en estos campos. Si se recibe un mensaje cuyos valores no se corresponden con los de la sesión, será rechazado con un mensaje Reject.

Hay que tener en cuenta que los valores de estos campos se invierten, respecto a los enviados por el cliente, cuando el mensaje es enviado por ClearGate. Supongamos que el operador “001” perteneciente al miembro “A001” tiene establecida una sesión con el grupo de contratos de Derivados Financieros de la ECC. Los valores serán los que se muestran a continuación:

Mensaje del cliente a ClearGate:

- SenderCompID = “A001”
- SenderSubID = “001”
- TargetCompID = “XMEF”
- TargetSubID = “C2” *

Mensaje de ClearGate al cliente:

- SenderCompID = “XMEF”
- SenderSubID = “C2”
- TargetCompID = “A001”
- TargetSubID = “001”

Si un mismo cliente desea trabajar con dos cámaras simultáneamente, o desea realizar dos conexiones diferentes con la misma cámara, deberá establecer varias conexiones tal y como se explica en 3.4.

3.4 Software cliente y sesiones FIX

Un cliente de ClearGate es un desarrollo software que se conecta a la ECC mediante el servidor ClearGate.

Tal y como se vio en 3.3, una sesión FIX queda limitada a un operador y una cámara. Un cliente podrá establecer varias sesiones FIX simultáneas, para acceder a más de una cámara u operar en una cámara con varios códigos de operador.

Un servidor ClearGate puede dar servicio a varias sesiones simultáneamente, ya sean de un mismo cliente o de varios.

Cuando un cliente FIX intenta conectar con una cámara que no está disponible, su mensaje de Logon es contestado con un mensaje Logout con la explicación pertinente.

3.5 Sincronización de la sesión FIX

Al iniciar una sesión de comunicación (envío de mensaje Logon), el cliente puede optar por iniciar una nueva sesión FIX o continuar con una sesión previa de la misma sesión de cámara. A continuación se describe el procedimiento a seguir en cada caso.

- **Inicio de nueva sesión FIX.** Para iniciar una nueva sesión FIX se deberá usar el número 1 en el campo MsgSeqNum del mensaje Logon.
- **Continuación de sesión FIX previa.** Para continuar una sesión FIX previa se deberá usar en el campo MsgSeqNum el número consecutivo al usado en el último mensaje de la sesión que se va a continuar.

Téngase en cuenta que al iniciar una nueva sesión FIX, la sesión iniciada sustituye a la anterior y por tanto esta última no podrá ser continuada posteriormente.

Una aplicación cliente sólo puede continuar con una sesión FIX previa si se conecta al mismo servidor ClearGate. En caso de que deba conectarse a otro servidor ClearGate sólo podrá iniciar una nueva sesión FIX.

* Para más detalle sobre los códigos de cámara, véase Tabla 11 en documento “Tablas de Codificación”

Cuando se envía un mensaje Logon con `MsgSeqNum` diferente de 1, el número enviado puede no coincidir con el número que ClearGate estaba esperando para esa sesión (ClearGate espera el número consecutivo al número del último mensaje recibido de dicha sesión). A continuación se presentan las diferentes situaciones que se pueden dar respecto al número de secuencia del mensaje Logon y el mensaje esperado por ClearGate.

- **MsgSeqNum igual al número esperado por ClearGate.** No hay discrepancia y ClearGate acepta la conexión.
- **MsgSeqNum inferior al número esperado por ClearGate.** ClearGate rechaza la conexión con un mensaje Logout con número de secuencia igual a 1. En este caso la conexión no puede ser aceptada ya que el número de secuencia usado en el mensaje Logon ya fue usado previamente por otro mensaje de la misma sesión.
- **MsgSeqNum superior al número esperado por ClearGate.** ClearGate acepta la conexión, y solicita el envío de los mensajes que faltan entre el número de secuencia que el estaba esperando y el número usado por el cliente. La solicitud de envío de dichos mensajes se realizará con uno de los siguientes mecanismos:
 - **Mensaje Logon con NextExpectedMsgSeqNum.** Este método se usará siempre y cuando el cliente haya usado el campo `NextExpectedMsgSeqNum` en su mensaje Logon
 - **Mensaje Resend Request.** En el caso que el cliente no haya usado el campo `NextExpectedMsgSeqNum` (mensaje Logon), el servidor tampoco hará uso de él. En este caso el servidor, después del mensaje de Logon de respuesta, notificará al cliente el error de secuencia mediante el mensaje Resend Request

Cuando se continúa con una sesión FIX es aconsejable usar el campo `NextExpectedMsgSeqNum` (mensaje Logon), indicando el número de mensaje esperado, para facilitar la sincronización entre ambas partes. De esta forma el servidor puede detectar si el cliente dejó de recibir alguno de los mensajes, y proceder a su reenvío. Cuando no se especifica este valor, el servidor continúa el envío de mensajes a partir del último número de secuencia enviado.

ClearGate usa el campo `NextExpectedMsgSeqNum` en el mensaje Logon de contestación, siempre y cuando el cliente lo haya usado en su mensaje de inicio.

ClearGate sólo usa el mensaje Resend Request tal y como se ha descrito anteriormente, es decir, inmediatamente después de una petición de Logon. En cualquier otro caso, cuando se produzca discrepancia entre el número de secuencia esperado y el recibido, ClearGate asume que existe algún problema grave y finaliza la conexión con el envío de un mensaje Logout.

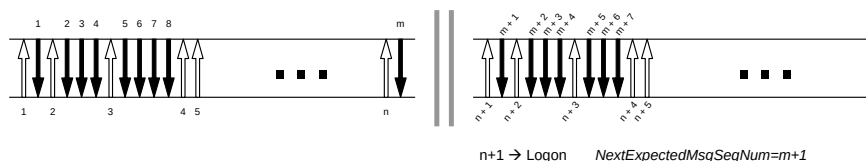
Cuando ClearGate solicita al cliente un número de secuencia inferior al que éste proponía, queda a decisión del cliente repetir los mismos mensajes que envió con los números de secuencia que faltan, enviar uno o más GapFills, o simplemente darles un nuevo uso. En cualquier caso el cliente debe tener en cuenta que los mensajes serán procesados por ClearGate en el momento de su recepción como cualquier otro mensaje. Se recomienda implementar controles para no enviar órdenes que podían haber quedado obsoletas durante el periodo que duró la desconexión.

Al igual que ClearGate, el cliente sólo puede hacer uso del mensaje Resend Request en el caso de detectar que el mensaje Logon que le ha enviado el servidor está fuera de secuencia y no contiene el campo `NextExpectedMsgSeqNum`. Si ClearGate recibe un mensaje Resend Request en cualquier otro momento será considerado como un error y procederá a finalizar la conexión.

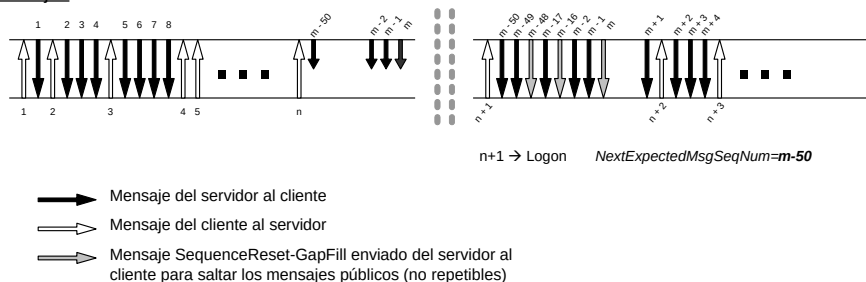
Independientemente de si fue solicitada mediante el mensaje Resend Request o con el campo `NextExpectedMsgSeqNum` del mensaje Logon, la repetición de mensajes por parte del servidor está limitada a los mensajes pertenecientes a la Sesión de Cámara en curso. El servidor repite todos los mensajes solicitados, excepto los de información pública. Dado el volumen que puede representar la información pública, ésta no es repetible y será sustituida por mensajes GapFill. El cliente debe usar

las funcionalidades de consulta disponibles para ponerse al día de esta información. Consúltense el apartado 3.6 para más información al respecto.

A) Se continua la sesión FIX sin petición de repetición de mensajes



B) Se continua la sesión FIX con petición de mensajes



- Escenarios de continuación de una sesión FIX -

Cuando un inicio de sesión de comunicaciones es rechazado, el servidor responde con un mensaje Logout. La aplicación cliente debe tener en cuenta que este mensaje Logout puede venir con número de secuencia 1, o con el número de secuencia correspondiente a su última comunicación. El número de secuencia usado por el cliente en su mensaje Logon no es tenido en cuenta por ClearGate y por tanto no altera el número de secuencia esperado en próximas comunicaciones.

3.6 Sincronización a nivel de aplicación

Cuando un cliente inicia una sesión de comunicación (mensaje Logon aceptado), recibe un conjunto de información relacionada con la Sesión de Cámara actual. El conjunto de información a recibir depende de si se trata del inicio de una nueva sesión o una reconexión a una sesión FIX existente.

- **Inicio de una sesión FIX.** El cliente recibe todos los mensajes privados, no asociados a suscripciones, correspondientes a toda la sesión de Cámara en curso. El total o parte de estos mensajes podrían haber sido recibidos previamente en una sesión FIX anterior.
- **Reconexión a una sesión FIX existente.** El cliente recibe todos los mensajes privados, no asociados a suscripciones, correspondientes a la sesión de Cámara en curso y que no haya recibido anteriormente. En este caso ClearGate asegura que no se produce ninguna duplicidad de mensaje (excepto cuando es solicitada explícitamente).

Los mensajes que provienen de una solicitud explícita de repetición (solicitada con un mensaje Resend Request o un mensaje Logon con NextExpectedMsgSeqNum inferior al último mensaje recibido) contendrán el valor "Y" en el campo PossDupFlag indicando dicha situación. Este caso no aplica cuando se trata de una nueva sesión FIX (inicio de la sesión con número de secuencia 1).

En ambos casos, tanto la información privada asociada a suscripciones, como la información pública, puede ser solicitada mediante los mensajes que implementan las funcionalidades correspondientes.

Debe tenerse en cuenta que cualquier suscripción a información es cancelada al finalizarse la sesión de comunicación. Si al reconectar una sesión FIX se desea este servicio, debe volver a solicitarse.

Los mensajes privados no asociados a suscripciones que se mencionan en este apartado se corresponden con los siguientes mensajes:

- News
- Confirmation con SecondaryConfirmStatus [5683] con valor distinto a "P" (Pending)
- Position Maintenance Report con PosTransType = 4 (Delivery)

3.7 Alta disponibilidad

Para mejorar la disponibilidad de acceso a la ECC se dispondrá de varias instancias del servidor ClearGate ejecutándose en equipos diferentes en las instalaciones del miembro.

Todas las instancias de ClearGate estarán conectadas con los sistemas centrales de la ECC. Por tanto, dispondrán de toda la información necesaria.

Cuando falla el servidor ClearGate, el cliente puede continuar trabajando con otro ClearGate. En este caso, el cliente debe iniciar una nueva sesión FIX (empezando por el número de secuencia 1), ya que el estado de las sesiones no se replica entre los diferentes servidores ClearGate. El cliente debe realizar los procesos necesarios para sincronizarse a nivel de aplicación (ver 3.5).

Cuando falla una aplicación cliente que tenía establecida una sesión FIX, la aplicación cliente puede reiniciarse en otro equipo que continúe la misma sesión (usando el mismo servidor ClearGate). En este caso, es responsabilidad del cliente recuperar el estado de la aplicación fallida. Si no fuese posible recuperar este estado, lo más recomendable es iniciar una nueva sesión FIX, si bien es posible mantener la sesión actual y consultar a nivel de aplicación todos los datos necesarios para reconstruir el estado.

3.8 Campo PossResend

La implementación FIX de la ECC no permite el uso del campo PossResend (ver 2.3 para más información sobre campos no soportados).

3.9 Mensajes administrativos que el cliente FIX debe gestionar

El cliente FIX debe ser capaz de gestionar todos los mensajes administrativos tal y como se describen en este capítulo, incluyendo el mensaje Resend Request. Es decisión del cliente el responder a éste mediante el reenvío de mensajes o simplemente enviando un GapFill (mensaje Sequence Reset).

3.10 Lista de mensajes

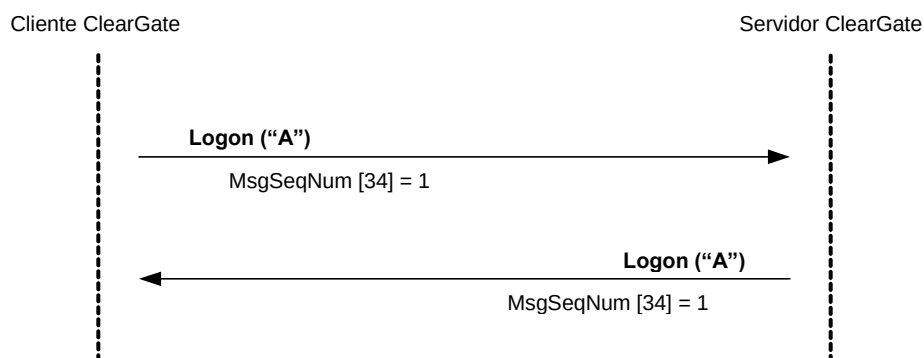
La funcionalidad de nivel de sesión se implementa en FIX 4.4 mediante siete mensajes administrativos. Todos ellos están completamente soportados por el protocolo FIX de ClearGate.

Mensaje	Descripción
Logon (Msg Type = A)	Solicitud o confirmación del inicio de una sesión de comunicación
Logout (Msg Type = 5)	Solicitud o confirmación de la finalización de una sesión de comunicación
Heartbeat (Msg Type = 0)	Notificación periódica de que la conexión permanece viva
Test Request (Msg Type = 1)	Solicitud de envío de un mensaje Heartbeat para confirmar que la conexión permanece viva
Resend Request (Msg Type = 2)	Solicitud de reenvío de mensajes que no han sido recibidos
Sequence Reset (Msg Type = 4)	Rellenar un hueco de mensajes restableciendo un número de secuencia superior
Reject (Msg Type = 3)	Rechazo de mensaje a nivel de sesión

3.11 Flujo de mensajes

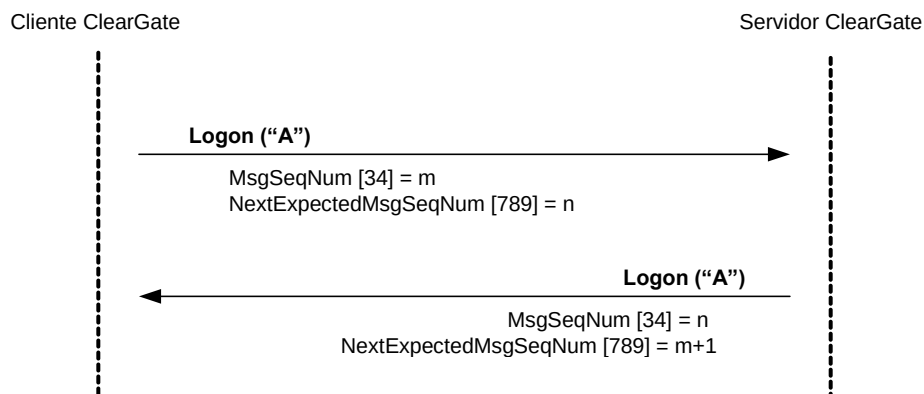
Inicio de sesión de comunicación e inicio de sesión FIX

Una petición de inicio de sesión de comunicación (mensaje Logon) aceptada, es contestada por el receptor con otro mensaje Logon. El iniciador no debe enviar ningún otro mensaje hasta que haya recibido esta confirmación de aceptación.



Inicio de sesión de comunicación y continuación de sesión FIX

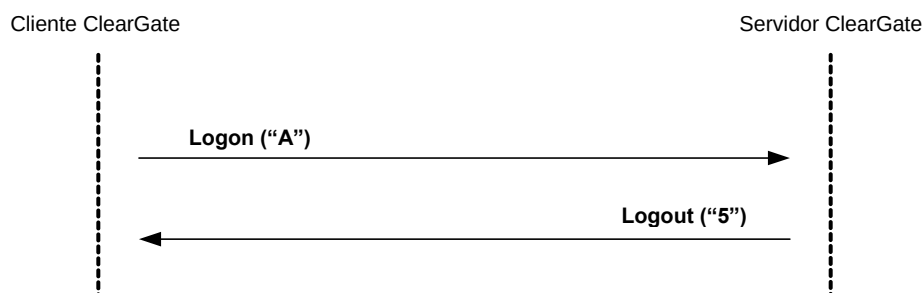
Una petición de inicio de sesión de comunicación (mensaje Logon) aceptada, es contestada por el receptor con otro mensaje Logon. El iniciador no debe enviar ningún otro mensaje hasta que haya recibido esta confirmación de aceptación.



Inicio de sesión de comunicación rechazado

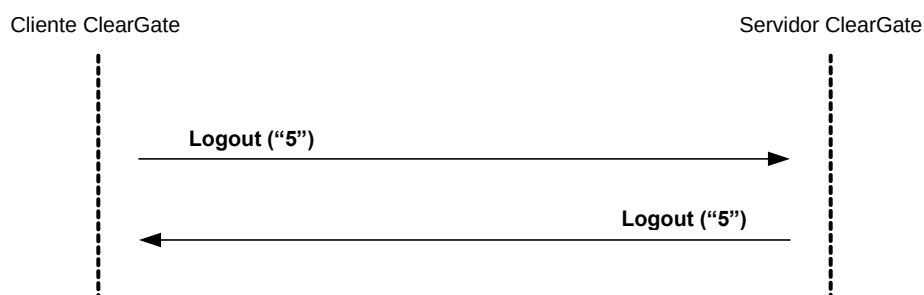
Cuando un inicio de sesión de comunicación (mensaje Logon) no es aceptado, ClearGate contestará con un mensaje Logout.

Para más detalle sobre el comportamiento de los números de secuencia de ambas partes consultar el apartado 3.5.



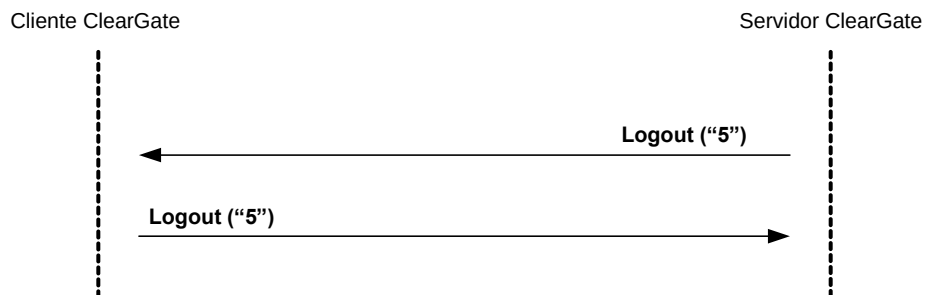
Finalización de la sesión de comunicación iniciada por el emisor

El cliente puede, en cualquier momento, finalizar la sesión de comunicación mediante el envío de un mensaje Logout.

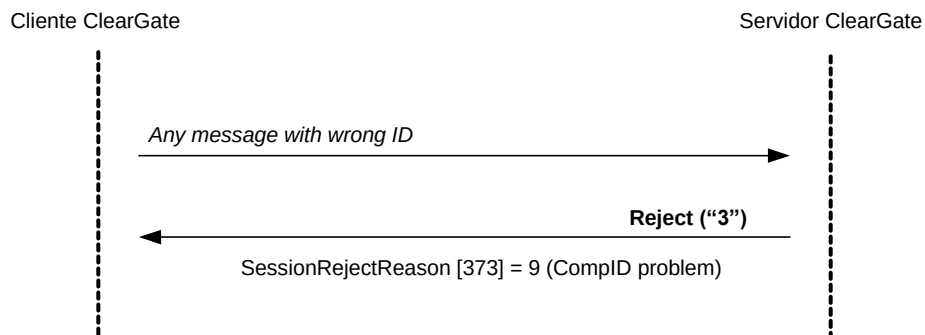


Finalización de la sesión de comunicación iniciada por el receptor

En situaciones excepcionales el servidor puede terminar la sesión de comunicación mediante un mensaje Logout.

**Envío de mensaje con los campos de identificación de sesión (SenderCompID, SenderSubID, TargetCompID y TargetSubID) con valores diferentes a los asociados a la sesión FIX actual**

Todos los mensajes asociados a una sesión FIX deben incluir los mismos valores identificadores de sesión (SenderCompID, SenderSubID, TargetCompID y TargetSubID). Si un mensaje difiere con los valores indicados en el Logon de la sesión, es rechazado mediante con Reject.



3.12 Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4

- Se ha añadido el campo opcional `ProprietaryFixProtocolVersion` al mensaje Logon para identificar la versión del protocolo particular de la ECC
- Se ha añadido el campo opcional `FixEngineName` al mensaje Logon. Contiene un texto descriptivo de la aplicación software
- Cuando una petición de inicio de sesión (mensaje Logon) es rechazada, el receptor (ECC) siempre enviará un mensaje Logout como contestación
- Los campos `SenderSubID` y `TargetSubID` en la cabecera de los mensajes (Standard Message Header) dejan de ser opcionales y pasan a ser requeridos
- El campo `PossResend` no está soportado
- No se soporta el método de encriptación de FIX
- ClearGate sólo acepta el mensaje `ResendRequest` después del mensaje Logon
- Los valores válidos del campo `ResetSeqNumFlag` del mensaje Logon quedan limitados al valor "N"

3.13 Definición de mensajes

3.13.1 Standard Message Header

Cabecera que contienen todos los mensajes FIX.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
8	BeginString	S	FIX.4.4	String	Indica el inicio de un nuevo mensaje. Contiene la versión del protocolo FIX. Siempre es el primer campo del mensaje
9	BodyLength	S		Int	Longitud del mensaje en bytes, desde la finalización de este campo hasta, e incluyendo, el delimitador previo al campo CheckSum. Siempre es el segundo campo del mensaje
35	MsgType	S	Todos los tipos de mensajes soportados por la ECC	String	Identifica el tipo de mensaje. Siempre es el tercer campo del mensaje
49	SenderCompID	S		String	Identificador de la entidad que envía el mensaje. Cuando el mensaje es enviado por ClearGate: - Si la sesión FIX está establecida con el Grupo de Contratos de Crypto, tendrá "BMCL" - Si la sesión de FIX no está establecida con el Grupo de Contratos de Crypto, tendrá "XMEF" Debe contener el código del miembro en los mensajes enviados por la aplicación cliente
56	TargetCompID	S		String	Identificador de la entidad a la que va destinado el mensaje. Cuando el mensaje es enviado a ClearGate: - Si la sesión FIX está establecida con el Grupo de Contratos de Crypto, tendrá "BMCL" - Si la sesión de FIX no está establecida con el Grupo de Contratos de Crypto, tendrá "XMEF" Contiene el código del miembro en los mensajes enviados por ClearGate
34	MsgSeqNum	S		Int	Número de secuencia del mensaje dentro de la sesión FIX actual
50	SenderSubID	S*	Para más detalle sobre los códigos de grupos de contratos, véase Tabla 11 en documento "Tablas de Codificación"	String	En los mensajes enviados por ClearGate contiene el código asignado al Grupo de contratos con el que se estableció la conexión. En mensajes enviados a ClearGate debe contener el código de operador con el que se inició la sesión FIX

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
57	TargetSubID	S*	Para más detalle sobre los códigos de grupos de contratos, véase Tabla 11 en documento "Tablas de Codificación"	String	En los mensajes enviados por ClearGate contiene el código de operador al que va destinado. En mensajes enviados a ClearGate debe contener el código de Grupo de contratos con el que se estableció la conexión
43	PossDupFlag	N	N = Envío del mensaje original (valor por defecto) Y = Posible duplicado	Boolean	Indica si se trata de la primera vez, dentro de una sesión FIX, que se envía un mensaje ("N") o si se está enviando de nuevo el mismo mensaje ("Y"), ya sea por una petición explícita de la otra parte o por la duda de la recepción del mensaje original
52	SendingTime	S		UTC Timestamp	Hora de envío del mensaje
122	OrigSendingTime	N		UTC Timestamp	Hora en que se envió el mensaje original. Requerido en un reenvío. Un mensaje es considerado un reenvío si el campo PossDupFlag = "Y" y el campo MsgType no es "4" (Sequence Reset)

3.13.2 Standard Message Trailer

Parte final de todos los mensajes FIX.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
10	Checksum	S		String(3)	Checksum del mensaje, calculado según lo descrito en el estándar. Siempre es el último campo del mensaje y su longitud es exactamente de 3 bytes

3.13.3 Logon (Msg Type = A)

El mensaje Logon es usado para iniciar una sesión por el cliente y para aceptarla por el servidor.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = A		
98	EncryptMethod	S	0 = None	Int	Ignorado por ClearGate
108	HeartBtInt	S	>= 5	Int	Intervalo de envío de mensajes de verificación de conexión (mensaje Heartbeat) expresado en segundos.
141	ResetSeqNumFlag	N	N	Boolean	Sólo permite el valor "N", ya que en la implementación del protocolo no es necesario
789	NextExpectedMsgSeqNum	N		Int	Indica el siguiente número de secuencia (MsgSeqNum) que se espera recibir
464	TestMessageIndicator	N	Y = Test N = Producción	Boolean	Indica cuando se trata de una sesión de pruebas o de producción. El cliente puede usarlo opcionalmente para indicar si desea conectarse a producción o a pruebas. El inicio de sesión se acepta si ClearGate atiende ese entorno. Si el cliente no indica nada, no se tiene en cuenta este parámetro y ClearGate siempre informa este campo.
553	Username	N		String	Identificador de usuario asignado por la ECC. Requerido cuando el mensaje es enviado por la aplicación cliente. Actualmente está formado por la combinación de código de miembro y de operador asignados por la ECC
554	Password	N		String	Password de usuario. Requerido cuando el mensaje es enviado por la aplicación cliente
5680*	ProprietaryFixProtocolVersion	N	C1.9	String	Identificación exacta de la versión del protocolo usado y esperado por el cliente. ClearGate siempre cumplimenta este campo, independientemente de si la aplicación cliente lo informó o no.
5679*	FixEngineName	N		String	Campo opcional, donde el cliente puede incluir la denominación del software usado para la conexión FIX. Sólo usado a modo informativo. ClearGate nunca envía este campo
	Standard Trailer	S			

3.13.4 Logout (Msg Type = 5)

El mensaje Logout es usado por ambas partes tanto para solicitar o notificar la finalización de la sesión de comunicación como para aceptar dicha solicitud.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = 5		
58	Text	N		String	Texto explicativo
	Standard Trailer	S			

3.13.5 Heartbeat (Msg Type = 0)

El mensaje Heartbeat es usado por ambas partes para indicar que la conexión se mantiene activa.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = 0		
112	TestReqID	N		String	Si el mensaje es la respuesta a un mensaje Test Request, debe contener el mismo valor que contenía el campo TestReqID original. En cualquier otro caso, este campo debe omitirse.
	Standard Trailer	S			

3.13.6 Test Request (Msg Type = 1)

El mensaje Test Request es usado por ambas partes para solicitar el envío de un mensaje Heartbeat.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = 1		
112	TestReqID	S		String	Identificador de la petición. Debe ser incluido en el mensaje Heartbeat de respuesta
	Standard Trailer	S			

3.13.7 Resend Request (Msg Type = 2)

El mensaje Resend Request puede ser usado por ambas partes para solicitar el reenvío de mensajes que no se han recibido.

ClearGate sólo hace uso de esta funcionalidad después de un mensaje Logon. En cualquier otro caso la recepción de un mensaje fuera de secuencia es considerado un error grave y se cierra la conexión.

ClearGate sólo acepta el envío de este tipo de mensaje inmediatamente después de un mensaje Logon en el que no se haya especificado el campo NextExpectedMsgSeqNum.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = 2		
7	BeginSeqNo	S	Número de secuencia válido	Int	Número de secuencia del primer mensaje del rango de mensajes del que se solicita el reenvío. Debe contener un valor inferior al último número de secuencia recibido
16	EndSeqNo	S	0 = Infinito Número de secuencia válido	Int	Número de secuencia del último mensaje del rango de mensajes del que se solicita el reenvío. Debe contener un valor inferior al último número de secuencia recibido. Si la petición es únicamente de un mensaje EndSeqNo = BeginSeqNo Si la petición es de todos los mensajes a partir de uno dado EndSeqNo = 0
	Standard Trailer	S			

3.13.8 Sequence Reset (Msg Type = 4)

El mensaje Sequence Reset es usado por ambas partes para rellenar un hueco en los mensajes que se están enviando, mediante la reasignación del número de secuencia (ver 3.5). El estándar FIX permite otros usos de este mensaje que no están soportados por la ECC (nótese que el campo GapFillFlag se ha hecho requerido y siempre debe contener el valor "Y").

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = 4		Téngase presente que PossDupFlag debe contener el valor "Y"
123	GapFillFlag	S*	Y = Indica que el mensaje es para rellenar un hueco	Boolean	Para más información consultar la documento de especificaciones de FIX 4.4
36	NewSeqNo	S		Int	Número de secuencia del mensaje que se enviará a continuación
	Standard Trailer	S			

3.13.9 Reject (Msg Type = 3)

El mensaje Reject es usado por ClearGate para rechazar un mensaje que no cumpla el protocolo FIX especificado por la ECC.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = 3		
45	RefSeqNum	S		Int	Número de secuencia del mensaje rechazado
373	SessionRejectReason	N	0 Invalid tag number 1 Required tag missing 2 Tag not defined for this message type 3 Undefined Tag 4 Tag specified without a value 5 Value is incorrect (out of range) for this tag 6 Incorrect data format for value 9 CompID problem 11 Invalid MsgType 13 Tag appears more than once 14 Tag specified out of required order 15 Repeating group fields out of order 16 Incorrect NumInGroup count for repeating group 17 Non "data" value includes field delimiter (SOH character) 99 Other	Int	Código que indica el motivo de rechazo
58	Text	N		String	Contiene una descripción más específica de la razón de rechazo
	Standard Trailer	S			

4. Convenciones generales en los mensajes de aplicación

4.1 Identificación de operaciones

4.1.1 SecondaryExecID

El campo SecondaryExecID contiene el número de registro de negociación. Este es el código asignado por el sistema central de negociación a la operación o aplicación referenciada en el mensaje. El periodo en que se garantiza la unicidad de este campo viene determinado por cada sistema central de negociación.

4.1.2 SecondaryTradeReportID

El campo SecondaryTradeReportID contiene el número de registro de liquidación. Este es el código asignado por el sistema central de liquidación de la ECC a la operación referenciada en el mensaje. Ambas partes de una operación reciben el mismo identificador.

Cada operación del sistema de negociación tiene su correspondiente operación del sistema de liquidación, sin embargo algunos tipos de operaciones son específicos del sistema de liquidación, como las operaciones de asignaciones, operaciones de traspaso, operaciones de ejercicio, etc.

Los campos SecondaryTradeReportRefID y TrdMatchID también contienen un número de registro de liquidación y son usados para referirse a la operación original e inicial respectivamente.

4.2 Bloque Parties

El bloque Parties (o el bloque NestedParties) es usado en varios mensajes de aplicación para identificar a las partes que intervienen en la transacción.

En la definición detallada de los mensajes que contienen este bloque, se incorpora el bloque tal y como se muestra a continuación. La lista de valores posibles está restringida según las características particulares del mensaje.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Start <Parties>				
453	NoPartyIDs	N		NumInGroup	
→ 448	PartyID	N		String	Código de miembro asignado por la ECC
→ 447	PartyIDSource	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	Indica la codificación seguida en el campo PartyID. Siempre se usa codificación propia de la ECC
→ 452	PartyRole	N		Int	Indica el rol que toma la parte referenciada en el campo PartyID
	End <Parties>				

En los mensajes de este manual se usan varios roles. La interpretación del campo PartyID depende del valor PartyRole tal y como se explica a continuación:

- **1 (Executing Firm)**
 - **Envío.** El protocolo implementado no permite el uso de este rol en envíos
 - **Recepción.** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con el código de miembro origen del Give-up del que se está tratando
- **3 (Give-out Internal Reference)**

- **Envío.** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con la referencia de Give-out asignada por el Miembro Origen para uso interno
- **Recepción.** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con la referencia interna de Give-out
- **4 (Clearing Firm)**
 - **Envío.** Usado como criterio de selección. Cuando se especifica este valor, se está indicando que se desea información relacionada con todas las cuentas que son liquidadas por el miembro que se indica en el campo PartyID
 - **Recepción.** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con el código de miembro que actúa como liquidador de la cuenta de la que se está tratando
- **12 (Executing Trader)**
 - **Envío.** El protocolo implementado no permite el uso de este rol en envíos
 - **Recepción.** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con el usuario que solicitó el traspaso o Give-up al que se refiere en el mensaje
- **13 (Order Origination Firm)**
 - **Envío.** Usado como criterio de selección. Cuando se especifica este valor, se está restringiendo la solicitud a las cuentas que pertenecen al miembro al que se refiere en el campo PartyID
 - **Recepción.** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con el código del miembro al que pertenece la cuenta de la que se está tratando
- **14 (Give-up Clearing Firm)**
 - **Envío.** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con el código de miembro destino del Give-up solicitado
 - **Recepción.** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con el código de miembro destino del Give-up del que se está tratando
- **24 (Give-up Reference)**
 - **Envío.** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con la referencia de Give-up
 - **Recepción.** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con la referencia de Give-up

- **33 (Give-up Mnemonic)**
 - **Envío.** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con el mnemotécnico de Give-out definido por el Miembro Origen o con el mnemotécnico de Give-in definido por el Miembro Destino
 - **Recepción.** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con el mnemotécnico de Give-Out o de Give-in
- **35 (Liquidity Provider)**
 - **Código** Proveedor de liquidez en xRolling sobre acciones
- **36 (Clearing Broker Trader)**
 - **Envío.** El protocolo implementado no permite el uso de este rol en envíos
 - **Recepción.** Cuando se especifica este valor, el campo PartyID se corresponde con el usuario del Miembro Destino que aceptó o rechazó el Give-up
- **38 (Position account)**
 - Usado en la mensajería de liquidaciones y cálculo de garantías
- **60 (Introducing Broker)**
 - Miembro demandante de xRolling sobre acciones
- **100 (Margin account)**
 - Usado en la mensajería de liquidaciones y cálculo de garantías
- **101 (Collateral account)**
 - Usado en la mensajería de liquidaciones y cálculo de garantías

4.3 Symbol y SecurityID

El significado de los campos Symbol y SecurityID de los bloques Instrument, UnderlyingInstrument y InstrumentLeg, varía dependiendo de cómo haya sido configurado el usuario asociado al cliente FIX.

Las dos posibles configuraciones son:

Tipo de Configuración	Significado de Symbol	Significado de SecurityID
Por contrato	Código de contrato	Activo subyacente del contrato (véase Tabla 14 en documento "Tablas de Codificación")
Por activo	Activo subyacente del contrato (véase Tabla 14 en documento "Tablas de Codificación")	Código de contrato

Hay que tener presente que todos los apartados y mensajes descritos en este manual se refieren al tipo de configuración "Por contrato".

4.4 Bloque Instrument

En algunas peticiones, el cliente FIX puede especificar criterios de selección de contratos. En estos casos, sólo se devuelve la información relacionada con los contratos que cumplen estos criterios. Los posibles criterios de selección se corresponden con campos del bloque Instrument.

En la siguiente tabla se indican cuáles son los campos aceptados por la ECC y el tipo de petición en que pueden intervenir.

Campo	Significado	Petición de información de contratos	Petición de información de precios
SecurityID	Activo Subyacente del contrato	X	X
Symbol	Código de contrato	-	X

En los siguientes subapartados se explica detalladamente el uso de estos campos.

4.4.1 Activo subyacente (campo SecurityID)

Este código identifica el activo subyacente de un contrato (véase Tabla 14 en documento “Tablas de Codificación”).

4.4.2 Código de contrato (campo Symbol)

Éste es el más selectivo de los criterios, ya que refiere a un contrato específico. Sólo puede ser usado en la petición de información de contratos. Cuando no se desee especificar un contrato concreto y usar el resto de criterios, este campo debe cumplimentarse con el valor “[N/A]”, tal y como se indica en las especificaciones del estándar FIX. Este campo es de uso obligatorio en el bloque Instrument.

4.5 Formato de Error (Campo Text)

El campo Text es usado en varios mensajes para incluir la descripción de un error. En esos casos el formato del campo es:

%MFsXXXXXX-Texto descriptivo

Donde **s** indica la severidad del error (I: information, W: warning, E: Error), **XXXXXX** es el código de error, al cual le sigue un texto explicativo. El texto “%MF” es fijo.

5. Mensajes Genéricos del Nivel de Aplicación

5.1 Introducción

En este capítulo se presentan algunos mensajes del nivel de aplicación destinados a cubrir dos funcionalidades: el control del estado de la comunicación y el rechazo de mensajes por parte de ClearGate.

5.2 Estado de la comunicación

ClearGate incluye un mecanismo para informar a la aplicación cliente sobre el estado de la comunicación entre el propio ClearGate y los sistemas centrales. Esta funcionalidad se implementa mediante los mensajes Network Status de FIX.

La solicitud puede ser realizada de forma puntual o usando el método de suscripción.

5.3 Cambio de password de conexión al ClearGate

Mediante esta funcionalidad se permite que la aplicación cliente puede cambiar su password de conexión al ClearGate.

La nueva password es válida para todas las futuras sesiones de comunicaciones que se establezcan.

5.4 Rechazo de mensajes de aplicación

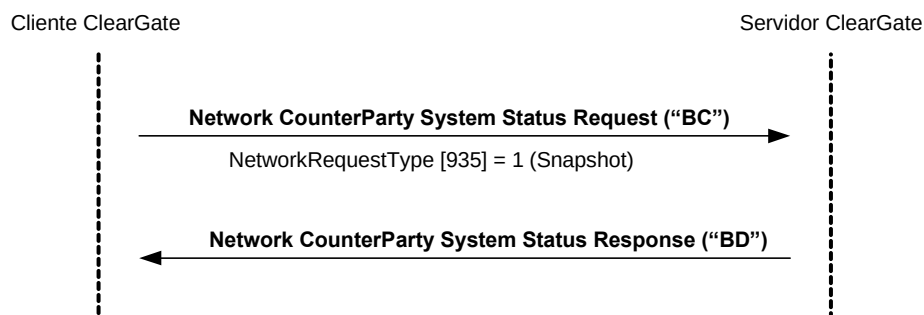
Cuando ClearGate recibe un mensaje soportado y sintácticamente correcto, en una situación no soportada, y no existe un mensaje específico de rechazo, se usa el mensaje genérico Business Message Reject. En particular es usado para el rechazo de los mensajes Network Counterparty System Status Request y Confirmation Ack.

5.5 Lista de mensajes

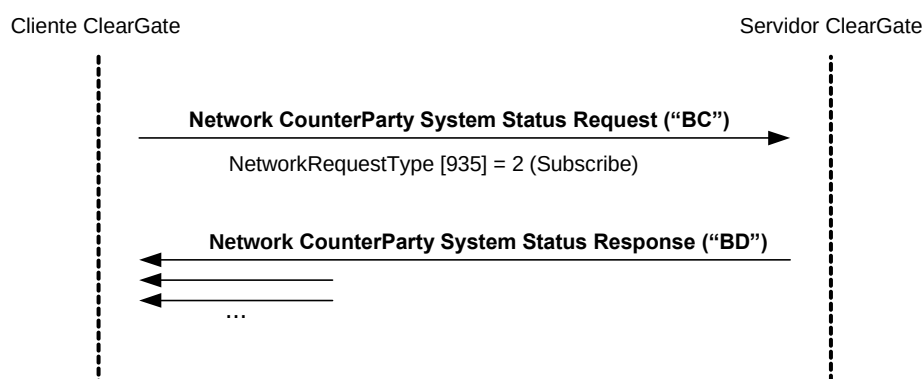
Mensaje	Descripción
Network Counterparty System Status Request (Msg Type = BC)	Solicitud del estado de conexión entre ClearGate y los sistemas centrales
Network Counterparty System Status Response (Msg Type = BD)	Informe del estado de conexión entre ClearGate y los sistemas centrales
User Request (Msg Type = BE)	Solicitud de cambio de la password de conexión entre la aplicación cliente y ClearGate
User Response (Msg Type = BF)	Informe del estado de la solicitud de cambio de password
Business Message Reject (MsgType = j)	Rechazo de mensaje a nivel de aplicación (usado en caso de que no exista un mensaje específico)

5.6 Flujo de mensajes

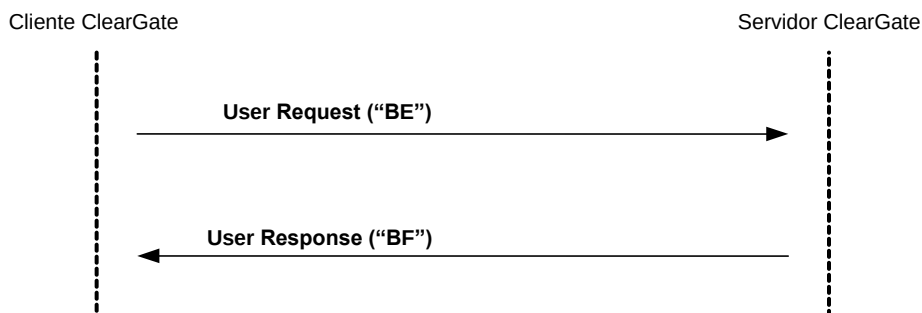
Consulta puntual del estado de la conexión



Suscripción al estado de la conexión



Cambio de password de conexión al ClearGate



5.7 Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4

En el mensaje User Request, los campos Password [554] y NewPassword [925] han pasado a ser requeridos.

5.8 Definición de mensajes

5.8.1 Network Counterparty System Status Request (Msg Type = BC)

Mensaje enviado por la aplicación cliente para solicitar información sobre el estado de conexión entre ClearGate y los sistemas centrales de la ECC.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = BC		
935	NetworkRequestType	S	1 = Snapshot 2 = Subscribe 4 = Stop subscribing	Int	
933	NetworkRequestID	S		String(10)	Identificador del mensaje
	Standard Trailer	S			

5.8.2 Network Counterparty System Status Response (Msg Type = BD)

Mensaje enviado por ClearGate como respuesta a un mensaje Network Counterparty System Status Request Message.

Contiene información acerca del estado de la conexión de ClearGate con los sistemas centrales de la ECC.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = BD		
937	NetworkStatusResponseType	S	1 = Full	Int	
933	NetworkRequestID	S		String	Identificador del mensaje Network Counterparty System Status Request
932	NetworkResponseID	S		String	Identificador único del mensaje
936	NoComplIDs	S	1	NumInGroup	
→930	RefCompID	N		String	Contiene el mismo valor que el campo SenderCompID de la cabecera (véase 3.3) Este campo siempre está presente en el mensaje
→931	RefSubID	N	Para más detalle sobre los códigos de grupo de contratos, véase Tabla 11 en documento "Tablas de Codificación"	String	Contiene el mismo valor que el campo SenderSubID de la cabecera (véase 3.3) Este campo siempre está presente en el mensaje
→928	StatusValue	N	1 = Connected 2 = Not connected – down expected up 3 = Not connected – down expected down	Int	Estado de la conexión Este campo siempre está presente en el mensaje. El valor 3 indica que ha finalizado la sesión de liquidación, pero que ClearGate se halla disponible para continuar realizando consultas. En este caso el campo StatusText contiene el texto "%MFI – End of session"
→929	StatusText	N		String	Información adicional
	Standard Trailer	S			

5.8.3 User Request (Msg Type = BE)

Mensaje enviado por el cliente para modificar su password de conexión al ClearGate.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = BE		
923	UserRequestID	S		String (10)	Identificador único para cada mensaje User Request
924	UserRequestType	S	3 = Change Password For User	Int	
553	Username	S		String	Identificador de usuario asignado por la ECC. Actualmente está formado por la combinación de código de miembro y de operador
554	Password	S*		String (10)	Password anterior
925	NewPassword	S*		String (10)	Nueva Password
	Standard Trailer	S			

5.8.4 User Response (Msg Type = BF)

Mensaje usado por ClearGate para indicar el estado de la petición iniciada con un mensaje User Request.

Este mensaje sólo es enviado al operador que realizó la solicitud relacionada.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = BF		
923	UserRequestID	S		String	Identificador asignado por el cliente en el mensaje User Request
553	Username	S		String	Identificador de usuario
926	UserStatus	N	5 = Password Changed 6 = Other	Int	Estado de la petición del mensaje User Request. En caso de rechazo (valor 6), el campo UserStatusText contiene un texto explicativo
927	UserStatusText	N		String	Cuando UserStatus = 6, contiene una descripción específica del motivo de rechazo
	Standard Trailer	S			

5.8.5 Business Message Reject (MsgType = j)

Mensaje enviado por ClearGate cuando recibe un mensaje soportado y sintácticamente correcto en una situación no soportada, para la que no existe un mensaje de rechazo específico. En particular es usado para el rechazo de los mensajes Network Counterparty System Status Request y Confirmation Ack.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = j		
45	RefSeqNum	S		Int	MsgSeqNum del mensaje rechazado
372	RefMsgType	S	.	String	MsgType del mensaje rechazado
379	BusinessRejectRefID	N		String	Identificador opcional del mensaje rechazado. Para un mensaje Confirmation Ack (MsgType = AU) rechazado, este campo contiene el valor del tag ConfirmID [664.]
380	BusinessRejectReason	S	0 = Other 3 = Unsupported Message Type	Int	Motivo de rechazo.
58	Text	N		String	Texto explicativo
	Standard Trailer	S			

6. Información de Contratos

6.1 Introducción

En este capítulo se distingue entre la información estática y la información dinámica de un contrato.

- **Información estática de contratos.** Definición de los contratos
- **Información dinámica de contratos.** Precio de liquidación, volumen negociado y open interest

Cada uno de estos grupos es tratado en un apartado independiente de este capítulo. En el apartado 6.4 se detalla el formato de los mensajes correspondientes.

6.2 Información estática de contratos

6.2.1 Descripción

Esta funcionalidad permite obtener la información estática de los contratos definidos en el grupo de contratos.

6.2.2 Solicitud de información de contratos

La solicitud de definición de los contratos se realiza con el mensaje Security List Request, tal y como se muestra en la siguiente tabla:

	Contratos Snapshot	Contratos Actualización
Security List Request	X	
Security List Request NewSecuritySubscription = 1	X	X

A continuación se detalla el significado de cada una de las columnas:

- **Contratos - Snapshot.** Se obtienen uno o más mensajes Security List con la descripción de los contratos disponibles, que cumplan los criterios de selección indicados en la solicitud
- **Contratos - Actualización.** Se obtiene un mensaje Security List con la información de un nuevo contrato, cuando éste es dado de alta en el sistema. Sólo se recibe la información de nuevos contratos que cumplan con los criterios de selección indicados en la solicitud

Nótese que el campo NewSecuritySubscription ha sido añadido por la ECC al mensaje Security List Request para permitir la suscripción a la definición de contratos creados durante la sesión, típicamente nuevos *strikes* de opciones.

6.2.3 Recepción de la definición de contratos

La información de definición de contratos se recibe mediante el mensaje Security List. Este mensaje informa de un contrato a la vez. El campo TotNoRelatedSym informa del total de contratos que cumplen los criterios de selección y el campo NoRelatedSym informa del número de contratos contenidos en el mensaje en cuestión.

6.2.4 Finalización de las suscripciones

Para finalizar una suscripción a la definición de contratos, se usa el mensaje Security List Request con el campo NewSecuritySubscription = 2.

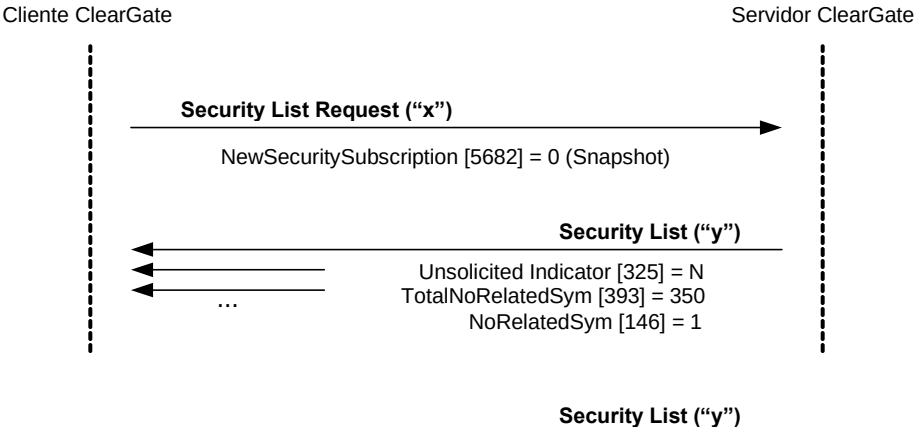
6.2.5 Lista de mensajes

Mensaje	Descripción
Security List Request (Msg Type = x)	Enviado por el cliente para solicitar la definición de contratos.
Security List (Msg Type = y)	Enviado por el servidor para informar de la definición de contratos. También es usado para informar el rechazo de la solicitud de dicha información

6.2.6 Flujo de mensajes

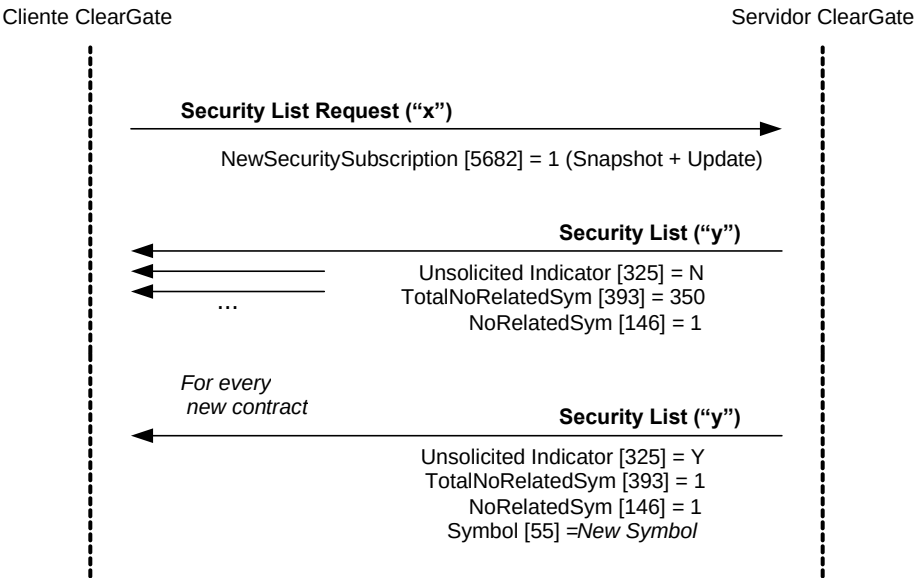
Solicitud de definición de contratos sin actualización

Después de la solicitud de definición de contratos se recibe uno o más mensajes Security List. Cada uno de estos mensajes indica el total de contratos que cumplen los criterios de selección en el campo TotNoRelatedSym y el número de contratos contenidos en el mensaje en cuestión en el campo NoRelatedSym.



Solicitud de definición de contratos con actualización

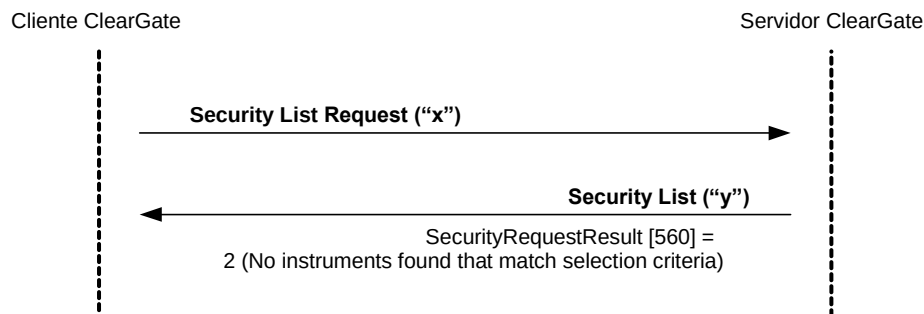
Cuando la solicitud de definición de contratos incluye la actualización de los mismos (NewSecuritySubscription = 1) además de los mensajes explicados en el caso anterior, cuando un nuevo contrato es dado de alta en el sistema se recibe un mensaje Security List conteniendo la información de este contrato.



Solicitud de definición de contratos, sin contratos que cumplan los criterios de selección

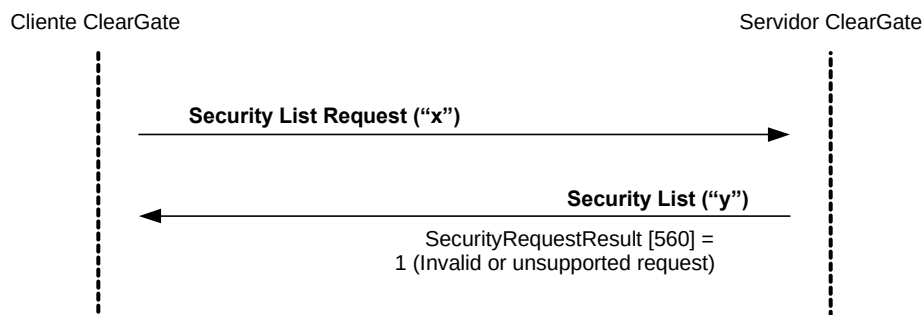
Cuando no existen contratos que cumplan los criterios de selección indicados en una solicitud de definición de contratos, ClearGate contesta con un mensaje Security List con el campo SecurityRequestResult = 2. Téngase en cuenta que en este caso, si la solicitud se realizó con

suscripción, dicha suscripción queda activa y por tanto si se dan de alta contratos que cumplan los criterios de selección se recibirán los correspondientes mensajes.



Solicitud de definición de contratos fallida

Cuando una solicitud de definición de contratos es errónea, es contestada con un mensaje Security List con el campo SecurityRequestResult = 1.



6.2.7 Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4

- Se ha añadido el campo de usuario NewSecuritySubscription (5682) al mensaje Security List Request, para soportar la funcionalidad de recibir la definición de contrato cuando un nuevo contrato es dado de alta en el sistema
- Se han añadido los campos UnsolicitedIndicator [325] y AccruedInterestAmt [159] al mensaje Security List

6.3 Información dinámica de contratos

6.3.1 Descripción

Esta funcionalidad permite solicitar la información dinámica de un conjunto de contratos.

6.3.2 Solicitud de información

La solicitud de información dinámica se realiza mediante el mensaje Market Data Request.

Se puede seleccionar un conjunto de contratos mediante la combinación de campos del bloque Instrument tal y como se explica en [4.1.1](#). Como se puede ver en la descripción detallada del mensaje se puede incluir varios bloques Instrument para hacer más de una selección simultánea. Un contrato se considera seleccionado si cumple alguno de los criterios de selección.

A continuación, se relacionan los tipos de información que la ECC ofrece. Un cliente puede solicitar una combinación de estos tipos en una misma solicitud.

- Precio de liquidación
- Volumen negociado
- Posición abierta al final de la sesión anterior

La información suministrada como precio de liquidación (Settlement Price) durante la sesión contiene el precio de liquidación del contrato en la sesión previa. Una vez se ha fijado el precio de liquidación de la sesión actual, se pasa a informar de este valor. El campo OpenCloseSettleFlag permite determinar cuando se ha fijado el precio de cierre.

La solicitud puede ser, sólo de la situación actual (snapshot), o incluir las actualizaciones (snapshot + update).

6.3.3 Recepción de información

ClearGate devuelve la información solicitada mediante mensajes Market Data Snapshot Full Refresh.

Si se ha solicitado la actualización de la información, cada vez que se produce un cambio se recibe un nuevo mensaje Market Data Snapshot Full Refresh. Este mensaje contiene tanto la información que ha variado como el resto de campos solicitados en la suscripción.

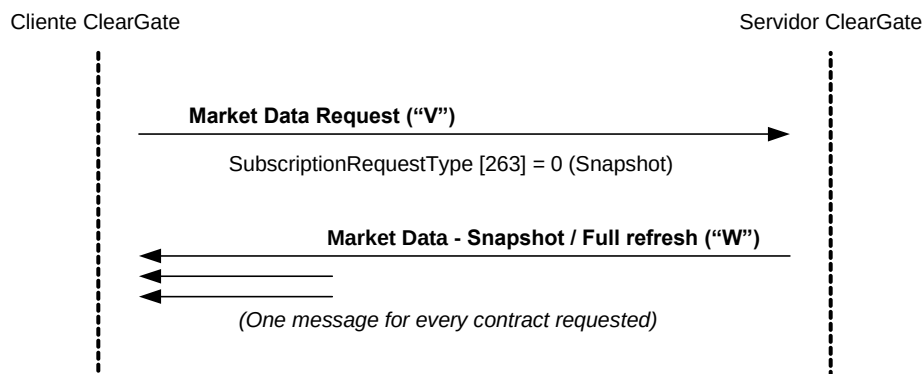
6.3.4 Lista de mensajes

Mensaje	Descripción
Market Data Request (Msg Type = V)	Enviado por el cliente para solicitar información de precios
Market Data Snapshot Full Refresh (Msg Type = W)	Enviado por el servidor para devolver información de precios
Market Data Request Reject (Msg Type = Y)	Enviado por el servidor para notificar que una solicitud Market Data Request ha sido rechazada

6.3.5 Flujo de mensajes

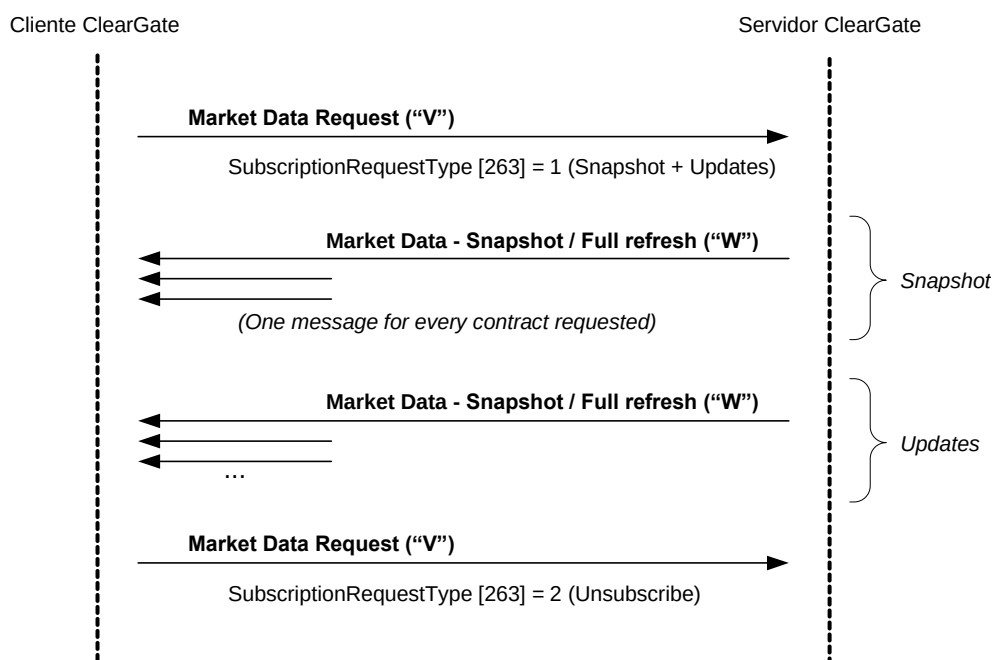
Solicitud de información dinámica de contratos sin actualización

Una solicitud de información dinámica de contratos, sin actualización, es contestada por ClearGate con un mensaje para cada uno de los contratos.



Solicitud de información dinámica de contratos con actualización

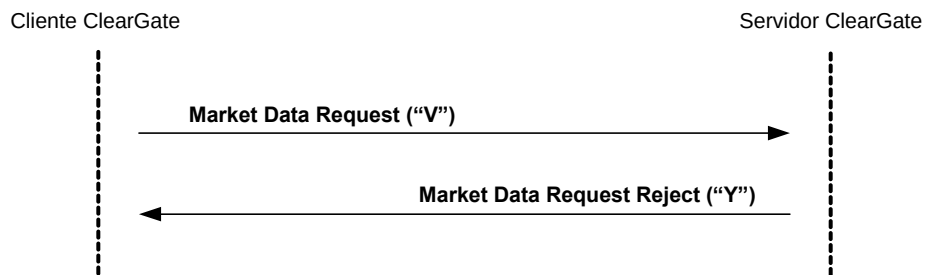
Una solicitud de información dinámica de contratos, con actualización, inicialmente recibe un conjunto de mensajes para los contratos seleccionados en el momento de la solicitud. A partir de este punto se reciben mensajes notificando los cambios que se producen.



Téngase en cuenta que una petición de finalización de la suscripción sólo es contestada en caso de error.

Solicitud de información dinámica de contratos errónea

Cuando una solicitud de información dinámica de contratos es errónea es contestada con un mensaje Market Data Request Reject.

**6.3.6 Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4**

- No está soportado el refresco incremental
- En el mensaje Market Data Request Reject, se ha ampliado el significado del valor 0 (invalid symbol) del campo MDReqRejReason para indicar un criterio de selección inválido

6.4 Definición de mensajes

6.4.1 Security List Request (Msg Type = x)

Usado por el cliente para solicitar la definición de los contratos.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = x		
320	SecurityReqID	S		String(10)	Identificador único para cada mensaje Security List Request Si SubscriptionRequestType = 2 o NewSecuritySubscription = 2, debe contener el valor de la solicitud original
559	SecurityListRequestType	S	0 = Symbol 1 = Security type	Int	Criterio de selección usado
	Start <Instrument>				
55	Symbol	S	[N/A] o código de contrato	String(22)	Código de contrato si SecurityListRequestType = 0, [N/A] si SecurityListRequestType = 1
48	SecurityID	N	Para más detalle sobre los activos subyacentes, véase Tabla 14 en documento "Tablas de Codificación"	String	Activo subyacente del contrato No permitido si SecurityListRequestType = 0
22	SecurityIDSource	N	8 = Exchange Symbol	String	Requerido si SecurityID está presente. No permitido si SecurityListRequestType = 0
	End <Instrument>				
5682 *	NewSecuritySubscription	N	0 = Snapshot 1 = Updates (Suscribir) 2 = Unsubscribe	Char	Indica el tipo de solicitud
	Standard Trailer	S			

6.4.2 Security List (Msg Type = y)

Mensaje enviado por el servidor para informar de la definición de uno o más contratos.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = y		
320	SecurityReqID	S		String	Identificador del mensaje Security List Request al que se está respondiendo
322	SecurityResponseID	S		String	Identificador único para cada mensaje Security List
560	SecurityRequestResult	S	0 = Valid request 1 = Invalid or unsupported request 2 = No instruments found that match selection criteria 4 = Instrument data temporarily unavailable	Int	Resultado de la solicitud identificada por SecurityReqID. En caso de rechazo (>0) el campo 58 Text contiene un texto explicativo
325*	UnsolicitedIndicator	N	N = El mensaje es parte de un snapshot Y = El mensaje es enviado como resultado de una suscripción (nuevo contrato)	Boolean	Contiene "Y" cuando el mensaje es enviado como resultado de una suscripción
393	TotNoRelatedSym	N		Int	Número total de contratos que cumplen los criterios de selección de la solicitud. El número de contratos que contiene el mensaje se indica en el campo NoRelatedSym. Este campo siempre está presente cuando SecurityRequestResult = 0
893	LastFragment	N		Boolean	Indica cuando el mensaje es el último en una secuencia de respuesta a una única solicitud. Este campo siempre está presente cuando SecurityRequestResult = 0
146	NoRelatedSym	N	1	NumInGroup	Indica el número de elementos contenidos en este mensaje.
	Start <Instrument>				
→55	Symbol	N	[N/A] o código de contrato	String(22)	Código de contrato. Presente si se ha especificado NoRelatedSym y SecurityRequestResult [560] = 0
→48	SecurityID	N	Para más detalle sobre los activos subyacentes, véase Tabla 14 en documento "Tablas de Codificación"	String	Activo subyacente del contrato
→22	SecurityIDSource	N	8 = Exchange Symbol	String	
→454	NoSecurityAltID	N	1		

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
→→455	SecurityAltID	N		String	Código de contrato ISIN
→→456	SecurityAltIDSource	N	4 = ISIN number	String	
→167	SecurityType	N	Consultar Apéndice B.1	String	Tipo de producto
→200	MaturityMonthYear	N	YYYYMM o YYYYMMDD o YYYYMMwW	Month- Year	Vencimiento del contrato
→541	MaturityDate	N		LocalMktDate	Fecha de vencimiento
→225	IssueDate	N		UTCDate	Fecha de emisión del contrato
→202	StrikePrice	N		Price	Precio de ejercicio. Sólo presente en opciones
→231	ContractMultiplier	N		Float	Indica el ratio o factor multiplicativo para convertir de unidades de "nominal" (p.ej. contratos) a unidades totales (p.ej. acciones)
→1193	SettlMethod	N	C = Cash settlement required (liquidación por diferencias) P = Physical settlement required (liquidación por entregas)	Char	Método de liquidación para este contrato
→1194	ExerciseStyle	N	0 = European 1 = American	Int	Tipo de ejercicio para este contrato
→201	PutOrCall	N	0 = Put 1 = Call	Int	Indica si la opción es put o call
→1244	FlexibleIndicator	N	Y = Flexible N = Standard (defecto)	Boolean	Indica si este contrato es flexible o estándar. Si no se informa este campo significa "N = Standard"
→107	SecurityDesc	N		String	Descripción del activo subyacente del contrato. Consúltese la Tabla 14 en documento "Tablas de Codificación"
→969	MinPriceIncrement	N		Float	Cantidad mínima permitida en el cambio de precio. Este campo siempre está presente en el mensaje
→864	NoEvents	N			
→→865	EventType	N	134 = Regla de ajustes 166 = Fecha de liquidación del diferimiento del vencimiento 167 xRolling closing type 168 xRolling Buyer financing rate 169 xRolling buyer rate markup		

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
			170 xRolling seller financing rate 171 xRolling seller rate markup 172 xRolling Dividend settlement percentage 173 xRolling differential between payment date and receipt of ordinary dividend flow		
→→866	EventDate	N		LocalMktDate	Fecha de liquidación del diferimiento del vencimiento, cuando EventType = 166
→→868	EventText	N		String	Contiene la regla de ajustes cuando EventType = 134: E – Sólo se ajustan los dividendos extraordinarios (defecto) T – Total Si EventType = 167, indica si el xRolling puede ser cerrado por alguna de las contrapartes antes de la fecha de vencimiento. M: Market (Default value). Valor a utilizar en xRolling FLEX con fecha de vencimiento cerrada y sin posibilidad de modificación. 1: By buyer 2: By seller A: By both Si EventType = 168, contiene el tipo de referencia financiación en compras S: €STR (Default value for non-FLEX xRolling) F: FISAnalytics M: MEFF rate 0: Zero ': N/A (used in FLEX, in the financing leg) Si EventType = 169, contiene el markup sobre tipo de referencia en compras De - 100.0000 a 100.0000 Si EventType = 170, contiene el tipo de referencia financiación en ventas S: €STR (Default value for non-FLEX xRolling) F: FISAnalytics

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
					M: MEFF rate 0: Zero '': N/A (used in FLEX, in the financing leg) Si EventType = 171, contiene el markup sobre tipo de referencia en ventas De -100.0000 a 100.0000 Si EventType = 172, contiene el porcentaje de liquidación de dividendos De 0.00 a 100.00 Si EventType = 173, contiene el diferencial de fecha de pago/ cobro del flujo de dividendo ordinario 0-999
	Start < ComplexEvents >				
→1483	NoComplexEvents	N	1	NumInGroup	
→→1484	ComplexEventType	N	16 = Foreign exchange cross currency	Int	
→→2124	ComplexEventCurrencyOne	N		Currency	Código de la divisa base. Expresada según estándar ISO 4217
→→2125	ComplexEventCurrencyTwo	N		Currency	Código de la divisa cotizada. Expresada según estándar ISO 4217
	End < ComplexEvents >				
	End <Instrument>				
	Start <StrikeRules>				
→1201	NoStrikeRules	N	1	NumInGroup	
→→1223	StrikeRuleID	N	[N/A]	String	
	Start <MaturityRules>				
→→1236	NoMaturityRules	N	1	NumInGroup	
→→→1222	MaturityRuleID	N	[N/A]	String	
→→→1302	MaturityMonthYearIncrementUnits	N	0 = Months 1 = Days 2 = Weeks 3 = Years	Int	Periodicidad
→→→1241	StartMaturityMonthYear	N	YYYYMMDD	Month-Year	Fecha de inicio de entrega para los contratos de energía
→→→1226	EndMaturityMonthYear	N	YYYYMMDD	Month-Year	Fecha de fin de entrega para los contratos de energía
→→→1229	MaturityMonthYearIncrement	N		Int	
	End < MaturityRules >				
	End <StrikeRules>				
→711	NoUnderlyings	N	1	NumInGroup	Presente si el contrato tiene como subyacente a otro contrato
	Start <UnderlyingInstrument>				
→→311	UnderlyingSymbol	S		String(22)	Símbolo del contrato que actúa como subyacente

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	End <UnderlyingInstrument>				
→15	Currency	N		Currency	Código de divisa. Expresada según estándar ISO 4217
→555	NoLegs	N		NumInGroup	Presente si el contrato tiene contratos entregables
	Start <InstrumentLeg>				
→→600	LegSymbol	N		String	Símbolo del contrato entregable
→→604	NoLegSecurityAltID	N	1		
→→→605	LegSecurityAltID	N		String	Código ISIN code del contrato entregable
→→→606	LegSecurityAltIDSource	N	4 = ISIN number	String	
→→253	LegFactor	N		Float	Factor de conversión del contrato entregable
→→599	LegInstrRegistry	N	1 = IBERCLEAR	String	Código del Depositario Central del contrato entregable
→→159*	AccruedInterestAmt	N		Amt	Cupón corrido del contrato entregable
	End < InstrumentLeg >				
→58	Text	N		String	Si SecurityRequestResult [560] > 0 contiene una explicación del error
	Standard Trailer	S			

6.4.3 Market Data Request (Msg Type = V)

Usado por el cliente para solicitar información de precios.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = V		
262	MDReqID	S		String(10)	Identificador único para cada mensaje Market Data Request. Si SubscriptionRequestType = 2 debe contener el identificador de la solicitud original
263	SubscriptionRequestType	S	0 Snapshot 1 = Snapshot + Updates 2 = Unsubscribe	Char	
264	MarketDepth	S		Int	Ignorado por ClearGate
265	MDUpdateType	N	0 = Full refresh	Int	Requerido si SubscriptionRequestType = 1
267	NoMDEntryTypes	S		NumInGroup	Número de campos MDEntryType que contiene el mensaje
→ 269	MDEntryType	S	6 = Settlement Price B = Trade Volume (total volume for contract in session) C = Open Interest	Char	Tipo de información solicitada
146	NoRelatedSym	S	1	NumInGroup	Número de criterios de selección
	Start <Instrument>				
→ 55	Symbol	S	[N/A] o código de contrato	String(22)	Código de contrato
→ 48	SecurityID	N	Para más detalle sobre los activos subyacentes, véase Tabla 14 en documento "Tablas de Codificación"	String	Activo subyacente del contrato
→ 22	SecurityIDSource	N	8 = Exchange Symbol	String	Requerido si se ha especificado SecurityID
	End <Instrument>				
	Standard Trailer	S			

6.4.4 Market Data Request Reject (Msg Type = Y)

Usado por ClearGate para rechazar una solicitud Market Data Request.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = Y		
262	MDReqID	S		String	Identificador de la solicitud que se está rechazando
281	MDReqRejReason	N	0 = Invalid selection criteria 1 = Duplicate MDReqID 4 = Unsupported SubscriptionRequestType 5 = Unsupported MarketDepth 6 = Unsupported MDUpdateType 8 = Unsupported MDEntryType	Char	Motivo de rechazo. Este campo siempre está presente en el mensaje
58	Text	N		String	Texto explicativo del motivo de rechazo
	Standard Trailer	S			

6.4.5 Market Data Snapshot Full Refresh (Msg Type = W)

Usado por ClearGate para comunicar la información de precios solicitada con un mensaje Market Data Request.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = W		
262	MDReqID	S		String	Identificador del mensaje Market Data Request al que se está contestando
	Start <Instrument>				
55	Symbol	S	Código de contrato	String(22)	Código de contrato
	End <Instrument>				
268	NoMDEntries	S		NumInGroup	Número de entradas que siguen
→269	MDEntryType	S	6 = Settlement Price B = Trade Volume (total volume for contract in session) C = Open Interest	Char	Tipo de información que contiene la presente entrada.
→270	MDEntryPx	N		Price	Precio. Presente cuando MDEntryType es igual a 6 En el caso en que no esté presente debe entenderse que el precio es 0
→236	Yield	N		Percentage	Contiene el precio de la operación en rentabilidad
→271	MDEntrySize	N		Qty	Volumen. Presente cuando MDEntryType es igual a B o C
→286	OpenCloseSettleFlag	N	1 = Session Open / Close / Settlement entry 4 = Entry from previous business day 5 = Theoretical Price Value	MultipleValue String	Cuando MDEntryType = 6, los valores 1 y 4 se usan para indicar si el precio de cierre es el de la sesión anterior (valor 4) o el de la sesión actual (valor 1)
→811	PriceDelta	N		float	Puede estar presente si MDEntryType = 6
	Standard Trailer	S			

7. Seguimiento y Gestión de la Posición

7.1 Introducción

En este capítulo se cubren las funcionalidades relacionadas con la posición abierta. Esto incluye:

- Consulta de posiciones
- Peticiones de ejercicio (Ver capítulo “10. Petición de Ejercicio”)
- Consulta de saldos en la relación Demandante de xRolling-Proveedor de Liquidez
- Ajustes de posición

7.2 Consulta de posición abierta

La aplicación cliente puede solicitar la posición abierta por cuenta y contrato, mediante el envío de un mensaje Request For Positions.

La posición abierta para una cuenta y contrato refleja la situación de dicha cuenta, en el momento de la solicitud, respecto al contrato en cuestión. La ECC proporciona esta información separada en dos partes:

- La posición abierta a principio de día
- El conjunto de operaciones realizadas desde el principio de día hasta el momento de la consulta

La posición abierta a principio de día es la que se tuvo en cuenta para la valoración a precio de mercado y el cálculo de garantías diarias de la sesión previa. Sólo se suministra información en aquellas combinaciones de cuenta/contrato que tengan una posición distinta de cero.

La posición abierta a principio de día es informada mediante el mensaje Position Report.

La información de las operaciones realizadas desde el inicio de día hasta el momento de la solicitud es reportada mediante mensajes Trade Capture Report.

Además de la posición en el momento de la solicitud, el mensaje Request For Positions permite realizar una suscripción, solicitando la actualización de información respecto a la posición abierta. La actualización de dicha información se realiza mediante la notificación de las operaciones realizadas con mensajes Trade Capture Report. Téngase en cuenta que al realizar la solicitud de actualización, se recibirán las operaciones de todas las cuentas, tuviesen o no posición en el momento de la solicitud.

La solicitud puede incluir un conjunto de criterios de selección, como pueden ser el miembro liquidador, el tipo de contrato, el instrumento concreto, etc. La información recibida como respuesta sólo es la correspondiente a los pares cuenta-contrato que cumplen los criterios especificados en la solicitud.

En caso de que la solicitud se haya hecho con suscripción, una vez se ha llegado al fin de día y la posición es definitiva, ClearGate envía un mensaje Position Report, para cada cuenta incluida en la solicitud, informando de la posición abierta en dicho momento. Este mismo mensaje también será incluido en la respuesta a una solicitud sin suscripción realizada después del fin de día.

7.2.1 Consulta por miembro negociador y/o liquidador

El mensaje Request For Positions permite realizar la consulta por miembro negociador y/o miembro liquidador usando el bloque Parties.

Que un usuario de un liquidador tenga la capacidad de ver la operativa de un miembro al que liquida dependerá de los permisos vigentes.

Cuando en una solicitud no se especifiquen estos campos se considera que la solicitud sólo refiere a todas las cuentas del miembro al que pertenece el operador que realiza la consulta.

Cuando un liquidador desee consultar la posición de las cuentas que él liquida deberá incluir su propio código de miembro en el campo PartyID asociado al PartyRole 4 (Clearing Firm). Si además se desea restringir esta consulta por miembro negociador se puede usar el campo PartyID asociado al PartyRole 13 (Order Origination Firm).

En la siguiente tabla se presentan diferentes ejemplos de selección y su interpretación. En estos ejemplos el Miembro A es un miembro liquidador que realiza la consulta y el Miembro B es un miembro negociador liquidado por A.

Miembro Negociador (bloque parties con PartyRole = 13)	Miembro Liquidador (bloque parties con PartyRole = 4)	Interpretación
-	-	Selección de cuentas del Miembro A
Miembro A	-	Selección de cuentas del Miembro A
-	Miembro A	Selección de cuentas liquidadas por el Miembro A, pertenecientes a cualquier miembro negociador al que liquida, incluidas las suyas
Miembro B	Miembro A	Selección de cuentas liquidadas por el Miembro A, pertenecientes al miembro B
Miembro B	-	Consulta errónea. Si se especifica un código diferente al propio como negociador, deberá especificarse el código de liquidador
-	Miembro B	Consulta errónea. Si se especifica un código diferente al propio como liquidador, deberá especificarse el código propio como negociador

En la siguiente tabla se presentan ejemplos en que la consulta es realizada por el Miembro B, que es un miembro negociador, donde algunas de sus cuentas son liquidadas por el Miembro liquidador A.

Miembro Negociador (bloque parties con PartyRole = 13)	Miembro Liquidador (bloque parties con PartyRole = 4)	Interpretación
-	-	Selección de cuentas propias del Miembro B
Miembro B	-	Selección de cuentas propias del Miembro B
Miembro B	Miembro A	Selección de cuentas propias del Miembro B que son liquidadas por el Miembro A
-	Miembro A	Consulta errónea. Si se especifica un código diferente al propio como liquidador, deberá especificarse el código propio como negociador

7.3 Consulta de posiciones netas en la relación Demandante de xRolling-Proveedor de liquidez

Cualquier miembro puede solicitar la consulta de posiciones netas para todas las parejas Demandante de xRolling-Proveedor de Liquidez (DR-PL). Para ello se deberá utilizar el mensaje Request For Positions indicando PosReqType[724]=7 (Net positions). En la petición se podrá indicar el código de proveedor de liquidez para el que se hace la petición (en caso de omisión, se entenderá que la petición es para todos los posibles **códigos de proveedores de liquidez**).

El sistema responderá con mensajes Position Report, uno por cada pareja DR-PL y contrato. En ellos, la posición indicada en los campos LongQty[704] y ShortQty[705] corresponderá al DR, siendo la del PL siempre la contraria, que no se incluye explícitamente en el mensaje.

7.4 Ajustes de posición

Para solicitar un ajuste de posición, la aplicación cliente debe enviar un mensaje Position Maintenance Request indicando la cuenta y contrato que se desea ajustar y el número de contratos en que se desea reducir la posición.

ClearGate responde a esta solicitud con un mensaje Position Maintenance Report informando de la aceptación o rechazo de la solicitud. Independientemente de si se trata de una aceptación o rechazo, este mensaje informa de la posición para la cuenta y contrato de referencia en el momento de emisión del mensaje.

En la ECC, el ajuste de posición se implementa mediante dos operaciones de cierre de posición, de signo contrario y volumen igual al del ajuste. Los usuarios suscritos a los mensajes Trade Capture Report recibirán los mensajes correspondientes a estas operaciones.

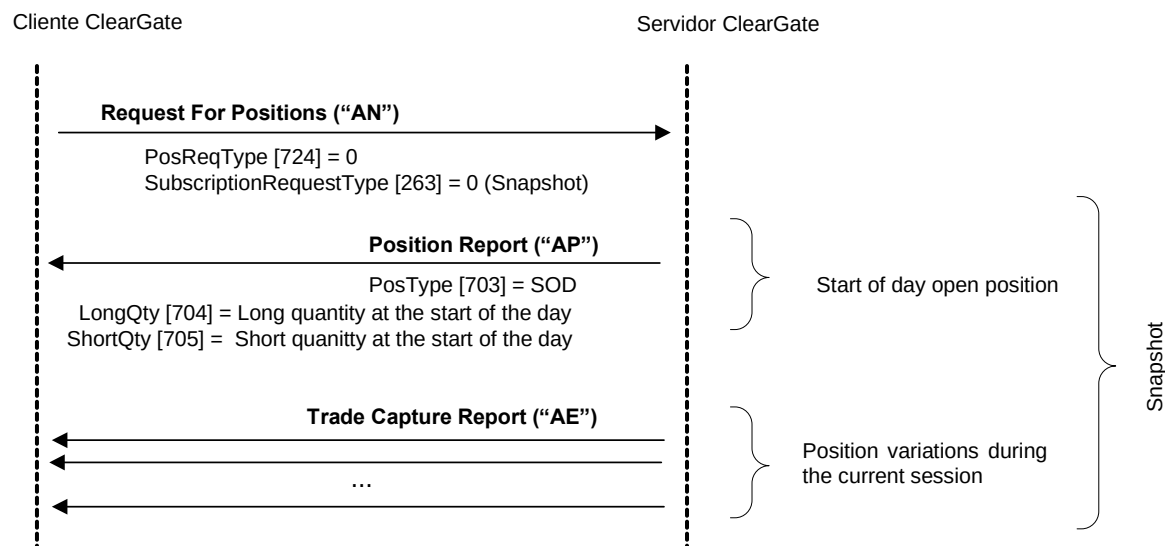
7.5 Lista de mensajes

Mensaje	Descripción
Request For Positions (Msg Type = AN)	Solicitud de información de la posición abierta
Request For Positions Ack (Msg Type = AO)	Acuse del mensaje Request For Positions
Position Report (Msg Type = AP)Position Report (Msg Type = AP)	Información de la posición abierta en la cámara para un contrato y cuenta
Trade Capture Report (Msg Type = AE)	Información de una operación registrada en la cámara
Position Maintenance Request (Msg Type = AL)	Solicitud de ajuste de posición
Position Maintenance Report (Msg Type = AM)Position Maintenance Report (Msg Type = AM)	Informe de aceptación o rechazo de un ajuste de posición

7.6 Flujo de mensajes

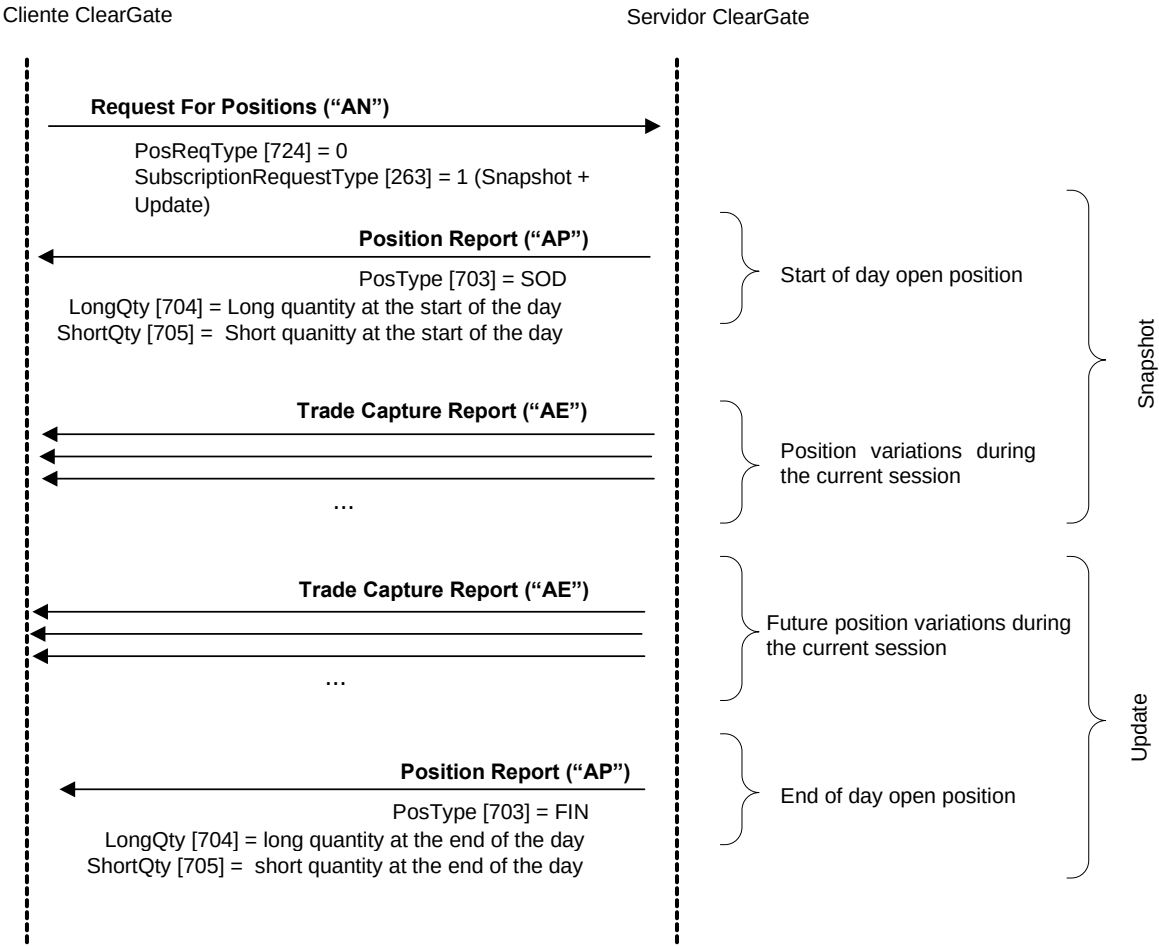
Solicitud de posición abierta sin actualización.

En el ejemplo se presentan los mensajes correspondientes a una combinación cuenta-contrato. Si los criterios de selección se refieren a más de una combinación, se recibirán los mismos mensajes para cada una de ellas.



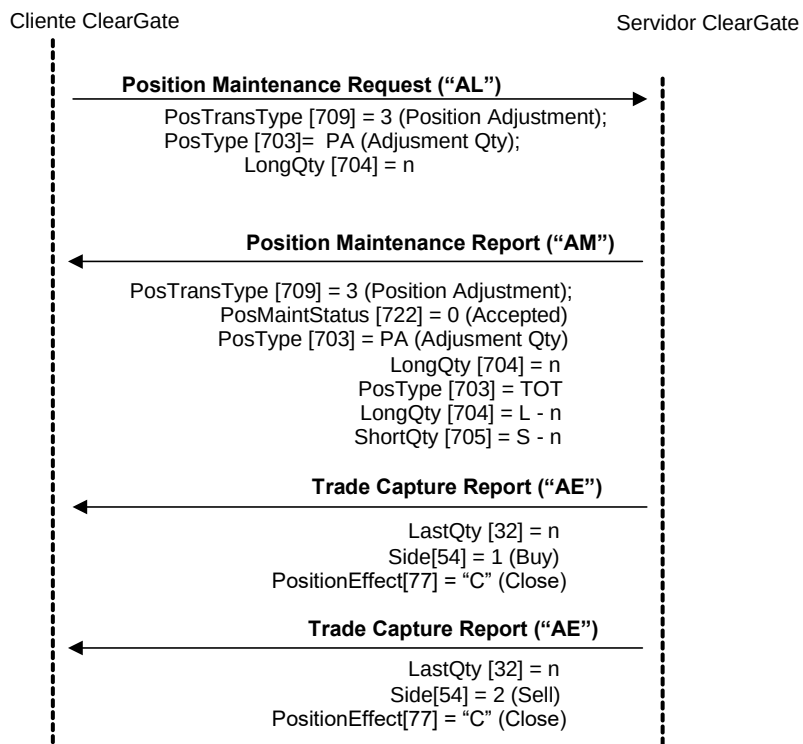
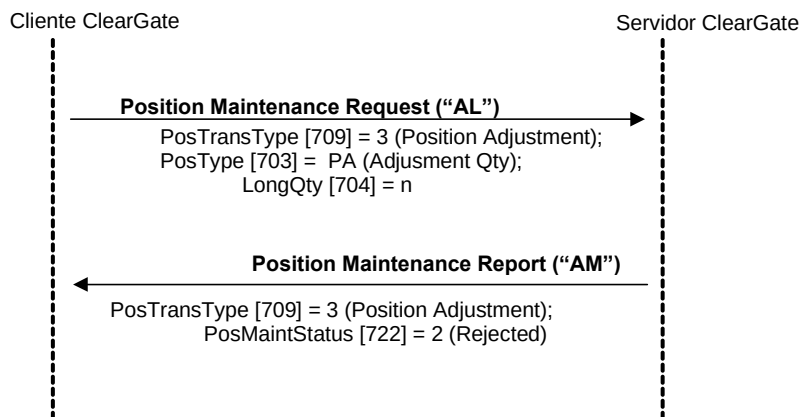
Solicitud de posición abierta con actualización.

En el ejemplo se presentan los mensajes correspondientes a una combinación cuenta-contrato. Si los criterios de selección se refieren a más de una combinación, se recibirán los mismos mensajes para cada una de ellas.



Solicitud de ajuste de posición aceptada

Solicitud de ajuste de posición por n contratos. En el momento de proceso del mensaje por el sistema la cuenta tenía L y N contratos comprados y vendidos respectivamente.

**Solicitud de ajuste de posición rechazada**

7.7 Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4

- Se ha añadido el campo de usuario ExchangeTradeType [5681] al mensaje Trade Capture Report
- Se han añadido los campos LeavesQty [151] y PosReqID [710] al mensaje Trade Capture Report
- Se ha añadido el campo LegSymbol [600] a los mensajes Position Maintenance Request y Position Maintenance Report
- El mensaje Trade Capture Report sólo informa de una de las partes que intervienen en la operación. Concretamente, la parte a la que se está enviando el mensaje
- En el mensaje Request For Positions se permite que no esté presente el bloque Parties. En tal caso se considera seleccionado el código de miembro negociador propio

7.8 Definición de mensajes

7.8.1 Request For Positions (Msg Type = AN)

Mensaje enviado por el cliente para solicitar la posición abierta, con o sin actualización.

También puede ser usado para solicitar el estado de las peticiones de ejercicio (ver capítulo 10).

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = AN		
710	PosReqID	S		String	Identificador de la solicitud asignado por el usuario. Debe ser un valor único cuando se trate de una petición nueva, y el valor asignado previamente cuando se trate de una finalización de suscripción
724	PosReqType	S	0 = Positions 2 = Exercises 7 = Net positions	Int	Indica el tipo de solicitud de la transacción 0: Indica posiciones por cuenta 2: Indica peticiones de ejercicio 7: Indica posiciones netas por pareja Demandante de xRolling-Proveedor de Liquidez
263	SubscriptionRequestType	N	0 = Snapshot (valor por defecto) 1 = Snapshot + Updates 2 = Unsubscribe	Char	Tipo de solicitud
→	Start <Parties>				
→ 453	NoPartyIDs	S		NumInGroup	El bloque Parties es requerido por el estándar. ClearGate acepta que este bloque no esté presente. En tal caso se considera seleccionado código de miembro negociador propio.
→→ 448	PartyID	S		String	Código del Miembro
→→ 447	PartyIDSource	S	D = Proprietary / Custom code	Char	Requerido si se ha especificado NoPartyIDs
→→ 452	PartyRole	S	13 = Order Origination Firm (para PosReqType[724] <>7) 4 = Clearing Firm 35=Liquidity Provider (para PosReqType[724] =7)	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID. Requerido si se ha especificado NoPartyIDs

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
			60=Introducing Broker (para PosReqType[724]=7)		
→	End <Parties>				
1	Account	S	Longitud exacta	String(5)	Código de cuenta. El uso del carácter comodín “?” para la selección múltiple, sólo está permitido en las cinco posiciones a la vez o en las dos últimas posiciones, caso en el cual debe ser usado en ambas a la vez
581	AccountType	S	1	Int	Ignorado por ClearGate
	Start <Instrument>				
55	Symbol	S	[N/A] o código de contrato	String(22)	Código de contrato (Cuando PosReqType = 2 debe referir a una opción)
48	SecurityID	N	Para más detalle sobre los activos subyacentes, véase Tabla 14 en documento “Tablas de Codificación”	String	Activo subyacente del contrato
22	SecurityIDSource	N	8 = Exchange Symbol	String	Requerido si se ha especificado SecurityID
	End <Instrument>				
715	ClearingBusinessDate	S		LocalMktDate	Ignorado por ClearGate
60	TransactTime	S		UTCTimestamp	Hora en que se ha generado la petición
	Standard Trailer	S			

7.8.2 Request For Positions Ack (Msg Type = AO)

Usado por el servidor para notificar el resultado de una petición Request For Positions de consulta de la posición abierta. Precede a la información de la posición en sí.

Dado que el mensaje Request For Positions puede ser usado para solicitar el estado de las instrucciones de ejercicio, este mensaje también es usado para contestar a esta petición (ver capítulo 10 para más información sobre petición de ejercicio).

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = AO		
721	PosMaintRptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Request For Positions Ack
710	PosReqID	N		String	Identificador del mensaje de solicitud Request For Positions, tal y como se especificó en éste. Este campo siempre está presente en el mensaje
727	TotalNumPosRepos	N		Int	Número de mensajes que se van a recibir, como respuesta a la solicitud Request For Positions correspondiente
728	PosReqResult	S	0 = Valid Request 1 = Invalid or unsupported Request 2 = No positions found that match criteria 4001 = Duplicate PosReqID 4002 = Invalid Account or Symbol	Int	Resultado de la solicitud Request For Position
729	PosReqStatus	S	0 = Completed 2 = Rejected	Int	Estado de la solicitud
1	Account	S	Longitud exacta	String(5)	Contiene el mismo valor que se indicó en la solicitud
581	AccountType	S	1	Int	Contiene el mismo valor que se indicó en la solicitud
58	Text	N		String	Texto explicativo en caso de error
	Standard Trailer	S			

7.8.3 Position Report (Msg Type = AP)

Mensaje que informa de la posición abierta para una cuenta y contrato, como respuesta a un mensaje Request For Positions con el campo PosReqType = 0 (consulta de posición abierta).

Este mensaje también es usado para informar de las peticiones de ejercicio, como respuesta a un mensaje Request For Positions con el campo PosReqType = 2 (consulta de peticiones de ejercicio). Consúltese el capítulo 10 para más información sobre peticiones de ejercicio.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = AP		
721	PosMaintRptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Position Report
710	PosReqID	N		String	Identificador del mensaje de solicitud Request For Positions, tal y como se especificó en éste. Este campo siempre está presente en el mensaje
724	PosReqType	N	0 = Positions 2 = Exercises 7 = Net positions	Int	Contiene el mismo valor que se indicó en la solicitud
325	UnsolicitedIndicator	N	N = El mensaje es parte de un snapshot Y = El mensaje es enviado como resultado de una suscripción	Boolean	Contiene "Y" cuando el mensaje es enviado como resultado de una suscripción
727	TotalNumPosReports	N		Int	Número de pares cuenta-contrato de los que se está informando. Téngase presente que no se informa de las cuentas sin posición o sin peticiones de ejercicio
728	PosReqResult	S	0 = Valid Request	Int	Resultado del Request For Positions. Téngase en cuenta que las peticiones erróneas se contestan con el mensaje Request For Positions Ack
715	ClearingBusinessDate	S		LocalMktDate	El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta, está presente por requerimiento del estándar
	Start <Parties>				
453	NoPartyIDs	N		NumInGroup	Número de participantes que se van a informar
→ 448	PartyID	N		String	Código del Miembro
→ 447	PartyIDSource	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	
→ 452	PartyRole	N	13 = Order Origination Firm (para PosReqType[724]<7> 7) 35=Liquidity Provider (para PosReqType[724]=7)	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
			60=Introducing Broker (para PosReqType[724]=7)		
	End <Parties>				
1	Account	S	Longitud fija	String(5)	Código de la cuenta de la que se está informando
581	AccountType	S	1	Int	Contiene el mismo valor que se indicó en la solicitud
	Start <Instrument>				
55	Symbol	S	Código de contrato	String(22)	Contrato del que se está informando
	End <Instrument>				
730	SettlPrice	S		Price	Precio de cierre del contrato. Contiene el valor de la sesión previa hasta que se ha fijado el valor para la sesión actual. El campo SettlPriceType permite diferenciar estos dos casos
731	SettlPriceType	S	1 = Final 2 = Theoretical	Int	Indica si el campo SettlPrice es de la sesión previa (valor 2) o de la sesión actual (valor 1)
734	PriorSettlPrice	S		Price	Precio de cierre previo con respecto a SettlPrice
	Start <PositionQty>				
702	NoPositions	S		NumInGroup	
→ 703	PosType	S	SOD = Start of Day Position FIN = End-of-Day Qty EX = Option Exercise Qty TOT = Total Transaction Qty ITD=Intraday	String	Se usa SOD y FIN cuando el mensaje es respuesta a una solicitud de informe de posiciones abiertas PosReqType[724]=0 Se usa EX y TOT conjuntamente cuando el mensaje es respuesta a una solicitud de informe de peticiones de ejercicio PosReqType[724]=2 Con PosReqType[724]=7 se usa ITD
→ 704	LongQty	N	>= 0, sin decimales	Qty	Cuando PosType = SOD o FIN, indica el número de contratos que conforman la posición compradora de la posición que se está reportando. Cuando PosType = EX indica el número de opciones a ejercer. Cuando no está presente y PosType = EX el mensaje informa de la cancelación de una petición de ejercicio (vuelta al comportamiento por defecto). Cuando PosType = TOT, indica el número de contratos que conforman la posición compradora en el momento del envío del mensaje. Sólo presente si hay posición compradora

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
→ 705	ShortQty	N	> 0, sin decimales	Qty	Cuando PosType = SOD o FIN, indica el número de contratos que conforman la posición vendedora de la posición que se está reportando. No usado cuando PosType = EX. Cuando PosType = TOT, indica el número de contratos que conforman la posición vendedora en el momento del envío del mensaje. Sólo presente si hay posición vendedora
	End <PositionQty>				
	Start <PositionAmountData>				El contenido de este bloque sólo debe ser tenido en cuenta si el contrato se liquida Mark-to-Market
753	NoPosAmt	N		NumInGroup	
→ 707	PosAmtType	N	SMTM = Start-of-Day Mark-to-Market Amount FMTM = Final Mark- to-Market Amount	String	Se usa SMTM cuando PosType [703] = SOD Se usa FMTM cuando PosType [703] = FIN
→ 708	PosAmt	N		Amt	Importe Nominal/Efectivo del total de la posición (con signo) para esta combinación cuenta-contrato
	End <PositionAmountData>				
	Standard Trailer	S			

7.8.4 Trade Capture Report (Msg Type = AE)

Mensaje que contiene los datos de una operación de cámara. Este mensaje puede ser respuesta a un mensaje Trade Capture Report Request o a un mensaje Request For Positions.

Cuando el mensaje es respuesta a una solicitud Request For Positions y se corresponde a una operación de una sesión de negociación previa, algunos de los campos obligatorios pueden contener valores no significativos si ClearGate no dispone de dicha información. En dichos campos las explicaciones detalladas que se presentan a continuación advierten de tal situación.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = AE		
571	TradeReportID	S		String	Identificador único para cada mensaje Trade Capture Report
568	TradeRequestID	N		String	Identificador de la solicitud. Presente cuando la solicitud es un mensaje Trade Capture Report Request
828	TrdType	N	Para más detalle sobre los tipos de operación, véase Tabla 12 en documento "Tablas de Codificación"	Int	Tipo de operación. Este valor es usado conjuntamente con TrdSubType [829].
829	TrdSubType	N	Para más detalle sobre los tipos de operación, véase Tabla 12 en documento "Tablas de Codificación"	Int	Este valor es usado conjuntamente con TrdType [828].
710*	PosReqID	N		String	Identificador de la solicitud. Presente cuando la solicitud es un mensaje Request For Positions
150	ExecType	N	F = Trade	Char	Tipo de operación
912	LastRptRequested	N		Boolean	Indica si se trata del último mensaje del snapshot de respuesta
325	UnsolicitedIndicator	N	N = El mensaje es parte de un snapshot Y = El mensaje es enviado como resultado de una suscripción	Boolean	Contiene "Y" cuando el mensaje es enviado como resultado de una suscripción
881	SecondaryTradeReportRefID	N		String	Contiene el número de registro de liquidación de la operación de procedencia
818	SecondaryTradeReportID	N		String	Número de registro de liquidación. Este campo siempre está presente en el mensaje
820	TradeLinkID	N		String	Referencia original primaria de la operación. En un repo, es la referencia común a las dos patas del miembro.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
880	TrdMatchID	N		String	Contiene el número de registro de liquidación de la operación inicial
17	ExecID	N		String	Referencia original secundaria de la operación. En un repo, es la referencia correspondiente a una de las patas del miembro (la ida o la vuelta)
527	SecondaryExecID	N		String	Número de registro de negociación de la operación inicial. Coincide con el campo TrdMatchID [880] del mensaje Execution Report.
5681*	ExchangeTradeType	N	Para más detalle sobre los tipos de operación, véase Tabla 12 en documento "Tablas de Codificación"	String	Tipo de operación.
	Start <RegulatoryTradeIDGrp>				
1907	NoRegulatoryTradeIDs			NumInGroup	
→1903	RegulatoryTradeID	N		String	Contiene el UTI de la operación
→1905	RegulatoryTradeIDSource	N	BMCL-UTI	String	Identifica la entidad que origina el valor en RegulatoryTradeID [1903]
	End <RegulatoryTradeIDGrp>				
570	PreviouslyReported	S	Y	Boolean	Indica si la operación fue notificada a la contrapartida
	Start <Instrument>				
55	Symbol	S	Código de contrato	String(22)	Código de contrato
→864	NoEvents	N		NumInGroup	
→→865	EventType	N	101 = Nominal de la operación (Par amount) 102 = Código del Miembro en el mercado en el que se realiza la entrega 103 = Código del Miembro contrapartida en el mercado en el que se realiza la entrega 104 = Tipo de cuenta	Int	

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
			105 = Identificador (AllocID) utilizado por el cliente en una petición de asignación		
→→868	EventText	N		String	Si EventType = 101, contiene el Nominal de la operación (Par amount). Presente para las operaciones de contado tanto a nivel de titular como a nivel de miembro (entregas) Si EventType = 102, contiene Código del Miembro en el mercado en el que se realiza la entrega. Presente para las operaciones de contado a nivel de miembro (entregas) Si EventType = 103, contiene Código del Miembro contrapartida en el mercado en el que se realiza la entrega. Presente para las operaciones de contado a nivel de miembro (entregas) Si EventType = 104, contiene el Tipo de Cuenta. Si EventType = 105, contiene el identificador (AllocID) utilizado por el cliente en una petición de asignación
	End <Instrument>				
236	Yield	N		Percentage	Contiene el precio de la operación en rentabilidad
32	LastQty	S	>= 0, sin decimales	Qty	Volumen comprado/vendido en la operación que se describe
151*	LeavesQty	N		Qty	Volumen vivo de la operación. Sólo está presente cuando el mensaje es respuesta a una solicitud de operaciones con volumen vivo
31	LastPx	S		Price	Precio de la operación que se describe
75	TradeDate	S		LocalMktDate	Fecha local del mercado en la que se negoció la operación.
60	TransactTime	S		UTCTimestamp	Fecha y hora, en formato UTC, en que se realizó la transacción.
	Start <TrdRegTimestamps>				
768	NoTrdRegTimestamps	N	1	NumInGroup	

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
→ 769	TrdRegTimestamp	N		UTCTimesta mp	Día y hora de la operación inicial en el Sistema de Negociación
→ 770	TrdRegTimestampType	N	3 = Time Out	Int	
	End <TrdRegTimestamps>				
63	SettlType	N	0 = Regular (valor por defecto) 2 = Next Day (T + 1)	Char	Indica el tipo de liquidación de la operación
552	NoSides	S	1	NumInGroup	Siempre 1 ya que sólo se incluye la parte compradora o vendedora, según corresponda al destinatario del mensaje.
→ 54	Side	S	1 = Buy 2 = Sell	Char	Posición que toma la parte en la operación.
→ 37	OrderID	S		String	Número de orden, único por operador de trading Contiene "NONE" cuando la operación no es resultado de la ejecución de una orden
→ 198	SecondaryOrderID	N		String	Identificador único de la orden de la operación inicial tal y como se asignó por el sistema de negociación.
→	Start <Parties>				
→453	NoPartyIDs	N		NumInGroup	
→→ 448	PartyID	N		String	
→→ 447	PartyIDSource	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	Presente si se ha especificado NoPartyIDs
→→ 452	PartyRole	N	12 = Executing Trader 13 = Order Origination Firm	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID. Presente si se ha especificado NoPartyIDs 12: Código de Operador del Miembro 13: Código del Miembro al que pertenece la cuenta asociada
→	End <Parties>				
→ 1	Account	N		String(5)/(3)	5 caracteres: Cuenta asociada con la operación. Presente en suscripciones que no utilicen la opción especial TrdType [828] = 15 en el mensaje Trade Capture Report Request.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
					3 caracteres (sólo para entregas. Para más información ver el apartado 13.4): Titular de la operación de entrega. Se utiliza para las operaciones de contado a nivel de titular (entregas). Presente en suscripciones que utilicen la opción TrdType [828] = 15 en el mensaje Trade Capture Report Request. No informado (sólo para entregas. Para más información ver el apartado 13.4): Se utiliza para las operaciones de contado a nivel de miembro (entregas). Presente en suscripciones que utilicen la opción especial TrdType [828] = 15 en el mensaje Trade Capture Report Request.
→ 381	GrossTradeAmt	N		Amt	Importe Nominal/Efectivo de la transacción
→ 77	PositionEffect	N	"O" = Open "C" = Close		Indica si la operación abre o cierra posición
→ 58	Text	N		String	Si es una operación procedente de una orden, contiene la referencia asignada en la orden. Si es una aplicación, es la referencia asignada por el intermediario. Si es una asignación de cuenta diaria o un traspaso, contiene la referencia de la operación de procedencia.
→136	NoMiscFees	N	0, 1, 2	NumInGroup	
→→ 137	MiscFeeAmt	N		Amt	Importe de la comisión. Contiene un valor positivo cuando se trata de un pago del Miembro al Mercado. Contiene un valor negativo si se trata de un pago del Mercado al Miembro (retrocesión)
→→ 138	MiscFeeCurr	N		Currency	Divisa en que está expresada la comisión. Codificada según estándar ISO 4217
→→ 139	MiscFeeType	N	4=Exchange Fees 7=Other	Char	Tipo de comisión. Contiene el valor 4 cuando se trata de una comisión de negociación. Contiene el valor 7 cuando se trata de una comisión de liquidación
→→ 891	MiscFeeBasis	N	0 = Absolute	Int	
	Standard Trailer	S			

7.8.5 Position Maintenance Request (Msg Type = AL)

Mensaje usado por la aplicación cliente para realizar una petición de ajuste de posición sobre una cuenta y contrato.

Este mensaje también permite a la aplicación cliente realizar una petición de ejercicio sobre una cuenta y contrato, o cancelar una petición previa. El envío de una nueva petición puede ser usado para reemplazar una solicitud previa.

También es usado para realizar las peticiones de las notificaciones de entrega.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = AL		
710	PosReqID	S		String	Identificador único para cada mensaje Position Maintenance Request
709	PosTransType	S	1 = Exercise 3 = Position Adjustment 4 = Delivery	Int	Indica el tipo de operación sobre la posición
712	PosMaintAction	S	1 = New 2 = Replace 3 = Cancel	Int	En el caso de petición de ejercicio indica si se trata de una solicitud explícita (valor 1) o solicitud de vuelta al comportamiento automático (valor 3). En el caso de un ajuste de posición siempre debe contener 1. En el caso de entregas siempre debe contener 2 y debe tenerse en cuenta que el último mensaje reemplaza totalmente al que está siendo modificado.
713	OrigPosReqRefID	N		String	Si PosTransType [709] = 4 (Delivery): PosReqID [710] de un Maintenance Request anterior que se va a modificar Si PosTransType [709] = 1 ó 3: Ignorado por ClearGate
715	ClearingBusinessDate	S		LocalMktDate	Ignorado por ClearGate
1	Account	S		String(5)/(3)	Código de cuenta de la que se solicita el ajuste de posición o el ejercicio. Si entregas, sólo se informa el titular (3 primeras posiciones de la cuenta del miembro en la ECC)
581	AccountType	S	1	Int	Ignorado por ClearGate
	Start <Instrument>				
55	Symbol	S		String(22)	Código de contrato del que se solicita el ajuste de posición, ejercicio o notificación de entrega. En el caso de petición de ejercicio debe referirse a un contrato de opciones
	End <Instrument>				

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
60	TransactTime	S		UTCTimest amp	Ignorado por ClearGate
	Start <PositionQty>				
702	NoPositions	N		NumInGrou p	Este bloque es requerido, excepto cuando PosMaintAction [712] =3 (Cancel)
→ 703	PosType	N	EX = Option Exercise Qty PA= Adjustment Qty DN = Delivery Notice Qty	String	Debe contener "EX" cuando PosTransType = 1, "PA" cuando PosTransType = 3 y "DN" cuando PosTransType = 4. Requerido si se ha especificado NoPositions
→ 704	LongQty	N	> 0, sin decimales	Qty	Cuando PosType=EX contiene el volumen máximo a ejercer. El valor especial 999999999 significa "ejercer todo" y éste es el valor por defecto. Cuando PosType=PA contiene el número de contratos en que se desea ajustar la posición.
→ 705	ShortQty	N	> 0, sin decimales	Qty	Cuando PosType = DN, indica el número de contratos que se entregan
	Start <NestedParties>				
→ 539	NoNestedPartyIDs	N		NumInGrou p	Número de participantes que se van a informar
→→ 524	NestedPartyID	N		String	Ver NestedPartyRole [538]
→→ 525	NestedPartyIDSource	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	
→→ 538	NestedPartyRole	N	13 = Order Origination Firm 4 = Clearing Firm	Int	Si 13 indica una notificación de entrega efectuada por el propio Miembro Negociador. Si 4 indica una notificación de entrega efectuada por el Liquidador del propio Miembro.
	End < NestedParties >				
→ 600*	LegSymbol	N		String	Símbolo del contrato entregable
	End <PositionQty>				
	Standard Trailer	S			

7.8.6 Position Maintenance Report (Msg Type = AM)

Enviado por ClearGate para informar del resultado de un mensaje Position Maintenance Request.

Este mensaje sólo es enviado al operador que realizó la solicitud. Para realizar un seguimiento, tanto de los ajustes de posición como de las peticiones de ejercicio y las notificaciones de entrega, se puede usar el mensaje Request For Positions con suscripción.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = AM		
721	PosMaintRptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Position Maintenance Report
709	PosTransType	S	1 = Exercise 3 = Position Adjustment 4 = Delivery	Int	Contiene el mismo valor que se especificó en la solicitud
710	PosReqID	S		String	Identificador asignado por el cliente en el mensaje Position Maintenance Request
712	PosMaintAction	S	1 = New 2 = Replace 3 = Cancel	Int	Contiene el mismo valor que se especificó en la solicitud
713	OrigPosReqRefID	S		String	Contiene el mismo valor que se especificó en la solicitud
722	PosMaintStatus	S	0 = Accepted 2 = Rejected	Int	Estado de la petición del mensaje Position Maintenance Request. Si el valor es 2, PosMaintResult contiene un código más específico
723	PosMaintResult	N	0 = Success 4001 = Duplicate PosReqID 4002 = Invalid Account or Symbol 4003 = Invalid quantity 4004 = Nothing to revoke (sólo para PosMaintAction = 3) 4005 = Action not allowed for this contract code 99 = Other	Int	Resultado del mensaje Position Maintenance Request
715	ClearingBusinessDate	S		LocalMktDate	Este campo no debe ser tenido en cuenta y está presente por requerimiento del estándar
1	Account	S		String(5)/(3)	Contiene el mismo valor que se especificó en la solicitud
581	AccountType	S	1	Int	Este campo no debe ser tenido en cuenta y está presente por requerimiento del estándar
	Start <Instrument>				

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
55	Symbol	S	Código de contrato	String(22)	Contiene el mismo valor que se especificó en la solicitud
	End <Instrument>				
60	TransactTime	S		UTCTimestamp	Este campo no debe ser tenido en cuenta y está presente por requerimiento del estándar
	Start <PositionQty>				
702	NoPositions	S		NumInGroup	
→703	PosType	S	EX = Option Exercise Qty PA = Adjustment Qty DN = Delivery Notice Qty DLV = Total Delivery Qty TOT = Total Transaction Qty	String	El valor EX sólo está presente cuando se trata de una respuesta a una petición de ejercicio. El valor PA sólo está presente cuando se trata de una respuesta a una petición de ajuste de posición. Los valores DN y DLV sólo están presentes cuando se trata de entregas.
→704	LongQty	N		Qty	Cuando PosType=EX contiene el número de contratos que se solicitó ejercer. Cuando PosType=PA contiene el número de contratos que se solicitó ajustar. Cuando PosType=TOT contiene el número de contratos comprados que conforman la posición actual. En caso de una solicitud de ajuste de posición aceptada, éste es el valor después del ajuste
→705	ShortQty	N		Qty	Cuando PosType = DN, indica el número de contratos que se entregan. Cuando PosType = DLV, indica el número total de contratos a entregar. Cuando PosType=TOT.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
					Contiene el número de contratos vendidos que conforman la posición actual. En caso de una solicitud de ajuste de posición aceptada, éste es el valor después del ajuste
	Start <NestedParties>				
→ 539	NoNestedPartyIDs	N		NumInGroup	Número de participantes que se van a informar
→→ 524	NestedPartyID	N		String	Ver NestedPartyRole [538]
→→ 525	NestedPartyIDSource	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	
→→ 538	NestedPartyRole	N	13 = Order Origination Firm 4 = Clearing Firm 21 = Clearing Organization	Int	Si 13 indica una notificación de entrega efectuada por el propio Miembro Negociador. Si 4 indica una notificación de entrega efectuada por el Liquidador del propio Miembro. Si 21 indica una notificación de entrega efectuada por la Cámara
	End <NestedParties >				
→ 600*	LegSymbol	N		String	Símbolo del contrato entregable
	End <PositionQty>				
	Start <PositionAmountData>				
753	NoPosAmt	S	0	NumInGroup	Este campo no debe ser tenido en cuenta y está presente por requerimiento del estándar
	End <PositionAmountData>				
58	Text	N			Texto explicativo. Puede estar presente si PosMaintResult es diferente de 0
	Standard Trailer	S			

8. Consulta de operaciones

8.1 Introducción

En este capítulo se describen los mecanismos ofrecidos por la interfaz FIX de la ECC para la consulta de las operaciones registradas en la Contrapartida Central.

La aplicación cliente puede solicitar la consulta de operaciones registradas mediante el mensaje Trade Capture Report Request.

El conjunto de operaciones que se reportan viene determinado por los siguientes criterios de selección:

- Bloque Parties. Permite seleccionar por miembro liquidador y miembro negociador
- Campo TradeDate. Permite discernir si se quieren consultar:
 - Las operaciones de la sesión. En este caso el mensaje de solicitud no debe contener este campo
 - Todas las operaciones vivas, independientemente de la fecha de liquidación. En este caso el mensaje debe contener el valor "19800101" en el campo TradeDate
- Campo Side. Si este campo está presente en el mensaje de solicitud, su valor indica si se desean sólo las operaciones compradoras o las vendedoras

Como respuesta a esta petición se recibe un mensaje Trade Capture Report por cada operación que cumpla los criterios de selección. Si no hay ninguna operación que cumpla los criterios, se recibe un mensaje Trade Capture Report Request Ack informando de este hecho.

La petición se puede realizar en dos modalidades, según se indique en el campo SubscriptionRequestType:

- **SubscriptionRequestType = 0 (Snapshot).** Se recibe un mensaje por cada operación, que cumpla los criterios de selección, registrada anteriormente al momento de la petición
- **SubscriptionRequestType = 1 (Snapshot plus update).** Se reciben los mismos mensajes de la petición Snapshot y a partir de ese momento se recibe un mensaje nuevo por cada operación que se produce y que cumple con el criterio de selección

Cada mensaje recibido contiene un número de registro de liquidación único en el campo SecondaryTradeReportID. Cuando la operación de la que se está informando proviene de una operación previa, el campo SecondaryTradeReportRefID contiene el número de registro de liquidación de la operación original. El identificador de operación de liquidación es el mismo para las dos partes de una operación. Es decir, si se toma tanto el papel de comprador como vendedor, debe esperarse la recepción de dos mensajes Trade Capture Report con el mismo SecondaryTradeReportID.

Para las operaciones que son resultado de negociación, se dispone de los campos SecondaryExecID, OrderID y SecondaryOrderID para realizar la reconciliación front-to-back.

Cuando el mensaje Trade Capture Report es el resultado de la ejecución de una aplicación, puede relacionarse con el correspondiente mensaje Execution Report mediante el campo SecondaryExecID de ambos, que contendrá el mismo valor.

8.2 Consulta por miembro negociador y/o liquidador

El mensaje Trade Capture Report Request permite realizar la consulta por miembro negociador y/o miembro liquidador usando el bloque Parties.

Que un usuario de un liquidador tenga la capacidad de ver la operativa de un miembro al que liquida dependerá de los permisos vigentes.

Cuando en una solicitud no se especifiquen estos campos se considera que la solicitud sólo refiere a las operaciones de todas las cuentas del miembro al que pertenece el operador que realiza la consulta.

Cuando un liquidador desee consultar operaciones de las cuentas que él liquida deberá incluir su propio código de miembro en el campo PartyID asociado al PartyRole 4 (Clearing Firm). Si además se desea restringir esta consulta por miembro negociador se puede usar el campo PartyID asociado al PartyRole 13 (Order Origination Firm).

En la siguiente tabla se presentan diferentes ejemplos de selección y su interpretación. En estos ejemplos el Miembro A es un miembro liquidador que realiza la consulta y el Miembro B es un miembro negociador liquidado por A.

Miembro Negociador (bloque parties con PartyRole = 13)	Miembro Liquidador (bloque parties con PartyRole = 4)	Interpretación
-	-	Selección de las operaciones en cuentas del Miembro A
Miembro A	-	Selección de las operaciones en cuentas del Miembro A
-	Miembro A	Selección de las operaciones cuentas liquidadas por el Miembro A, pertenecientes a cualquier miembro negociador al que liquida, incluidas las suyas
Miembro B	Miembro A	Selección de las operaciones en cuentas liquidadas por el Miembro A, pertenecientes al miembro B
Miembro B	-	Consulta errónea. Si se especifica un código diferente al propio como negociador, deberá especificarse el código de liquidador
-	Miembro B	Consulta errónea. Si se especifica un código diferente al propio como liquidador, deberá especificarse el código propio como negociador

En la siguiente tabla se presentan ejemplos en que la consulta es realizada por el Miembro B, que es un miembro negociador, donde algunas de sus cuentas son liquidadas por el Miembro liquidador A.

Miembro Negociador (bloque parties con PartyRole = 13)	Miembro Liquidador (bloque parties con PartyRole = 4)	Interpretación
-	-	Selección de operaciones cuentas propias del Miembro B
Miembro B	-	Selección de operaciones cuentas propias del Miembro B
Miembro B	Miembro A	Selección de operaciones en cuentas propias del Miembro B que son liquidadas por el Miembro A
-	Miembro A	Consulta errónea. Si se especifica un código diferente al propio como liquidador, deberá especificarse el código propio como negociador

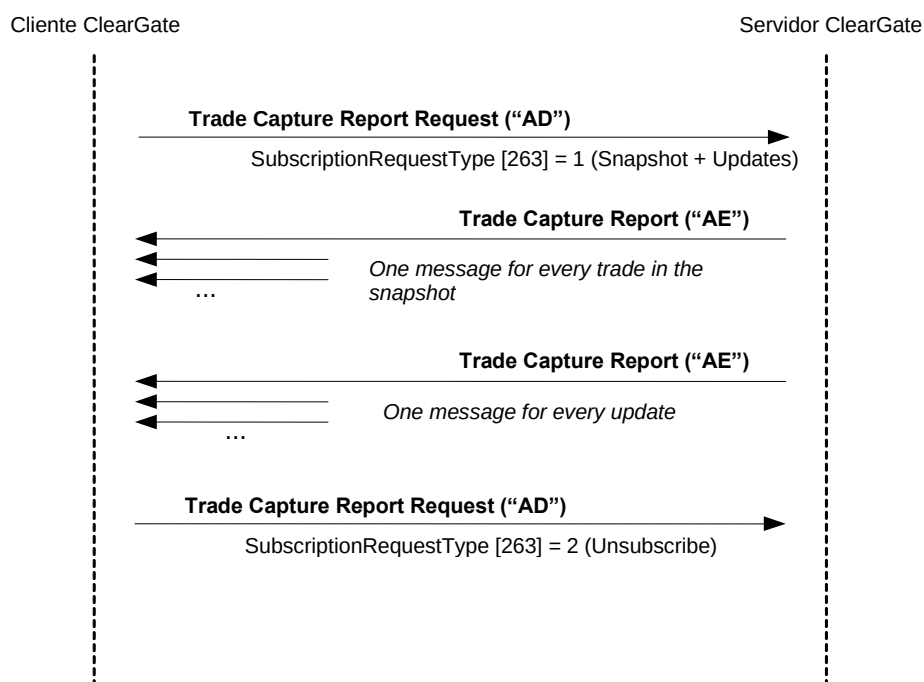
8.3 Lista de mensajes

Mensaje	Descripción
Trade Capture Report Request (Msg Type = AD)	Solicitud de operaciones
Trade Capture Report Request Ack (Msg Type = AQ)	Acuse del mensaje Trade Capture Report Request
Trade Capture Report (Msg Type = AE)	Información de una operación registrada en la contrapartida central

8.4 Flujo de mensajes

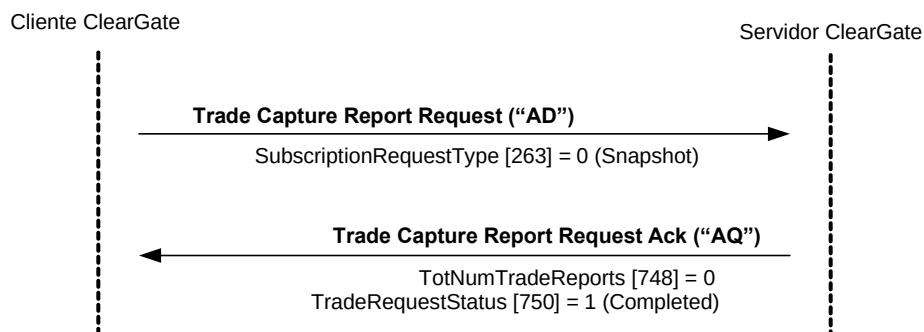
Solicitud de operaciones de cámara con suscripción de actualización, seguido de una cancelación de la suscripción

Después de la solicitud se reciben los mensajes correspondientes a las operaciones que se habían registrado hasta el momento (snapshot) y a partir de este punto se reciben las nuevas operaciones según se vayan registrando.



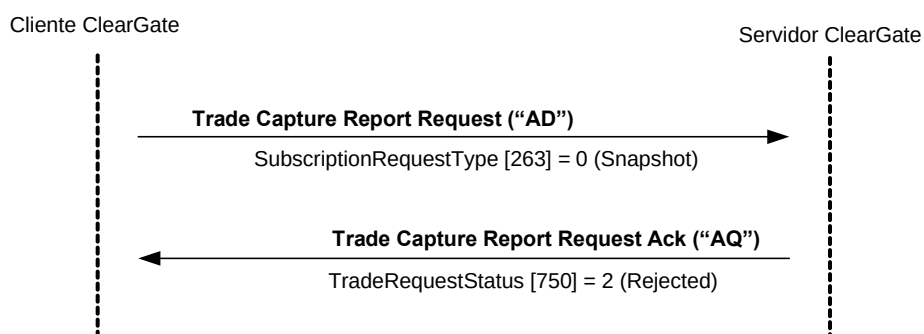
Solicitud de operaciones de cámara sin suscripción de actualización, sin operaciones que cumplan con los criterios de selección

Cuando no hay ninguna operación que cumpla los criterios de selección, el servidor envía un mensaje Trade Capture Report Request Ack para notificar el resultado de la petición, con un valor 0 en el campo TotNumTradeReports.



Solicitud de operaciones de cámara no válida

Cuando la solicitud de operaciones de cámara (mensaje Trade Capture Report Request) no es válida, la solicitud es rechazada mediante un mensaje Trade Capture Report Request Ack.



8.5 Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4

- En el mensaje Trade Capture Report Request sólo se permiten algunos de los criterios de selección contemplados por el estándar

8.6 Definición de mensajes

8.6.1 Trade Capture Report Request (Msg Type = AD)

Mensaje enviado por el cliente para solicitar información de las operaciones de cámara. Permite la solicitud con o sin suscripción a nuevas operaciones.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = AD		
568	TradeRequestID	S		String (10)	Identificador de la solicitud asignado por el usuario. Debe ser un valor único cuando se trate de una petición nueva, y el valor asignado previamente cuando se trate de una finalización de suscripción
569	TradeRequestType	S	0 = All trades that match criteria	Int	
263	SubscriptionRequestType	N	0 = Snapshot (valor por defecto) 1 = Snapshot + Updates 2 = Unsubscribe	Char	Indica si la petición es solicitud, con o sin suscripción o si bien si trata de una cancelación de una petición previa
818	SecondaryTradeReportID	N		String	Número de registro de liquidación
828	TrdType	N	15 = Deliveries	Int	Sólo debe estar presente en la suscripción especial de las operaciones de compra-venta a realizar en IBERCLEAR como consecuencia del proceso de entrega
	Start <Parties>				
453	NoPartyIDs	N		NumInGroup	Número de criterios de selección definidos en el bloque Parties
→ 448	PartyID	N		String	Código de Miembro Requerido si se ha especificado NoPartyIDs
→ 447	PartyIDSource	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	Requerido si se ha especificado NoPartyIDs
→ 452	PartyRole	N	13 = Order Origination Firm 4 = Clearing Firm	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID. Requerido si se ha especificado NoPartyIDs
	End <Parties>				
580	NoDates	N	1	NumInGroup	
→75	TradeDate	N	"19800101"	LocalMktDate	Sólo debe estar presente en la solicitud de todas las operaciones con volumen vivo diferente de 0. En dicho caso debe contener el valor especial "19800101"
54	Side	N	1 = Buy 2 = Sell	Char	Criterio opcional de selección. Permite obtener sólo operaciones en que se actúa como comprador o como vendedor
	Standard Trailer	S			

8.6.2 Trade Capture Report Request Ack (Msg Type = AQ)

Mensaje usado por ClearGate para notificar que un mensaje Trade Capture Report Request no es válido o que no hay ninguna operación que cumpla los criterios de selección.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = AQ		
568	TradeRequestID	S		String	Identificador especificado en el mensaje de solicitud Trade Capture Report Request correspondiente
569	TradeRequestType	S		Int	Mismo valor que se especificó en la solicitud
263	SubscriptionRequestType	N	0 = Snapshot (valor por defecto) 1 = Snapshot + Updates 2 = Unsubscribe	Char	El mismo valor que se especificó en la solicitud
748	TotNumTradeReports	N	0	Int	Número de operaciones que contiene la selección. Siempre es 0 ya que este mensaje sólo es enviado cuando la solicitud no es válida o no hay operaciones que cumplan los criterios de selección
749	TradeRequestResult	S	0 = Successful 2 = Invalid TradeRequestType 99 = other	Int	Resultado de la petición Cuando el valor es 99, el campo Text contiene un texto explicativo
750	TradeRequestStatus	S	1 = Completed 2 = Rejected	Int	Estado de la petición. Cuando se informa de un error el valor es 2, cuando no hay operaciones que cumplan los criterios el valor es 1
58	Text	N		String	Contiene un texto explicativo del motivo de rechazo
	Standard Trailer	S			

9. Gestión de Operaciones

9.1 Introducción

En este capítulo se cubren las funcionalidades asociadas con el traspaso, total o parcial, de una operación de una cuenta a otra y con la asignación de operaciones a precio medio.

La ECC clasifica esta operativa según el tipo de las cuentas de origen y destino.

Término ECC	Origen	Destino
Asignación de cuenta diaria	Cuenta diaria	Cuenta ordinaria (mismo miembro)
Traspaso	Cuenta ordinaria	Cuenta ordinaria (mismo miembro)
Asignación de operaciones a precio medio	Cuenta ordinaria	Misma cuenta origen
Give-up	Cuenta diaria o ordinaria	Otro miembro

La ECC sólo permite el traspaso de órdenes ya ejecutadas, es decir operaciones.

En los siguientes apartados se describen las particularidades de las diferentes operativas.

9.2 Asignación de cuenta diaria y traspaso

Desde el punto de vista de la interfaz FIX, una asignación de cuenta diaria y un traspaso funcionan del mismo modo. La única diferencia es el tipo de la cuenta origen, y este atributo está implícito en la cuenta y por tanto no hay que especificarlo en el mensaje.

La solicitud se realiza mediante el mensaje Allocation Instruction, indicando los datos de la operación a transferir y la cuenta destino.

ClearGate informa del estado de la solicitud, al operador que la realizó, mediante el mensaje Allocation Instruction Ack.

Cuando la solicitud es aceptada y realizada todos los operadores del Miembro reciben un mensaje Confirmation con los datos del traspaso realizado.

9.3 Asignación de operaciones a precio medio

Posibilidad de agrupar operaciones hechas en la misma sesión, por un solo miembro, en un único contrato, en una misma cuenta, en el mismo lado y asignarlas al precio medio ponderado de esta agrupación.

La solicitud se realiza mediante el mensaje Allocation Instruction, indicando los datos de las operaciones que se quieren agrupar.

ClearGate informa del estado de la solicitud, al operador que la realizó, mediante el mensaje Allocation Instruction Ack.

Cuando la solicitud es aceptada y realizada todos los operadores del Miembro reciben los correspondientes mensajes Trade Capture Report.

9.4 Give-up (Miembro Origen)

La operativa de Give-up siempre es iniciada por el Miembro al que pertenece la cuenta asociada a la operación que se va a transferir. En este documento, dicha figura es referida como Miembro Origen.

El Miembro Origen puede solicitar la realización de un Give-up mediante el mensaje Allocation Instruction. Dicho mensaje debe contener los datos de la operación a transferir, el Miembro Destino y una referencia para el Miembro Destino.

Antes de que el Give-up sea aceptado por el Miembro Destino, cualquier operador del Miembro Origen puede cancelar la solicitud con un nuevo mensaje Allocation Instruction.

ClearGate notifica los estados de la petición, al operador que la realizó, mediante mensajes Allocation Instruction Ack.

Por otro lado, ClearGate informa a todos los operadores del Miembro Origen, incluido el que inició la actuación, de los datos del Give-up y los diferentes estados por los que va pasando mediante mensajes Confirmation.

9.5 Give-up (Miembro Destino)

El Miembro Destino es el seleccionado por el Miembro Origen, en su mensaje de solicitud, como receptor de la operación que se va a transferir.

Una vez la solicitud de Give-up es procesada por los sistemas centrales, ésta puede ser aceptada automáticamente o quedar pendiente de aceptación por parte de Miembro Destino.

El hecho de que un Give-up sea aceptado de forma automática dependerá de la normativa de la Cámara y los posibles filtros que el Miembro Destino tenga configurados.

En el caso de que el Give-up quede pendiente de aceptación, ClearGate envía un mensaje Confirmation a todos los operadores del Miembro Destino informando de los datos del Give-up y solicitando la aceptación o rechazo del mismo. Si el Miembro Destino tiene definida una cuenta destino para la referencia introducida en el mensaje de solicitud, ésta cuenta estará presente en el mensaje.

La aceptación o rechazo de un Give-up se realiza con un mensaje Confirmation Ack. En caso de aceptación, en dicho mensaje debe indicarse la cuenta destino del Give-up, independientemente de si se recibió información de la cuenta asociada a la referencia.

Si el Miembro Destino es liquidador de la cuenta que ha elegido como destino, su aceptación es suficiente para la realización del Give-up. Si el Miembro Destino no es liquidador de dicha cuenta, será necesaria la aceptación del Miembro Liquidador para la realización del Give-up.

Si es necesaria la aceptación por parte del Miembro Liquidador de la cuenta destino, una vez éste se ha pronunciado, ClearGate envía un mensaje Confirmation informando del estado en que queda el Give-up.

En caso de que el Miembro Liquidador rechace el Give-up, éste vuelve a quedar pendiente del Miembro Destino, que puede optar por rechazarlo definitivamente o volver a especificar una cuenta. Ambas actuaciones se llevan a cabo con el mensaje Confirmation Ack tal y como se ha descrito previamente en este mismo apartado.

9.6 Give-up (Liquidador de la cuenta destino)

Cuando el Miembro Destino de un Give-up no es liquidador de su operativa, será necesaria la aceptación del Miembro Liquidador de la cuenta destino para que se realice el Give-up.

Al igual que sucede en el caso del Miembro Destino, esta aceptación puede ser realizada de forma automática por los sistemas centrales de la ECC a partir de los posibles filtros que el Miembro Liquidador tenga definidos.

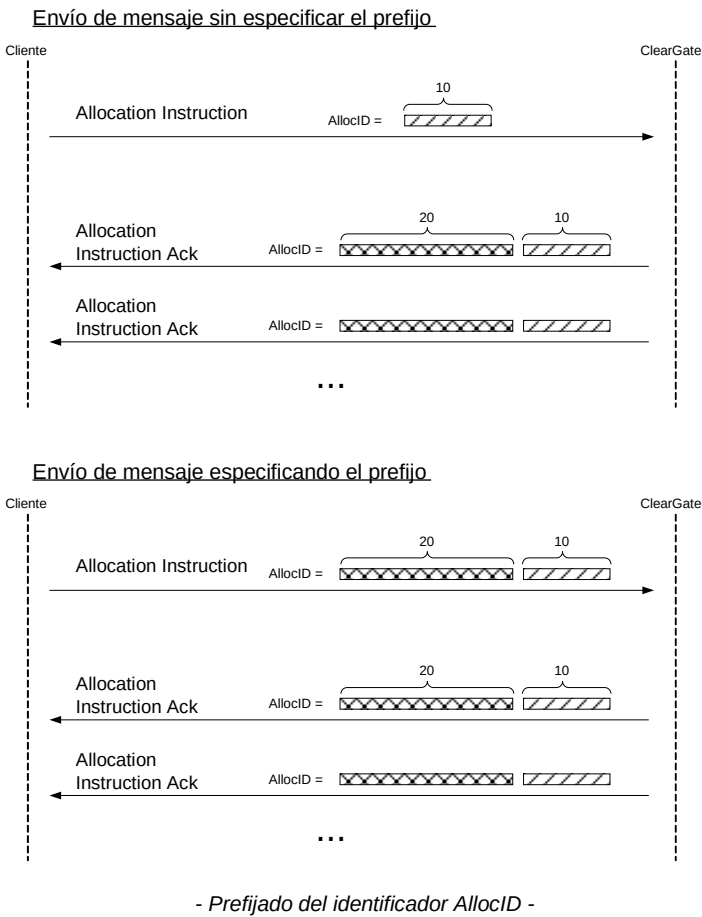
Cuando un Give-up queda pendiente de la aceptación por parte del Miembro Liquidador de la cuenta destino, ClearGate envía un mensaje Confirmation a todos los operadores de este miembro, informando de los datos del Give-up y solicitando la aceptación o rechazo del mismo. Esta aceptación o rechazo se realiza con un mensaje Confirmation Ack.

Cuando el Give-up es rechazado por el Miembro Liquidador, éste queda pendiente de actuación por parte del Miembro Destino. El Miembro Liquidador sólo volverá a recibir un mensaje relacionado con este Give-up cuando el Miembro Destino opte por volver a seleccionar una cuenta que también sea liquidada por él.

9.7 Campo AllocID

El campo AllocID, presente en una solicitud iniciada con un mensaje Allocation Instruction, es el identificador que permite cancelar dicha petición (sólo Give-up), así como relacionar la petición con los mensajes Confirmation de notificación de estado de traspasos o Give-ups.

El campo AllocID asignado por el cliente debe ser de diez caracteres de longitud. Si la longitud fuese inferior, ClearGate completa con espacios por detrás hasta llegar a dicha longitud. ClearGate también acepta que los mensajes enviados por el cliente usen un AllocID de longitud 30, en este caso sólo las 10 últimas posiciones pueden ser fijadas libremente, ya que las 20 primeras deben coincidir con el formato que se presenta a continuación.



ClearGate realiza un proceso de prefijado del campo AllocID para evitar duplicados en este identificador.

El AllocID asignado por ClearGate en el mensaje de respuesta tiene el formato AAMDDMmmmTttMmmmTttNnnnnnnnnn, formado con la siguiente codificación:

- **AAMDD**. Es la fecha de la sesión de cámara
- **MmmmTtt**. Contiene el código de miembro y operador de conexión desde el que se realizó la solicitud
- **Nnnnnnnnnn**. Es el valor asignado por la aplicación cliente a AllocID en el mensaje original

En el caso de los Give-up, este identificador también está presente en los mensajes Confirmation recibidos por el Miembro Origen, que se generan como resultado de la solicitud de Give-up.

Un operador del Miembro Origen que quiera cancelar un Give-up, debe usar este identificador en el campo RefAllocID del mensaje Allocation Instruction de solicitud.

9.8 Campo SecondaryAllocID

El campo SecondaryAllocID es un identificador único para cada traspaso realizado en la ECC, sea éste un Give-up, una asignación de cuenta diaria o un traspaso propiamente dicho.

Este campo está presente en los mensajes Confirmation que las aplicaciones cliente reciben informando del estado de un traspaso.

De este modo todos los mensajes relacionados con un mismo Give-up contendrán el mismo valor en este campo, independientemente del papel que tome el receptor. Por ello, este valor permite identificar de forma unívoca el Give-up frente a la cámara y el resto de participantes.

9.9 Seguimiento de operaciones mediante los mensajes Trade Capture Report

En la ECC, la operativa de traspasar, total o parcialmente, una operación de una cuenta a otra se lleva a cabo mediante la realización de dos nuevas operaciones. La primera es sobre la cuenta origen y con signo opuesto a la operación original. La segunda es sobre la cuenta destino y con el mismo signo que la operación original. El volumen de ambas operaciones es el número de contratos que se transfieren de la operación original.

Una vez realizado el proceso de traspaso, sea éste una asignación de cuenta diaria, un traspaso, un Give-up o una asignación de operaciones a precio medio, aquellos operadores que estén suscritos recibirán los mensajes Trade Capture Report de la operación u operaciones correspondientes.

En el caso de que la operación provenga de un traspaso, el mensaje Trade Capture Report contiene una serie de campos relevantes para la reconciliación de la información y el seguimiento de operaciones:

- **PositionEffect.** Indica si la operación abre o cierra posición. De las operaciones derivadas de un traspaso, la realizada sobre la cuenta origen contendrá "C" (Close), y la realizada sobre la cuenta destino "O" (Open).
- **SecondaryTradeReportRefID.** Contiene el número de registro de liquidación de la operación de procedencia.
- **SecondaryTradeReportID.** Contiene el número de registro de liquidación de la nueva operación. Este mismo campo se encuentra en los mensajes Confirmation relacionados que informan de la aceptación.
- **TrdMatchID.** Contiene el número de registro de liquidación de la operación inicial.

9.10 Lista de mensajes

Mensaje	Descripción
Allocation Instruction (Msg Type = J)	Solicitud de un traspaso, una asignación de cuenta diaria, un Give-up o una asignación de operaciones a precio medio
Allocation Instruction Ack (Msg Type = P)	Acuse del mensaje Allocation Instruction. Contiene el estado de la solicitud relacionada
Confirmation (Msg Type = AK)	Informe del estado de un traspaso, una asignación de cuenta diaria o un Give-up. También usado para solicitar la aceptación o rechazo de un Give-up
Confirmation Ack (Msg Type = AU)	Mensaje de aceptación o rechazo de un Give-up
Business Message Reject (MsgType = j)	Mensaje usado por ClearGate para el rechazo de un mensaje Confirmation Ack inválido
Trade Capture Report (Msg Type = AE)	Informe de ejecución de una operación. Enviado a los clientes implicados que estén suscritos

9.11 Flujo de mensajes

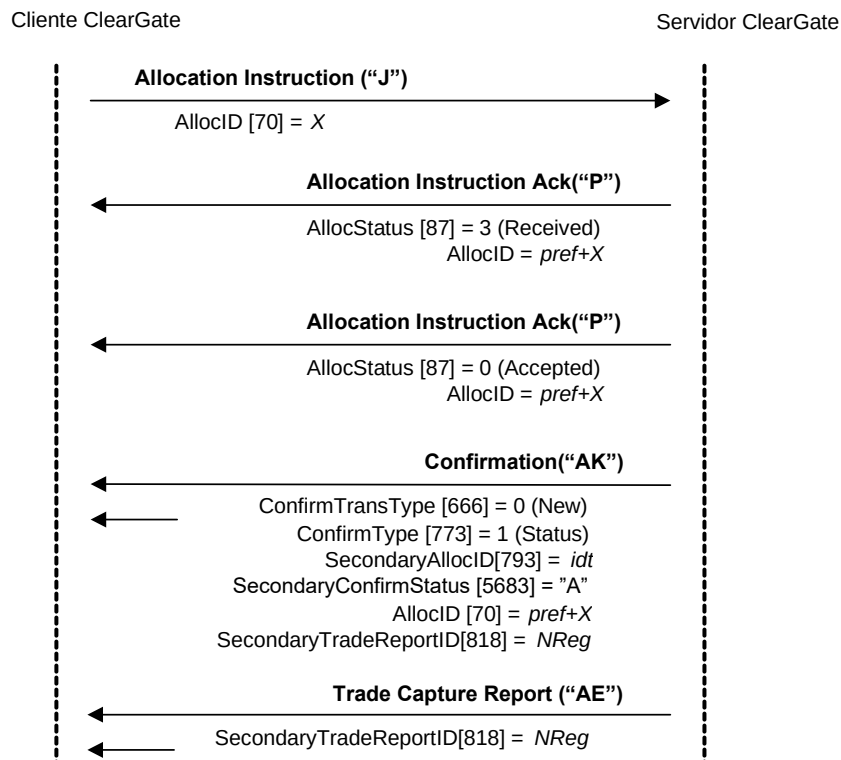
En los diagramas presentes en este apartado el uso de dos flechas indica que el mensaje va dirigido a todos los operadores del miembro en cuestión.

Solicitud de asignación de cuenta diaria o de traspaso aceptada

El cliente envía la solicitud mediante un mensaje Allocation Instruction. Primero recibe el mensaje Allocation Instruction Ack con el campo AllocStatus = 3, que indica que ClearGate ha recibido el mensaje y lo ha enviado a los sistemas centrales. Posteriormente se recibe el mensaje Allocation Instruction Ack con el campo AllocStatus = 0, que indica que el mensaje ha sido aceptado por los sistemas centrales.

Cuando la asignación ha sido realizada, se envía un mensaje Confirmation a todos las aplicaciones cliente del Miembro para informar de los datos de la solicitud.

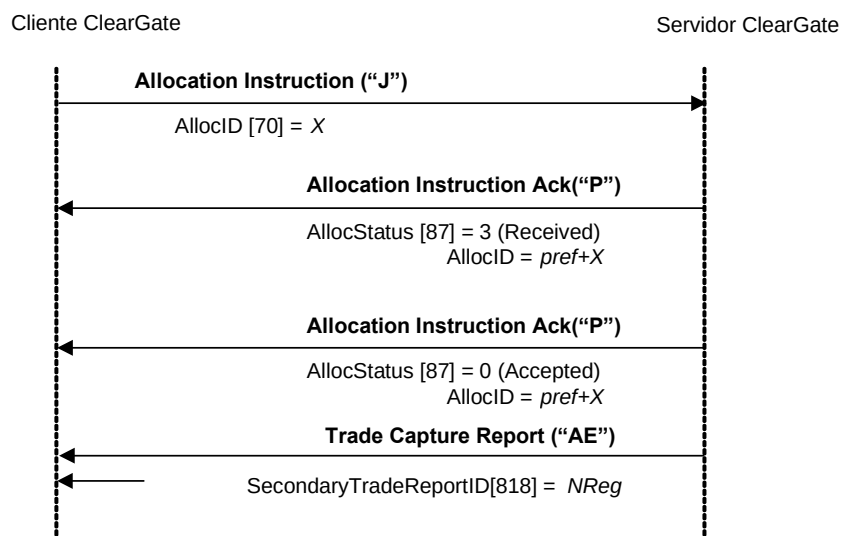
Además, se envía un mensaje Trade Capture Report por cada operación que se derive de la asignación realizada, a las aplicaciones cliente suscritas a este tipo de mensajes.



Solicitud de operaciones a precio medio aceptada

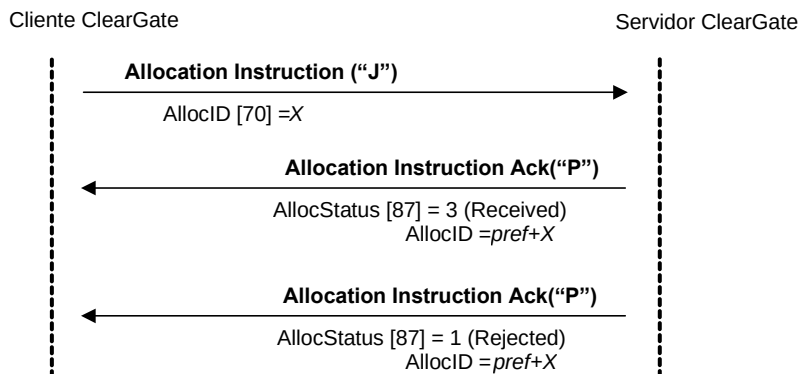
El cliente envía la solicitud mediante un mensaje Allocation Instruction. Primero recibe el mensaje Allocation Instruction Ack con el campo AllocStatus = 3, que indica que ClearGate ha recibido el mensaje y lo ha enviado a los sistemas centrales. Posteriormente se recibe el mensaje Allocation Instruction Ack con el campo AllocStatus = 0, que indica que el mensaje ha sido aceptado por los sistemas centrales.

Cuando la asignación de operaciones a precio medio sido realizada, se envían los correspondientes mensajes Trade Capture Report a las aplicaciones cliente suscritas a este tipo de mensajes.



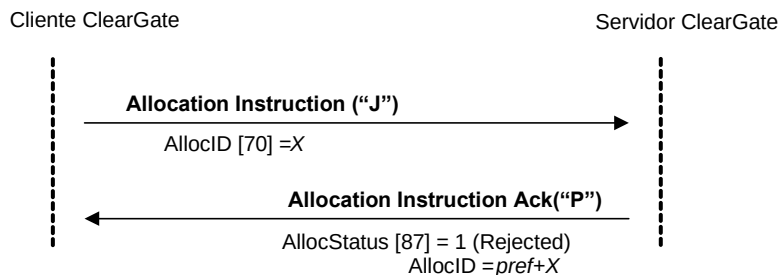
Solicitud de asignación rechazada por los sistemas centrales

El cliente envía la solicitud mediante un mensaje Allocation Instruction. Primero recibe el mensaje Allocation Instruction Ack con el campo AllocStatus = 3, que indica que ClearGate ha recibido el mensaje y lo ha enviado a los sistemas centrales. Finalmente recibe el mensaje Allocation Instruction Ack con el campo AllocStatus = 1, que indica que la asignación ha sido rechazada por los sistemas centrales.

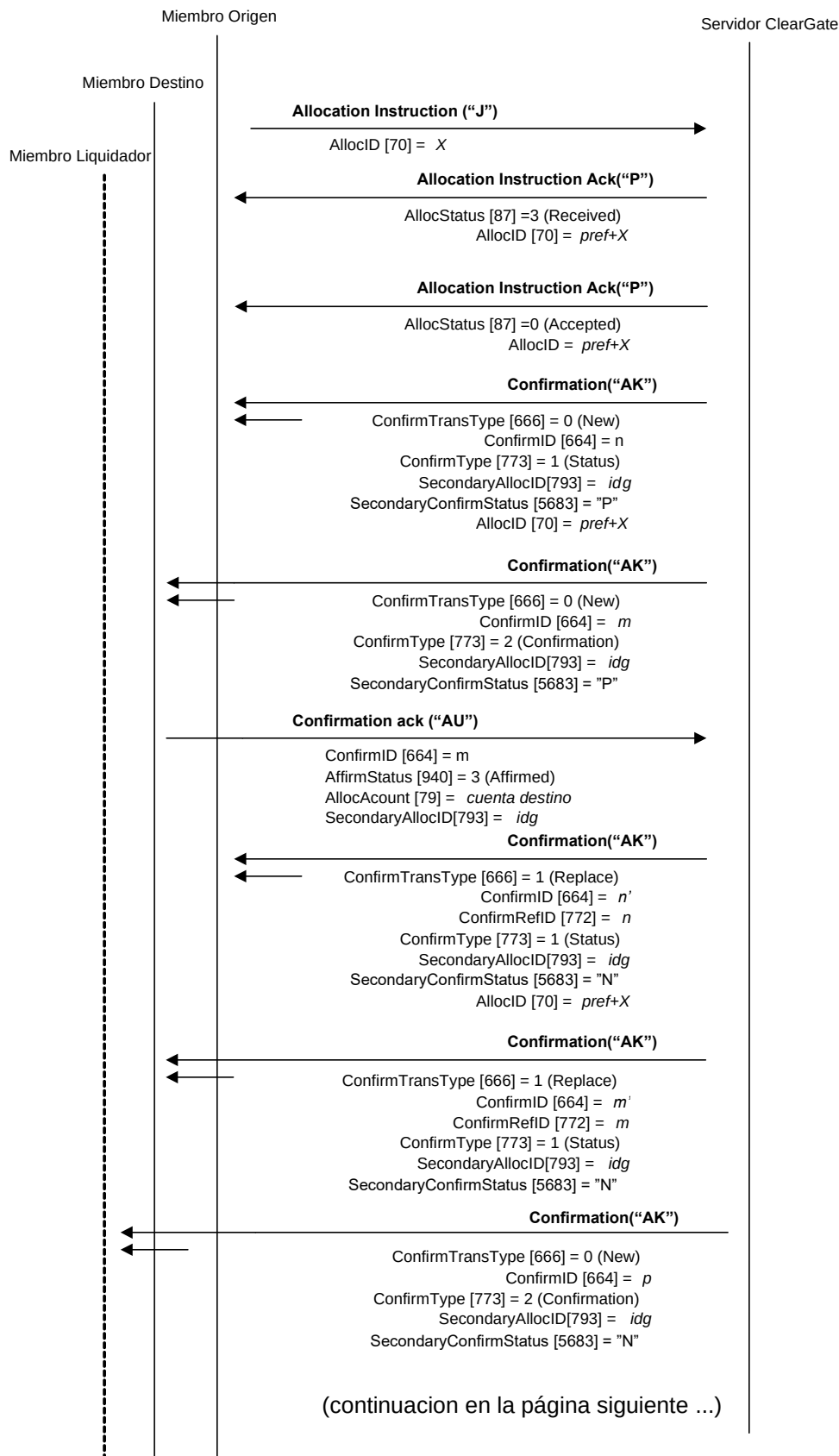


Solicitud de asignación rechazada por el servidor ClearGate

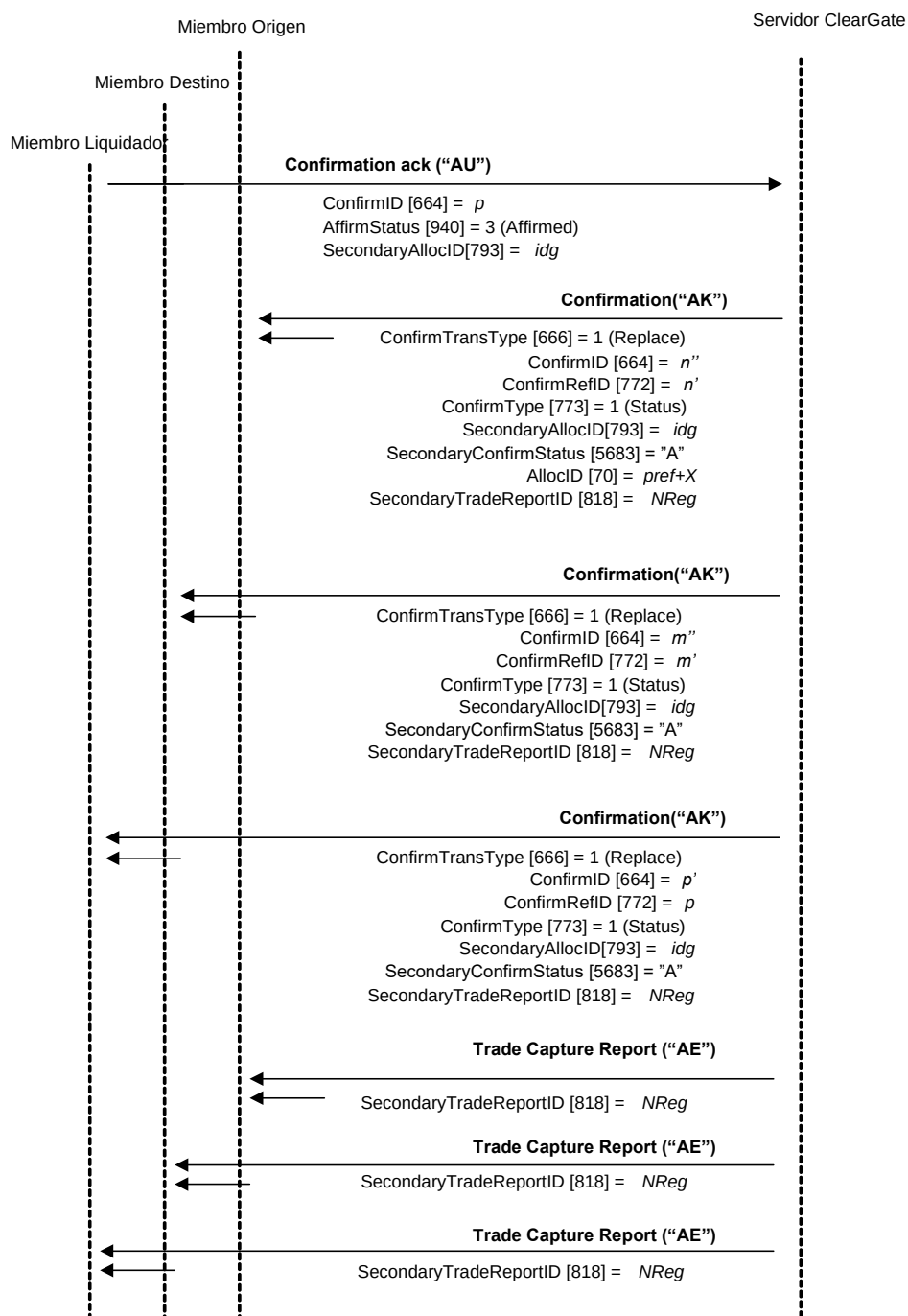
El cliente envía la solicitud mediante un mensaje Allocation Instruction. El mensaje es rechazado por ClearGate que responde con el mensaje Allocation Instruction Ack con el campo AllocStatus = 1.



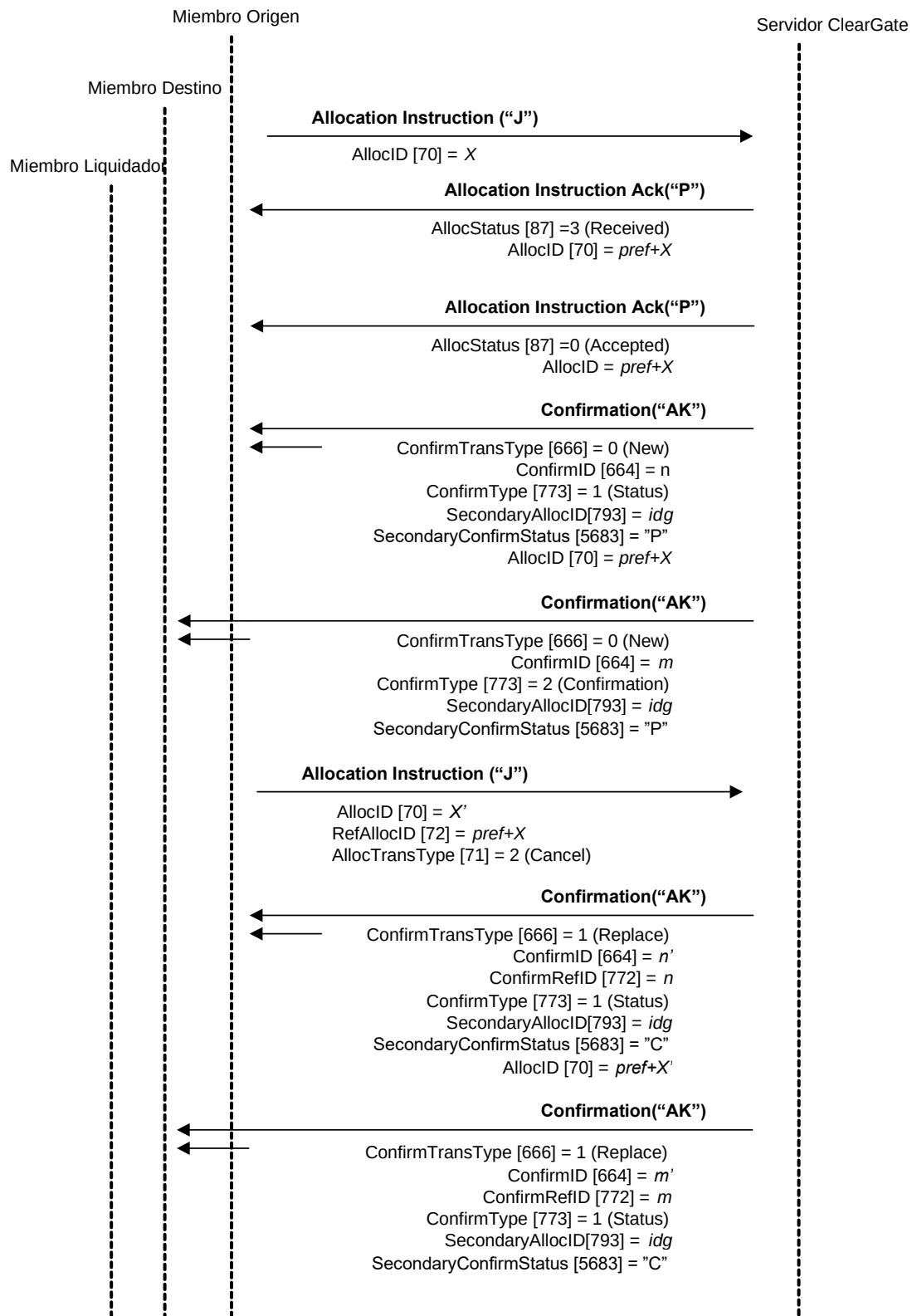
Solicitud de Give-up aceptada cuyo Miembro Destino no es liquidador de su propia operativa



(... continuación de la página anterior)

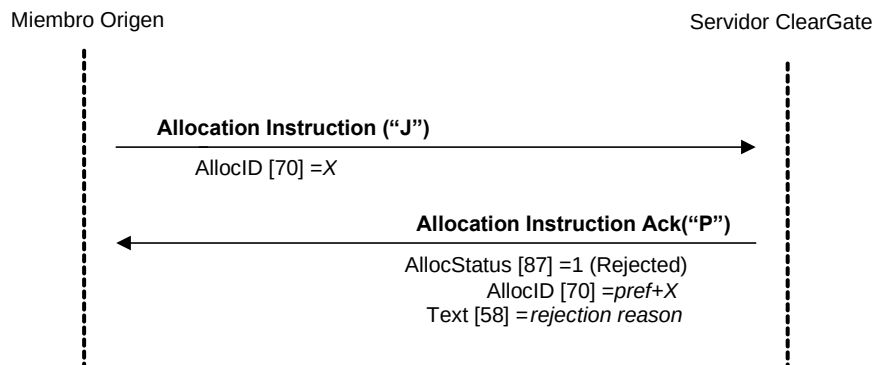


Cancelación del Give-out por parte del Miembro Origen



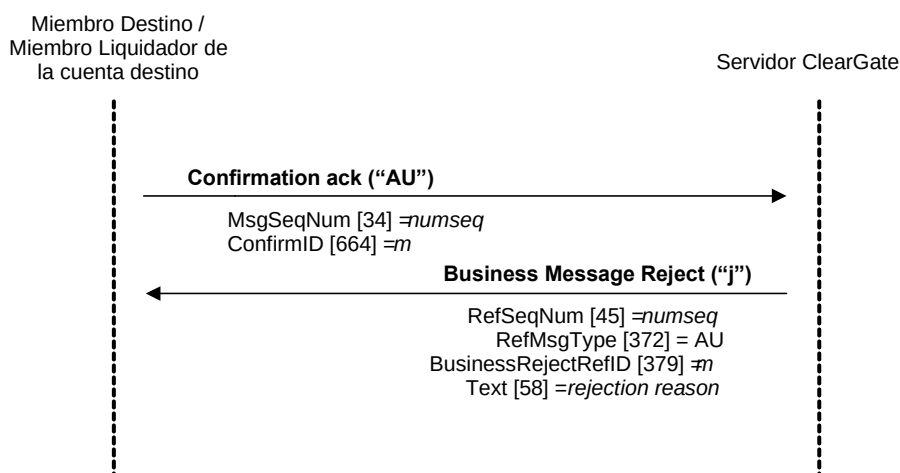
Solicitud de alta o cancelación de Give-up rechazada

Cuando una solicitud para dar de alta o cancelar un Give-up no sea válida, será rechazada mediante el correspondiente mensaje Allocation instruction Ack. En dicho caso no existe un mensaje Confirmation asociado ya que no se llega a procesar la solicitud.



Envío de mensaje Confirmation Ack rechazado

Cuando un mensaje Confirmation Ack no sea válido, ya sea por los datos o por el estado del Give-up de referencia, será rechazado con un mensaje Business Message Reject.



9.12 Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4

- Sólo algunas de las funcionalidades definidas por FIX relacionadas con el mensaje Allocation Instruction están soportadas. Los traspasos sólo están permitidos post-trade por tanto, basados en operaciones y no en órdenes. Por ello, ciertos campos relacionados con órdenes que son requeridos por el estándar son ignorados por ClearGate.
- FIX permite la asignación de varias operaciones en un único mensaje y permite la asignación a varias cuentas. Estas funcionalidades no están soportadas por ClearGate. Un mensaje Allocation Instruction está relacionado con una única operación y cuenta destino.
- Los campos NoExecs (124), LastQty (32), AllocAccount (79) y AllocQty (80) han pasado a ser requeridos en el mensaje Allocation Instruction.
- Se ha añadido el campo SecondaryTradeReportID (818) al mensaje Allocation Instruction. Este campo es requerido en el mensaje.
- Se han añadido los campos SecondaryTradeReportID (818), NoExecs (124) y SecondaryTradeReportRefID (881) al mensaje Confirmation.
- Se ha añadido el campo de usuario SecondaryConfirmStatus (5683) al mensaje Confirmation.
- Se han añadido los campos AllocAccount (79) y SecondaryAllocID (793) al mensaje Confirmation Ack.

9.13 Definición de mensajes

9.13.1 Allocation Instruction (Msg Type = J)

Mensaje enviado por el cliente para solicitar un traspaso, una asignación de cuenta diaria, una petición de Give-up o una asignación de operaciones a precio medio.

El criterio usado por ClearGate para diferenciar un Give-up de un traspaso o una asignación es la presencia del campo 538 en el mensaje.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = J		
70	AllocID	S		String(30)	Identificador único para cada mensaje Allocation Instruction
71	AllocTransType	S	0 = New 2 = Cancel	Char	Indica si el mensaje es de solicitud de traspaso o cancelación. La cancelación sólo puede realizarse sobre un traspaso de tipo Give-up que esté pendiente de aceptación por parte del destino
626	AllocType	S	1 = Buyside Calculated	Int	
72	RefAllocID	N		String(30)	Identificador de la solicitud de Give-up a cancelar. Requerido cuando AllocTransType contiene 2.
796	AllocCancReplaceReason	N	1 = Original details incomplete/incorrect 99 = Other	Int	Requerido cuando AllocTransType contiene 2. Ignorado por ClearGate
857	AllocNoOrdersType	S	0 = Not specified	Int	
124	NoExecs	S*		NumInGroup	Indica el número de operaciones que se van a asignar. Debe ser 1 excepto en asignación de operaciones a precio medio.
→32	LastQty	S*	> 0, sin decimales	Qty	Volumen de la operación
→31	LastPx	S*		Price	Precio de la operación. Requerido. Ignorado por ClearGate en asignación de operaciones a precio medio.
→818*	SecondaryTradeReportID	S*		String	Número de registro de liquidación de la operación a traspasar
54	Side	S	1 = Buy 2 = Sell	Char	Indica si la operación a transferir es compradora o vendedora
	Start <Instrument>				
55	Symbol	S	Código de contrato	String(22)	Código de contrato
	End <Instrument>				
53	Quantity	S	> 0	Qty	Cantidad de contratos a ser transferidos
6	AvgPx	S		Price	Precio de la operación resultante. Debe contener el mismo valor que el campo LastPx.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
					Ignorado por ClearGate en asignación de operaciones a precio medio.
75	TradeDate	S		LocalMktDate	Ignorado por ClearGate
78	NoAllocs	S*	1	NumInGroup	Número de destinos. ClearGate sólo acepta un único destino
→ 79	AllocAccount	S*	Longitud exacta	String(5)	Cuenta destino Ignorado por ClearGate cuando la solicitud es de Give-up
→ 80	AllocQty	S*		Qty	Cantidad a ser transferida. Debe ser igual a la suma de todos los campos LastQty [32] que se envían en este mensaje Allocation Instruction.
→	Start <NestedParties>				
→ 539	NoNestedPartyIDs	N		NumInGroup	Requerido cuando la solicitud es de Give-up
→→ 524	NestedPartyID	N		String	Referencia interna de Give-out, Código del Miembro Destino del Give-up, referencia de Give-up o mnemotécnico de Give-out. Para la referencia interna de Give-out (NestedPartyRole=3) este campo está limitado a 18 caracteres. Para el Miembro Destino del Give-up (NestedPartyRole=14) este campo tiene una longitud exacta de 4 caracteres alfanuméricos. Para la referencia de Give-up (NestedPartyRole=24) este campo está limitado a 18 caracteres. Para el mnemotécnico de Give-out (NestedPartyRole=33) este campo está limitado a 10 caracteres. Requerido si se ha especificado NoNestedPartyIDs
→→ 525	NestedPartyIDSource	N	D = Proprietary/ Custom code	Char	Requerido si se ha especificado NoNestedPartyIDs
→→ 538	NestedPartyRole	N	3 = Give-out internal reference 14 = Give-Up Clearing Firm 24 = Give-up Reference 33 = Give-up mnemonic	Int	Requerido si se ha especificado NoNestedPartyIDs. El valor 3 indica que el contenido de NestedPartyID corresponde a la referencia asignada por el Miembro Origen para uso interno y que se asocia al mnemotécnico de Give-out. Una misma referencia interna puede estar asociada a más de un mnemotécnico. Puede no estar informada. El valor 14 Indica que el contenido de NestedPartyID corresponde al Miembro Destino del Give-up. El valor 24 indica que el contenido de NestedPartyID corresponde a la referencia de Give-up.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
					El valor 33 indica que el contenido de NestedPartyID corresponde al mnemotécnico de Give-out.
→	End <NestedParties>				
	Standard Trailer	S			

9.13.2 Allocation Instruction Ack (Msg Type = P)

Mensaje usado por ClearGate para indicar el estado de la petición iniciada con un mensaje Allocation Instruction.

Este mensaje sólo es enviado al operador que realizó la solicitud relacionada.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = P		
70	AllocID	S		String(30)	Identificador asignado por el cliente en el mensaje Allocation Instruction
75	TradeDate	N		LocalMkt Date	
87	AllocStatus	S	0 = Accepted 1 = Rejected 3 = Received not yet processed	Int	Estado de la solicitud. El valor 0 indica que el mensaje ha sido aceptado por los sistemas centrales. El valor 1 indica que el traspaso o la asignación ha sido rechazada. El valor 3 indica que el mensaje ha sido recibido por el servidor ClearGate
88	AllocRejCode	N	0 = Unknown account 1 = Incorrect quantity 7 = Other 8 = Incorrect allocated quantity	Int	Identifica la razón de rechazo. Sólo está presente cuando AllocStatus = 1 Si contiene el valor 7, el campo Text contiene un texto explicativo del motivo de rechazo
58	Text	N		String	Texto explicativo del motivo de rechazo
	Standard Trailer	S			

9.13.3 Confirmation (Msg Type = AK)

Mensaje usado por ClearGate para notificar el estado de una asignación de cuenta diaria, traspaso, o Give-up. También usado para solicitar la aceptación o rechazo de un Give-up.

En la descripción de los campos de este mensaje se usará el término “traspaso” para referirse tanto a la asignación de cuenta diaria, el Give-up o el traspaso propiamente dicho.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = AK		
664	ConfirmID	S		String	Identificador único para cada mensaje Confirmation
772	ConfirmRefID	N		String	Identificador del mensaje Confirmation que es reemplazado por este mensaje. Presente cuando ConfirmTransType = 1
666	ConfirmTransType	S	0 = New 1 = Replace	Int	
773	ConfirmType	S	1 = Status 2 = Confirmation	Int	Indica si el mensaje es una solicitud de aceptación de un Give-up (2=Confirmation) o una notificación del estado de un traspaso (1=Status)
665	ConfirmStatus	S	1 = Received	Int	El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta, está presente por requerimiento del estándar
	Start <Parties>				
453	NoPartyIDs	N		NumInGroup	
→ 448	PartyID	N		String	Código de miembro, Operador o referencia de Give-up
→ 447	PartyIDSource	N	D = Proprietary / custom code	String	Requerido si se ha especificado NoPartyIDs
→ 452	PartyRole	N	1 = Executing Firm 3 = Give-out internal reference 4 = Clearing Firm 12 = Executing Trader 14 = Give-up Clearing Firm 24 = Give-up Reference 33 = Give-up mnemonic 36 = Clearing Broker Trader	Int	Requerido si se ha especificado NoPartyIDs. El valor 1 está presente en los mensajes destinados al Miembro Origen y al Miembro Destino de un Give-up informándoles del Miembro Origen. El valor 3, cuando está presente, informa de la referencia interna al Miembro Origen del Give-up. El valor 4 está presente en los mensajes destinados al Miembro Destino cuando el mensaje contiene una cuenta en el campo 79, informándole del Miembro Liquidador de dicha cuenta. Este valor también esta presenta en los mensajes enviados al Miembro Liquidador. El valor 12 está presente en los mensajes destinados a los usuarios del Miembro que realizó la solicitud de traspaso, así como a los usuarios del Miembro Destino del Give-up si es el caso, informándoles del operador que inició la solicitud. El valor 14 está presente en todos los mensajes relacionados con Give-up, informando del Miembro Destino. El valor 24, cuando está presente, informa de la referencia del Give-up.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
					El valor 33, cuando esté presente, informa del mnemotécnico del Give-out al Miembro Origen y del mnemotécnico del Give-in al Miembro Destino. El valor 36, cuando esté presente, informa del operador del Miembro Destino que realizó la aceptación o rechazo de un Give-up.
	End <Parties>				
70	AllocID	N		String(30)	Identificador del mensaje Allocation Instruction relacionado. Sólo presente cuando el mensaje va destinado al Miembro del operador que inició la actuación
793	SecondaryAllocID	N		String(10)	Identificador único del traspaso
60	TransactTime	S		UTCTime stamp	Hora, en formato UTC, en que se realiza la transacción
75	TradeDate	S		LocalMkt Date	Fecha en que se realiza la transacción
	Start <Instrument>				
55	Symbol	S		String(22)	Código de contrato
	End <Instrument>				
711	NoUnderlyings	S	0	NumInGroup	Este campo no debe ser tenido en cuenta y está presente por requerimiento del estándar
555	NoLegs	S	0	NumInGroup	Este campo no debe ser tenido en cuenta y está presente por requerimiento del estándar
80	AllocQty	S	> 0, sin decimales	Qty	Volumen del traspaso
54	Side	S	1 = Buy 2 = Sell	Char	Indica el signo de la operación a traspasar
862	NoCapacities	S	0	Int	El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta, está presente por requerimiento del estándar
79	AllocAccount	S		String(5)	Cuenta destino. En un Give-up sólo se informa de este campo cuando se recibe el mensaje como destino o liquidador (nunca como origen). En cualquier otro caso contiene "[N/A]".
6	AvgPx	S		Price	Precio de la operación
381	GrossTradeAmt	S		Amt	Importe Nominal/Efectivo de la transacción
118	NetMoney	S	0	Price	El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta, está presente por requerimiento del estándar
818*	SecondaryTradeReportID	N		String	Número de registro de liquidación de la nueva operación. Sólo está presente cuando SecondaryConfirmStatus = "A".
5683*	SecondaryConfirmStatus	N	"P" = Pendiente "N" = Aceptado por Miembro Destino "R" = Rechazado por Miembro Destino "A" = Aceptado por Liquidador de Miembro Destino "L" = Rechazado por Liquidador de Miembro Destino	Char	Describe el estado en que se encuentra el traspaso

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
			"C" = Cancelado por Miembro Origen "S" = Anulado por el sistema "H" = Petición solicitada no válida "X" = Petición rechazada "B" = Pendiente siguiente sesión		
124*	NoExecs	N		NumInGroup	Indica el número de operaciones que se han asignado
→88 1*	SecondaryTradeReportRefID	N		String	Número de registro de liquidación de la operación a transferir. Sólo está presente cuando el mensaje va destinado a los usuarios del Miembro que solicitó el traspaso
	Standard Trailer	S			

9.13.4 Confirmation Ack (Msg Type = AU)

Mensaje usado por el cliente para aceptar o rechazar un Give-up.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = AU		
664	ConfirmID	S		String(9)	Identificador del mensaje Confirmation al que se está respondiendo
75	TradeDate	S		LocalMkt Date	ClearGate no procesa este campo y está presente por requerimientos del estándar
60	TransactTime	S		UTCTime Stamp	ClearGate no procesa este campo y está presente por requerimientos del estándar
940	AffirmStatus	S	2 = Confirm rejected, i.e. not affirmed 3 = Affirmed	Int	
79*	AllocAccount	N	Longitud exacta	String(5)	Cuenta destino del Give-in. Requerido cuando se trata de un mensaje de aceptación de Give-up por parte del Miembro Destino
793*	SecondaryAllocID	S		String(10)	Identificador único del Give-up al que se está refiriendo
	Standard Trailer	S			

9.13.5 Business Message Reject (MsgType = j)

Este mensaje es enviado por ClearGate para rechazar un mensaje Confirmation Ack inválido. La descripción de este mensaje se encuentra en el apartado 5.8.5.

10. Petición de Ejercicio

10.1 Introducción

La funcionalidad de petición de ejercicio permite que un cliente FIX pueda solicitar el ejercicio a final de día, de un conjunto de opciones asociadas a una cuenta y contrato en concreto.

El cliente debe especificar el código de contrato de la opción a ejercer y la cuenta que tiene la posición. El código de contrato debe referir a un contrato de opción que acepte la petición de ejercicio, en caso contrario la petición será rechazada.

Una petición de ejercicio indica implícitamente que el resto de opciones no deben ser ejercidas.

ClearGate no implementa un método para indicar el número de opciones que no deben ejercerse (entendiéndose que el resto debe ejercerse). Cuando un cliente desea especificar que no se debe ejercer ninguna opción de una posición (sólo permitido el día de vencimiento), debe enviar una petición de ejercicio con volumen 0.

La solicitud de ejercicio anticipado (antes de la fecha de vencimiento) puede ser revocada, de forma que se vuelve al estado original, es decir, no se ejercería ninguna opción.

Las solicitudes de ejercicio enviadas en la fecha de vencimiento también pueden ser revocadas, de forma que se producirá el comportamiento por defecto (ejercicio sólo de las opciones in-the-money respecto al precio de cierre del subyacente distribuido en el mensaje Market Data).

Cuando se envía más de una petición de ejercicio para una misma cuenta y contrato, la última solicitud anula cualquier petición previa, quedando como volumen a ejercer el solicitado en esta última petición.

Existen dos escenarios para la petición de ejercicio dependiendo de la fecha de vencimiento, que son descritos en los siguientes apartados.

En ambos escenarios, el ejercicio de opciones se realiza al final de la sesión de negociación. Durante el día, un cliente FIX puede consultar mediante ClearGate las peticiones de ejercicio pendientes para el final de este día. Esta consulta puede realizarse aplicando diversos criterios de selección tal y como se detalla en la descripción del mensaje correspondiente (Request For Positions).

Las operaciones que se generan por el ejercicio de opciones pueden ser consultadas mediante el mensaje Trade Capture Report Request, tal y como se describe en el capítulo 7 Seguimiento y Gestión de la Posición .

10.2 Escenario 1: Opciones americanas, antes del día de vencimiento

Una petición de ejercicio, en este escenario, pasa a ser efectiva al final de la sesión. Durante la sesión, la petición de ejercicio puede ser reemplazada mediante una nueva petición de ejercicio o cancelada con el correspondiente mensaje.

Si al llegar a final de sesión, la cuenta no dispone del número de contratos que se solicitó ejercer, entonces sólo los contratos disponibles serán ejercidos, quedando anulada el resto de la petición.

10.3 Escenario 2: Día de vencimiento

Este escenario incluye tanto las opciones americanas como las europeas. Durante el día de vencimiento existen tres opciones:

- a. **Enviar una petición de ejercicio tal y como se explica en el escenario 1.** Esta petición puede ser reemplazada o revocada. A final de sesión se ejercerá todo el volumen disponible hasta llegar a la cantidad especificada. La posición restante no será ejercida y expirará. Si se revoca la petición se pasa al comportamiento por defecto como se explica en el punto c

- b. **Enviar una petición de ejercicio solicitando el ejercicio de 0 contratos.** Al final de la sesión, no se ejercerá ninguna opción y todos los contratos expirarán. Esta petición puede ser reemplazada por otra o revocada, pasando al estado a ó c correspondientemente
- c. **No hacer nada y optar por el comportamiento por defecto.** El comportamiento por defecto es ejercer la posición cuando está in-the-money y no ejercer cuando está at-the-money o out-of-the-money. Téngase en cuenta que el comportamiento por defecto sólo puede aplicarse a toda la posición a la vez. Para contratos que no permiten la petición de ejercicio, este es el único sistema posible

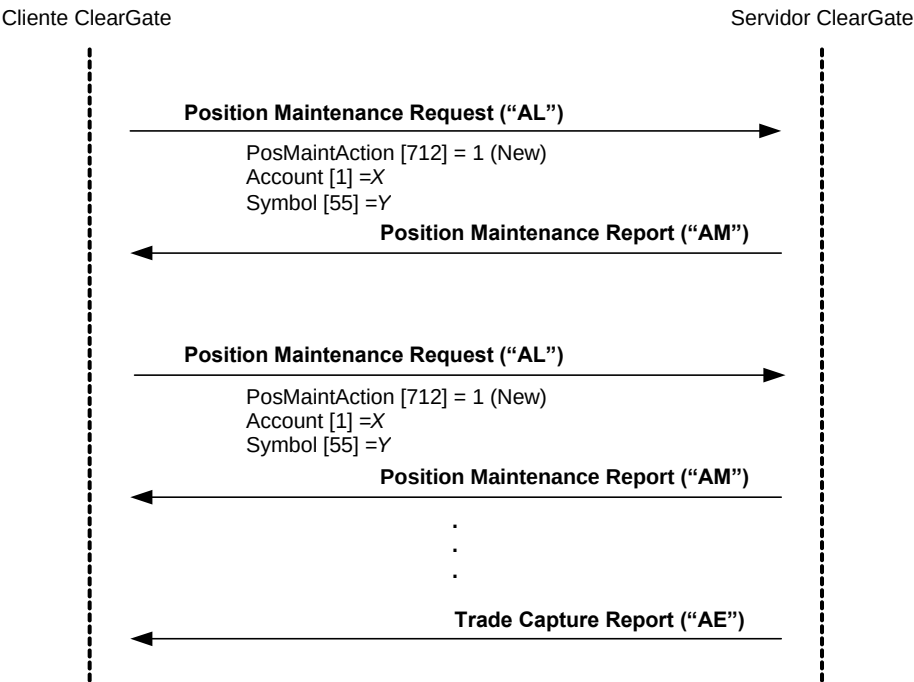
10.4 Lista de mensajes

Mensaje	Descripción
Position Maintenance Request (Msg Type = AL)	Enviado por el cliente FIX para solicitar el ejercicio de un contrato
Position Maintenance Report (Msg Type = AM)	Enviado por ClearGate para indicar la aceptación o rechazo de una petición de ejercicio
Request For Positions (Msg Type = AN)	Usado por el cliente FIX para solicitar sus peticiones de ejercicio
Request For Positions Ack (Msg Type = AO)	Enviado por ClearGate como respuesta al mensaje Request For Positions. Precede a los mensajes Position Report (si hay alguno)
Position Report (Msg Type = AP)	Enviado por ClearGate como respuesta a una petición Request For Positions aceptada. Informa de la petición de ejercicio activa (pero no realizada) para una cuenta y contrato en concreto
Trade Capture Report (Msg Type = AE)	Enviado por ClearGate para notificar que se ha realizado un ejercicio. Sólo enviado a los clientes relacionados suscritos a este tipo de mensaje

10.5 Flujo de mensajes

Petición de ejercicio anticipado

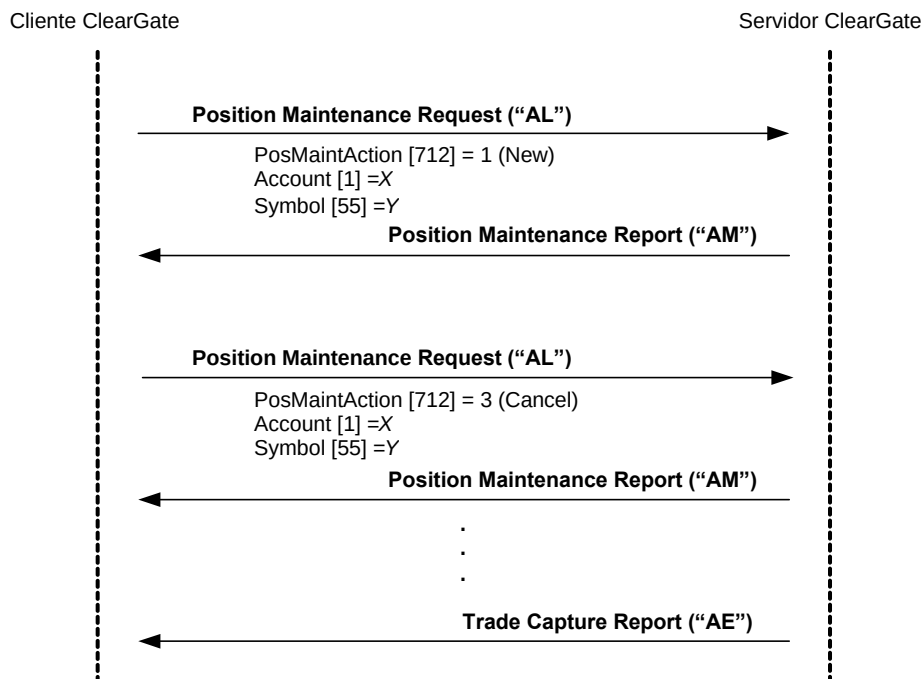
El cliente envía una petición de ejercicio para una opción americana, antes del día de vencimiento. ClearGate contesta con un mensaje de aceptación de la solicitud. El siguiente envío de petición de ejercicio sobre la misma cuenta y contrato sustituye la orden previa. A final de día, el volumen indicado en la última petición, o el volumen disponible si es inferior, es ejercido y se recibe el correspondiente Trade Capture Report que así lo notifica, siempre y cuando se esté suscrito a este tipo de mensajes. Si no existe posición en la cuenta no se ejerce ninguna opción y por tanto no se genera ningún mensaje Trade Capture Report asociado.



Petición de ejercicio y posterior cancelación

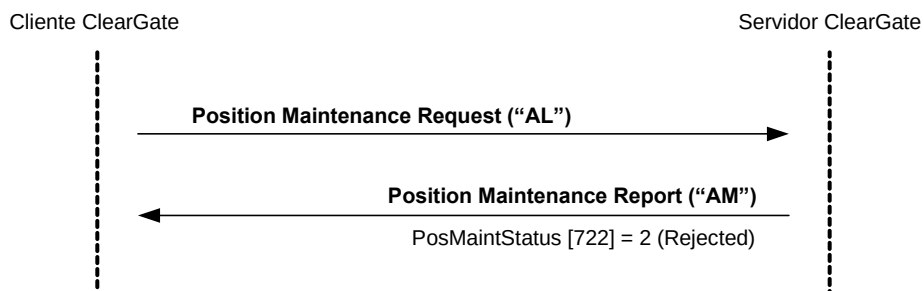
Cualquier petición de ejercicio puede ser cancelada con un mensaje Position Maintenance Request con el campo PosMaintAction = 3. Una vez cancelada se vuelve al comportamiento por defecto, es decir, no ejercer anticipadamente y ejercer el día de vencimiento si la opción está in-the-money.

En el ejemplo que se presenta, las opciones se consideran in-the-money y se trata del día de vencimiento, por lo que se ejercen las opciones.



Petición de ejercicio rechazada por el sistema

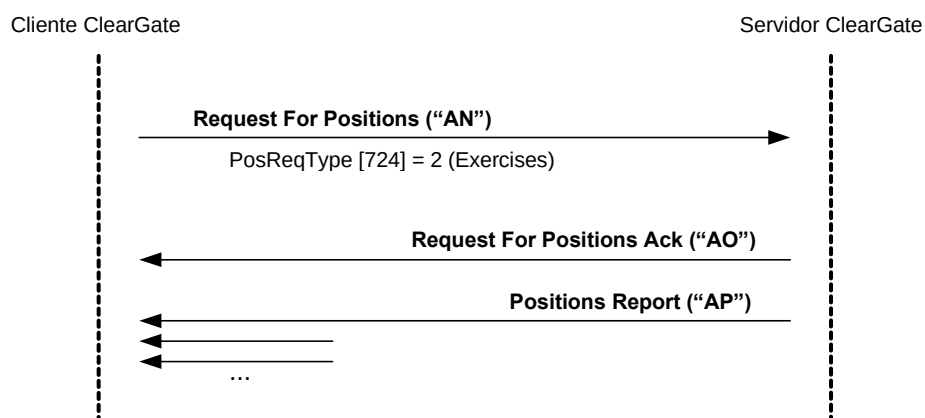
Si el cliente FIX envía una petición de ejercicio no válida, por ejemplo sobre una opción europea antes del vencimiento, será rechazada con un mensaje Position Maintenance Report con el campo PosMaintStatus = 2. Una petición de ejercicio rechazada no altera la petición de ejercicio solicitada previamente.



Solicitud del estado de las peticiones de ejercicio pendientes

El cliente puede solicitar el estado de la petición de ejercicio sobre un conjunto de cuentas y contratos. Como resultado obtendrá un mensaje Position Report por cada par cuenta-contrato sobre el que exista una petición de ejercicio.

Este sistema implementa el mecanismo de Snapshot y Update, y permite que el cliente, si lo desea, vaya recibiendo las modificaciones a medida que se producen.



10.6 Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4

No se han realizado acotaciones ni adaptaciones en los mensajes incluidos en este capítulo.

10.7 Definición de mensajes

Los mensajes Position Maintenance Request y Position Maintenance Report mencionados en este capítulo también son usados para el ajuste de posición. Su definición se encuentra en los apartados 7.8.5 y 7.8.6 del capítulo 7.

Los mensajes Request For Positions, Request For Positions Ack, Position Report y Trade Capture Report mencionados en este capítulo también son usados para el seguimiento de la posición. Su definición se encuentra en los apartados 7.8.1, 7.8.2, 7.8.3 and 7.8.4.

11. Comunicación de Eventos

11.1 Introducción

En este capítulo se describen dos funcionalidades basadas en el mensaje News:

- Difusión de información del supervisor de la cámara
- Envío de mensajes desde una aplicación cliente al supervisor de la cámara

La información transferida en ambos casos es un texto de formato libre.

Un programa cliente no tiene que suscribirse para recibir estos mensajes. Todo cliente queda implícitamente suscrito desde el inicio de sesión.

No existe ningún mecanismo para verificar si un mensaje ha sido entregado a sus destinatarios.

Al establecer una conexión de comunicación, si el cliente continúa la sesión FIX recibe todos los mensajes News que tenía pendientes desde el momento de la desconexión. Cuando el cliente opta por iniciar una nueva sesión FIX, recibe todos los mensajes News, destinados a él, que se han generado desde el inicio de sesión.

11.2 Lista de mensajes

Mensaje	Descripción
News (Msg Type = B)	Usado para recibir mensajes de texto del supervisor de la cámara. También usado para enviar mensajes de texto al supervisor de la cámara

11.3 Flujo de mensajes

Recepción de mensaje



Envío de mensaje



11.4 Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4

- Sólo se permiten una línea de hasta 78 caracteres por mensaje

11.5 Definición de mensajes

11.5.1 News (Msg Type = B)

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	<i>Standard Header</i>	S	MsgType = B		
61	Urgency	N	0 = Normal 1 = Flash 2 = Background	Char	El valor por defecto es 0
148	Headline	S		String	Encabezado del mensaje. Ignorado por ClearGate
33	LinesOfText	S	1	NumInGroup	Número de líneas del texto. Sólo se permite una línea
→58	Text	S		String(78)	Una línea de texto
	<i>Standard Trailer</i>	S			

12. Gestión de Referencias y Filtros de Give-up

12.1 Introducción

La funcionalidad de gestión de Referencias y Filtros de Give-up agrupa varias funciones. Desde el punto de vista del cliente FIX, éstas son las siguientes:

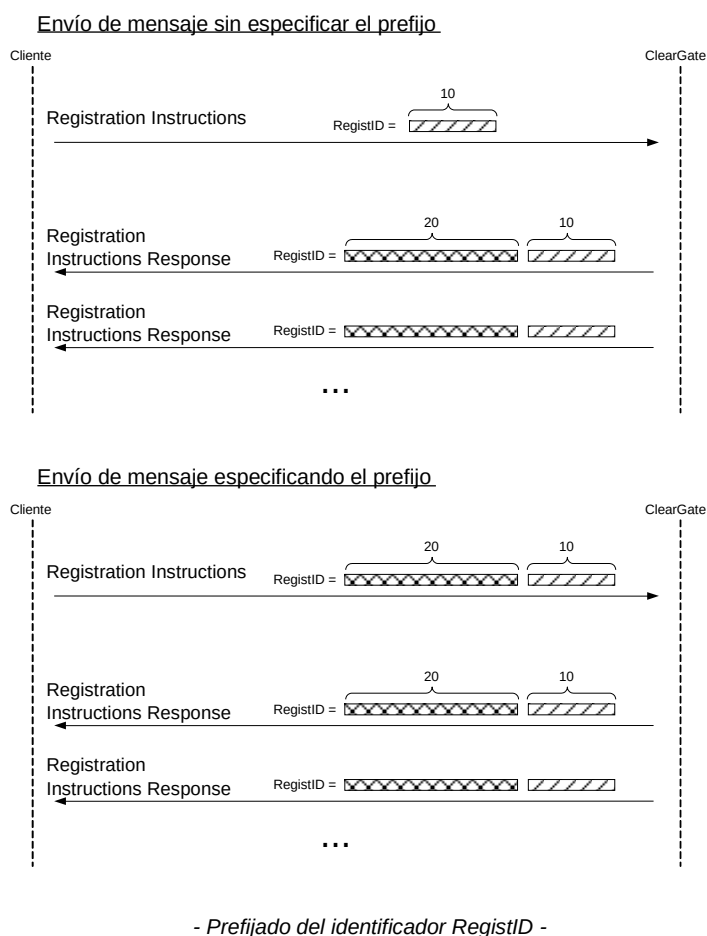
- Mantenimiento de referencias de Give-out por Miembro Origen
- Mantenimiento de referencias de Give-in por Miembro Destino
- Mantenimiento de filtros de Give-in por Miembro Destino
- Mantenimiento de filtros de Give-in por Miembro Liquidador
- Mantenimiento de peticiones automáticas de Give-out
- Consulta de referencias y filtros de Give-up

Cada una de estas funciones se trata en un apartado separado dentro de este capítulo. Para cada función se describe el método de uso, la lista de mensajes relacionados, los flujos de mensajes, las adiciones o acotaciones aplicadas en esta implementación y la descripción detallada de los mensajes.

12.2 Campo RegistID

El campo RegistID, presente en una solicitud iniciada con un mensaje Registration Instructions, es el identificador que permite relacionar la petición con los mensajes Registration Instructions Response de respuesta.

El campo RegistID asignado por el cliente debe ser de diez caracteres de longitud. Si la longitud fuese inferior, ClearGate completa con espacios por detrás hasta llegar a dicha longitud. ClearGate también acepta que los mensajes enviados por el cliente usen un RegistID de longitud 30, en este caso sólo las 10 últimas posiciones pueden ser fijadas libremente, ya que las 20 primeras deben coincidir con el formato que se presenta a continuación.



ClearGate realiza un proceso de prefijado del campo RegistID para evitar duplicados en este identificador.

El RegistID asignado por ClearGate en el mensaje de respuesta tiene el formato AAMDDMmmmTttMmmmTttNnnnnnnnnn, formado con la siguiente codificación:

- **AAMDD**. Es la fecha de la sesión de cámara
- **MmmmTtt**. Contiene el código de miembro y operador de conexión desde el que se realizó la solicitud
- **Nnnnnnnnnn**. Es el valor asignado por la aplicación cliente a RegistID en el mensaje original

Un operador que quiera modificar o cancelar una referencia o un filtro de Give-up, debe usar este identificador en el campo RegistRefID del mensaje Registration Instructions de solicitud.

12.3 Mantenimiento de referencias de Give-out por Miembro Origen

12.3.1 Descripción

El cliente FIX usa esta funcionalidad para realizar el mantenimiento de las referencias que el Miembro Origen utiliza en la solicitud de Give-outs.

Estas referencias son comunes para todos los operadores del Miembro y pueden ser modificadas en tiempo real.

En la solicitud de Give-out, el Miembro Ejecutor debe indicar una referencia que sirva al Miembro Destino para identificar únicamente (junto con el código de Miembro Ejecutor) el origen del Give-in. Es la "Referencia Give-up".

Los Miembros Ejecutor y Destino deben ponerse de acuerdo para establecer esta referencia común a ambos.

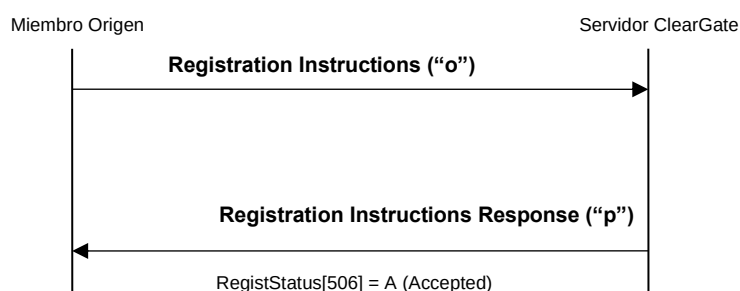
Por otro lado, a fin de facilitar el envío del Give-out y la gestión interna, se puede crear una referencia mnemotécnica y una referencia interna, que son códigos que define el Miembro Ejecutor y que no requieren de acuerdo con el Miembro Destino.

12.3.2 Lista de mensajes

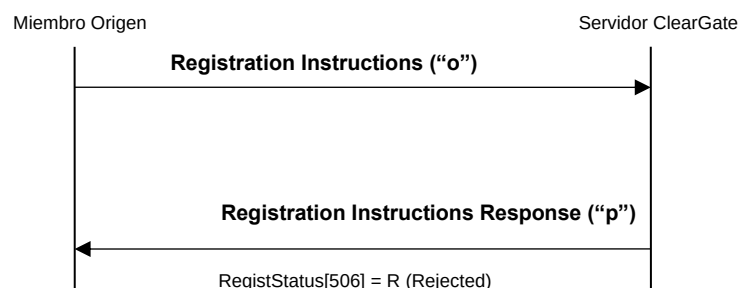
Mensaje	Descripción
Registration Instructions (Msg Type = o)	Usado por el cliente para solicitar el mantenimiento de referencias de Give-out por Miembro Origen
Registration Instructions Response (Msg Type = p)	Enviado por la ECC para confirmar o rechazar el mantenimiento de referencias de Give-out por Miembro Origen

12.3.3 Flujo de mensajes

Solicitud correcta



Solicitud errónea



12.3.4 Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4

- En el mensaje Registration Instructions, los campos NoPartyIDs (453) y NoPartySubIDs (802) han pasado a ser requeridos
- Se ha añadido el campo Text (58) al mensaje Registration Instructions Response

12.3.5 Definición de mensajes**12.3.5.1 Registration Instructions (Msg Type = 0)**

Mensaje enviado por el cliente para gestionar las referencias de Give-out.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = 0		
513	RegistID	S		String (30)	Identificador único para cada mensaje Registration Instructions
514	RegistTransType	S	0 = New 1 = Replace 2 = Cancel	Char	
508	RegistRefID	N		String (30)	Identificador del mensaje Registration Instructions que es reemplazado o cancelado por este mensaje. Requerido cuando RegistTransType = 1 ó 2
	Start <Parties>				
453	NoPartyIDs	S*		NumInGroup	
→ 448	PartyID	S		String	Código de miembro o referencia. Para la referencia interna de Give-out (PartyRole=3) este campo está limitado a 18 caracteres alfanuméricos. Para el Miembro Destino del Give-up (PartyRole = 14) este campo tiene una longitud exacta de 4 caracteres alfanuméricos. Para la referencia de Give-up (PartyRole = 24) este campo está limitado a 18 caracteres alfanuméricos. Para la referencia mnemotécnica de Give-out (PartyRole = 33) este campo está limitado a 10 caracteres alfanuméricos.
→ 447	PartyIDSource	S	D = Proprietary / Custom code	String	
→ 452	PartyRole	S	3 = Give-out Internal Reference 14 = Give-up Clearing Firm 24 = Give-up Reference 33 = Give-up Mnemonic	Int	El valor 3 es para la referencia interna de Give-out asignada por el Miembro Origen. El valor 14 es para el Miembro Destino del Give-up. El valor 24 es para la referencia de Give-up. El valor 33 es para la referencia mnemotécnica de Give-out.
→ 802	NoPartySubIDs	S*	1	NumInGroup	
→→ 523	PartySubID	S	GOR = Give-out references	String	
→→ 803	PartySubIDType	S		Int	Este campo es requerido por el estándar. ClearGate acepta que este campo no esté presente
	End <Parties>				
	Standard Trailer	S			

12.3.5.2 Registration Instructions Response (Msg Type = p)

Mensaje usado por ClearGate para indicar el estado de la petición iniciada con un mensaje Registration Instructions.

Este mensaje sólo es enviado al operador que realizó la solicitud relacionada.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = p		
513	RegistID	S		String (30)	Identificador asignado por el cliente en el mensaje Registration Instructions
514	RegistTransType	S	0 = New 1 = Replace 2 = Cancel	Char	
508	RegistRefID	N		String (30)	Identificador del mensaje Registration Instructions que es reemplazado o cancelado por este mensaje. Presente cuando RegistTransType = 1 ó 2
	Start <Parties>				
453	NoPartyIDs	N		NumInGroup	
→ 448	PartyID	N		String	Código de miembro o de referencia
→ 447	PartyIDSource	N	D = Proprietary / Custom code	String	
→ 452	PartyRole	N	3 = Give-out Internal Reference 14 = Give-up Clearing Firm 24 = Give-up Reference 33 = Give-up Mnemonic	Int	El valor 3 es para la referencia interna de Give-out asignada por el Miembro Origen. El valor 14 es para el Miembro Destino del Give-up. El valor 24 es para la referencia de Give-up. El valor 33 es para la referencia mnemotécnica de Give-out.
→ 802	NoPartySubIDs	N	1	NumInGroup	
→→ 523	PartySubID	S	GOR = Give-out references	String	
→→ 803	PartySubIDType	S		Int	El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta, está presente por requerimiento del estándar
	End <Parties>				
506	RegistStatus	S	A = Accepted R = Rejected	Char	Estado de la petición del mensaje Registration Instructions. En caso de rechazo (valor "R"), el campo Text contiene un texto explicativo
58*	Text	N		String	Cuando RegistStatus = "R", contiene una descripción específica del motivo de rechazo
	Standard Trailer	S			

12.4 Mantenimiento de referencias de Give-in por Miembro Destino

12.4.1 Descripción

El cliente FIX usa esta funcionalidad para realizar el mantenimiento de las referencias que el Miembro Destino utiliza en la aceptación de Give-ins.

Estas referencias son comunes para todos los operadores del Miembro y pueden ser modificadas en tiempo real.

En la solicitud de Give-out, el Miembro Ejecutor debe indicar una referencia que sirva al Miembro Destino para identificar únicamente (junto con el código de Miembro Ejecutor) el origen del Give-in. Es la "Referencia Give-up".

Los Miembros Ejecutor y Destino deben ponerse de acuerdo para establecer esta referencia común a ambos.

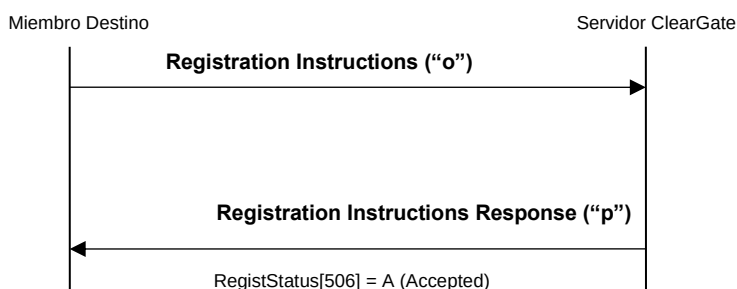
Por otro lado, a fin de facilitar la aceptación del Give-in, se puede crear una referencia mnemotécnica que es un código que define el Miembro Destino y que no requiere de acuerdo con el Miembro Origen.

12.4.2 Lista de mensajes

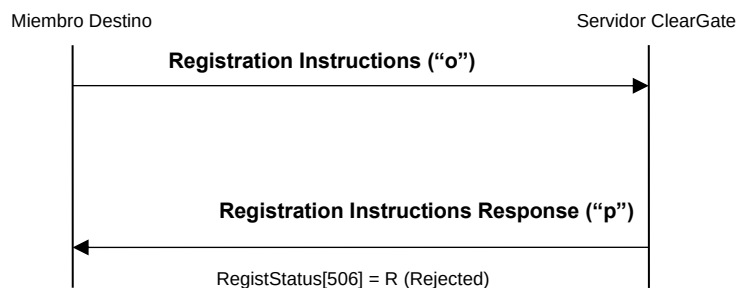
Mensaje	Descripción
Registration Instructions (Msg Type = o)	Usado por el cliente para solicitar el mantenimiento de referencias de Give-in por Miembro Destino
Registration Instructions Response (Msg Type = p)	Enviado por la ECC para confirmar o rechazar el mantenimiento de referencias de Give-in por Miembro Destino

12.4.3 Flujo de mensajes

Solicitud correcta



Solicitud errónea



12.4.4 Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4

- En el mensaje Registration Instructions, los campos NoPartyIDs (453), NoPartySubIDs (802) y Account (1) han pasado a ser requeridos
- Se ha añadido el campo Text (58) al mensaje Registration Instructions Response

12.4.5 Definición de mensajes

12.4.5.1 Registration Instructions (Msg Type = 0)

Mensaje enviado por el cliente para gestionar las referencias de Give-in.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = 0		
513	RegistID	S		String (30)	Identificador único para cada mensaje Registration Instructions
514	RegistTransType	S	0 = New 1 = Replace 2 = Cancel	Char	
508	RegistRefID	N		String (30)	Identificador del mensaje Registration Instructions que es reemplazado o cancelado por este mensaje. Requerido cuando RegistTransType = 1 ó 2
	Start <Parties>				
453	NoPartyIDs	S*	3	NumInGroup	
→ 448	PartyID	S		String	Código de miembro o de referencia. Para el Miembro Origen del Give-up (PartyRole = 1) este campo tiene una longitud exacta de 4 caracteres alfanuméricos. Para la referencia de Give-up (PartyRole = 24) este campo está limitado a 18 caracteres alfanuméricos. Para la referencia mnemotécnica de Give-in (PartyRole = 33) este campo está limitado a 10 caracteres alfanuméricos.
→ 447	PartyIDSource	S	D = Proprietary / Custom code	String	
→ 452	PartyRole	S	1 = Executing Firm 24 = Give-up Reference 33 = Give-up Mnemonic	Int	El valor 1 es para el Miembro Origen del Give-up. El valor 24 es para la referencia de Give-up. El valor 33 es para la referencia mnemotécnica de Give-in.
→ 802	NoPartySubIDs	S*	1	NumInGroup	
→→ 523	PartySubID	S	GIR = Give-in references	String	
→→ 803	PartySubIDType	S		Int	Este campo es requerido por el estándar. ClearGate acepta que este campo no esté presente
	End <Parties>				
1	Account	S*		String (5)	Cuenta destino en la que debe registrarse el Give-in en caso de ser aceptado
	Standard Trailer	S			

12.4.5.2 Registration Instructions Response (Msg Type = p)

Mensaje usado por ClearGate para indicar el estado de la petición iniciada con un mensaje Registration Instructions.

Este mensaje sólo es enviado al operador que realizó la solicitud relacionada.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = p		
513	RegistID	S		String (30)	Identificador asignado por el cliente en el mensaje Registration Instructions
514	RegistTransType	S	0 = New 1 = Replace 2 = Cancel	Char	
508	RegistRefID	N		String (30)	Identificador del mensaje Registration Instructions que es reemplazado o cancelado por este mensaje. Presente cuando RegistTransType = 1 ó 2
	Start <Parties>				
453	NoPartyIDs	N		NumInGroup	
→ 448	PartyID	N		String	Código de miembro o de referencia
→ 447	PartyIDSource	N	D = Proprietary / Custom code	String	
→ 452	PartyRole	N	1 = Executing Firm 24 = Give-up Reference 33 = Give-up Mnemonic	Int	El valor 1 es para el Miembro Origen del Give-up. El valor 24 es para la referencia de Give-up. El valor 33 es para la referencia mnemotécnica de Give-in.
→ 802	NoPartySubIDs	N	1	NumInGroup	
→→ 523	PartySubID	S	GIR = Give-in references	String	
→→ 803	PartySubIDType	S		Int	El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta, está presente por requerimiento del estándar
	End <Parties>				
1	Account	N		String	Cuenta destino en la que debe registrarse el Give-in en caso de ser aceptado
506	RegistStatus	S	A = Accepted R = Rejected	Char	Estado de la petición del mensaje Registration Instructions. En caso de rechazo (valor "R"), el campo Text contiene un texto explicativo
58*	Text	N		String	Cuando RegistStatus = "R", contiene una descripción específica del motivo de rechazo
	Standard Trailer	S			

12.5 Mantenimiento de filtros de Give-in por Miembro Destino

12.5.1 Descripción

El cliente FIX usa esta funcionalidad para que el Miembro Destino del Give-in pueda configurar filtros que permitan la aceptación automática de las peticiones de Give-in.

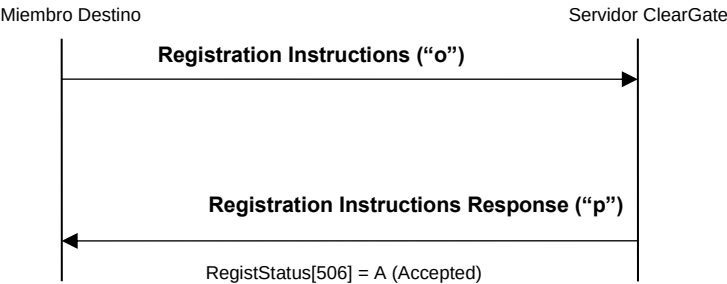
La aceptación de Give-ins puede automatizarse mediante unos filtros definidos por los Miembros Destino y/o Liquidador, quedando pendiente de aceptación o rechazo manual todo aquello que no supere dichos filtros.

12.5.2 Lista de mensajes

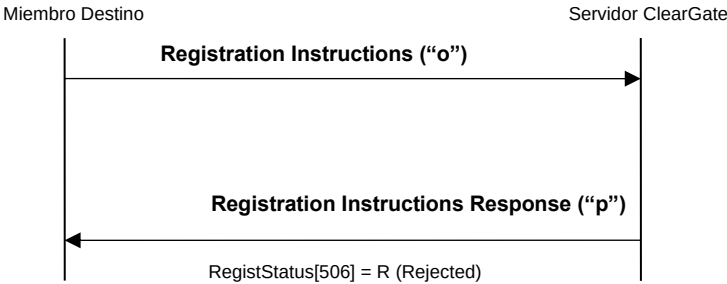
Mensaje	Descripción
Registration Instructions (Msg Type = o)	Usado por el cliente para solicitar el mantenimiento de filtros de Give-in por Miembro Destino
Registration Instructions Response (Msg Type = p)	Enviado por la ECC para confirmar o rechazar el mantenimiento de filtros de Give-in por Miembro Destino

12.5.3 Flujo de mensajes

Solicitud correcta



Solicitud errónea



12.5.4 Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4

- En el mensaje Registration Instructions, los campos NoPartyIDs (453) y NoPartySubIDs (802) han pasado a ser requeridos
- Se ha añadido el campo Text (58) al mensaje Registration Instructions Response

12.5.5 Definición de mensajes**12.5.5.1 Registration Instructions (Msg Type = 0)**

Mensaje enviado por el cliente para gestionar los filtros de Give-in por Miembro Destino.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = 0		
513	RegistID	S		String (30)	Identificador único para cada mensaje Registration Instructions
514	RegistTransType	S	0 = New 1 = Replace 2 = Cancel	Char	
508	RegistRefID	N		String (30)	Identificador del mensaje Registration Instructions que es reemplazado o cancelado por este mensaje. Requerido cuando RegistTransType = 1 ó 2
	Start <Parties>				
453	NoPartyIDs	S*	2	NumInGroup	
→ 448	PartyID	S		String	Código de miembro o de referencia. Para el Miembro Origen del Give-up (PartyRole = 1) este campo tiene una longitud exacta de 4 caracteres alfanuméricos. Para la referencia de Give-up (PartyRole = 24) este campo está limitado a 18 caracteres alfanuméricos.
→ 447	PartyIDSource	S	D = Proprietary / Custom code	String	
→ 452	PartyRole	S	1 = Executing Firm 24 = Give-up Reference	Int	El valor 1 es para el Miembro Origen del Give-up. El valor 24 es para la referencia de Give-up. El uso del carácter comodín "?" está permitido sólo si se utiliza en todas las posiciones tanto en el Miembro Origen del Give-up como en la referencia de Give-up (pero no en ambos campos a la vez)
→ 802	NoPartySubIDs	S*	1	NumInGroup	
→→ 523	PartySubID	S	GIF = Give-in filters	String	
→→ 803	PartySubIDType	S		Int	Este campo es requerido por el estándar. ClearGate acepta que este campo no esté presente
	End <Parties>				
	Start <Stipulations>				
232*	NoStipulations	S	2	NumInGroup	
→ 233*	StipulationType	S	TAL = Transaction Amount Limit SAL = Session Amount Limit	String	
→ 234*	StipulationValue	S	[N/A] o un valor numérico >=0 and <= 999999999	String	Si StipulationType = TAL, es el importe máximo para un Give-in que será aceptado automáticamente para ese Miembro Origen del Give-up y referencia de Give-up.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
					Si StipulationType = SAL, es el importe acumulado máximo por sesión de Give-ins que serán aceptados automáticamente para ese Miembro Origen del Give-up y referencia de Give-up. Se informará a [N/A] cuando se desee que el filtro sea totalmente abierto, esto es, no haya un importe máximo específico a comprobar
	End <Stipulations>				
	Standard Trailer	S			

12.5.5.2 Registration Instructions Response (Msg Type = p)

Mensaje usado por ClearGate para indicar el estado de la petición iniciada con un mensaje Registration Instructions.

Este mensaje sólo es enviado al operador que realizó la solicitud relacionada.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = p		
513	RegistID	S		String (30)	Identificador asignado por el cliente en el mensaje Registration Instructions
514	RegistTransType	S	0 = New 1 = Replace 2 = Cancel	Char	
508	RegistRefID	N		String (30)	Identificador del mensaje Registration Instructions que es reemplazado o cancelado por este mensaje. Presente cuando RegistTransType = 1 ó 2
	Start <Parties>				
453	NoPartyIDs	N		NumInGroup	
→ 448	PartyID	N		String	Código de miembro o de referencia. El valor comodín “?” significa “todo”.
→ 447	PartyIDSource	N	D = Proprietary / Custom code	String	
→ 452	PartyRole	N	1 = Executing Firm 24 = Give-up Reference	Int	El valor 1 es para el Miembro Origen del Give-up. El valor 24 es para la referencia de Give-up.
→ 802	NoPartySubIDs	N		NumInGroup	
→→ 523	PartySubID	S	GIF = Give-in filters	String	
→→ 803	PartySubIDType	S		Int	El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta, está presente por requerimiento del estándar
	End <Parties>				
	Start <Stipulations>				
232*	NoStipulations	N		NumInGroup	
→ 233*	StipulationType	N	TAL = Transaction Amount Limit SAL = Session Amount Limit	String	
→ 234*	StipulationValue	N		String	Si StipulationType = TAL, es el importe máximo para un Give-in que será aceptado automáticamente para ese Miembro Origen del Give-up y referencia de Give-up. Si StipulationType = SAL, es el importe acumulado máximo por sesión de Give-ins que serán aceptados automáticamente para ese Miembro Origen del Give-up y referencia de Give-up. El valor [N/A] indica que el filtro es totalmente abierto, esto es, no hay un importe máximo específico a comprobar
	End <Stipulations>				
506	RegistStatus	S	A = Accepted R = Rejected	Char	Estado de la petición del mensaje Registration Instructions.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
					En caso de rechazo (valor "R"), el campo Text contiene un texto explicativo
58*	Text	N		String	Cuando RegistStatus = "R", contiene una descripción específica del motivo de rechazo
	Standard Trailer	S			

12.6 Mantenimiento de filtros de Give-in por Miembro Liquidador

12.6.1 Descripción

El cliente FIX usa esta funcionalidad para que el Miembro Liquidador del Give-in pueda configurar filtros que permitan la aceptación automática de las peticiones de Give-in,

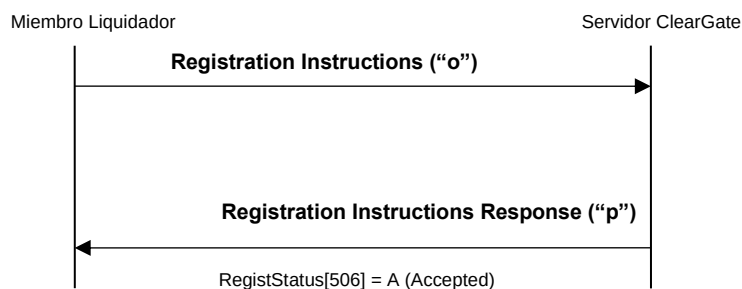
La aceptación de Give-in puede automatizarse mediante unos filtros definidos por los Miembros Destino y/o Liquidador, quedando pendiente de aceptación o rechazo manual todo aquello que no supere dichos filtros.

12.6.2 Lista de mensajes

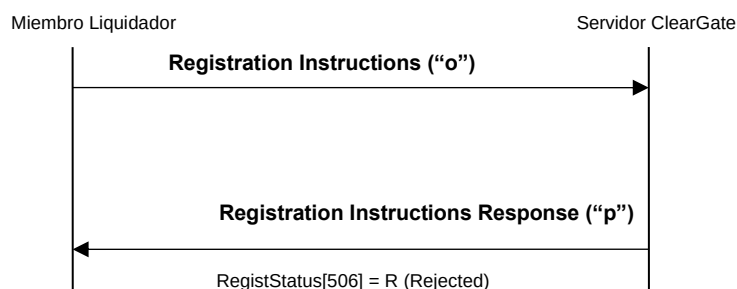
Mensaje	Descripción
Registration Instructions (Msg Type = o)	Usado por el cliente para solicitar el mantenimiento de filtros de Give-in por Miembro Liquidador
Registration Instructions Response (Msg Type = p)	Enviado por la ECC para confirmar o rechazar el mantenimiento de filtros de Give-in por Miembro Liquidador

12.6.3 Flujo de mensajes

Solicitud correcta



Solicitud errónea



12.6.4 Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4

- En el mensaje Registration Instructions, los campos NoPartyIDs (453) y NoPartySubIDs (802) han pasado a ser requeridos
- Se ha añadido el campo Text (58) al mensaje Registration Instructions Response
- Se ha añadido el bloque Stipulations al mensaje Registration Instructions Response

12.6.5 Definición de mensajes**12.6.5.1 Registration Instructions (Msg Type = 0)**

Mensaje enviado por el cliente para gestionar los filtros de Give-in por Miembro Liquidador.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = 0		
513	RegistID	S		String (30)	Identificador único para cada mensaje Registration Instructions
514	RegistTransType	S	0 = New 1 = Replace 2 = Cancel	Char	
508	RegistRefID	N		String (30)	Identificador del mensaje Registration Instructions que es reemplazado o cancelado por este mensaje. Requerido cuando RegistTransType = 1 ó 2
	Start <Parties>				
453	NoPartyIDs	S*	1	NumInGroup	
→ 448	PartyID	S		String (4)	Código de Miembro Destino del Give-up
→ 447	PartyIDSource	S	D = Proprietary / Custom code	String	
→ 452	PartyRole	S	14 = Give-up Clearing Firm	Int	
→ 802	NoPartySubIDs	S*	1	NumInGroup	
→→ 523	PartySubID	S	GIFCM = Give-in filters of clearing member	String	
→→ 803	PartySubIDType	S		Int	Este campo es requerido por el estándar. ClearGate acepta que este campo no esté presente
	End <Parties>				
1	Account	S*		String (5)	Cuenta destino del Give-in. El uso del carácter comodín "?" está permitido sólo si se utiliza en todas las cinco posiciones a la vez.
	Start <Stipulations>				
232*	NoStipulations	S	2	NumInGroup	
→ 233*	StipulationType	S	TAL = Transaction Amount Limit SAL = Session Amount Limit	String	
→ 234*	StipulationValue	S	[N/A] o un valor numérico >=0 and <= 999999999	String	Si StipulationType = TAL, es el importe máximo para un Give-in que será aceptado automáticamente para ese Miembro Destino del Give-up y cuenta. Si StipulationType = SAL, es el importe acumulado máximo por sesión de Give-ins que serán aceptados automáticamente para ese Miembro Destino del Give-up y cuenta. Se informará a [N/A] cuando se desee que el filtro sea totalmente abierto, esto es, no haya un importe máximo específico a comprobar
	End <Stipulations>				
	Standard Trailer	S			

12.6.5.2 Registration Instructions Response (Msg Type = p)

Mensaje usado por ClearGate para indicar el estado de la petición iniciada con un mensaje Registration Instructions.

Este mensaje sólo es enviado al operador que realizó la solicitud relacionada.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = p		
513	RegistID	S		String (30)	Identificador asignado por el cliente en el mensaje Registration Instructions
514	RegistTransType	S	0 = New 1 = Replace 2 = Cancel	Char	
508	RegistRefID	N		String (30)	Identificador del mensaje Registration Instructions que es reemplazado o cancelado por este mensaje. Presente cuando RegistTransType = 1 ó 2
	Start <Parties>				
453	NoPartyIDs	N		NumInGroup	
→ 448	PartyID	N		String	Código de Miembro Destino del Give-up
→ 447	PartyIDSource	N	D = Proprietary / Custom code	String	
→ 452	PartyRole	N	14 = Give-up Clearing Firm	Int	
→ 802	NoPartySubIDs	N	1	NumInGroup	
→→ 523	PartySubID	S	GIFCM = Give-in filters of clearing member	String	
→→ 803	PartySubIDType	S		Int	El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta, está presente por requerimiento del estándar
	End <Parties>				
1	Account	N		String	Cuenta destino del Give-in. El valor comodín "?" significa "para todas las cuentas".
	Start <Stipulations>				
232*	NoStipulations	N		NumInGroup	
→ 233*	StipulationType	N	TAL = Transaction Amount Limit SAL = Session Amount Limit	String	
→ 234*	StipulationValue	N		String	Si StipulationType = TAL, es el importe máximo para un Give-in que será aceptado automáticamente para ese Miembro Destino del Give-up y cuenta. Si StipulationType = SAL, es el importe acumulado máximo por sesión de Give-ins que serán aceptados automáticamente para ese Miembro Destino del Give-up y cuenta. El valor [N/A] indica que el filtro es totalmente abierto, esto es, no hay un importe máximo específico a comprobar
	End <Stipulations>				
506	RegistStatus	S	A = Accepted R = Rejected	Char	Estado de la petición del mensaje Registration Instructions.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
					En caso de rechazo (valor "R"), el campo Text contiene un texto explicativo
58*	Text	N		String	Cuando RegistStatus = "R", contiene una descripción específica del motivo de rechazo
	Standard Trailer	S			

12.7 Mantenimiento de peticiones automáticas de Give-out

12.7.1 Descripción

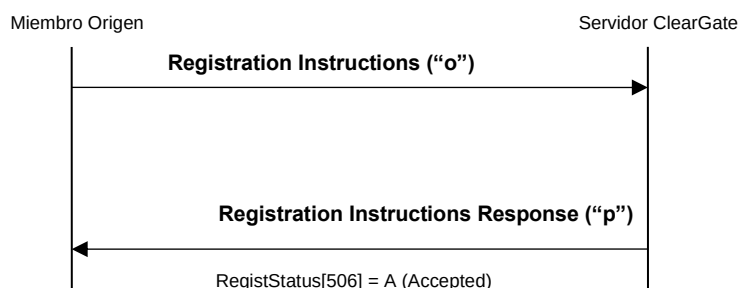
El cliente FIX usa esta funcionalidad para configurar la solicitud automática de Give-outs para las operaciones procedentes del sistema de negociación (case de órdenes y aplicaciones) en base a la cuenta en la que se ha operado.

12.7.2 Lista de mensajes

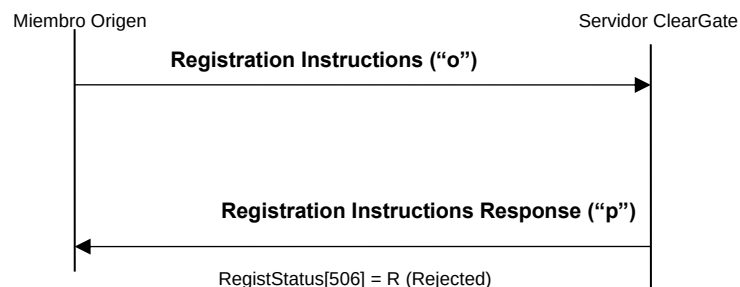
Mensaje	Descripción
Registration Instructions (Msg Type = o)	Usado por el cliente para solicitar el mantenimiento de peticiones automáticas de Give-out
Registration Instructions Response (Msg Type = p)	Enviado por la ECC para confirmar o rechazar el mantenimiento de peticiones automáticas de Give-out

12.7.3 Flujo de mensajes

Solicitud correcta



Solicitud errónea



12.7.4 Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4

- En el mensaje Registration Instructions, los campos NoPartyIDs (453) y NoPartySubIDs (802) han pasado a ser requeridos
- Se ha añadido el campo Text (58) al mensaje Registration Instructions Response

12.7.5 Definición de mensajes**12.7.5.1 Registration Instructions (Msg Type = 0)**

Mensaje enviado por el cliente para gestionar las peticiones automáticas de Give-out.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = 0		
513	RegistID	S		String (30)	Identificador único para cada mensaje Registration Instructions
514	RegistTransType	S	0 = New 1 = Replace 2 = Cancel	Char	
508	RegistRefID	N		String (30)	Identificador del mensaje Registration Instructions que es reemplazado o cancelado por este mensaje. Requerido cuando RegistTransType = 1 ó 2
	Start <Parties>				
453	NoPartyIDs	S*	1	NumInGroup	
→ 448	PartyID	S		String(10)	Código de referencia mnemotécnica de Give-out
→ 447	PartyIDSource	S	D = Proprietary / Custom code	String	
→ 452	PartyRole	S	33 = Give-up Mnemonic	Int	
→ 802	NoPartySubIDs	S*	1	NumInGroup	
→→ 523	PartySubID	S	AGR = Automatic Give-out request	String	
→→ 803	PartySubIDType	S		Int	Este campo es requerido por el estándar. ClearGate acepta que este campo no esté presente
	End <Parties>				
1	Account	S*		String (5)	Cuenta origen del Give-out
	Standard Trailer	S			

12.7.5.2 Registration Instructions Response (Msg Type = p)

Mensaje usado por ClearGate para indicar el estado de la petición iniciada con un mensaje Registration Instructions.

Este mensaje sólo es enviado al operador que realizó la solicitud relacionada.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = p		
513	RegistID	S		String (30)	Identificador asignado por el cliente en el mensaje Registration Instructions
514	RegistTransType	S	0 = New 1 = Replace 2 = Cancel	Char	
508	RegistRefID	N		String (30)	Identificador del mensaje Registration Instructions que es reemplazado o cancelado por este mensaje. Presente cuando RegistTransType = 1 ó 2
	Start <Parties>				
453	NoPartyIDs	N		NumInGroup	
→ 448	PartyID	N		String	Código de referencia mnemotécnica de Give-out
→ 447	PartyIDSource	N	D = Proprietary / Custom code	String	
→ 452	PartyRole	N	33 = Give-up Mnemonic	Int	
→ 802	NoPartySubIDs	N	1	NumInGroup	
→→ 523	PartySubID	S	AGR = Automatic Give- out request	String	
→→ 803	PartySubIDType	S		Int	El contenido de este campo no debe ser tenido en cuenta, está presente por requerimiento del estándar
	End <Parties>				
1	Account	N		String	Cuenta origen del Give-out
506	RegistStatus	S	A = Accepted R = Rejected	Char	Estado de la petición del mensaje Registration Instructions. En caso de rechazo (valor "R"), el campo Text contiene un texto explicativo
58*	Text	N		String	Cuando RegistStatus = "R", contiene una descripción específica del motivo de rechazo
	Standard Trailer	S			

12.8 Consulta de referencias y filtros de Give-up

12.8.1 Descripción

La aplicación cliente puede solicitar la consulta de referencias y filtros de Give-up mediante el mensaje Registration Instructions.

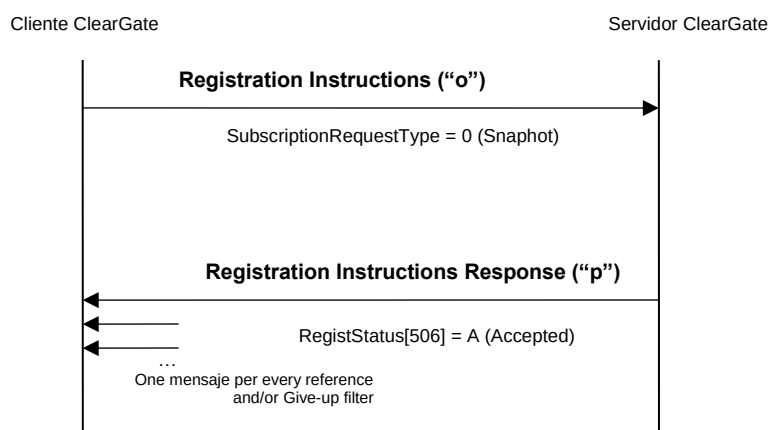
Como respuesta a esta petición se recibe un mensaje Registration Instructions Response por cada referencia y filtro disponibles en este momento en el sistema.

12.8.2 Lista de mensajes

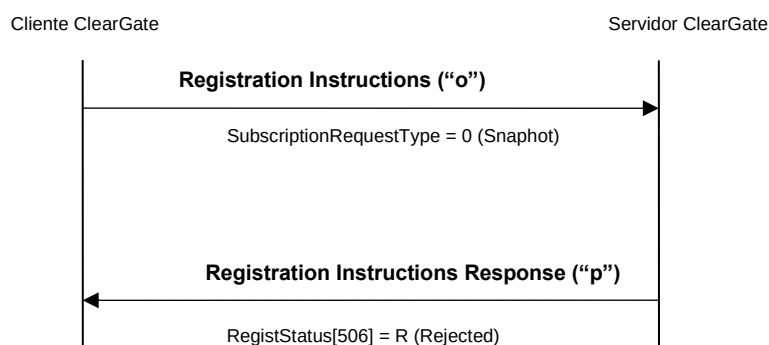
Mensaje	Descripción
Registration Instructions (Msg Type = o)	Usado por el cliente para solicitar la consulta de referencias y filtros de Give-up
Registration Instructions Response (Msg Type = p)	Enviado por la ECC para confirmar o rechazar la consulta de referencias y filtros de Give-up

12.8.3 Flujo de mensajes

Solicitud correcta



Solicitud errónea



12.8.4 Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4

- Se ha añadido el campo SubscriptionRequestType (263) al mensaje Registration Instructions
- Se han añadido los campos LastRptRequested (912) y Text (58) al mensaje Registration Instructions Response

12.8.5 Definición de mensajes

12.8.5.1 Registration Instructions (Msg Type = 0)

Mensaje enviado por el cliente para consultar las referencias y filtros de Give-up.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = 0		
513	RegistID	S		String (10)	Identificador único para cada mensaje Registration Instructions
514	RegistTransType	S		Char	ClearGate no tiene en cuenta el valor de este campo cuando viene informado el tag SubscriptionRequestType[263]
263*	SubscriptionRequestType	N	0 = Snapshot	Char	Si se informa este campo, ClearGate interpreta que se desea una consulta de todas las referencias y filtros de Give-up existentes y no va a tener en cuenta el resto de campos de este mensaje
	Standard Trailer	S			

12.8.5.2 Registration Instructions Response (Msg Type = p)

Mensaje usado por ClearGate para indicar el estado de la petición iniciada con un mensaje Registration Instructions.

Este mensaje sólo es enviado al operador que realizó la solicitud relacionada.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = p		
513	RegistID	S		String	Identificador asignado por el cliente en el mensaje Registration Instructions
514	RegistTransType	S	0 = New	Char	
912*	LastRptRequested	N	Y = Last message N = Not last message	Boolean	
	... <Parties> Account <Stipulations> ...				Información específica según el tipo de registro
506	RegistStatus	S	A = Accepted R = Rejected	Char	Estado de la petición del mensaje Registration Instructions. En caso de rechazo (valor "R"), el campo Text contiene un texto explicativo
58*	Text	N		String	Cuando RegistStatus = "R", contiene una descripción específica del motivo de rechazo
	Standard Trailer	S			

13. Entregas de Futuros sobre Bono

13.1 Introducción

La funcionalidad de entregas permite que un cliente FIX pueda:

- a) Conocer los entregables publicados, mediante el mensaje Security List en el bloque InstrumentLeg
- b) Comunicar, dentro del periodo de notificación de entregas, qué referencias, dentro de los valores entregables, va a entregar por cada posición vendida. Esta comunicación se realiza mediante mensajes Position Maintenance Request
- c) Saber las operaciones de compra-venta a realizar en IBERCLEAR. Estas operaciones se comunican mediante mensajes Trade Capture Report realizados a través de una suscripción especial utilizando un mensaje Trade Capture Report Request con la opción TrdType [828] = 15.

A continuación se describe con más detalle cada una de estas fases.

13.2 Lista de entregables

La relación de valores entregables y factores de conversión para los contratos de derivados se divulgan en el bloque InstrumentLeg del mensaje Security List. La información más relevante sería:

- Contrato de derivados sobre el que se hace la entrega: Symbol [55]
- Código del valor entregable: LegSymbol [600]
- Código ISIN del entregable: LegSecurityAltID [605]
- Factor de conversión: LegFactor [253]
- Cupón Corrido: AccruedInterestAmt [159]

13.3 Notificación de entregas

La entrega se inicia por parte de los Miembros con posiciones vendidas, para los que la ECC habilita el periodo de notificación de entregas, en el que cada Miembro comunica a la ECC qué referencias, dentro de los valores entregables (ver 13.2 - Lista de entregables), va a entregar por cada posición vendida. Finalizado este periodo, si quedan posiciones vendidas para las que no se ha notificado la referencia a entregar, el Miembro Liquidador deberá realizar la notificación a la ECC. Por último, si quedaran posiciones para las que no se indicara qué referencia se va a entregar, la ECC asignaría la referencia, preferentemente el entregable más barato.

Esta comunicación se realiza mediante el mensaje Position Maintenance Request. La información más relevante sería:

- PosTransType [709] = 4 (Delivery)
- Symbol [55] = Contrato de derivados sobre el que se hace la entrega
- Account [1] = Titular sobre el que se hace la entrega
- PosType [703] = DN (Delivery Notice Qty)
- ShortQty [705]: Número de contratos a entregar
- NestedPartyRole [538] = 13 (si la comunicación la realiza el Miembro Negociador) ó 4 (si la comunicación la realiza el Miembro Liquidador)

- LegSymbol [600]: Referencia que se entrega

Debe tenerse en cuenta que cada vez que se envía una modificación a un Position Maintenance Request enviado anteriormente, el último reemplaza totalmente al antiguo. O sea, cada vez hay que mandar toda la información de notificación de entregas.

Para más información ver el flujo de mensajes “13.3 – Notificación de entrega”.

13.4 Operaciones de compra-venta a realizar

Las operaciones de compra-venta a realizar en IBERCLEAR están disponibles mediante mensajes Trade Capture Report realizados a través de una suscripción especial utilizando un mensaje Trade Capture Report Request con la opción TrdType [828] = 15. Existen dos niveles de información:

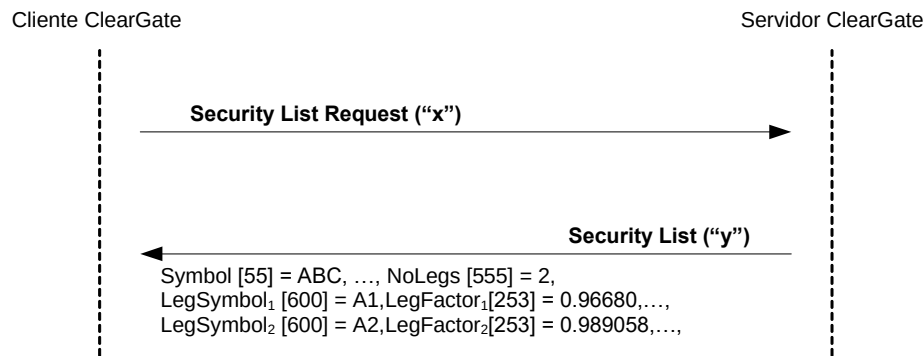
- Operaciones de contado a nivel de titular. El campo Account [1] tiene 3 posiciones (el titular de la operación)
- Operaciones de contado a nivel de miembro. El campo Account [1] no viene informado

13.5 Lista de mensajes

Mensaje	Descripción
Security List (Msg Type = y)	Enviado por ClearGate para informar de la relación de valores entregables y factores de conversión
Position Maintenance Request (Msg Type = AL)	Enviado por el cliente FIX para comunicar, dentro del periodo de notificación de entregas, qué referencias, dentro de los valores entregables, va a entregar por cada posición vendida
Position Maintenance Report (Msg Type = AM)	Enviado por ClearGate para indicar la aceptación o rechazo de una notificación de entregas
Trade Capture Report Request (Msg Type = AD)	Solicitud especial de operaciones de entrega con la opción especial TrdType [828] = 15
Trade Capture Report Request Ack (Msg Type = AQ)	Acuse del mensaje Trade Capture Report Request
Trade Capture Report (Msg Type = AE)	Enviado por ClearGate para saber las operaciones de compra-venta a realizar como resultado del proceso de entrega. Sólo enviado a los clientes relacionados suscritos a este tipo de mensaje con la opción especial TrdType [828] = 15

13.6 Flujo de mensajes

Solicitud de la lista de entregables

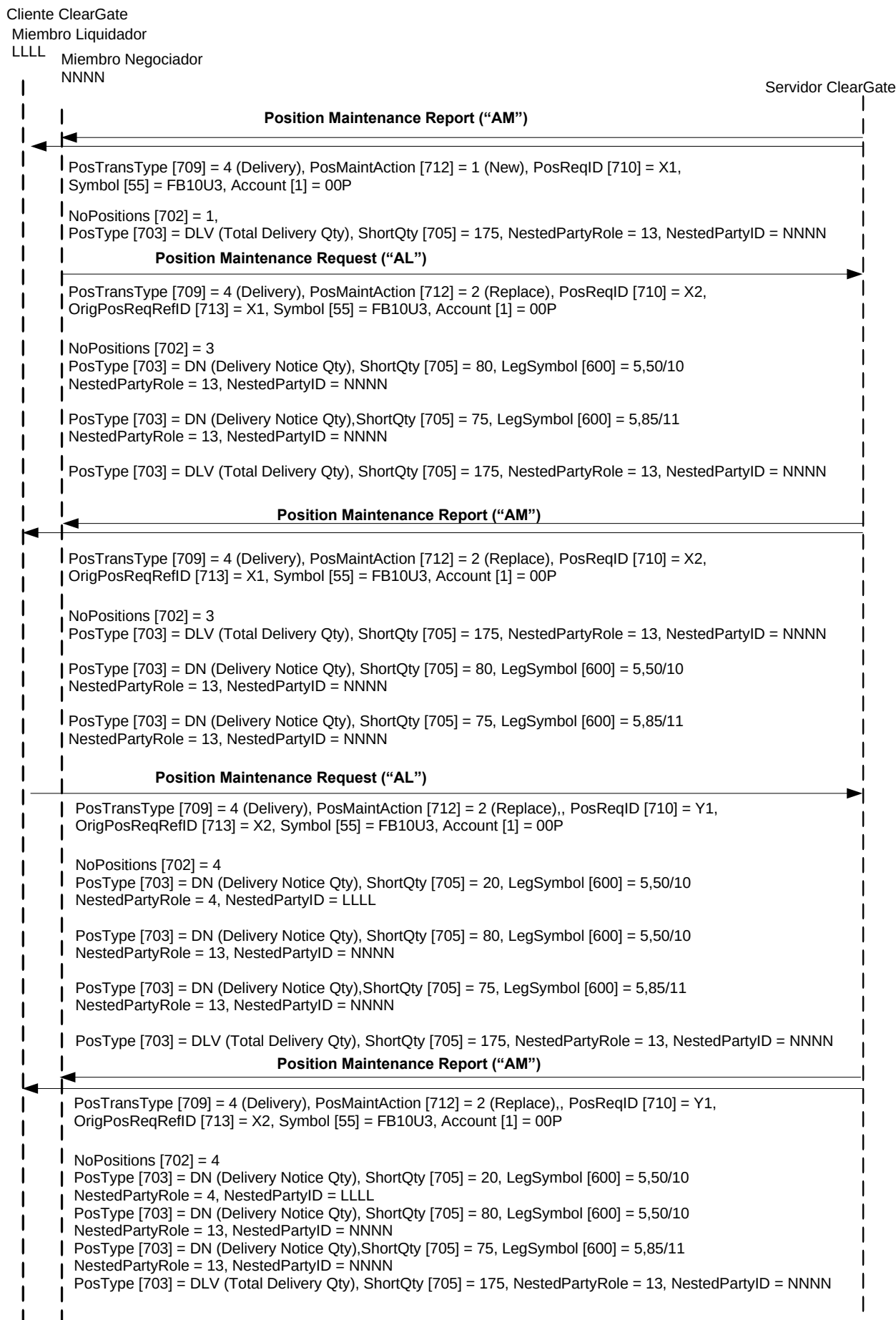


Notificación de entrega

Inicialmente, ClearGate envía un mensaje Position Maintenance Report de forma no solicitada con PosTransType [709] = 4 (Delivery), PosMaintAction [712] = 1 (New), PosReqID [710] informado, PosType [703] = DLV (Total Delivery Qty) y ShortQty [705] informado con el número total de contratos a entregar.

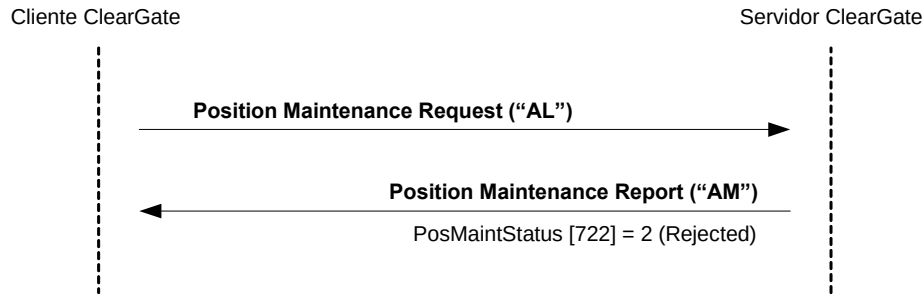
A continuación, el cliente envía una petición de notificación de entrega usando el mensaje Position Maintenance Request con PosTransType [709] = 4 (Delivery), PosMaintAction [712] = 2 (Replace), PosType [703] = DN (Delivery Notice Qty) y ShortQty [705] informado con el número de contratos que se entregan.

ClearGate contesta con un mensaje de aceptación de la solicitud. El siguiente envío de notificación de entrega sustituye completamente la orden previa.



Notificación de entrega rechazada por el sistema

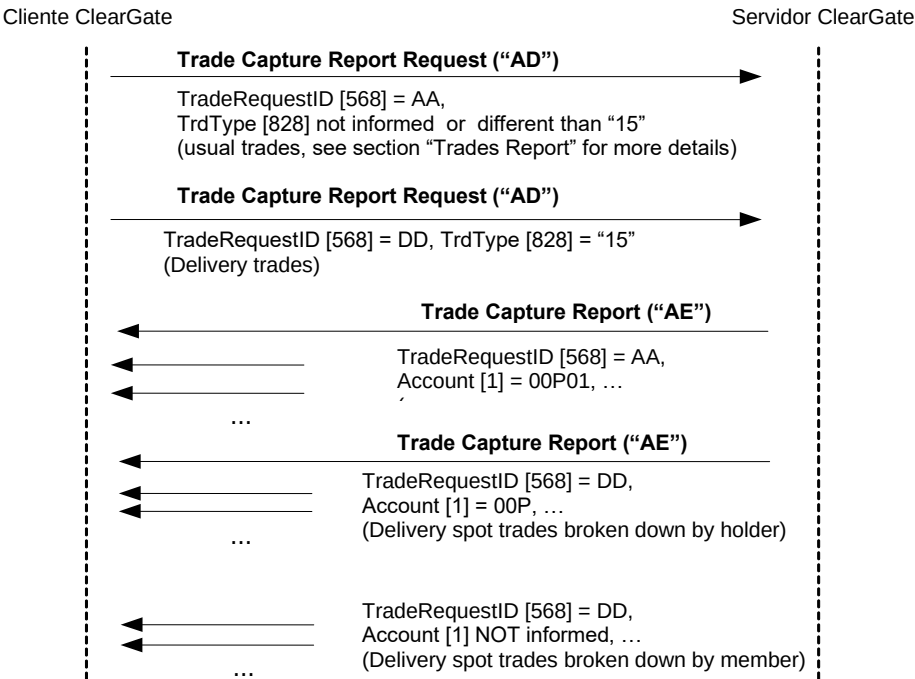
Si el cliente FIX envía una notificación de entrega no válida, será rechazada con un mensaje Position Maintenance Report con el campo PosMaintStatus = 2. Una notificación de entrega rechazada no altera la Notificación de entregas solicitada previamente.



Operaciones de entrega

Las operaciones de compra-venta de entrega se reciben mediante mensajes Trade Capture Report realizados a través de una suscripción especial utilizando un mensaje Trade Capture Report Request con la opción TrdType [828] = 15. Existen dos niveles de información:

- Operaciones de entrega a nivel de titular. El campo Account [1] tiene una longitud de 3 caracteres (Titular asociado con la operación)
- Operaciones de entrega a nivel de titular. El campo Account [1] no se informa



13.7 Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4

- Se ha añadido el campo LegSymbol [600] a los mensajes Position Report, Position Maintenance Request y Position Maintenance Report

13.8 Definición de mensajes

El mensaje Security List mencionado en este capítulo también es usado en la información estática de contratos. Su definición se encuentra en el apartado 6.4.2 del capítulo 6.

Los mensajes Position Maintenance Request, Position Maintenance Report y Trade Capture Report mencionados en este capítulo también son usados para el seguimiento y gestión de posición. Su definición se encuentra en los apartados 7.8.5, 7.8.6 y 7.8.4 del capítulo 7.

Los mensajes Trade Capture Report y Request Trade Capture Report Request Ack mencionados en este capítulo también son usados para la consulta de posiciones. Su definición se encuentra en los apartados 8.6.1 and 8.6.2 del capítulo 8.

14. Cálculo de garantías de una cuenta o de una cartera simulada

14.1 Introducción

Se proporcionan diversos cálculos intradía y fin de día relacionados con las garantías y las liquidaciones diarias.

14.1.1 Garantías por posición en cartera simulada

Se proporciona la información de las Garantías durante sesión de una cartera entrada por la aplicación cliente.

Para ello se utilizan los mensajes Margin Requirement Inquiry y Margin Requirement Report.

La aplicación cliente utiliza el mensaje Margin Requirement Inquiry de tipo ETH y subtipo SIM (SIMm para utilizar criterios de cálculo de cuentas minoristas) para entrar una cartera con la posición en cada contrato y ClearGate genera un mensaje Margin Requirement Report con el resultado de la garantía estimada de la cartera en este momento de la sesión.

Ambos mensajes quedan relacionados por el campo MarginReqmtInqID [1635].

14.1.2 Garantías por posición en cuentas de posición y cuentas de garantías

Se proporciona la simulación de las Garantías durante sesión correspondiente a la posición de una cuenta de posición o de una cuenta de garantías.

Para ello se utilizan los mensajes Margin Requirement Inquiry y Margin Requirement Report.

La aplicación cliente utiliza el mensaje Margin Requirement Inquiry de tipo ETH y subtipo POSACC o MARACC, indicando la cuenta en el bloque Parties. ClearGate genera un mensaje Margin Requirement Report con el resultado de la garantía estimada de la cartera en este momento de la sesión.

14.1.3 Obtención de cálculos de liquidaciones a fin de día

Se proporcionan los cálculos de liquidaciones, incluidos los de garantías y los de detalle de cálculo de garantías a final de día.

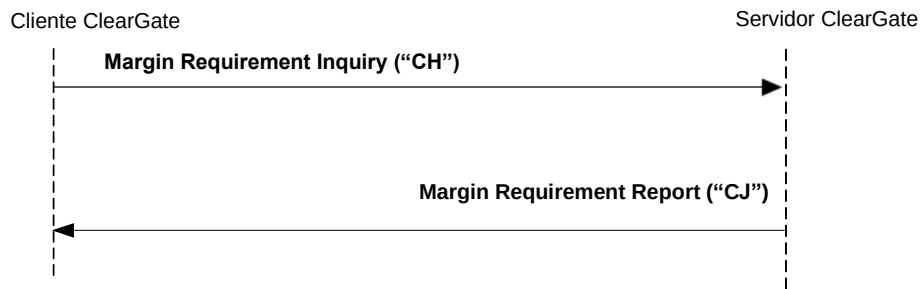
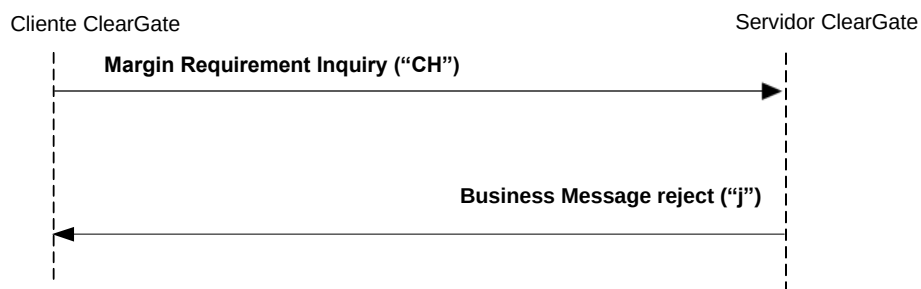
Para ello el sistema publica mensajes Margin Requirement Report.

ClearGate genera mensajes Margin Requirement Report de tipo EOD y subtipos POSACC, MARACC, COLACC, POSDET, MARDET (POSDETm, MARDETm para cálculos realizados con criterios de cuentas minoristas), indicando la cuenta en el bloque Parties con los resultados para la correspondiente cuenta.

14.2 Lista de mensajes

Mensaje	Descripción
Margin Requirement Inquiry (Msg Type = CH)	Enviado por la aplicación cliente para entrar una cartera con la posición en cada contrato
Margin Requirement Report (Msg Type = CJ)	Enviado por ClearGate como respuesta a un Margin Requirement Inquiry con el resultado de la garantía estimada en este momento de la sesión

14.3 Flujo de mensajes

Información de las Garantías enviadas como respuesta a un Margin Requirement Inquiry**Rechazo enviado como respuesta a un Margin Requirement Inquiry****14.4 Acotaciones y adaptaciones de FIX 4.4**

- Se añade el bloque Stipulations a los mensajes Margin Requirement Inquiry y Margin Requirement Report. Este bloque es requerido en el mensaje Margin Requirement Inquiry.

14.5 Definición de mensajes

14.5.1 Margin Requirement Inquiry (Msg Type = CH)

Enviado por la aplicación cliente para entrar una cartera con la posición en cada contrato.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = CH		
1635	MarginReqmtInqID	S		String(30)	Identificador único para cada mensaje Margin Requirement Inquiry
	Start <MarginReqmtInqQualGrp>	S			
1636	NoMarginReqmtInqQualifier		1	NumInGroup	Siempre 1
→1637	MarginReqmtInqQualifier	S	0 = Summary	Int	Siempre 0
	End <MarginReqmtInqQualGrp>				
→	Start <Parties>				
→ 453	NoPartyIDs	S		NumInGroup	
→→ 448	PartyID	S		String	
→→ 447	PartyIDSource	S	D = Proprietary / Custom code	Char	Requerido si se ha especificado NoPartyIDs
→→ 452	PartyRole	S	13 = Order Origination Firm 38=Position account 100=Margin account	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID. Requerido si se ha especificado NoPartyIDs
→	End <Parties>				
716	SettlSessID	N	ETH = Electronic Trading Hours (valor por defecto)		ETH siempre
717	SettlSessSubID	N	SIM (valor por defecto) SIMm POSACC MARACC		ETH: - SIM: Simulación de garantías para una cartera como la especificada en el bloque Stipulations. - SIMm: Simulación de garantías con criterios de minorista para una cartera como la especificada en el bloque Stipulations. - POSACC: Simulación de garantías para la cuenta de posición especificada en bloque Parties - MARACC: Simulación de garantías para la cuenta de garantías especificada en bloque Parties
	Start <Stipulations>				Usado en tipos SIM, SIMm

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
232*	NoStipulations	Y*		NumInGroup	
→ 233*	StipulationType	Y*	SYMBOL = Código de contrato POS = Posición abierta	String	
→ 234*	StipulationValue	Y*		String	Si StipulationType [233] = SYMBOL, contiene el código de contrato. Si StipulationType [233] = POS, contiene la posición abierta en este contrato (con signo).
	End <Stipulations>				
	Standard Trailer	Y			

14.5.2 Margin Requirement Report (Msg Type = CJ)

Enviado por ClearGate como respuesta a un Margin Requirement Inquiry con el resultado de la garantía estimada en este momento de la sesión.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
	Standard Header	S	MsgType = CJ		
1642	MarginReqmtRptID	S		String	Identificador único para cada mensaje Margin Requirement Report
1635	MarginReqmtInqID	S		String	Identificador de la solicitud enviado por el cliente en el mensaje Margin Requirement Inquiry
1638	MarginReqmtRptType	S	0 = Summary	Int	
→	Start <Parties>				
→ 453	NoPartyIDs	S		NumInGroup	
→→ 448	PartyID	S		String	
→→ 447	PartyIDSource	S	D = Proprietary / Custom code	Char	Requerido si se ha especificado NoPartyIDs
→→ 452	PartyRole	S	13 = Order Origination Firm 4 = Clearing Firm 38=Position account 100=Margin account 101=Collateral account	Int	Indica el rol que toma el código especificado en PartyID. Requerido si se ha especificado NoPartyIDs
→	End <Parties>				
716	SettlSessID	N	EOD = End of Day ETH = Electronic Trading Hours		EOD para envíos a final de día ETH para envíos que son respuesta a una solicitud
717	SettlSessSubID	N	SIM SIMm POSACC MARACC COLACC POSDet POSDetm MARDET MARDETm		EOD: • POSACC: Valores actuales para una cuenta de posición • MARACC: Valores actuales para una cuenta de garantías • COLACC: Valores actuales para una cuenta de colateral • POSDET: Detalle cálculo de initial margin cuenta posición • MARDET: Detalle cálculo de initial margin cuenta de garantías • POSDETM: Detalle cálculo de initial margin cuenta posición con criterios de minorista • MARDETM: Detalle cálculo de initial margin cuenta de garantías con criterios de minorista ETH: • SIM: Simulación de garantías para una cartera como la especificada en el bloque Stipulations.

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
					- SIMm: Simulación de garantías con criterios de minorista para una cartera como la especificada en el bloque Stipulations. - POSACC: Valores actuales para una cuenta de posición - MARACC: Valores actuales para una cuenta de garantías
1639	MarginClass				Código de matriz de garantías (sólo en POSDET, MARDET, POSDEtm, MARDEtm)
	Start <MarginAmount>				
1643	NoMarginAmt	S		NumInGroup	
→1645	MarginAmt	S		Amt	Importe
→1644	MarginAmtType	S	11: Initial Margin 23: VariationMargin 17: PremiumMargin 8: DeliveryMargin 105: IM Increased 106: DeferralFee 107: InitialMarginPledged 211: IM (divisa cálculo) 223: VM (divisa cálculo) 217: PremiumM (divisa cálculo) 208: DeliveryM (divisa cálculo) 305: IM_Increased (divisa cálculo) 306: CalcDeferralFee (divisa cálculo) 320: Escenario 321: Escenario con grandes posiciones 10: Garantía time-spreads 22: Garantía grupo previa 2: Garantía final 21: Garantía grupo tras compensación subyacentes 24: Ajuste por variation margin pending 322: Delta compradora 323: Delta vendedora 324: Delta neta 325: Delta a aplicar 326: Delta final 327: Delta neta sin grandes posiciones		ETH 11: para SIM y SIMm 11, 23, 17, 105: para POSACC y MARACC EOD 11, 23, 17, 8, 106: POSACC y MARACC 211, 223, 217, 208, 306: POSACC y MARACC si hay divisas de cálculo diferentes a la de liquidación 11, 23, 17, 8, 106, 107: COLACC 320-330, 10, 22, 2, 21, 24, 105: POSDET, POSDEtm, MARDET, MARDEtm

Tag	Nombre	Req	Valores válidos	Formato	Descripción
			328: NetPositionMargin 329: InterCommoditySpreadCredit 330: PremiumMargin		
→1646	MarginAmtCcy	S			Divisa
	End <MarginAmount>				
	Start <Stipulations>				Usados para Subtipos SIM, SIMm
232*	NoStipulations	N		NumInGroup	
→233*	StipulationType	N	SYMBOL = Código de contrato POS = Posición abierta	String	
→234*	StipulationValue	N		String	Si StipulationType [233] = SYMBOL, contiene el código de contrato tal como se ha especificado en el mensaje Margin Requirement Report. Si StipulationType [233] = POS, contiene la posición abierta en este contrato (con signo) tal como se ha especificado en el mensaje Margin Requirement Report.
	End <Stipulations>				
	Standard Trailer	S			

Apéndice A Campos de Usuario

En la siguiente tabla se presentan los campos de usuario usados en los mensajes de este manual.

Tag	Nombre	Formato	Descripción
5680	ProprietaryFixProtocolVersion	String	Identificación exacta de la versión del protocolo usado y esperado por el iniciador.
5679	FixEngineName	String	Contiene una cadena descriptiva del software usado por el cliente para a conexión FIX. Sólo usado a modo informativo
5681	ExchangeTradeType	String	Tipo de operación del mercado (véase Tabla 12 en documento "Tablas de Codificación")
5682	NewSecuritySubscription	Char	Campo para solicitar la suscripción a la definición de nuevos contratos
5683	SecondaryConfirmStatus	Char	Describe el estado en que se encuentra el Give-up de referencia

Apéndice B Tablas de valores

B.1 Tipos de producto en tag SecurityType [167]

Tipo de producto	Descripción
F	Futuro
O	Opción
W	Swap
X	Otros
G	xRolling